

中信建投中证 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:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

报告送出日期: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。

基金托管人中信证券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	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51

§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证 500 增强	
基金主代码	006440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 05 月 09 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	198,244,928.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投中证 500 增强 A	中信建投中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	006440	006441
报告期末下属分级基金的份额总额	93,924,221.49 份	104,320,706.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 500 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。 指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。
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	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		中信建投基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责	姓名	朱伟	杨军智

人	联系电话	010-59100208	010-60834299
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		4009-108-108	010-60836588
传真		010-59100298	010-60834004
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		100010	100125
法定代表人		黄凌	张佑君

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.cfund108.com
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	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 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-2025 年 06 月 30 日）	
	中信建投中证 500 增强 A	中信建投中证 500 增强 C
本期已实现收益	4,802,160.91	4,966,713.10
本期利润	8,667,696.98	9,403,466.03
加权平均基金份额本期利润	0.0855	0.0828
本期加权平均净值利润率	5.99%	5.89%
本期基金份额净值增长率	6.21%	6.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	42,250,192.29	44,599,023.87
期末可供分配基金份额利润	0.4498	0.4275
期末基金资产净值	141,450,054.69	154,699,767.58
期末基金份额净值	1.5060	1.4829
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	

基金份额累计净值增长率	50.60%	48.29%
-------------	--------	--------

注：1、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。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所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。

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

中信建投中证 500 增强 A 净值表现

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	5.09%	0.66%	4.09%	0.75%	1.00%	-0.09%
过去三个月	3.89%	1.45%	0.97%	1.43%	2.92%	0.02%
过去六个月	6.21%	1.21%	3.21%	1.29%	3.00%	-0.08%
过去一年	24.83%	1.51%	18.83%	1.64%	6.00%	-0.13%
过去三年	0.09%	1.24%	-7.61%	1.29%	7.70%	-0.05%
自基金合同生效起至今	50.60%	1.24%	7.67%	1.25%	42.93%	-0.01%

中信建投中证 500 增强 C 净值表现

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	5.06%	0.66%	4.09%	0.75%	0.97%	-0.09%
过去三个月	3.81%	1.45%	0.97%	1.43%	2.84%	0.02%
过去六个月	6.05%	1.21%	3.21%	1.29%	2.84%	-0.08%
过去一年	24.47%	1.51%	18.83%	1.64%	5.64%	-0.13%
过去三年	-0.81%	1.24%	-7.61%	1.29%	6.80%	-0.05%
自基金合同生效起至今	48.29%	1.24%	7.67%	1.25%	40.62%	-0.01%

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

中信建投中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月09日-2025年06月30日)



中信建投中证500增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月09日-2025年06月30日)



§ 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

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 61 个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

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		
王鹏	本基金的基金经理、指数 与量化投资部行政负责人	2020-05-09	-	10 年	中国籍，1984 年 8 月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities 研究员、CIBC World Market 期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019 年 2 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金、中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金、中信建投量化选股股票型证券投资基金、中信建投中证 A500 指数增强型证券投资

					资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------

注：1、基金经理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的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%的情况。

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，全球市场在宏观经济挑战与地缘政治风险的交织影响下，呈现出高度的波动性和复杂性。全球经济增长动能放缓，而国内经济在政策支持下展现出韧性。在这样的背景下，市场风格转换迅速，从成长到价值再到行业轮动，对投资决策提出了更高要求。“关税风波”等外部事件也加剧了特定行业的波动，促使市场更加关注内需驱动型和自主可控领域的投资机会。

本产品利用量化的方法进行选股和风险管理，严格控制行业与风格的偏离，同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证 500 增强 A 基金份额净值为 1.5060 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.21%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%；截至报告期末中信建投中证 500 增强 C 基金份额净值为 1.4829 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.05%，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

展望下半年，我们认为市场环境仍将充满挑战，但中国经济的内生韧性和新质生产力的加速发展将为投资提供新的增长引擎。我们将继续关注人工智能、生物技术等高成长领域，同时也会密切留意消费复苏和具备稳定分红潜力的公司。我们将持续深化对市场研究，以期更好地把握市场脉搏，应对未来的不确定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、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关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

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实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中信建投中证 500 指数增强

型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，中信建投基金管理有限公司在中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：中信建投中证 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	20,350,677.79	22,346,559.23
结算备付金		32,574.83	531,392.24
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	278,364,685.04	305,155,749.48
其中：股票投资		278,356,584.51	305,155,749.48
基金投资		-	-
债券投资		8,100.53	-
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		138,333.23	102,138.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		298,886,270.89	328,135,839.92
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		2,363,365.66	712,233.80
应付管理人报酬		181,740.88	212,767.46
应付托管费		24,232.12	28,368.96
应付销售服务费		38,190.38	44,392.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.80	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	128,918.78	258,008.45
负债合计		2,736,448.62	1,255,770.84
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	198,244,928.36	232,223,540.80
未分配利润	6.4.7.8	97,904,893.91	94,656,528.28
净资产合计		296,149,822.27	326,880,069.08
负债和净资产总计		298,886,270.89	328,135,839.92

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 198,244,928.36 份，其中中信建投中证 500 增强 A 类基金份额净值 1.5060 元，基金份额 93,924,221.49 份；中信建投中证 500 增强 C 类基金份额净值 1.4829 元，基金份额 104,320,706.87 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投中证 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		19,716,179.99	-29,222,378.11
1. 利息收入		34,581.07	91,765.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,581.07	91,765.40
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,363,159.16	-12,381,420.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,483,344.44	-15,965,517.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	25,204.82	3,777.14
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,854,609.90	3,580,320.47
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	8,302,289.00	-17,014,362.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	16,150.76	81,638.89
减：二、营业总支出		1,645,016.98	2,046,608.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,133,726.70	1,370,940.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,163.56	182,792.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	237,886.13	308,341.28
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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		0.07	-
8. 其他费用	6.4.7.17	122,240.52	184,535.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,071,163.01	-31,268,986.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,071,163.01	-31,268,986.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,071,163.01	-31,268,986.84

