中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026年01月01日起至2026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遵规守信情况的说明 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遵规守信情况声明 11
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 11
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 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 15
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48
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 48
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 49
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 49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
7.12 投资组合报告附注 49

§8 基金份额持有人信息 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
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 51
§9 开放式基金份额变动 51
§10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
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 52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 52
10.8 其他重大事件 53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 54
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 54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 54
§12 备查文件目录 54
12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投沪深 300 指数增强	
基金主代码	015061	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 07 月 27 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	56,202,219.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投沪深 300 指数增强 A	中信建投沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015061	015062
报告期末下属分级基金的份额总额	46,076,668.27 份	10,125,551.36 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以沪深 300 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，在对标的指数成分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	沪深 300 指数收益率×95%+中证综合债指数收益率×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。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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲

	联系电话	010-56950806	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-65289868	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	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		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		金强	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	中信建投沪深 300 指数增强 A	中信建投沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	12,849,707.71	1,557,440.51
本期利润	9,132,810.75	1,029,151.74
加权平均基金份额本期利润	0.0870	0.0855
本期加权平均净值利润率	7.00%	6.97%
本期基金份额净值增长率	7.09%	6.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	13,450,428.19	2,752,959.57
期末可供分配基金份额利润	0.2919	0.2719
期末基金资产净值	59,527,096.46	12,878,510.93
期末基金份额净值	1.2919	1.2719
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	29.19%	27.19%

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、期末可供分配利润为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、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

中信建投沪深 300 指数增强 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
过去三个月	9.09%	1.18%	11.36%	1.19%	-2.27%	-0.01%
过去六个月	7.09%	1.07%	7.30%	1.07%	-0.21%	0.00%
过去一年	24.03%	0.93%	25.21%	0.97%	-1.18%	-0.04%
过去三年	32.34%	1.05%	29.00%	1.06%	3.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	29.19%	1.01%	17.60%	1.03%	11.59%	-0.02%

中信建投沪深 300 指数增强 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
过去三个月	8.99%	1.18%	11.36%	1.19%	-2.37%	-0.01%
过去六个月	6.88%	1.07%	7.30%	1.07%	-0.42%	0.00%
过去一年	23.55%	0.93%	25.21%	0.97%	-1.66%	-0.04%
过去三年	30.79%	1.05%	29.00%	1.06%	1.79%	-0.01%
自基金合同生效起至今	27.19%	1.01%	17.60%	1.03%	9.59%	-0.02%

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





§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管理、私募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 71 只。

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	2022-07-27	-	11 年	中国籍，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基金基金经理。

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、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行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金运作整体合法合规。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》、其他有关法律法规及基金合同的约定，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，不存在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

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

2026 年上半年，A 股市场整体震荡走强，但市场结构分化较为显著，科技成长方向表现突出，资金向景气度较高、产业趋势较为明确的领域集中，市场收益集中度和风格暴露有所提升。在此背景下，动量、成长及景气相关特征对个股表现的解释力有所增强，但与此同时，局部板块估值抬升、交易拥挤以及风格快速切换，也对指数增强策略的稳定性和风险控制提出了更高要求。

报告期内，本基金继续坚持指数增强投资策略，在严格控制组合相对业绩比较基准跟踪误差的基础上，运用量化模型开展主动管理。组合管理中，一方面保持与标的指数较高的相关性，控制行业、市值及风格偏离；另一方面结合市场环境变化，对盈利增长、景气趋势、盈利预期变化、估值与量价等因子进行动态配置，在风险预算允许范围内适度提升对基本面改善较为明确、产业趋势向上的成长型公司的关注。同时，基金持续加强对个股集中度、组合拥挤度及交易成本的管理，降低单一因子和单一行业暴露带来的组合风险，力争提升超额收益的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 1.2919 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.09%，同期业绩比较基准收益率为 7.30%；截至报告期末中信建投沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 1.2719 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.88%，同期业绩比较基准收益率为 7.30%。

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 A 股市场仍有望保持较为活跃的结构性特征。随着新一轮科技创新和产业升级持续推进，部分成长行业仍处于较好的产业周期之中，成长风格的中期投资机会值得继续关注。但经过前期较大幅度上涨后，市场对成长公司的定价可能逐步由估值扩张转向盈利增长和业绩兑现，个股之间的分化预计也将进一步加大。

