中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料 8
§3 主要财务指标和基金净值表现 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 9
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57

7.12 投资组合报告附注 57
§8 基金份额持有人信息 58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 59
§9 开放式基金份额变动 59
§10 重大事件揭示 59
10.1 基金份额持有人大会决议 59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 60
10.8 其他重大事件 61
§11 影响投资者决策的其他重要信息 61
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信保诚中证 500 指数增强	
基金主代码	021185	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 06 月 21 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	139,557,934.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	021185	021186
报告期末下属分级基金的份额总额	24,696,601.19 份	114,861,333.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，在控制跟踪误差基础上，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过前述范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 本基金为指数增强型基金，主要策略为复制标的指数，投资组合将以成份股在标的指数中的基准权重为基础，利用量化投资模型在一定范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。 基金管理人研发的量化投资模型借鉴国内外成熟的量化组合投资经验，运用多因子选股模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本的基础上，优化投资组合。 （1）多因子选股模型 本基金采用量化方法，以对中国股票市场的长期研究为基础，构建多因子模型，从多个维度捕捉市场有效性暂时缺失之处，通过个股

	在多因子上的暴露估测个股的超值回报。概括来讲，本基金多因子模型的因子可归为价值、动量、成长、情绪、质量、事件等几类。上述因子类别综合了来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师及监管政策、公司事件等各方面信息。基金经理根据市场状况及变化，对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。 （2）风险估测模型 指数化投资力求跟踪误差最小，增强型投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险管理模型，力争将投资组合风险控制在预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于标的指数的偏离风险。 （3）交易成本模型 本基金的交易成本模型既考虑固定交易成本，也考虑交易的市场冲击效应，在尽量降低总体交易成本的基础上，减少交易对业绩造成的负面影响。 （4）投资组合优化模型 本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以标的指数成份股为主，并包括非成份股中与成份股相关性较强、流动性较好、基本面信息充足等特征的股票。 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选相应的存托凭证投资标的。 对于港股通标的股票，本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场，本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法，精选出具有投资价值的优质标的。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。 2、债券投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行投资。 3、证券公司短期公司债券投资策略 本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。 4、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，研究资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收

	益结构安排，评估其内在价值。 5、可转换债券、可交换债券投资策略 本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，研究上市公司对转股价的修正和转股意愿。 6、衍生品投资策略 为了更好地实现投资目标，基金还可投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。 本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。 本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，结合期权定价模型投资股票期权，提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。 本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。 7、融资、转融通证券出借业务投资策略 本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。 利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。 为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标和风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	滕菲菲
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120895	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		涂一镭	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	956,520.64	2,672,733.82
本期利润	2,863,966.01	8,705,690.88
加权平均基金份额本期利润	0.1072	0.0713
本期加权平均净值利润率	8.55%	5.70%
本期基金份额净值增长率	7.10%	6.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	7,333,890.46	33,505,702.71
期末可供分配基金份额利润	0.2970	0.2917
期末基金资产净值	32,505,073.83	150,562,983.53
期末基金份额净值	1.3162	1.3108
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	

	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	31.62%	31.08%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.35%	0.70%	4.09%	0.75%	1.26%	-0.05%
过去三个月	2.14%	1.38%	0.97%	1.43%	1.17%	-0.05%
过去六个月	7.10%	1.17%	3.21%	1.29%	3.89%	-0.12%
过去一年	31.65%	1.51%	18.83%	1.64%	12.82%	-0.13%
自基金合同生效起至今	31.62%	1.48%	15.47%	1.63%	16.15%	-0.15%

中信保诚中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.30%	0.70%	4.09%	0.75%	1.21%	-0.05%
过去三个月	2.04%	1.38%	0.97%	1.43%	1.07%	-0.05%
过去六个月	6.88%	1.17%	3.21%	1.29%	3.67%	-0.12%
过去一年	31.12%	1.51%	18.83%	1.64%	12.29%	-0.13%
自基金合同生效起至今	31.08%	1.48%	15.47%	1.63%	15.61%	-0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信保诚中证 500 指数增强 A

中信保诚中证 500 指数增强 C

注：本基金建仓期自 2024 年 06 月 21 日至 2024 年 12 月 21 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 89 只，分别为：中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金、中信保诚薪金宝货币市场基金、中信保诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳健债券型证券投资基金、中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳悦债券型证券投资基金、中信保诚稳鑫债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、中信保诚稳泰债券型证券投资基金、中信保诚

新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金、中信保诚先进制造混合型证券投资基金、中信保诚远见成长混合型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚景气优选混合型证券投资基金、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚 90 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚周期优选混合型发起式证券投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚乾元 30 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚汇利债券型证券投资基金、中信保诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王颖	量化投资部副总监（主持工作）、基金经理	2024 年 06 月 21 日	-	12	王颖女士，经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司，担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、基金经理助理。现任量化投资部副总监（主持工作），中信保诚新锐回报灵

					活配置混合型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同、招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,不同投资组合同时同向交易同一证券时需通过交易系统中的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，事后根据公

司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资组合经理出具情况说明后签字确认。报告期内，本基金与公司旗下管理的其它产品之间未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每月对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，经济数据基本符合预期，关税对经济扰动较大，地产影响明显，消费韧性较强，国内经济运行总体平稳。

市场方面，上半年 A 股市场震荡上行。从行业表现上看，军工、有色、传媒涨幅居前，煤炭、食品饮料、石油石化等板块跌幅较大。从量化角度看，成长、量价类因子表现较强，贡献正收益，估值类因子表现较去年有所回撤；低波、低换手类因子在小盘股内表现强势，但在中大盘内贡献负超额。整体来看，量化策略表现符合预期。

基金投资运作方面，本基金为指数增强型基金，跟踪的标的指数为中证 500 指数。一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