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投中证 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	232,223,540.80	94,656,528.28	326,880,069.08
二、本期期初净资产	232,223,540.80	94,656,528.28	326,880,069.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-33,978,612.44	3,248,365.63	-30,730,246.81
(一)、综合收益总额	-	18,071,163.01	18,071,163.01
(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)	-33,978,612.44	-14,822,797.38	-48,801,409.82
其中：1. 基金申购款	20,434,050.08	8,371,020.54	28,805,070.62
2. 基金赎回款	-54,412,662.52	-23,193,817.92	-77,606,480.44
(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	198,244,928.36	97,904,893.91	296,149,822.27
项 目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 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	306,996,290.50	94,228,166.66	401,224,457.16
二、本期期初净资产	306,996,290.50	94,228,166.66	401,224,457.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-30,071,496.48	-39,364,665.37	-69,436,161.85
(一)、综合收益总额	-	-31,268,986.84	-31,268,986.84
(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)	-30,071,496.48	-8,095,678.53	-38,167,175.01
其中：1. 基金申购款	42,236,214.34	10,122,189.60	52,358,403.94
2. 基金赎回款	-72,307,710.82	-18,217,868.13	-90,525,578.95
(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	276,924,794.02	54,863,501.29	331,788,295.31

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：

黄凌	张欣宇	谭保民
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

中信建投中证 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”）证监许可〔2020〕第 367 号《关于准予中信建投同顺量化逆向策略股票型证券投资基金变更注册的批复》核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国

证券投资基金法》和《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2020）第 0003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 272,396,616.24 份基金份额，其中认购资金利息折合 146,489.89 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的一类基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的其他股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号〈年度报告的内容与格式〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日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 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信

用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产

或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实

现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	1,405,329.24
等于：本金	1,404,330.47
加：应计利息	998.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	18,945,348.55
等于：本金	18,944,689.82
加：应计利息	658.73
减：坏账准备	-
合计	20,350,677.79

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		270,035,579.89	-	278,356,584.51	8,321,004.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,100.00	0.53	8,100.53	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,100.00	0.53	8,100.53	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		270,043,679.89	0.53	278,364,685.04	8,321,004.62

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

无余额。

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

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	46.50
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	-
预提费用	116,351.28
其他应付	12,521.00
合计	128,918.78

6.4.7.7 实收基金

中信建投中证 500 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	109,783,769.98	109,783,769.98
本期申购	3,771,719.35	3,771,719.35
本期赎回（以“-”号填列）	-19,631,267.84	-19,631,267.84
本期末	93,924,221.49	93,924,221.49

中信建投中证 500 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	122,439,770.82	122,439,770.82
本期申购	16,662,330.73	16,662,330.73
本期赎回（以“-”号填列）	-34,781,394.68	-34,781,394.68
本期末	104,320,706.87	104,320,706.87

6.4.7.8 未分配利润

中信建投中证 500 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	44,153,167.77	1,732,966.48	45,886,134.25
本期期初	44,153,167.77	1,732,966.48	45,886,134.25
本期利润	4,802,160.91	3,865,536.07	8,667,696.98
本期基金份额交易产生的变动数	-6,705,136.39	-322,861.64	-7,027,998.03
其中：基金申购款	1,585,537.11	12,587.68	1,598,124.79
基金赎回款	-8,290,673.50	-335,449.32	-8,626,122.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,250,192.29	5,275,640.91	47,525,833.20

中信建投中证 500 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	46,853,833.86	1,916,560.17	48,770,394.03
本期期初	46,853,833.86	1,916,560.17	48,770,394.03
本期利润	4,966,713.10	4,436,752.93	9,403,466.03
本期基金份额交易产生的变动数	-7,221,523.09	-573,276.26	-7,794,799.35
其中：基金申购款	6,685,170.40	87,725.35	6,772,895.75
基金赎回款	-13,906,693.49	-661,001.61	-14,567,695.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,599,023.87	5,780,036.84	50,379,060.71

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	15,790.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,607.99
结算备付金利息收入	1,182.59
其他	-
合计	34,581.07

6.4.7.10 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	1,308,388,105.04
减：卖出股票成本总额	1,298,594,089.61

减：交易费用	1,310,670.99
买卖股票差价收入	8,483,344.44

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	22.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,182.03
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	25,204.82

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	121,953.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	96,700.00
减：应计利息总额	22.99
减：交易费用	48.21
买卖债券差价收入	25,182.03

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 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	2,854,609.90
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	2,854,609.90

6.4.7.14 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	8,302,289.00
——股票投资	8,302,289.00

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,302,289.00

6.4.7.15 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	16,150.76
合计	16,150.76

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于 25%。

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	43,889.24
合计	122,240.52

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

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之

前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

无。

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
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司

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

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

金额单位：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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券股份有限公司	1,185,615,185.35	46.10%	2,053,013,705.18	46.03%
中信建投证券股份有限公司	1,386,265,555.33	53.90%	2,407,566,822.36	53.97%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券	65,806.05	53.96%	19,006.98	53.09%

股份有限公司				
中信证券股份 有限公司	56,147.18	46.04%	16,795.61	46.91%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金总额的 比例
中信证券股份 有限公司	226,634.41	46.10%	-	-
中信建投证券 股份有限公司	264,939.59	53.90%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金总额的 比例
中信建投证券 股份有限公司	1,255,886.32	46.06%	-	-
中信证券股份 有限公司	1,470,913.21	53.94%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理 费	1,133,726.70	1,370,940.07
其中：应支付销售机构的客户维 护费	533,962.44	618,734.03
应支付基金管理人的净	599,764.26	752,206.04

管理费		
-----	--	--

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 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 × 0.75% / 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	151,163.56	182,792.02

注：支付基金托管人中信证券股份有限公司的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。其计算公式为：