本基金将继续坚持稳健的指数增强框架，在控制跟踪误差和组合风险暴露的基础上，适度加强对成长、景气和盈利质量等有效信号的挖掘，重点关注产业趋势与基本面能够相互验证的投资机会。同时，持续监测热门行业的估值水平、交易拥挤度和因子相关性，避免过度暴露于单一成长风格，力争在参与成长机会的同时保持组合较好的风险收益特征，实现较为稳定、可持续的指数增强效果。

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，符合相关法律及基金合同的规定。

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

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，对中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金报告期的投资运作，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，中信建投基金管理有限公司在中信建投沪深 300 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，中信建投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报告期内的财务指标、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：中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	23,204,677.08	9,795,284.04
结算备付金		740,853.00	637,147.33
存出保证金		33,948.12	48,592.42
交易性金融资产	6.4.7.2	67,914,025.39	155,235,047.66
其中：股票投资		67,914,025.39	155,235,047.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		207,633.09	71,923.82
应收股利		-	-
应收申购款		33,452.23	172,747.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		92,134,588.91	165,960,742.72
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 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		289,444.29	65,729.75
应付赎回款		19,147,368.35	190,190.79
应付管理人报酬		104,265.60	139,908.40
应付托管费		10,426.55	13,990.83
应付销售服务费		4,280.19	6,144.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	173,196.54	222,433.40
负债合计		19,728,981.52	638,398.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	56,202,219.63	137,235,381.57
未分配利润	6.4.7.8	16,203,387.76	28,086,963.06
净资产合计		72,405,607.39	165,322,344.63
负债和净资产总计		92,134,588.91	165,960,742.72

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 56,202,219.63 份，其中中信建投沪深 300 指数增强 A 类基金份额净值 1.2919 元，基金份额 46,076,668.27 份；中信建投沪深 300 指数增强 C 类基金份额净值 1.2719 元，基金份额 10,125,551.36 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

		2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		11,053,042.60	5,889,351.72
1.利息收入		36,149.81	39,398.18
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,149.81	39,398.18
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）		15,255,128.95	4,612,323.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	14,243,137.21	2,516,165.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	1,011,991.74	2,096,158.09
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	-4,245,185.73	1,199,981.61
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	6,949.57	37,647.94
减：二、营业总支出		891,080.11	1,075,725.30
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	720,893.81	821,044.74
2.托管费	6.4.10.2.2	72,089.34	82,104.46
3.销售服务费	6.4.10.2.3	29,338.64	88,256.17
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		-	-
8.其他费用	6.4.7.17	68,758.32	84,319.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,161,962.49	4,813,626.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,161,962.49	4,813,626.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,161,962.49	4,813,626.42

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	137,235,381.57	28,086,963.06	165,322,344.63
二、本期期初净资产	137,235,381.57	28,086,963.06	165,322,344.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-81,033,161.94	-11,883,575.30	-92,916,737.24
（一）、综合收益总额	-	10,161,962.49	10,161,962.49
（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）	-81,033,161.94	-22,045,537.79	-103,078,699.73
其中：1.基金申购款	4,072,949.22	932,905.71	5,005,854.93
2.基金赎回款	-85,106,111.16	-22,978,443.50	-108,084,554.66
（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	56,202,219.63	16,203,387.76	72,405,607.39
项 目	上年度可比期间 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	159,525,451.93	1,985,004.80	161,510,456.73
二、本期期初净资产	159,525,451.93	1,985,004.80	161,510,456.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,226,425.78	4,362,071.83	14,588,497.61
（一）、综合收益总额	-	4,813,626.42	4,813,626.42
（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）	10,226,425.78	-451,554.59	9,774,871.19
其中：1.基金申购款	61,806,327.05	-56,356.16	61,749,970.89
2.基金赎回款	-51,579,901.27	-395,198.43	-51,975,099.70
（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	169,751,877.71	6,347,076.63	176,098,954.34

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：

金强	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

中信建投沪深 300 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〔2021〕4138 号《关于准予中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金注册的批复》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《中信建投沪深 300 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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 279,962,374.84 元，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(2022)第 0560 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 280,010,786.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,411.36 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，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/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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 类基金份额将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《中信建投沪深 300 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(含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规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：本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%，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%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+中证综合债指数收益率×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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号-定期报告的内容与格式》、《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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 2026 年 01 月 01 日至 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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；