在投资策略方面，本基金以多因子量化投资策略为主，通过多策略分散投资，力求在控制基金与标的指数偏离度的基础上，获取更高的超额收益。本基金在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，争取收益增厚。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为 7.10%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%；中信保诚中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为 6.88%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，7 月，中央财经委员会第六次会议再次提出“反内卷”，伴随部分行业政策出台，市场对未来流动性宽松和经济向好的预期有所回升，A 股市场 7 月走出连续上涨行情。长期来看，政策利好频发下，宽松预期有利于 A 股市场整体活跃度的提升，利好 A 股市场整体行情；

伴随基本面改善和新技术的出现，部分行业有超额收益的空间。从量化角度看，伴随市场波动率的提升，部分风险因子可能走出不同与过去低流动性情况下的表现，从去年以来，我们也观察到不同因子在不同股票上表现的差异性，我们将持续观察不同量化策略和大类因子表现的变化，拉长因子观察周期，并及时对投资策略进行优化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。估值委员会由主管运营的公司领导、投资、研究、会计和风控等岗位资深人员组成。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程人员均具备相应的专业胜任能力及相关工作经历。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。在每个估值日，本基金管理人使用估值政策确定的估值方法，确定基金的份额净值，托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年上半年

的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司在中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2025 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金
报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	17,807,009.01	14,596,852.86
结算备付金		1,869,807.71	894,423.60
存出保证金		1,673,961.60	1,206,187.20
交易性金融资产	6.4.7.2	159,563,113.34	156,841,833.49
其中：股票投资		158,543,944.02	153,789,078.83
基金投资		-	-
债券投资		1,019,169.32	3,052,754.66
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		7,604,844.80	2,257,564.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		188,518,736.46	175,796,861.79
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 06 月 30 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,066,052.21	900,035.79
应付管理人报酬		122,075.60	129,384.03
应付托管费		15,259.43	16,173.01
应付销售服务费		50,720.35	46,584.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,082.63	0.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	172,488.88	118,333.33
负债合计		5,450,679.10	1,210,510.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	139,557,934.21	142,289,141.99
未分配利润	6.4.7.8	43,510,123.15	32,297,208.83
净资产合计		183,068,057.36	174,586,350.82
负债和净资产总计		188,518,736.46	175,796,861.79

注：截止本报告期末，基金份额总额 139,557,934.21 份。其中：中信保诚中证 500 指数增强 A 的基金份额净值 1.3162 元，基金份额总额 24,696,601.19 份；中信保诚中证 500 指数增强 C 的基金份额净值 1.3108 元，基金份额总额 114,861,333.02 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金
本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	**附注号**	**本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日**	**上年度可比期间 2024 年 06 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日**
一、营业总收入		12,802,366.12	22,367.91
1.利息收入		41,809.53	73,691.15

其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,870.67	17,830.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,938.86	55,860.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,746,547.86	13,984.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,745,522.50	-4,700.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,194.66	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	388,609.86	-
股利收益	6.4.7.14	1,597,220.84	18,684.20
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	7,940,402.43	-65,307.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	73,606.30	-
减：二、营业总支出		1,232,709.23	72,045.36
1．管理人报酬		742,223.03	43,142.28
2．托管费		92,777.89	5,392.78
3．销售服务费		304,031.31	16,210.60
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		1,413.98	-
8．其他费用	6.4.7.18	92,263.02	7,299.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,569,656.89	-49,677.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,569,656.89	-49,677.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,569,656.89	-49,677.45

6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	142,289,141.99	32,297,208.83	174,586,350.82
二、本期期初净资产	142,289,141.99	32,297,208.83	174,586,350.82

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,731,207.78	11,212,914.32	8,481,706.54
（一）、综合收益总额	-	11,569,656.89	11,569,656.89
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,731,207.78	-356,742.57	-3,087,950.35
其中：1.基金申购款	330,429,402.60	85,962,022.75	416,391,425.35
2.基金赎回款	-333,160,610.38	-86,318,765.32	-419,479,375.70
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	139,557,934.21	43,510,123.15	183,068,057.36

项目	上年度可比期间 2024 年 06 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	219,344,315.69	-	219,344,315.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-49,677.45	-49,677.45
（一）、综合收益总额	-	-49,677.45	-49,677.45
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	219,344,315.69	-49,677.45	219,294,638.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

董元星	桂思毅	刘卓
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]461 号)批准，由中信保诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2024 年

6 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 219,344,315.69 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税

额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定

计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	1,058,169.73
等于：本金	1,057,643.79
加：应计利息	525.94
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	16,748,839.28
等于：本金	16,748,636.19
加：应计利息	203.09
合计	17,807,009.01

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	154,483,993.31	-	158,543,944.02	4,059,950.71
贵金属投资-金交所黄金合	-	-	-	-

约					
债券	交易所市场	1,006,000.00	16,969.32	1,019,169.32	-3,800.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,006,000.00	16,969.32	1,019,169.32	-3,800.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		155,489,993.31	16,969.32	159,563,113.34	4,056,150.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,453,717.40	-	-	-
IC2507	1,127,014.54	-	-	-
IC2508	7,866,200.00	-	-	-
IC2509	4,460,502.86	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,453,717.40	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位： 人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	1.00	1,173,480.00	46,465.46
IC2508	IC2508	7.00	8,155,560.00	289,360.00
IC2509	IC2509	4.00	4,620,640.00	160,137.14
合计				495,962.60
减：可抵销期货暂收款				495,962.60
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	122,840.70
其他	19,895.40
合计	172,488.88

6.4.7.7 实收基金

中信保诚中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,682,404.87	32,682,404.87
本期申购	25,287,651.65	25,287,651.65
本期赎回（以“-”号填列）	-33,273,455.33	-33,273,455.33
本期末	24,696,601.19	24,696,601.19

中信保诚中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	109,606,737.12	109,606,737.12
本期申购	305,141,750.95	305,141,750.95