日托管费 = 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		
	中信建投中证 500 增强 A	中信建投中证 500 增强 C	合计
中信证券股份有限公司	-	100,889.21	100,889.21
中信建投证券股份有限公司	-	44,246.13	44,246.13
合计	-	145,135.34	145,135.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证 500 增强 A	中信建投中证 500 增强 C	合计
中信证券股份有限公司	-	125,732.72	125,732.72
中信建投证券股份有限公司	-	53,901.45	53,901.45
中信建投基金管理有限公司	-	17,077.68	17,077.68
合计	-	196,711.85	196,711.85

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.30% / 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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 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 01 月 01 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
中信证券股份有限公司-托管户	1,405,329.24	15,790.49	1,997,035.15	31,525.16
中信证券股份有限公司-证券户	8,997,021.14	3,865.08	13,665,627.48	12,940.45
中信建投证券股份有限公司-证券户	9,948,327.41	13,742.91	14,135,706.68	20,761.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中信证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按同业利率或约定利率计息。本基金证券户的存款由中信证券股份有限公司和中信建投证券股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过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

无余额。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

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	8,100.53	-
未评级	-	-
合计	8,100.53	-

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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。

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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》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（如有）。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。

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。

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。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,350,677.79	-	-	-	20,350,677.79
结算备付金	32,574.83	-	-	-	32,574.83
交易性金融资产	-	-	8,100.53	278,356,584.51	278,364,685.04
应收申购款	-	-	-	138,333.23	138,333.23
资产总计	20,383,252.62	-	8,100.53	278,494,917.74	298,886,270.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,363,365.66	2,363,365.66
应付管理人报酬	-	-	-	181,740.88	181,740.88

应付托管费	-	-	-	24,232.12	24,232.12
应付销售服务费	-	-	-	38,190.38	38,190.38
应交税费	-	-	-	0.80	0.80
其他负债	-	-	-	128,918.78	128,918.78
负债总计	-	-	-	2,736,448.62	2,736,448.62
利率敏感度缺口	20,383,252.62	-	8,100.53	275,758,469.12	296,149,822.27
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,346,559.23	-	-	-	22,346,559.23
结算备付金	531,392.24	-	-	-	531,392.24
交易性金融资产	-	-	-	305,155,749.48	305,155,749.48
应收申购款	-	-	-	102,138.97	102,138.97
资产总计	22,877,951.47	-	-	305,257,888.45	328,135,839.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	712,233.80	712,233.80
应付管理人报酬	-	-	-	212,767.46	212,767.46
应付托管费	-	-	-	28,368.96	28,368.96
应付销售服务费	-	-	-	44,392.17	44,392.17
其他负债	-	-	-	258,008.45	258,008.45
负债总计	-	-	-	1,255,770.84	1,255,770.84
利率敏感度缺口	22,877,951.47	-	-	304,002,117.61	326,880,069.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	278,356,584.51	93.99	305,155,749.48	93.35
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,100.53	0.00	—	—
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	278,364,685.04	93.99	305,155,749.48	93.35

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
	业绩比较基准上升 5%	13,423,503.46	15,450,526.02
	业绩比较基准下降 5%	-13,423,503.46	-15,450,526.02

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	278,356,584.51	305,155,749.48
第二层次	8,100.53	-
第三层次	-	-
合计	278,364,685.04	305,155,749.48

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	278,356,584.51	93.13

	其中：股票	278,356,584.51	93.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,100.53	0.00
	其中：债券	8,100.53	0.00
	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	20,383,252.62	6.82
8	其他各项资产	138,333.23	0.05
9	合计	298,886,270.89	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	172,752.00	0.06
B	采矿业	6,529,242.50	2.20
C	制造业	157,154,812.08	53.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,398,362.00	2.50
E	建筑业	1,727,832.00	0.58
F	批发和零售业	10,947,492.00	3.70
G	交通运输、仓储和邮政业	2,112,656.00	0.71
H	住宿和餐饮业	1,385,928.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,712,987.74	6.32
J	金融业	26,536,670.30	8.96
K	房地产业	4,367,804.40	1.47
L	租赁和商务服务业	732,813.40	0.25
M	科学研究和技术服务业	424,403.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,862,958.00	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	766,923.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	3,659,318.00	1.24
S	综合	2,145,735.00	0.72
	合计	247,638,689.42	83.62

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	61,318.00	0.02

C	制造业	22,339,674.79	7.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	160,966.00	0.05
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	591,340.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,266,946.00	0.43
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,563,462.30	1.20
J	金融业	74,202.00	0.03
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	66,440.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,121,314.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	1,267,002.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	61,422.00	0.02
P	教育	81,648.00	0.03
Q	卫生和社会工作	62,160.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	30,717,895.09	10.37

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	300207	欣旺达	192,700	3,865,562.00	1.31
2	000050	深天马 A	443,700	3,780,324.00	1.28
3	002841	视源股份	105,900	3,664,140.00	1.24
4	300140	节能环保	542,800	3,349,076.00	1.13
5	000783	长江证券	479,900	3,325,707.00	1.12
6	002414	高德红外	313,600	3,214,400.00	1.09
7	600998	九州通	624,000	3,207,360.00	1.08
8	002624	完美世界	195,000	2,958,150.00	1.00
9	002080	中材科技	149,100	2,907,450.00	0.98
10	002138	顺络电子	102,000	2,868,240.00	0.97
11	600109	国金证券	325,300	2,852,881.00	0.96
12	002266	浙富控股	910,100	2,803,108.00	0.95
13	600707	彩虹股份	427,000	2,758,420.00	0.93

