# 中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金

# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

# § 2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中信保诚沪深 300 指数增强 |
| 基金主代码 | 020160 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 12 月 18 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 115,322,115.04 份 |
| 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。<br>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。<br>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。<br>1、股票投资策略<br>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。<br>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。<br>（1）多因子选股模型<br>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。<br>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。<br>（2）风险估测模型<br>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。<br>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。<br>（3）交易成本模型<br>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。<br>（4）投资组合优化模型<br>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。<br>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。<br>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。<br>2、债券投资策略<br>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。<br>3、证券公司短期公司债券投资策略<br>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。<br>4、资产支持证券投资策略<br>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。<br>5、可转换债券、可交换债券投资策略<br>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。<br>6、衍生品投资策略<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>7、融资、转融通证券出借业务投资策略<br>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。<br>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。<br>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。<br>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 | 沪深 300 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。<br>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。 | |
| 基金管理人 | 中信保诚基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信证券股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中信保诚沪深 300 指数增强 A | 中信保诚沪深 300 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 020160 | 020161 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,004,148.87 份 | 107,317,966.17 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日） |
|---|---|

| | 中信保诚沪深 300 指数增强 A | 中信保诚沪深 300 指数增强 C |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 52,435.32 | 588,805.98 |
| 2.本期利润 | -3,835,259.47 | -20,656,867.50 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2227 | -0.1811 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,738,508.64 | 142,361,130.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3416 | 1.3265 |

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。

## 3.2 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

中信保诚沪深 300 指数增强 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -11.63% | 1.23% | -11.88% | 1.22% | 0.25% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.23% | 1.24% | -1.92% | 1.22% | 2.15% | 0.02% |
| 过去一年 | -1.67% | 1.09% | -5.72% | 1.08% | 4.05% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.16% | 1.06% | 29.03% | 1.11% | 5.13% | -0.05% |

中信保诚沪深 300 指数增强 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -11.70% | 1.23% | -11.88% | 1.22% | 0.18% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.03% | 1.24% | -1.92% | 1.22% | 1.95% | 0.02% |
| 过去一年 | -2.07% | 1.09% | -5.72% | 1.08% | 3.65% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.65% | 1.06% | 29.03% | 1.11% | 3.62% | -0.05% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中信保诚沪深 300 指数增强 A




中信保诚沪深 300 指数增强 C




## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 姜鹏 | 基金经理 | 2023 年 12 月 18 日 | - | 12 | 姜鹏先生，经济学硕士。曾担任中交城市投资控股有限公司业务分析岗、杭州金达资产管理有限公司量化研究员。2017 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、投资经理。现任中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证 A500 指数增强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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 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，满足条件时自动执行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检查和统计分析。本报告期，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原则的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，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。报告期内，本投资组合与公司旗下管理的其它投资组合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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。本基金为指数增强型基金，股票投资方面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，通过量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求获得超越标的指数的超额收益。

市场方面，三季度 A 股市场整体呈现高位震荡、结构再平衡的格局。科技成长板块在经历二季度极致上涨后，三季度波动明显加剧，板块内部出现高低切换与精耕细作的特征；与此同时，前期大幅跑输的消费、地产链等低位板块在政策预期催化下出现阶段性估值修复，市场风格向再平衡过渡。行业层面，通信、电子等行业出现明显回调，消费内需等低估值行业重新获得资金关注。市场情绪方面，三季