本期赎回（以“-”号填列）	-299,887,155.05	-299,887,155.05
本期末	114,861,333.02	114,861,333.02

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

中信保诚中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,459,413.62	-976,191.23	7,483,222.39
本期期初	8,459,413.62	-976,191.23	7,483,222.39
本期利润	956,520.64	1,907,445.37	2,863,966.01
本期基金份额交易产生的变动数	-2,082,043.80	-456,671.96	-2,538,715.76
其中：基金申购款	7,180,463.10	-764,067.88	6,416,395.22
基金赎回款	-9,262,506.90	307,395.92	-8,955,110.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,333,890.46	474,582.18	7,808,472.64

中信保诚中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,078,619.74	-3,264,633.30	24,813,986.44
本期期初	28,078,619.74	-3,264,633.30	24,813,986.44
本期利润	2,672,733.82	6,032,957.06	8,705,690.88
本期基金份额交易产生的变动数	2,754,349.15	-572,375.96	2,181,973.19
其中：基金申购款	85,526,092.06	-5,980,464.53	79,545,627.53
基金赎回款	-82,771,742.91	5,408,088.57	-77,363,654.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,505,702.71	2,195,947.80	35,701,650.51

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	12,346.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,232.64
结算备付金利息收入	19,291.93
其他	-
合计	38,870.67

注：1、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	951,198,817.97
减：卖出股票成本总额	947,474,402.80
减：交易费用	978,892.67
买卖股票差价收入	2,745,522.50

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益--利息收入	26,614.66
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,420.00
债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	15,194.66

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,045,350.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,011,420.00
减：应计利息总额	45,350.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-11,420.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益--其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	388,609.86

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,597,220.84
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,597,220.84

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	7,233,106.99
--股票投资	7,236,536.99
--债券投资	-3,430.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2.衍生工具	723,474.42
--权证投资	-
--期货投资	723,474.42
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	16,178.98
合计	7,940,402.43

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	72,833.23
转换费收入	773.07

合计	73,606.30

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	26.42
银行费用	2,976.45
合计	92,263.02

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 06 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	742,223.03	43,142.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	360,765.94	17,903.37
应支付基金管理人的净管理费	381,457.09	25,238.91

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 06 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	92,777.89	5,392.78

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C	合计
中信银行股份有限公司	-	51,077.95	51,077.95
合计	-	51,077.95	51,077.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 06 月 21 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C	合计
中信保诚基金管理有限公司	-	0.13	0.13
中信银行股份有限公司	-	1,382.07	1,382.07
合计	-	1,382.20	1,382.20

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费

率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 06 月 21 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	1,058,169.73	12,346.10	3,358,024.38	14,908.69

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末 2025 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 04 月 02 日	6 个月	锁定期股票	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 01 月 16 日	6 个月	锁定期股票	5.30	14.44	518	2,745.40	7,479.92	-
001382	新亚电缆	2025 年 03 月 13 日	6 个月	锁定期股票	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	6 个月	锁定期股票	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 05 月 21 日	6 个月	锁定期股票	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 01 月 20 日	6 个月	锁定期股票	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 02 月 24 日	6 个月	锁定期股票	28.33	44.98	156	4,419.48	7,016.88	-
301275	汉朔科技	2025 年 03 月 04 日	6 个月	锁定期股票	27.50	56.19	153	4,207.50	8,597.07	-
301458	钧崴电子	2025 年 01 月 02 日	6 个月	锁定期股票	10.40	34.11	617	6,416.80	21,045.87	-
301479	弘景光电	2025 年 03 月 06 日	6 个月	锁定期股票	41.90	77.87	97	4,064.30	7,553.39	-
301479	弘景光电	2025 年 05 月 28 日	1-6 个月（含）	锁定期股票-转增	-	77.87	39	-	3,036.93	-
301501	恒鑫生活	2025 年 03 月 11	6 个月	锁定期股票	39.92	45.22	105	4,191.60	4,748.10	-

		日								
301501	恒鑫生活	2025 年 06 月 06 日	1-6 个月（含）	锁定期股票-转增	-	45.22	47	-	2,125.34	-
301535	浙江华远	2025 年 03 月 18 日	6 个月	锁定期股票	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 04 月 17 日	6 个月	锁定期股票	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 05 月 28 日	6 个月	锁定期股票	89.60	139.48	51	4,569.60	7,113.48	-
301595	太力科技	2025 年 05 月 12 日	6 个月	锁定期股票	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 01 月 08 日	6 个月	锁定期股票	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 01 月 15 日	6 个月	锁定期股票	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 04 月 30 日	6 个月	锁定期股票	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 03 月 26 日	6 个月	锁定期股票	11.80	22.98	388	4,578.40	8,916.24	-
301662	宏工科技	2025 年 04 月 10 日	6 个月	锁定期股票	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 04 月 02 日	6 个月	锁定期股票	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 06 月 13 日	6 个月	锁定期股票	12.80	44.54	319	4,083.20	14,208.26	-
603014	威高血净	2025 年 05 月 12 日	6 个月	锁定期股票	26.50	32.68	114	3,021.00	3,725.52	-
603049	中策橡胶	2025 年 05 月 27 日	6 个月	锁定期股票	46.50	42.85	102	4,743.00	4,370.70	-