14	002056	横店东磁	192,600	2,725,290.00	0.92
15	000021	深科技	143,600	2,691,064.00	0.91
16	600873	梅花生物	244,300	2,611,567.00	0.88
17	002532	天山铝业	309,500	2,571,945.00	0.87
18	600739	辽宁成大	233,400	2,567,400.00	0.87
19	000960	锡业股份	167,300	2,559,690.00	0.86
20	000060	中金岭南	554,400	2,539,152.00	0.86
21	600166	福田汽车	926,000	2,509,460.00	0.85
22	000893	亚钾国际	82,200	2,477,508.00	0.84
23	600704	物产中大	469,500	2,474,265.00	0.84
24	002340	格林美	389,000	2,470,150.00	0.83
25	600583	海油工程	446,700	2,438,982.00	0.82
26	600380	健康元	203,700	2,246,811.00	0.76
27	300677	英科医疗	93,500	2,214,080.00	0.75
28	601216	君正集团	400,100	2,208,552.00	0.75
29	600673	东阳光	184,500	2,145,735.00	0.72
30	605589	圣泉集团	75,700	2,100,675.00	0.71
31	000729	燕京啤酒	161,600	2,089,488.00	0.71
32	600056	中国医药	201,400	2,082,476.00	0.70
33	000898	鞍钢股份	890,100	2,065,032.00	0.70
34	300017	网宿科技	189,600	2,032,512.00	0.69
35	600871	石化油服	1,041,400	2,030,730.00	0.69
36	600143	金发科技	196,700	2,027,977.00	0.68
37	002958	青农商行	557,400	2,012,214.00	0.68
38	002244	滨江集团	203,800	1,987,050.00	0.67
39	688100	威胜信息	53,500	1,982,175.00	0.67
40	002273	水晶光电	97,100	1,939,087.00	0.65
41	000636	风华高科	140,100	1,924,974.00	0.65
42	002299	圣农发展	130,000	1,857,700.00	0.63
43	600517	国网英大	348,400	1,776,840.00	0.60
44	000739	普洛药业	125,800	1,761,200.00	0.59
45	688778	厦钨新能	31,000	1,733,520.00	0.59
46	600299	安迪苏	177,900	1,716,735.00	0.58
47	000623	吉林敖东	100,300	1,700,085.00	0.57
48	600535	天士力	106,900	1,672,985.00	0.56
49	000728	国元证券	211,500	1,668,735.00	0.56
50	603816	XD 顾家家	64,400	1,643,488.00	0.55
51	600487	亨通光电	104,300	1,595,790.00	0.54
52	000709	河钢股份	722,278	1,560,120.48	0.53
53	000988	华工科技	33,100	1,556,031.00	0.53
54	300054	鼎龙股份	53,500	1,534,380.00	0.52
55	600699	均胜电子	87,500	1,526,000.00	0.52
56	600528	中铁工业	202,800	1,496,664.00	0.51

57	002517	恺英网络	77,100	1,488,801.00	0.50
58	600062	华润双鹤	79,700	1,487,202.00	0.50
59	300373	扬杰科技	28,300	1,468,770.00	0.50
60	603379	三美股份	30,300	1,458,036.00	0.49
61	603225	新凤鸣	136,000	1,448,400.00	0.49
62	300001	特锐德	59,900	1,435,803.00	0.48
63	601098	中南传媒	108,100	1,418,272.00	0.48
64	601233	桐昆股份	133,700	1,417,220.00	0.48
65	002926	华西证券	151,100	1,350,834.00	0.46
66	600578	京能电力	298,600	1,340,714.00	0.45
67	688213	思特威	12,900	1,318,638.00	0.45
68	000009	中国宝安	144,500	1,283,160.00	0.43
69	000528	柳 工	133,100	1,279,091.00	0.43
70	601717	郑煤机	76,300	1,268,106.00	0.43
71	300627	华测导航	36,000	1,260,000.00	0.43
72	603565	中谷物流	131,600	1,256,780.00	0.42
73	300919	中伟股份	38,000	1,249,440.00	0.42
74	603341	龙旗科技	30,700	1,247,341.00	0.42
75	600497	驰宏锌锗	234,500	1,240,505.00	0.42
76	688475	萤石网络	39,000	1,229,280.00	0.42
77	601665	齐鲁银行	194,200	1,227,344.00	0.41
78	000537	中绿电	146,800	1,227,248.00	0.41
79	002461	珠江啤酒	108,500	1,224,965.00	0.41
80	600132	重庆啤酒	21,600	1,190,160.00	0.40
81	688099	晶晨股份	16,402	1,164,706.02	0.39
82	002500	山西证券	198,100	1,156,904.00	0.39
83	300496	中科创达	19,800	1,132,956.00	0.38
84	600862	中航高科	43,100	1,124,048.00	0.38
85	600959	江苏有线	319,200	1,098,048.00	0.37
86	688772	珠海冠宇	75,900	1,084,611.00	0.37
87	600361	创新新材	270,000	1,077,300.00	0.36
88	000825	太钢不锈	292,600	1,050,434.00	0.35
89	002739	万达电影	88,300	1,009,269.00	0.34
90	601155	新城控股	73,300	1,002,744.00	0.34
91	002595	豪迈科技	16,900	1,000,818.00	0.34
92	000598	兴蓉环境	137,700	992,817.00	0.34
93	002318	久立特材	40,700	951,973.00	0.32
94	601991	大唐发电	289,600	918,032.00	0.31
95	601231	环旭电子	61,400	898,282.00	0.30
96	600606	绿地控股	548,400	893,892.00	0.30
97	600157	永泰能源	665,000	891,100.00	0.30
98	601555	东吴证券	101,800	890,750.00	0.30
99	600325	华发股份	182,200	887,314.00	0.30