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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	23,204,677.08
等于：本金	23,202,034.72
加：应计利息	2,642.36
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	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	23,204,677.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		65,295,871.48	-	67,914,025.39	2,618,153.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		65,295,871.48	-	67,914,025.39	2,618,153.91

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 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	18.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	91,231.26
其中：交易所市场	91,231.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,946.47
合计	173,196.54

6.4.7.7 实收基金

中信建投沪深 300 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,468,066.65	122,468,066.65
本期申购	2,035,657.64	2,035,657.64
本期赎回（以“-”号填列）	-78,427,056.02	-78,427,056.02
本期末	46,076,668.27	46,076,668.27

中信建投沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,767,314.92	14,767,314.92
本期申购	2,037,291.58	2,037,291.58
本期赎回（以“-”号填列）	-6,679,055.14	-6,679,055.14
本期末	10,125,551.36	10,125,551.36

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.7.8 未分配利润

中信建投沪深 300 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	25,449,555.55	-168,820.41	25,280,735.14
本期期初	25,449,555.55	-168,820.41	25,280,735.14
本期利润	12,849,707.71	-3,716,896.96	9,132,810.75
本期基金份额交易产生的变动数	-22,517,169.99	1,554,052.29	-20,963,117.70
其中：基金申购款	552,360.03	-62,340.47	490,019.56
基金赎回款	-23,069,530.02	1,616,392.76	-21,453,137.26

本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,782,093.27	-2,331,665.08	13,450,428.19

中信建投沪深 300 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	2,829,059.46	-22,831.54	2,806,227.92
本期期初	2,829,059.46	-22,831.54	2,806,227.92
本期利润	1,557,440.51	-528,288.77	1,029,151.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,126,663.29	44,243.20	-1,082,420.09
其中：基金申购款	500,751.91	-57,865.76	442,886.15
基金赎回款	-1,627,415.20	102,108.96	-1,525,306.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,259,836.68	-506,877.11	2,752,959.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	35,240.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	830.89
其他	77.93
合计	36,149.81

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	447,974,002.64
减：卖出股票成本总额	433,299,422.19
减：交易费用	431,443.24
买卖股票差价收入	14,243,137.21

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——申购差价收入

无。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,011,991.74
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	1,011,991.74

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	-4,245,185.73
——股票投资	-4,245,185.73
——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	-4,245,185.73

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	6,949.57
合计	6,949.57

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,811.85
合计	68,758.32

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

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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、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
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
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、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

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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
中信建投证券股份有限公司	321,001,726.33	40.24%	32,045,002.00	3.32%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	62,888.10	40.24%	37,479.83	41.08%
关联方名称	上年度可比期间 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
中信建投证券股份有限公司	6,278.19	3.32%	4,713.20	4.85%

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	720,893.81	821,044.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	261,219.29	323,286.29
应支付基金管理人的净管理费	459,674.52	497,758.45

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 1.00%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×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	72,089.34	82,104.46

注：支付基金托管人中信银行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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投沪深 300 指数增强 A	中信建投沪深 300 指数增强 C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	8,155.32	8,155.32
中信银行股份有限公司	-	11,141.35	11,141.35
合计	-	19,296.67	19,296.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	中信建投沪深 300 指数增强 A	中信建投沪深 300 指数增强 C	合计
中信银行股份有限公司	-	17,129.75	17,129.75
中信建投证券股份有限公司	-	17,247.12	17,247.12
合计	-	34,376.87	34,376.87

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 0.40%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×0.40%/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

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	23,204,677.08	35,240.99	11,729,043.17	38,224.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，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

金额单位：人民币元

本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信建投证券股份有限公司	688818	电科蓝天	网下配售	4,966	47,028.02
上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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（2026 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
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	497	4,706.59	34,859.58	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	233	4,585.44	32,967.17	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	58	2,584.48	27,182.86	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	692	12,123.84	24,856.64	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	67	2,745.66	20,648.73	-
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	44	4,055.92	20,378.60	-
688811	有研复材	2026 年 04 月 01 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	507	3,249.87	12,233.91	-
603459	红板科技	2026 年 03	6 个月	新股流通	17.70	84.32	106	1,876.20	8,937.92	-