603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期股票	12.30	54.45	166	2,041.80	9,038.70	-
603120	肯特催化	2025 年 04 月 09 日	6 个月	锁定期股票	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 03 月 12 日	6 个月	锁定期股票	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603210	泰鸿万立	2025 年 04 月 01 日	6 个月	锁定期股票	8.60	15.61	265	2,279.00	4,136.65	-
603257	中国瑞林	2025 年 03 月 28 日	6 个月	锁定期股票	20.52	37.47	71	1,456.92	2,660.37	-
603271	永杰新材	2025 年 03 月 04 日	6 个月	锁定期股票	20.60	35.08	77	1,586.20	2,701.16	-
603382	海阳科技	2025 年 06 月 05 日	6 个月	锁定期股票	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 06 月 12 日	6 个月	锁定期股票	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 02 月 25 日	6 个月	锁定期股票	24.18	33.32	66	1,595.88	2,199.12	-
688411	海博思创	2025 年 01 月 20 日	6 个月	锁定期股票	19.38	83.49	366	7,093.08	30,557.34	-
688545	兴福电子	2025 年 01 月 15 日	6 个月	锁定期股票	11.68	26.95	589	6,879.52	15,873.55	-
688583	思看科技	2025 年 01 月 08 日	6 个月	锁定期股票	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025 年 06 月 19 日	1 个月内（含）	锁定期股票-转增	-	79.68	52	-	4,143.36	-
688755	汉邦科技	2025 年 05 月 09 日	6 个月	锁定期股票	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
68875	胜科	2025 年	6 个月	锁定期	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

7	纳米	03 月 18 日		股票						
688758	赛分科技	2025 年 01 月 02 日	6 个月	锁定期股票	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 06 月 04 日	6 个月	锁定期股票	47.27	124.16	177	8,366.79	21,976.32	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

本基金管理人风险管理组织体系包括董事会（及其下设的风控与审计委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等。董事会下设风控与审计委员会,根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等。管理层下设经营层面风险管理委员会,负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及的各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务

流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险等情况。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构的证券账户内，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,019,169.32	3,052,754.66
合计	1,019,169.32	3,052,754.66

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的

债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险，本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额，并及时追踪持仓证券的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公

司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金持有的大

部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2025年06月30日	1个月内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	17,807,009.01	-	-	-	-	-	17,807,009.01
结算备付金	1,869,807.71	-	-	-	-	-	1,869,807.71
存出保证金	-	-	-	-	-	1,673,961.60	1,673,961.60
交易性金融资产	-	1,019,169.32	-	-	-	158,543,944.02	159,563,113.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	7,604,844.80	7,604,844.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,676,816.72	1,019,169.32	-	-	-	167,822,750.42	188,518,736.46
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,066,052.21	5,066,052.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	122,075.60	122,075.60
应付托管费	-	-	-	-	-	15,259.43	15,259.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	50,720.35	50,720.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	24,082.63	24,082.63

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	172,488.88	172,488.88
负债总计	-	-	-	-	-	5,450,679.10	5,450,679.10
利率敏感度缺口	19,676,816.72	1,019,169.32	-	-	-	162,372,071.32	183,068,057.36
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	14,596,852.86	-	-	-	-	-	14,596,852.86
结算备付金	894,423.60	-	-	-	-	-	894,423.60
存出保证金	-	-	-	-	-	1,206,187.20	1,206,187.20
交易性金融资产	-	510,750.00	2,542,004.66	-	-	153,789,078.83	156,841,833.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,257,564.64	2,257,564.64
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,491,276.46	510,750.00	2,542,004.66	-	-	157,252,830.67	175,796,861.79
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	900,035.79	900,035.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	129,384.03	129,384.03
应付托管费	-	-	-	-	-	16,173.01	16,173.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	46,584.77	46,584.77
应付投资顾问	-	-	-	-	-	-	-

费							
应交税费	-	-	-	-	-	0.04	0.04
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	118,333.33	118,333.33
负债总计	-	-	-	-	-	1,210,510.97	1,210,510.97
利率敏感度缺口	15,491,276.46	510,750.00	2,542,004.66	-	-	156,042,319.70	174,586,350.82

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险,主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	158,543,944.0	86.60	153,789,078.8	88.09

	2		3	
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	158,543,944.02	86.60	153,789,078.83	88.09

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2025 年 06 月 30 日)	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	7,739,203.15	7,310,279.70
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-7,739,203.15	-7,310,279.70

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	158,179,149.61	153,512,220.16
第二层次	1,034,554.86	3,073,135.76
第三层次	349,408.87	256,477.57

合计	159,563,113.34	156,841,833.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	158,543,944.02	84.10
	其中：股票	158,543,944.02	84.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,019,169.32	0.54
	其中：债券	1,019,169.32	0.54
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,676,816.72	10.44
8	其他各项资产	9,278,806.40	4.92
9	合计	188,518,736.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	127,912.00	0.07
B	采矿业	6,601,156.50	3.61
C	制造业	84,417,449.95	46.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,936,728.00	2.15
E	建筑业	973,676.00	0.53
F	批发和零售业	5,026,438.42	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	2,214,098.00	1.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,081,468.24	9.33
J	金融业	13,636,676.00	7.45
K	房地产业	1,852,241.00	1.01
L	租赁和商务服务业	378,068.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	135,252.00	0.07
Q	卫生和社会工作	182,984.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	2,203,132.00	1.20
S	综合	-	-
	合计	138,767,280.11	75.80

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,964,726.00	7.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,245,156.00	2.32
J	金融业	2,536,397.00	1.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,140.91	0.02