100	688469	芯联集成	185,900	886,743.00	0.30
101	003022	联泓新科	55,600	880,148.00	0.30
102	601568	北元集团	211,400	877,310.00	0.30
103	600801	华新水泥	73,600	871,424.00	0.29
104	300699	光威复材	26,400	836,088.00	0.28
105	300136	信维通信	37,200	833,280.00	0.28
106	002472	双环传动	24,400	817,156.00	0.28
107	000959	首钢股份	238,300	810,220.00	0.27
108	002410	广联达	60,400	809,964.00	0.27
109	688819	天能股份	28,900	802,264.00	0.27
110	601636	旗滨集团	157,300	788,073.00	0.27
111	600688	上海石化	270,900	772,065.00	0.26
112	000750	国海证券	186,000	766,320.00	0.26
113	601106	中国一重	273,600	766,080.00	0.26
114	688318	财富趋势	6,600	758,472.00	0.26
115	600754	锦江酒店	33,300	747,252.00	0.25
116	600369	西南证券	164,700	716,445.00	0.24
117	603077	和邦生物	401,200	702,100.00	0.24
118	600909	华安证券	120,400	701,932.00	0.24
119	603858	步长制药	42,500	690,200.00	0.23
120	300037	新宙邦	18,736	659,507.20	0.22
121	688249	晶合集成	32,400	656,748.00	0.22
122	000921	海信家电	25,500	655,350.00	0.22
123	600271	航天信息	70,400	650,496.00	0.22
124	002558	巨人网络	27,300	642,915.00	0.22
125	600816	建元信托	217,800	642,510.00	0.22
126	600131	国网信通	36,200	640,740.00	0.22
127	600258	首旅酒店	45,200	638,676.00	0.22
128	601997	贵阳银行	102,100	637,104.00	0.22
129	601456	国联民生	61,300	634,455.00	0.21
130	600155	华创云信	90,700	631,272.00	0.21
131	002673	西部证券	79,300	624,884.00	0.21
132	601615	XD 明阳智	54,100	621,609.00	0.21
133	002939	长城证券	73,000	611,740.00	0.21
134	688387	信科移动	108,016	610,290.40	0.21
135	600637	东方明珠	81,100	605,817.00	0.20
136	002850	科达利	5,300	599,801.00	0.20
137	603087	甘李药业	10,900	597,102.00	0.20
138	600763	通策医疗	14,400	594,432.00	0.20
139	001696	宗申动力	25,700	576,965.00	0.19
140	600498	烽火通信	26,800	563,604.00	0.19
141	688172	燕东微	27,708	544,739.28	0.18
142	000951	中国重汽	29,900	525,642.00	0.18

143	002409	雅克科技	9,400	514,086.00	0.17
144	601108	财通证券	64,000	506,240.00	0.17
145	002430	杭氧股份	25,600	497,152.00	0.17
146	688777	中控技术	10,932	490,956.12	0.17
147	300395	菲利华	9,400	480,340.00	0.16
148	600928	西安银行	118,000	462,560.00	0.16
149	688561	奇安信	13,500	458,730.00	0.15
150	002153	石基信息	52,600	455,516.00	0.15
151	000830	鲁西化工	44,000	453,200.00	0.15
152	000967	盈峰环境	65,200	453,140.00	0.15
153	600925	苏能股份	85,500	447,165.00	0.15
154	600977	中国电影	41,200	441,664.00	0.15
155	601918	新集能源	68,000	439,280.00	0.15
156	688122	西部超导	8,400	435,792.00	0.15
157	300285	国瓷材料	24,600	426,810.00	0.14
158	603000	人民网	20,900	422,389.00	0.14
159	600021	上海电力	47,300	415,767.00	0.14
160	600970	中材国际	47,300	405,834.00	0.14
161	600008	首创环保	133,700	403,774.00	0.14
162	600582	天地科技	67,400	403,726.00	0.14
163	300724	捷佳伟创	7,200	390,960.00	0.13
164	600004	白云机场	42,900	390,390.00	0.13
165	300595	欧普康视	24,300	371,061.00	0.13
166	002439	启明星辰	22,800	364,572.00	0.12
167	000563	陕国投 A	101,400	361,998.00	0.12
168	300573	兴齐眼药	6,960	360,458.40	0.12
169	000591	太阳能	81,800	359,102.00	0.12
170	000415	渤海租赁	107,600	358,308.00	0.12
171	002738	中矿资源	11,100	356,976.00	0.12
172	688425	铁建重工	86,700	353,736.00	0.12
173	603290	斯达半导	4,300	349,461.00	0.12
174	603927	中科软	18,040	348,893.60	0.12
175	601858	中国科传	17,400	338,430.00	0.11
176	000932	华菱钢铁	76,800	337,920.00	0.11
177	603233	大参林	20,700	337,410.00	0.11
178	600885	宏发股份	14,880	331,972.80	0.11
179	600499	科达制造	33,500	328,300.00	0.11
180	600906	财达证券	47,600	324,632.00	0.11
181	300390	天华新能	16,900	322,283.00	0.11
182	600820	隧道股份	51,500	314,150.00	0.11
183	002432	九安医疗	8,600	313,298.00	0.11
184	600848	上海临港	34,520	313,096.40	0.11
185	601990	南京证券	38,600	311,888.00	0.11

186	000997	新 大 陆	9,500	307,610.00	0.10
187	300888	稳健医疗	7,400	304,140.00	0.10
188	601880	辽港股份	199,600	299,400.00	0.10
189	300604	长川科技	6,600	296,406.00	0.10
190	600298	安琪酵母	8,400	295,428.00	0.10
191	603486	科沃斯	4,900	285,327.00	0.10
192	002507	涪陵榨菜	22,300	285,217.00	0.10
193	603338	浙江鼎力	5,900	279,660.00	0.09
194	603160	汇顶科技	3,900	277,017.00	0.09
195	601965	中国汽研	15,600	276,900.00	0.09
196	002008	大族激光	11,200	272,944.00	0.09
197	300601	康泰生物	17,400	264,306.00	0.09
198	688032	禾迈股份	2,600	259,636.00	0.09
199	601928	凤凰传媒	23,100	258,027.00	0.09
200	605358	立昂微	11,000	256,300.00	0.09
201	600312	平高电气	16,500	253,935.00	0.09
202	601577	长沙银行	25,400	252,476.00	0.09
203	603786	科博达	4,500	249,345.00	0.08
204	603893	瑞芯微	1,600	242,976.00	0.08
205	601168	西部矿业	14,500	241,135.00	0.08
206	603650	彤程新材	7,500	241,125.00	0.08
207	002202	金风科技	22,900	234,725.00	0.08
208	000039	中集集团	29,700	233,442.00	0.08
209	601696	中银证券	21,600	230,904.00	0.08
210	600884	杉杉股份	23,800	225,148.00	0.08
211	000738	航发控制	10,800	224,100.00	0.08
212	300476	胜宏科技	1,600	215,008.00	0.07
213	600398	海澜之家	30,200	210,192.00	0.07
214	002185	华天科技	20,600	208,060.00	0.07
215	002281	光迅科技	4,100	202,212.00	0.07
216	688183	生益电子	3,899	199,628.80	0.07
217	002262	恩华药业	9,000	187,020.00	0.06
218	301498	乖宝宠物	1,700	185,929.00	0.06
219	600098	广州发展	29,600	185,000.00	0.06
220	300058	蓝色光标	27,640	181,318.40	0.06
221	600208	衢州发展	60,000	177,600.00	0.06
222	002563	森马服饰	33,100	174,106.00	0.06
223	301165	锐捷网络	2,820	173,317.20	0.06
224	601118	海南橡胶	36,600	172,752.00	0.06
225	002155	湖南黄金	9,550	170,467.50	0.06
226	002821	凯莱英	1,900	167,675.00	0.06
227	300763	锦浪科技	2,900	166,431.00	0.06
228	601128	常熟银行	21,730	160,150.10	0.05