		月 31 日		受限						
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	108	1,496.88	7,933.68	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	69	3,860.55	3,939.90	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	73	1,150.48	3,409.83	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	170	1,900.60	2,990.30	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	61	1,334.68	1,556.72	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	34	1,287.92	1,185.58	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	29	971.21	983.97	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代	股	停牌	停	期末估	复牌	复牌开	数量	期末成本总	期末估值总	备

码	票名称	日期	牌原因	值单价	日期	盘单价	（股）	额	额	注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	832.00	2026-07-13	890.99	200	146,840.04	166,400.00	-

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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2026 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	23,204,677.08	-	-	-	23,204,677.08
结算备付金	740,853.00	-	-	-	740,853.00
存出保证金	33,948.12	-	-	-	33,948.12
交易性金融	-	-	-	67,914,025.39	67,914,025.39

资产					
应收清算款	-	-	-	207,633.09	207,633.09
应收申购款	-	-	-	33,452.23	33,452.23
资产总计	23,979,478.20	-	-	68,155,110.71	92,134,588.91
负债					
应付清算款	-	-	-	289,444.29	289,444.29
应付赎回款	-	-	-	19,147,368.35	19,147,368.35
应付管理人报酬	-	-	-	104,265.60	104,265.60
应付托管费	-	-	-	10,426.55	10,426.55
应付销售服务费	-	-	-	4,280.19	4,280.19
其他负债	-	-	-	173,196.54	173,196.54
负债总计	-	-	-	19,728,981.52	19,728,981.52
利率敏感度缺口	23,979,478.20	-	-	48,426,129.19	72,405,607.39
上年度末 2025 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	9,795,284.04	-	-	-	9,795,284.04
结算备付金	637,147.33	-	-	-	637,147.33
存出保证金	48,592.42	-	-	-	48,592.42
交易性金融资产	-	-	-	155,235,047.66	155,235,047.66
应收清算款	-	-	-	71,923.82	71,923.82
应收申购款	-	-	-	172,747.45	172,747.45
资产总计	10,481,023.79	-	-	155,479,718.93	165,960,742.72
负债					
应付清算款	-	-	-	65,729.75	65,729.75
应付赎回款	-	-	-	190,190.79	190,190.79
应付管理人报酬	-	-	-	139,908.40	139,908.40
应付托管费	-	-	-	13,990.83	13,990.83
应付销售服务费	-	-	-	6,144.92	6,144.92
其他负债	-	-	-	222,433.40	222,433.40
负债总计	-	-	-	638,398.09	638,398.09
利率敏感度缺口	10,481,023.79	-	-	154,841,320.84	165,322,344.63

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	67,914,025.39	93.80	155,235,047.66	93.90
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
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	67,914,025.39	93.80	155,235,047.66	93.90

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	3,434,294.52	7,721,327.39
	业绩比较基准下降 5%	-3,434,294.52	-7,721,327.39

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	67,543,560.00	153,861,618.76
第二层次	166,400.00	1,258,982.00
第三层次	204,065.39	114,446.90
合计	67,914,025.39	155,235,047.66

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

本财务报表已于 2026 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	67,914,025.39	73.71
	其中：股票	67,914,025.39	73.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	23,945,530.08	25.99
8	其他各项资产	275,033.44	0.30
9	合计	92,134,588.91	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	81,856.00	0.11
B	采矿业	4,147,662.00	5.73
C	制造业	37,377,017.00	51.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,810,265.00	2.50
E	建筑业	992,091.00	1.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,122,396.00	2.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,038,495.00	4.20
J	金融业	11,880,357.00	16.41
K	房地产业	738,542.00	1.02
L	租赁和商务服务业	158,489.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	398,432.00	0.55
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	62,745,602.00	86.66

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	149,943.00	0.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,154,489.39	4.36
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	209,835.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	340,254.00	0.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	559,134.00	0.77
L	租赁和商务服务业	215,465.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	106,560.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	108,575.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	214,980.00	0.30
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	109,188.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	5,168,423.39	7.14

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。

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	300308	中际旭创	3,000	3,810,000.00	5.26
2	300750	宁德时代	6,400	2,515,264.00	3.47
3	688256	寒武纪	1,100	1,755,105.00	2.42