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,776,663.91	10.80

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002532	天山铝业	389,600	3,237,576.00	1.77
2	603979	金诚信	67,400	3,130,056.00	1.71
3	600536	中国软件	56,700	2,651,859.00	1.45
4	603565	中谷物流	220,700	2,107,685.00	1.15
5	002185	华天科技	203,000	2,050,300.00	1.12
6	600862	中航高科	78,100	2,036,848.00	1.11
7	000997	新 大 陆	62,100	2,010,798.00	1.10
8	603893	瑞芯微	12,500	1,898,250.00	1.04
9	600959	江苏有线	551,400	1,896,816.00	1.04
10	601928	凤凰传媒	167,300	1,868,741.00	1.02
11	688213	思特威	18,235	1,863,981.70	1.02
12	688469	芯联集成	389,117	1,856,088.09	1.01
13	688120	华海清科	10,908	1,840,179.60	1.01
14	300017	网宿科技	171,500	1,838,480.00	1.00
15	300604	长川科技	39,200	1,760,472.00	0.96
16	002410	广联达	126,700	1,699,047.00	0.93
17	600143	金发科技	160,900	1,658,879.00	0.91
18	300496	中科创达	28,900	1,653,658.00	0.90
19	688249	晶合集成	77,469	1,570,296.63	0.86
20	300627	华测导航	44,720	1,565,200.00	0.85
21	600498	烽火通信	73,800	1,552,014.00	0.85
22	600765	中航重机	91,300	1,541,144.00	0.84
23	000423	东阿阿胶	29,200	1,527,160.00	0.83
24	000893	亚钾国际	49,000	1,476,860.00	0.81
25	600873	梅花生物	135,600	1,449,564.00	0.79

26	000887	中鼎股份	81,700	1,437,103.00	0.79
27	688578	艾力斯	15,171	1,411,509.84	0.77
28	600764	中国海防	41,300	1,404,200.00	0.77
29	300373	扬杰科技	27,000	1,401,300.00	0.77
30	689009	九号公司	22,600	1,337,242.00	0.73
31	300623	捷捷微电	44,800	1,335,040.00	0.73
32	600998	九州通	256,103	1,316,369.42	0.72
33	600685	中船防务	48,100	1,307,839.00	0.71
34	000050	深天马A	152,000	1,295,040.00	0.71
35	600704	物产中大	245,300	1,292,731.00	0.71
36	000729	燕京啤酒	96,100	1,242,573.00	0.68
37	002202	金风科技	120,500	1,235,125.00	0.67
38	000783	长江证券	177,200	1,227,996.00	0.67
39	688278	特宝生物	16,969	1,223,634.59	0.67
40	002595	豪迈科技	20,100	1,190,322.00	0.65
41	600131	国网信通	66,900	1,184,130.00	0.65
42	600486	扬农化工	20,300	1,177,400.00	0.64
43	603529	爱玛科技	33,200	1,142,080.00	0.62
44	000513	丽珠集团	31,600	1,138,864.00	0.62
45	600885	宏发股份	51,020	1,138,256.20	0.62
46	603379	三美股份	22,800	1,097,136.00	0.60
47	600380	健康元	99,100	1,093,073.00	0.60
48	000528	柳　　工	112,300	1,079,203.00	0.59
49	002603	以岭药业	76,500	1,078,650.00	0.59
50	600707	彩虹股份	160,800	1,038,768.00	0.57
51	002008	大族激光	42,500	1,035,725.00	0.57
52	002244	滨江集团	102,300	997,425.00	0.54
53	600155	华创云信	143,000	995,280.00	0.54
54	688297	中无人机	18,500	987,900.00	0.54
55	600901	江苏金租	161,800	980,508.00	0.54
56	300450	先导智能	39,200	974,120.00	0.53
57	600316	洪都航空	25,800	972,660.00	0.53
58	000728	国元证券	122,900	969,681.00	0.53
59	603858	步长制药	58,200	945,168.00	0.52
60	002507	涪陵榨菜	73,300	937,507.00	0.51
61	600363	联创光电	16,000	933,280.00	0.51
62	000066	中国长城	61,900	916,120.00	0.50
63	002299	圣农发展	63,700	910,273.00	0.50
64	601162	天风证券	182,900	901,697.00	0.49
65	600582	天地科技	149,400	894,906.00	0.49
66	688521	芯原股份	9,200	887,800.00	0.48

67	000563	陕国投A	248,400	886,788.00	0.48
68	600056	中国医药	84,700	875,798.00	0.48
69	000039	中集集团	110,400	867,744.00	0.47
70	000623	吉林敖东	51,000	864,450.00	0.47
71	600909	华安证券	148,000	862,840.00	0.47
72	603233	大参林	52,800	860,640.00	0.47
73	000932	华菱钢铁	194,200	854,480.00	0.47
74	603486	科沃斯	14,600	850,158.00	0.46
75	300454	深信服	8,900	838,202.00	0.46
76	600970	中材国际	95,000	815,100.00	0.45
77	600312	平高电气	52,900	814,131.00	0.44
78	002926	华西证券	90,500	809,070.00	0.44
79	601568	北元集团	194,900	808,835.00	0.44
80	601155	新城控股	58,700	803,016.00	0.44
81	601179	中国西电	130,000	798,200.00	0.44
82	002939	长城证券	93,600	784,368.00	0.43
83	002056	横店东磁	54,100	765,515.00	0.42
84	002465	海格通信	52,800	736,032.00	0.40
85	600060	海信视像	31,100	715,922.00	0.39
86	600008	首创环保	230,000	694,600.00	0.38
87	000987	越秀资本	100,300	688,058.00	0.38
88	300803	指南针	8,500	685,610.00	0.37
89	601108	财通证券	86,500	684,215.00	0.37
90	600739	辽宁成大	61,900	680,900.00	0.37
91	600517	国网英大	129,300	659,430.00	0.36
92	600985	淮北矿业	55,800	632,772.00	0.35
93	002130	沃尔核材	26,400	628,848.00	0.34
94	600348	华阳股份	94,300	628,038.00	0.34
95	600299	安迪苏	64,400	621,460.00	0.34
96	600801	华新水泥	51,800	613,312.00	0.34
97	600578	京能电力	134,300	603,007.00	0.33
98	600562	国睿科技	18,800	592,012.00	0.32
99	000921	海信家电	22,300	573,110.00	0.31
100	601918	新集能源	88,700	573,002.00	0.31
101	600109	国金证券	63,700	558,649.00	0.31
102	601233	桐昆股份	52,500	556,500.00	0.30
103	688027	国盾量子	2,000	550,020.00	0.30
104	600968	海油发展	132,000	538,560.00	0.29
105	600021	上海电力	58,400	513,336.00	0.28
106	603816	顾家家居	19,600	500,192.00	0.27
107	601991	大唐发电	156,200	495,154.00	0.27