229	002683	广东宏大	4,600	156,124.00	0.05
230	601179	中国西电	25,400	155,956.00	0.05
231	002152	广电运通	11,600	155,904.00	0.05
232	000027	深圳能源	24,000	153,120.00	0.05
233	600563	法拉电子	1,400	152,726.00	0.05
234	000723	美锦能源	34,800	150,336.00	0.05
235	600339	中油工程	45,700	149,439.00	0.05
236	002025	航天电器	2,900	149,089.00	0.05
237	600282	南钢股份	34,800	146,160.00	0.05
238	300751	迈为股份	2,100	146,076.00	0.05
239	000937	冀中能源	24,800	142,600.00	0.05
240	600988	赤峰黄金	5,700	141,816.00	0.05
241	002429	兆驰股份	32,200	141,036.00	0.05
242	002831	裕同科技	6,000	140,520.00	0.05
243	688052	纳芯微	800	139,592.00	0.05
244	603939	益丰药房	5,600	137,032.00	0.05
245	600390	五矿资本	23,500	137,005.00	0.05
246	300567	精测电子	2,200	133,342.00	0.05
247	601139	深圳燃气	20,900	132,924.00	0.04
248	688002	睿创微纳	1,900	132,468.00	0.04
249	688188	柏楚电子	1,000	131,660.00	0.04
250	688295	中复神鹰	6,323	131,518.40	0.04
251	601019	山东出版	13,600	128,792.00	0.04
252	600038	中直股份	3,300	128,073.00	0.04
253	600060	海信视像	5,500	126,610.00	0.04
254	600995	南网储能	12,800	125,184.00	0.04
255	300002	神州泰岳	10,600	125,080.00	0.04
256	603605	珀莱雅	1,500	124,185.00	0.04
257	603298	杭叉集团	5,900	123,605.00	0.04
258	300748	金力永磁	5,180	123,491.20	0.04
259	002436	兴森科技	9,200	121,808.00	0.04
260	603589	口子窖	3,500	121,800.00	0.04
261	601399	国机重装	40,200	120,600.00	0.04
262	002353	杰瑞股份	3,400	119,000.00	0.04
263	600435	北方导航	7,600	118,484.00	0.04
264	601158	重庆水务	25,200	116,928.00	0.04
265	300558	贝达药业	2,000	115,900.00	0.04
266	600153	建发股份	11,100	115,107.00	0.04
267	002966	苏州银行	13,100	115,018.00	0.04
268	601611	中国核建	12,400	113,956.00	0.04
269	603345	安井食品	1,400	112,588.00	0.04
270	000831	中国稀土	3,100	111,972.00	0.04
271	003031	中瓷电子	2,100	111,741.00	0.04

272	301267	华夏眼科	5,700	109,269.00	0.04
273	002156	通富微电	4,200	107,604.00	0.04
274	600764	中国海防	3,100	105,400.00	0.04
275	002756	永兴材料	3,300	104,775.00	0.04
276	600141	兴发集团	5,000	102,650.00	0.03
277	601156	东航物流	7,800	102,102.00	0.03
278	600839	四川长虹	10,500	102,060.00	0.03
279	000683	博源化工	21,300	102,027.00	0.03
280	603606	东方电缆	1,800	93,078.00	0.03
281	300339	润和软件	1,800	91,494.00	0.03
282	600685	中船防务	3,300	89,727.00	0.03
283	002508	老板电器	4,700	89,347.00	0.03
284	000423	东阿阿胶	1,700	88,910.00	0.03
285	600348	华阳股份	13,200	87,912.00	0.03
286	002603	以岭药业	6,200	87,420.00	0.03
287	603129	春风动力	400	86,600.00	0.03
288	002064	华峰化学	13,000	85,930.00	0.03
289	688297	中无人机	1,600	85,440.00	0.03
290	603979	金诚信	1,800	83,592.00	0.03
291	300803	指南针	1,020	82,273.20	0.03
292	002385	大北农	20,300	82,012.00	0.03
293	688349	三一重能	3,240	80,805.60	0.03
294	600529	山东药玻	3,600	79,704.00	0.03
295	002423	中粮资本	6,500	79,495.00	0.03
296	000034	神州数码	2,100	79,044.00	0.03
297	000785	居然智家	25,600	78,080.00	0.03
298	003035	南网能源	16,600	76,194.00	0.03
299	603868	飞科电器	2,100	75,327.00	0.03
300	002465	海格通信	5,400	75,276.00	0.03
301	002261	拓维信息	2,400	74,280.00	0.03
302	600483	福能股份	7,700	74,228.00	0.03
303	600352	浙江龙盛	7,100	72,136.00	0.02
304	000887	中鼎股份	4,100	72,119.00	0.02
305	600580	卧龙电驱	3,620	71,567.40	0.02
306	300012	华测检测	6,100	71,309.00	0.02
307	000878	云南铜业	5,400	68,688.00	0.02
308	000066	中国长城	4,600	68,080.00	0.02
309	600879	航天电子	6,500	68,055.00	0.02
310	600316	洪都航空	1,800	67,860.00	0.02
311	300251	光线传媒	3,200	64,864.00	0.02
312	001389	广合科技	1,100	64,647.00	0.02
313	000429	粤高速 A	4,800	63,984.00	0.02
314	002044	美年健康	12,300	63,222.00	0.02