4	603986	兆易创新	2,100	1,711,500.00	2.36
5	600519	贵州茅台	1,300	1,541,137.00	2.13
6	601899	紫金矿业	59,300	1,490,802.00	2.06
7	300502	新易盛	2,300	1,396,100.00	1.93
8	002384	东山精密	4,600	1,206,810.00	1.67
9	601318	中国平安	23,400	1,117,116.00	1.54
10	688981	中芯国际	6,600	1,048,212.00	1.45
11	688041	海光信息	2,600	962,780.00	1.33
12	002475	立讯精密	12,900	908,160.00	1.25
13	688012	中微公司	1,800	843,300.00	1.16
14	002463	沪电股份	5,400	825,120.00	1.14
15	002371	北方华创	900	796,104.00	1.10
16	600183	生益科技	4,100	710,940.00	0.98
17	600036	招商银行	19,900	706,450.00	0.98
18	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.91
19	000333	美的集团	8,600	649,558.00	0.90
20	000725	京东方 A	69,700	604,996.00	0.84
21	300274	阳光电源	3,800	604,276.00	0.83
22	600030	中信证券	20,400	586,092.00	0.81
23	601398	工商银行	82,500	583,275.00	0.81
24	300408	三环集团	3,300	550,770.00	0.76
25	600900	长江电力	20,500	542,635.00	0.75
26	600150	中国船舶	15,800	533,882.00	0.74
27	601211	国泰海通	28,900	525,980.00	0.73
28	600522	中天科技	8,300	503,644.00	0.70
29	688008	澜起科技	1,600	495,840.00	0.68
30	300014	亿纬锂能	7,100	461,713.00	0.64
31	600919	江苏银行	42,000	452,760.00	0.63
32	601166	兴业银行	26,500	438,840.00	0.61
33	300059	东方财富	21,500	438,170.00	0.61
34	601138	工业富联	6,000	432,900.00	0.60
35	601328	交通银行	66,600	428,238.00	0.59
36	600887	伊利股份	16,800	402,528.00	0.56
37	603259	药明康德	3,200	398,432.00	0.55
38	600309	万华化学	5,700	389,937.00	0.54
39	603993	洛阳钼业	22,200	389,610.00	0.54
40	000988	华工科技	2,100	387,681.00	0.54
41	000338	潍柴动力	14,100	384,225.00	0.53
42	002415	海康威视	11,200	383,040.00	0.53
43	000063	中兴通讯	10,100	365,519.00	0.50
44	600176	中国巨石	4,800	349,824.00	0.48
45	000858	五 粮 液	4,700	347,800.00	0.48
46	000792	盐湖股份	11,500	347,185.00	0.48

47	601816	京沪高铁	75,900	343,827.00	0.47
48	601688	华泰证券	16,600	342,292.00	0.47
49	600000	浦发银行	39,000	335,790.00	0.46
50	300394	天孚通信	1,100	332,948.00	0.46
51	601088	中国神华	8,500	331,840.00	0.46
52	601857	中国石油	38,000	329,840.00	0.46
53	002594	比亚迪	4,100	326,770.00	0.45
54	600489	中金黄金	18,100	326,705.00	0.45
55	601288	农业银行	53,300	323,531.00	0.45
56	600031	三一重工	18,300	316,224.00	0.44
57	600276	恒瑞医药	5,800	301,832.00	0.42
58	002600	领益智造	17,300	299,982.00	0.41
59	601601	中国太保	10,400	296,608.00	0.41
60	600999	招商证券	14,000	295,400.00	0.41
61	000001	平安银行	28,700	288,435.00	0.40
62	601229	上海银行	32,100	278,628.00	0.38
63	601658	邮储银行	55,500	273,615.00	0.38
64	601668	中国建筑	63,000	273,420.00	0.38
65	601728	中国电信	52,100	270,399.00	0.37
66	600547	山东黄金	11,500	265,535.00	0.37
67	601988	中国银行	46,400	265,408.00	0.37
68	601169	北京银行	53,700	263,130.00	0.36
69	601006	大秦铁路	56,800	261,848.00	0.36
70	601225	陕西煤业	12,800	260,480.00	0.36
71	600926	杭州银行	18,000	260,100.00	0.36
72	601919	中远海控	19,600	259,896.00	0.36
73	600690	海尔智家	12,700	259,207.00	0.36
74	600111	北方稀土	5,300	254,665.00	0.35
75	601985	中国核电	28,100	253,743.00	0.35
76	601939	建设银行	25,700	247,491.00	0.34
77	002241	歌尔股份	10,900	245,577.00	0.34
78	600048	保利发展	52,300	242,149.00	0.33
79	002493	荣盛石化	21,400	230,050.00	0.32
80	600050	中国联通	56,800	227,200.00	0.31
81	601009	南京银行	22,400	221,536.00	0.31
82	000651	格力电器	5,900	221,250.00	0.31
83	000100	TCL 科技	38,000	221,160.00	0.31
84	601995	中金公司	6,100	220,515.00	0.30
85	600346	恒力石化	12,400	219,604.00	0.30
86	601766	中国中车	41,700	216,840.00	0.30
87	600188	兖矿能源	12,200	216,794.00	0.30
88	600115	中国东航	56,900	216,789.00	0.30
89	600089	特变电工	9,400	211,500.00	0.29