108	000750	国海证券	120,000	494,400.00	0.27
109	600483	福能股份	49,700	479,108.00	0.26
110	000709	河钢股份	215,500	465,480.00	0.25
111	600583	海油工程	82,900	452,634.00	0.25
112	603899	晨光股份	15,500	449,345.00	0.25
113	600118	中国卫星	15,600	445,692.00	0.24
114	300140	节能环境	71,900	443,623.00	0.24
115	000825	太钢不锈	123,500	443,365.00	0.24
116	000027	深圳能源	69,200	441,496.00	0.24
117	600095	湘财股份	36,700	368,101.00	0.20
118	600098	广州发展	58,600	366,250.00	0.20
119	000959	首钢股份	105,600	359,040.00	0.20
120	002608	江苏国信	46,900	343,777.00	0.19
121	002423	中粮资本	25,100	306,973.00	0.17
122	002797	第一创业	30,800	218,064.00	0.12
123	300207	欣旺达	10,800	216,648.00	0.12
124	600352	浙江龙盛	20,800	211,328.00	0.12
125	002138	顺络电子	7,400	208,088.00	0.11
126	600079	人福医药	9,800	205,604.00	0.11
127	300024	机器人	11,800	202,724.00	0.11
128	603087	甘李药业	3,700	202,686.00	0.11
129	002673	西部证券	25,700	202,516.00	0.11
130	600298	安琪酵母	5,700	200,469.00	0.11
131	000733	振华科技	4,000	200,200.00	0.11
132	300001	特锐德	8,300	198,951.00	0.11
133	600392	盛和资源	15,100	198,867.00	0.11
134	601216	君正集团	35,900	198,168.00	0.11
135	002155	湖南黄金	11,050	197,242.50	0.11
136	600549	厦门钨业	9,300	194,556.00	0.11
137	600038	中直股份	5,000	194,050.00	0.11
138	600153	建发股份	18,700	193,919.00	0.11
139	688520	神州细胞	3,216	192,477.60	0.11
140	003031	中瓷电子	3,600	191,556.00	0.10
141	300558	贝达药业	3,300	191,235.00	0.10
142	002683	广东宏大	5,600	190,064.00	0.10
143	688568	中科星图	5,254	189,196.54	0.10
144	600637	东方明珠	25,200	188,244.00	0.10
145	002958	青农商行	51,600	186,276.00	0.10
146	600839	四川长虹	19,100	185,652.00	0.10
147	000415	渤海租赁	55,300	184,149.00	0.10
148	600166	福田汽车	67,900	184,009.00	0.10

149	002044	美年健康	35,600	182,984.00	0.10
150	600867	通化东宝	22,300	182,860.00	0.10
151	000967	盈峰环境	26,300	182,785.00	0.10
152	000636	风华高科	13,200	181,368.00	0.10
153	600271	航天信息	19,400	179,256.00	0.10
154	688100	威胜信息	4,838	179,247.90	0.10
155	603290	斯达半导	2,200	178,794.00	0.10
156	601106	中国一重	63,100	176,680.00	0.10
157	000951	中国重汽	10,000	175,800.00	0.10
157	601399	国机重装	58,600	175,800.00	0.10
159	600580	卧龙电驱	8,880	175,557.60	0.10
160	688387	信科移动	30,872	174,426.80	0.10
161	600925	苏能股份	33,100	173,113.00	0.09
162	688172	燕东微	8,689	170,825.74	0.09
163	601098	中南传媒	13,000	170,560.00	0.09
164	601019	山东出版	17,300	163,831.00	0.09
165	688153	唯捷创芯	5,228	162,120.28	0.09
166	688819	天能股份	5,833	161,924.08	0.09
167	002607	中公教育	44,200	135,252.00	0.07
168	002572	索菲亚	9,600	134,496.00	0.07
169	601118	海南橡胶	27,100	127,912.00	0.07
170	603077	和邦生物	72,500	126,875.00	0.07
171	600928	西安银行	31,100	121,912.00	0.07
172	600820	隧道股份	18,700	114,070.00	0.06
173	603345	安井食品	1,400	112,588.00	0.06
174	603885	吉祥航空	7,900	106,413.00	0.06
175	300888	稳健医疗	2,500	102,750.00	0.06
176	002273	水晶光电	4,600	91,862.00	0.05
177	002080	中材科技	4,600	89,700.00	0.05
178	000937	冀中能源	14,900	85,675.00	0.05
179	002294	信立泰	1,600	75,728.00	0.04
180	600808	马钢股份	21,700	74,865.00	0.04
181	002203	海亮股份	5,600	57,792.00	0.03
182	600208	衢州发展	17,500	51,800.00	0.03
183	600879	航天电子	4,300	45,021.00	0.02
184	000032	深桑达Ａ	2,200	44,506.00	0.02
185	000009	中国宝安	3,800	33,744.00	0.02
186	601555	东吴证券	1,200	10,500.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301316	慧博云通	43,300	1,865,364.00	1.02
2	002735	王子新材	75,100	1,112,231.00	0.61
3	600353	旭光电子	78,400	1,045,856.00	0.57
4	002389	航天彩虹	39,400	1,008,640.00	0.55
5	688776	国光电气	9,500	1,002,060.00	0.55
6	600990	四创电子	35,300	989,812.00	0.54
7	600345	长江通信	37,100	957,551.00	0.52
8	002605	姚记科技	33,000	920,700.00	0.50
9	688322	奥比中光	15,500	914,655.00	0.50
10	601881	中国银河	52,200	895,230.00	0.49
11	301236	软通动力	16,300	890,632.00	0.49
12	300581	晨曦航空	31,200	638,664.00	0.35
13	688552	航天南湖	15,250	608,627.50	0.33
14	688116	天奈科技	13,000	595,010.00	0.33
15	688103	国力股份	9,500	577,980.00	0.32
16	601788	光大证券	32,100	577,158.00	0.32
17	300726	宏达电子	16,000	572,000.00	0.31
18	300275	梅安森	43,000	568,460.00	0.31
19	301511	德福科技	26,900	556,830.00	0.30
20	688499	利元亨	13,300	553,413.00	0.30
21	000962	东方钽业	33,700	553,017.00	0.30
22	603267	鸿远电子	11,000	552,970.00	0.30
23	600999	招商证券	31,000	545,290.00	0.30
24	300033	同花顺	1,900	518,719.00	0.28
25	688719	爱科赛博	9,200	391,000.00	0.21
26	688411	海博思创	366	30,557.34	0.02
27	688775	影石创新	177	21,976.32	0.01
28	301458	钧崴电子	617	21,045.87	0.01
29	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
30	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
31	688545	兴福电子	589	15,873.55	0.01
32	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
33	301678	新恒汇	319	14,208.26	0.01
34	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
35	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
36	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
37	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
38	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
39	301479	弘景光电	136	10,590.32	0.01
40	603072	天和磁材	166	9,038.70	0.00