315	600392	盛和资源	4,800	63,216.00	0.02
316	600295	鄂尔多斯	7,200	62,712.00	0.02
317	600859	王府井	4,500	62,505.00	0.02
318	601016	节能风电	21,600	62,424.00	0.02
319	300070	碧水源	13,300	59,850.00	0.02
320	688120	华海清科	88	14,845.60	0.01
321	688072	拓荆科技	72	11,067.12	0.00
322	688525	佰维存储	63	4,246.20	0.00
323	688617	惠泰医疗	6	1,782.00	0.00

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	占基金资产净值比例 (%)
1	688128	中国电研	52,200	1,278,900.00	0.43
2	600031	三一重工	71,000	1,274,450.00	0.43
3	002616	长青集团	213,300	1,267,002.00	0.43
4	600219	南山铝业	310,700	1,189,981.00	0.40
5	002001	新 和 成	53,703	1,142,262.81	0.39
6	688111	金山办公	3,786	1,060,269.30	0.36
7	000100	TCL 科技	242,800	1,051,324.00	0.35
8	000630	铜陵有色	304,800	1,018,032.00	0.34
9	000725	京东方 A	197,600	788,424.00	0.27
10	300231	银信科技	58,700	722,597.00	0.24
11	300759	康龙化成	29,100	714,114.00	0.24
12	603025	大豪科技	50,900	713,618.00	0.24
13	600850	电科数字	29,400	711,186.00	0.24
14	002382	蓝帆医疗	123,900	693,840.00	0.23
15	600183	生益科技	22,500	678,375.00	0.23
16	002102	能特科技	211,900	669,604.00	0.23
17	600176	中国巨石	57,100	650,940.00	0.22
18	002352	顺丰控股	13,300	648,508.00	0.22
19	002588	史丹利	72,500	638,725.00	0.22
20	002745	木林森	79,000	622,520.00	0.21
21	600033	福建高速	174,700	618,438.00	0.21
22	002083	孚日股份	123,600	596,988.00	0.20
23	002011	盾安环境	51,400	596,240.00	0.20
24	600169	太原重工	245,100	593,142.00	0.20
25	600597	光明乳业	70,400	592,064.00	0.20
26	600595	中孚实业	132,100	578,598.00	0.20
27	600887	伊利股份	15,800	440,504.00	0.15
28	000895	双汇发展	17,100	417,411.00	0.14

29	688217	睿昂基因	13,900	351,670.00	0.12
30	600337	美克家居	157,700	348,517.00	0.12
31	002226	江南化工	54,700	317,260.00	0.11
32	603259	药明康德	4,300	299,065.00	0.10
33	600986	浙文互联	32,500	265,525.00	0.09
34	688508	芯朋微	4,300	240,026.00	0.08
35	002661	克明食品	23,300	233,233.00	0.08
36	002407	多氟多	17,700	215,763.00	0.07
37	300246	宝莱特	27,000	215,730.00	0.07
38	002625	光启技术	4,800	191,904.00	0.06
39	300241	瑞丰光电	33,200	189,240.00	0.06
40	600418	江淮汽车	4,600	184,414.00	0.06
41	300112	万讯自控	18,400	166,520.00	0.06
42	000757	浩物股份	36,500	165,345.00	0.06
43	600356	恒丰纸业	20,100	161,805.00	0.05
44	603968	醋化股份	14,100	160,317.00	0.05
45	688021	奥福科技	10,200	155,958.00	0.05
46	688681	科汇股份	10,932	153,048.00	0.05
47	300232	洲明科技	21,000	152,040.00	0.05
48	688685	迈信林	2,700	150,795.00	0.05
49	688329	艾隆科技	7,500	144,300.00	0.05
50	688659	元琛科技	16,442	143,538.66	0.05
51	300637	扬帆新材	11,500	138,575.00	0.05
52	688345	博力威	4,800	132,240.00	0.04
53	688307	中润光学	4,600	130,824.00	0.04
54	688512	慧智微	11,300	123,283.00	0.04
55	000538	云南白药	2,200	122,738.00	0.04
56	688328	深科达	5,324	120,588.60	0.04
57	300279	和晶科技	17,300	119,889.00	0.04
58	603808	歌力思	14,400	119,520.00	0.04
59	002030	达安基因	19,000	114,950.00	0.04
60	300500	启迪设计	8,900	108,135.00	0.04
61	301180	万祥科技	7,300	107,529.00	0.04
62	002384	东山精密	2,800	105,756.00	0.04
63	688004	博汇科技	5,200	103,480.00	0.03
64	688286	敏芯股份	1,462	103,348.78	0.03
65	300126	锐奇股份	13,700	99,462.00	0.03
66	300658	延江股份	14,600	94,462.00	0.03
67	688015	交控科技	4,300	89,612.00	0.03
68	600642	申能股份	10,400	89,440.00	0.03
69	688718	唯赛勃	7,000	86,660.00	0.03
70	688030	山石网科	5,300	84,747.00	0.03
71	002228	合兴包装	23,300	82,249.00	0.03