度末情绪指标探底，融资余额与成交活跃度同步收缩。风格因子方面，三季度动量和成长类因子出现明显回调，前期超跌的价值、红利、估值、低波等因子出现明显反弹，超额收益大幅修复，量价类因子亦有一定的表现。整体而言，二季度 A 股出现了实质性的风格切换，近年来 A 股风格切换出现频率较高，对组合风险管理提出了一定的挑战。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争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，还积极的参与主板及科创板、创业板等新股申购，力争为基金获取收益增厚机会。同时，本基金管理人秉承尽职尽责、为投资者负责的态度，认真谨慎的应对投资者的日常申赎等工作。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚沪深 300 指数增强 A 份额净值增长率为-11.63%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；中信保诚沪深 300 指数增强 C 份额净值增长率为-11.70%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 140,186,172.13 | 91.39 |
| | 其中：股票 | 140,186,172.13 | 91.39 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 42,914.04 | 0.03 |
| | 其中：债券 | 42,914.04 | 0.03 |
| | 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 | 12,645,270.85 | 8.24 |
| 8 | 其他资产 | 510,735.99 | 0.33 |
| 9 | 合计 | 153,385,093.01 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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 | 1,120,356.00 | 0.73 |
| B | 采矿业 | 7,927,884.04 | 5.18 |
| C | 制造业 | 79,281,196.84 | 51.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,243,493.00 | 2.77 |
| E | 建筑业 | 1,840,024.00 | 1.20 |
| F | 批发和零售业 | 236,245.00 | 0.15 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,101,220.00 | 2.68 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,926,381.46 | 4.52 |
| J | 金融业 | 29,861,181.02 | 19.50 |
| K | 房地产业 | 638,133.00 | 0.42 |
| L | 租赁和商务服务业 | 728,689.00 | 0.48 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,342,760.00 | 1.53 |
| 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 | 212,268.00 | 0.14 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 91,051.00 | 0.06 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 139,550,882.36 | 91.15 |

### 5.2.2 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 | 635,289.77 | 0.41 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 635,289.77 | 0.41 |

### 5.2.3 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。

## 5.3 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

### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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 | 300308 | 中际旭创 | 6,200 | 5,012,328.00 | 3.27 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 15,080 | 4,389,938.80 | 2.87 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 3,400 | 4,279,308.00 | 2.80 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 60,900 | 3,245,361.00 | 2.12 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 73,248 | 3,022,212.48 | 1.97 |
| 6 | 300502 | 新易盛 | 7,748 | 3,013,972.00 | 1.97 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 94,100 | 2,803,239.00 | 1.83 |
| 8 | 603259 | 药明康德 | 14,000 | 2,342,760.00 | 1.53 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 27,620 | 2,212,362.00 | 1.45 |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 69,800 | 1,992,092.00 | 1.30 |

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 301666 | 大普微 | 384 | 127,157.76 | 0.08 |
| 2 | 301689 | 电科思仪 | 1,688 | 120,821.65 | 0.08 |
| 3 | 688781 | 视涯科技 | 2,421 | 89,213.85 | 0.06 |
| 4 | 688828 | 国仪公司 | 491 | 28,797.15 | 0.02 |
| 5 | 688635 | 长进光子 | 110 | 25,379.20 | 0.02 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 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） | 42,914.04 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 42,914.04 | 0.03 |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 127110 | 广核转债 | 178 | 24,302.99 | 0.02 |
| 2 | 111022 | 锡振转债 | 120 | 18,611.05 | 0.01 |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IF2612 | IF2612 | 3 | 3,869,460.00 | -300,540.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -300,540.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -156,609.28 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -406,151.65 |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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中，报告编制日前一年内，招商银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的经营状况，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 490,131.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 20,604.39 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 510,735.99 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 127110 | 广核转债 | 24,302.99 | 0.02 |
| 2 | 111022 | 锡振转债 | 18,611.05 | 0.01 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 5.11.5.1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。

### 5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 301666 | 大普微 | 127,157.76 | 0.08 | 锁定期股票 |
| 2 | 688781 | 视涯科技 | 89,213.85 | 0.06 | 锁定期股票 |
| 3 | 688828 | 国仪公司 | 28,797.15 | 0.02 | 锁定期股票 |
| 4 | 688635 | 长进光子 | 25,379.20 | 0.02 | 锁定期股票 |
| 5 | 301689 | 电科思仪 | 9,281.48 | 0.01 | 锁定期股票 |

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中信保诚沪深 300 指数增强 A | 中信保诚沪深 300 指数增强 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 25,855,670.74 | 128,881,491.11 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,165,374.98 | 8,909,699.09 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 19,016,896.85 | 30,473,224.03 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 8,004,148.87 | 107,317,966.17 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

# §9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 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 | 1 | 2026-07-01 至 2026-09-30 | 85,211,509.43 | - | 21,302,877.36 | 63,908,632.07 | 55.42% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：<br>(1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；<br>(2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；<br>(3)因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；<br>(4)基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；<br>(5)大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。 | | | | | | | |

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §10 备查文件目录

## 10.1 备查文件目录

1、中信保诚沪深 300 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、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同

4、中信保诚沪深 300 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

## 10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

## 10.3 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

2026 年 10 月 26 日