41	301658	首航新能	388	8,916.24	0.00
42	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
43	301275	汉朔科技	153	8,597.07	0.00
44	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
45	001356	富岭股份	518	7,479.92	0.00
46	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
47	301590	优优绿能	51	7,113.48	0.00
48	301173	毓恬冠佳	156	7,016.88	0.00
49	301501	恒鑫生活	152	6,873.44	0.00
50	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
51	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
52	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
53	603049	中策橡胶	102	4,370.70	0.00
54	603210	泰鸿万立	265	4,136.65	0.00
55	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
56	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
57	603014	威高血净	114	3,725.52	0.00
58	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
59	603271	永杰新材	77	2,701.16	0.00
60	603257	中国瑞林	71	2,660.37	0.00
61	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
62	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
63	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
64	603409	汇通控股	66	2,199.12	0.00
65	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000997	新 大 陆	10,087,338.00	5.78
2	002532	天山铝业	9,089,521.00	5.21
3	600959	江苏有线	8,154,204.00	4.67
4	600498	烽火通信	7,456,872.00	4.27
5	002185	华天科技	6,398,182.00	3.66
6	300207	欣旺达	6,384,220.00	3.66
7	688213	思特威	6,232,684.74	3.57
8	600487	亨通光电	6,179,119.00	3.54
9	002368	太极股份	5,882,211.00	3.37
10	688120	华海清科	5,863,356.90	3.36

11	002065	东华软件	5,574,920.00	3.19
12	300604	长川科技	5,328,353.00	3.05
13	600764	中国海防	5,157,259.00	2.95
14	600079	人福医药	5,100,207.00	2.92
15	002958	青农商行	5,007,645.00	2.87
16	603979	金诚信	4,979,429.04	2.85
17	688278	特宝生物	4,883,485.20	2.80
18	000423	东阿阿胶	4,842,668.00	2.77
19	000039	中集集团	4,770,180.00	2.73
20	300017	网宿科技	4,766,692.00	2.73
21	601216	君正集团	4,740,532.00	2.72
22	603893	瑞芯微	4,734,889.00	2.71
23	300677	英科医疗	4,723,705.40	2.71
24	000050	深天马Ａ	4,422,713.00	2.53
25	002273	水晶光电	4,385,791.00	2.51
26	300496	中科创达	4,383,069.00	2.51
27	601577	长沙银行	4,374,961.00	2.51
28	002155	湖南黄金	4,365,177.00	2.50
29	601168	西部矿业	4,353,989.00	2.49
30	601179	中国西电	4,288,084.00	2.46
31	000729	燕京啤酒	4,271,138.00	2.45
32	688578	艾力斯	4,263,880.20	2.44
33	603129	春风动力	4,152,732.00	2.38
34	600312	平高电气	4,141,639.00	2.37
35	600155	华创云信	4,136,865.00	2.37
36	300866	安克创新	4,133,490.70	2.37
37	000750	国海证券	4,133,231.00	2.37
38	600704	物产中大	4,090,240.00	2.34
39	002414	高德红外	4,090,123.00	2.34
40	603338	浙江鼎力	4,088,011.00	2.34
41	688002	睿创微纳	4,025,060.39	2.31
42	300803	指南针	3,999,464.00	2.29
43	002410	广联达	3,988,833.00	2.28
44	002507	涪陵榨菜	3,938,064.90	2.26
45	688469	芯联集成	3,907,293.23	2.24
46	688005	容百科技	3,902,763.67	2.24
47	600109	国金证券	3,860,340.00	2.21
48	600862	中航高科	3,841,836.00	2.20
49	600536	中国软件	3,724,892.00	2.13
50	600737	中粮糖业	3,720,148.00	2.13
51	603087	甘李药业	3,710,524.00	2.13

52	600008	首创环保	3,682,973.00	2.11
53	601567	三星医疗	3,658,709.00	2.10
54	600060	海信视像	3,640,581.00	2.09
55	000060	中金岭南	3,601,662.00	2.06
56	689009	九号公司	3,594,676.73	2.06
57	600582	天地科技	3,524,367.00	2.02
58	600901	江苏金租	3,497,821.00	2.00