72	301236	软通动力	1,500	81,960.00	0.03
73	002659	凯文教育	16,200	81,648.00	0.03
74	688095	福昕软件	1,200	81,492.00	0.03
75	688667	菱电电控	1,500	79,815.00	0.03
76	002999	天禾股份	11,100	77,478.00	0.03
77	688419	耐科装备	1,992	74,261.76	0.03
78	002948	青岛银行	14,900	74,202.00	0.03
79	300335	迪森股份	13,100	71,526.00	0.02
80	688616	西力科技	5,600	71,232.00	0.02
81	301353	普莱得	2,800	70,896.00	0.02
82	302132	中航成飞	800	70,352.00	0.02
83	600351	亚宝药业	11,500	69,805.00	0.02
84	688536	思瑞浦	500	69,360.00	0.02
85	603636	南威软件	5,400	68,256.00	0.02
86	600488	津药药业	16,300	67,971.00	0.02
87	300612	宣亚国际	4,400	66,440.00	0.02
88	000553	安道麦 A	9,000	64,980.00	0.02
89	300737	科顺股份	13,400	64,588.00	0.02
90	688296	和达科技	4,900	64,337.00	0.02
91	301103	何氏眼科	2,800	62,160.00	0.02
92	301081	严牌股份	6,400	61,760.00	0.02
93	688233	神工股份	1,934	61,443.18	0.02
94	300736	百邦科技	5,800	61,422.00	0.02
95	002128	电投能源	3,100	61,318.00	0.02
96	300400	劲拓股份	3,600	60,624.00	0.02
97	688689	银河微电	2,600	59,982.00	0.02
98	300866	安克创新	500	56,800.00	0.02
99	688018	乐鑫科技	70	10,227.00	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	600739	辽宁成大	8,657,554.00	2.65
2	600998	九州通	8,335,037.00	2.55
3	601577	长沙银行	8,081,018.00	2.47
4	000783	长江证券	7,916,776.00	2.42
5	300207	欣旺达	7,710,072.00	2.36
6	002266	浙富控股	7,403,411.00	2.26
7	000728	国元证券	7,118,750.00	2.18
8	000893	亚钾国际	6,787,623.00	2.08

9	600352	浙江龙盛	6,499,613.00	1.99
10	300699	光威复材	6,420,607.95	1.96
11	002056	横店东磁	6,368,258.00	1.95
12	300136	信维通信	6,294,432.00	1.93
13	688213	思特威	6,025,837.52	1.84
14	300002	神州泰岳	6,013,000.00	1.84
15	002138	顺络电子	5,954,616.00	1.82
16	601399	国机重装	5,918,931.00	1.81
17	601992	金隅集团	5,802,207.00	1.78
18	600109	国金证券	5,780,237.00	1.77
19	600361	创新新材	5,746,770.00	1.76
20	002625	光启技术	5,658,228.00	1.73

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	601577	长沙银行	9,182,619.00	2.81
2	002558	巨人网络	9,158,626.00	2.80
3	601168	西部矿业	8,418,401.00	2.58
4	600352	浙江龙盛	7,990,353.00	2.44
5	600739	辽宁成大	7,927,932.00	2.43
6	300054	鼎龙股份	7,899,074.00	2.42
7	002019	亿帆医药	7,773,076.00	2.38
8	688213	思特威	7,527,370.43	2.30
9	002683	广东宏大	7,414,361.00	2.27
10	000728	国元证券	7,385,734.00	2.26
11	000878	云南铜业	7,373,978.00	2.26
12	000893	亚钾国际	7,340,938.00	2.25
13	601992	金隅集团	7,282,548.00	2.23
14	600141	兴发集团	7,109,981.00	2.18
15	300699	光威复材	6,921,753.00	2.12
16	002266	浙富控股	6,825,715.00	2.09
17	600968	海油发展	6,806,142.00	2.08
18	601997	贵阳银行	6,647,743.80	2.03
19	002273	水晶光电	6,625,020.00	2.03
20	600521	华海药业	6,566,195.00	2.01

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	1,263,492,635.64
卖出股票收入（成交）总额	1,308,388,105.04

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	-	-
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)	8,100.53	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,100.53	0.00

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	123257	安克转债	81	8,100.53	0.00

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现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、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	138,333.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,333.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
中信建投中证 500 增强 A	7,243	12,967.59	92,240.49	0.0982%	93,831,981.00	99.9018%
中信建投中证 500 增强 C	6,645	15,699.13	17,457,085.18	16.7341%	86,863,621.69	83.2659%
合计	13,580	14,598.30	17,549,325.67	8.8523%	180,695,602.69	91.1477%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

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	中信建投中证 500 增强 A	255,727.34	0.2723%
	中信建投中证 500 增强 C	374.08	0.0004%
	合计	256,101.42	0.1292%

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	中信建投中证 500 增强 A	10~50
	中信建投中证 500 增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投中证 500 增强 A	0
	中信建投中证 500 增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证 500 增强 A	中信建投中证 500 增强 C
基金合同生效日（2020 年 05 月 09 日）基金份额总额	109,947,302.18	162,449,314.06
本报告期期初基金份额总额	109,783,769.98	122,439,770.82

本报告期基金总申购份额	3,771,719.35	16,662,330.73
减：本报告期基金总赎回份额	19,631,267.84	34,781,394.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	93,924,221.49	104,320,706.87

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

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，未发生基金管理人及其高级管理人员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，未发生基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的 比例		总量的比例	
中信建 投证券	3	1,386,265,555.33	53.90%	264,939.59	53.90%	—
中信证 券	2	1,185,615,185.35	46.10%	226,634.41	46.10%	—

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：（1）选择证券公司参与证券交易的标准 基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

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
中信建投 证券	65,806.05	53.96%	—	—	—	—	—	—
中信证券	56,147.18	46.04%	—	—	—	—	—	—

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	关于警惕冒用中信建投基金管理有限公司名义进行诈骗活动的重要通知	规定网站	2025-01-14
2	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-01-22

3	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	规定网站	2025-01-22
4	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	规定网站、规定报刊	2025-03-20
5	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	规定网站	2025-03-20
6	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	规定网站	2025-03-20
7	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2025-03-26
8	中信建投中证 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	规定网站	2025-03-26
9	中信建投中证 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	规定网站	2025-03-26
10	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	规定网站	2025-03-31
11	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025-03-31
12	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站	2025-03-31
13	中信建投基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下权益类公募基金的公告	规定网站、规定报刊	2025-04-11
14	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-04-22
15	中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-04-22

§ 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

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日