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000997	新 大 陆	12,157,979.00	6.96
2	603129	春风动力	9,028,603.00	5.17
3	002065	东华软件	8,985,527.00	5.15
4	300207	欣旺达	8,187,719.00	4.69
5	002368	太极股份	7,854,314.59	4.50
6	002532	天山铝业	7,465,902.00	4.28
7	600959	江苏有线	7,408,324.00	4.24
8	600487	亨通光电	7,349,973.45	4.21
9	600498	烽火通信	7,192,496.00	4.12
10	002185	华天科技	6,249,048.00	3.58
11	002273	水晶光电	6,242,555.00	3.58
12	002958	青农商行	6,198,198.00	3.55
13	300866	安克创新	5,998,309.32	3.44
14	000039	中集集团	5,820,949.00	3.33
15	688278	特宝生物	5,757,692.44	3.30
16	603338	浙江鼎力	5,700,035.92	3.26
17	688578	艾力斯	5,561,506.04	3.19
18	601168	西部矿业	5,547,851.00	3.18
19	601567	三星医疗	5,362,888.99	3.07
20	600764	中国海防	5,324,654.99	3.05
21	601179	中国西电	5,300,748.00	3.04
22	603893	瑞芯微	5,225,039.80	2.99
23	002120	韵达股份	5,094,862.00	2.92
24	600704	物产中大	4,995,209.00	2.86
25	600079	人福医药	4,969,524.00	2.85
26	002444	巨星科技	4,848,467.99	2.78
27	000050	深天马 A	4,835,598.00	2.77
28	601555	东吴证券	4,784,067.00	2.74
29	601216	君正集团	4,754,146.00	2.72

30	688213	思特威	4,710,627.99	2.70
31	300677	英科医疗	4,657,798.20	2.67
32	000729	燕京啤酒	4,636,469.00	2.66
33	000060	中金岭南	4,585,949.00	2.63
34	600901	江苏金租	4,422,337.00	2.53
35	002155	湖南黄金	4,413,168.60	2.53
36	600155	华创云信	4,413,134.00	2.53
37	601577	长沙银行	4,394,645.00	2.52
38	688099	晶晨股份	4,354,537.29	2.49
39	688002	睿创微纳	4,350,866.29	2.49
40	002517	恺英网络	4,332,172.00	2.48
41	002414	高德红外	4,310,899.00	2.47
42	688120	华海清科	4,281,155.67	2.45
43	002410	广联达	4,259,804.80	2.44
44	000034	神州数码	4,215,022.00	2.41
45	601128	常熟银行	4,031,638.00	2.31
46	600637	东方明珠	4,015,275.00	2.30
47	600968	海油发展	3,998,617.00	2.29
48	000636	风华高科	3,965,848.00	2.27
49	002262	恩华药业	3,944,798.00	2.26
50	000709	河钢股份	3,939,905.00	2.26
51	002558	巨人网络	3,867,297.00	2.22
52	688005	容百科技	3,861,454.87	2.21
53	002128	电投能源	3,848,843.52	2.20
54	002507	涪陵榨菜	3,786,041.00	2.17
55	000403	派林生物	3,767,191.40	2.16
56	002202	金风科技	3,747,509.00	2.15
57	600862	中航高科	3,731,733.00	2.14
58	600998	九州通	3,711,585.00	2.13
59	000783	长江证券	3,710,105.00	2.13
60	600685	中船防务	3,680,847.00	2.11
61	000750	国海证券	3,654,159.00	2.09
62	600737	中粮糖业	3,641,946.00	2.09
63	300476	胜宏科技	3,631,639.00	2.08
64	002019	亿帆医药	3,609,833.00	2.07
65	603087	甘李药业	3,578,804.00	2.05
66	300604	长川科技	3,574,069.02	2.05
67	600258	首旅酒店	3,565,705.20	2.04
68	000598	兴蓉环境	3,517,534.00	2.01
69	300251	光线传媒	3,503,781.26	2.01
70	300803	指南针	3,499,261.00	2.00

71	002432	九安医疗	3,493,173.00	2.00

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	944,992,731.00
卖出股票收入（成交）总额	951,198,817.97

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,019,169.32	0.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,019,169.32	0.56

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019723	23 国债 20	10,000	1,019,169.32	0.56

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,673,961.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,604,844.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,278,806.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信保诚中证 500 指数增强 A	622	39,705.15	-	-	24,696,601.19	100.00%
中信保诚中证 500 指数增强 C	2,365	48,567.16	4,491,480.07	3.91%	110,369,852.95	96.09%
合计	2,987	46,721.77	4,491,480.07	3.22%	135,066,454.14	96.78%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚中证 500 指数增强 A	496,197.23	2.01%
	中信保诚中证 500 指数增强 C	526,938.97	0.46%

	合计	1,023,136.20	0.73%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信保诚中证 500 指数增强 A	0
	中信保诚中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚中证 500 指数增强 A	10~50
	中信保诚中证 500 指数增强 C	50~100
	合计	50~100

注：期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚中证 500 指数增强 A	中信保诚中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 06 月 21 日）基金份额总额	54,506,399.98	164,837,915.71
本报告期期初基金份额总额	32,682,404.87	109,606,737.12
本报告期基金总申购份额	25,287,651.65	305,141,750.95
减：本报告期基金总赎回份额	33,273,455.33	299,887,155.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,696,601.19	114,861,333.02

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，自 2025 年 4 月 21 日起，刘业伟先生不再担任中信保诚基金管理有限公司副总经理职务。上述变更事项已按规定公告并向监管机构备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	811,666,579.22	42.84%	163,687.22	42.87%	-
中信证券	2	1,083,140,619.09	57.16%	218,155.19	57.13%	-

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评

估通过后方可签署合同。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	23,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《证券时报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025年01月21日
2	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	同上	2025年03月28日
3	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	同上	2025年04月21日
4	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 6 月）	同上	2025年06月30日
5	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025年06月30日
6	中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025年06月30日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金相关批准文件

2、中信保诚基金管理有限公司营业执照

3、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同

4、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2025 年 08 月 29 日