90	301308	江波龙	300	211,140.00	0.29
91	000657	中钨高新	2,200	210,584.00	0.29
92	600989	宝丰能源	10,300	209,399.00	0.29
93	002460	赣锋锂业	3,200	209,280.00	0.29
94	000157	中联重科	29,500	205,615.00	0.28
95	601336	新华保险	3,400	202,844.00	0.28
96	600019	宝钢股份	36,700	199,281.00	0.28
97	601111	中国国航	32,700	197,835.00	0.27
98	601825	沪农商行	26,200	196,238.00	0.27
99	600549	厦门钨业	2,300	195,960.00	0.27
100	600372	中航机载	18,000	195,300.00	0.27
101	601058	赛轮轮胎	16,700	192,551.00	0.27
102	600029	南方航空	37,100	192,178.00	0.27
103	601669	中国电建	40,800	191,760.00	0.26
104	601390	中国中铁	45,800	190,986.00	0.26
105	601838	成都银行	10,700	189,390.00	0.26
106	601377	兴业证券	31,200	188,448.00	0.26
107	001979	招商蛇口	29,300	188,399.00	0.26
108	603799	华友钴业	3,900	188,214.00	0.26
109	600795	国电电力	39,700	185,399.00	0.26
110	000166	申万宏源	42,100	185,240.00	0.26
111	600011	华能国际	24,000	182,160.00	0.25
112	600015	华夏银行	28,100	179,559.00	0.25
113	600584	长电科技	1,700	176,035.00	0.24
114	600886	国投电力	13,200	175,692.00	0.24
115	002709	天赐材料	3,400	174,862.00	0.24
116	601901	方正证券	24,100	173,520.00	0.24
117	601618	中国中冶	70,500	172,020.00	0.24
118	601360	三六零	19,400	168,586.00	0.23
119	601881	中国银河	13,300	167,181.00	0.23
120	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.23
121	300124	汇川技术	2,500	165,825.00	0.23
122	601877	正泰电器	6,600	165,462.00	0.23
123	601788	光大证券	11,400	164,502.00	0.23
124	601456	国联民生	18,600	164,424.00	0.23
125	600219	南山铝业	41,200	164,388.00	0.23
126	601117	中国化学	22,300	163,905.00	0.23
127	003816	中国广核	41,700	163,047.00	0.23
128	600515	海南机场	58,500	160,290.00	0.22
129	002466	天齐锂业	2,600	159,432.00	0.22
130	600025	华能水电	17,500	155,575.00	0.21
131	688223	晶科能源	32,100	152,475.00	0.21
132	601600	中国铝业	18,500	152,070.00	0.21

133	600023	浙能电力	28,900	152,014.00	0.21
134	600588	用友网络	16,300	149,634.00	0.21
135	601319	中国人保	22,100	149,396.00	0.21
136	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.21
137	000002	万　科A	49,900	147,704.00	0.20
138	601898	中煤能源	12,100	147,378.00	0.20
139	600918	中泰证券	27,700	147,364.00	0.20
140	000975	山金国际	8,600	146,200.00	0.20
141	600061	国投资本	21,700	142,135.00	0.20
142	603019	中科曙光	1,300	139,399.00	0.19
143	600018	上港集团	29,300	138,296.00	0.19
144	002916	深南电路	300	137,370.00	0.19
145	001965	招商公路	14,800	135,568.00	0.19
146	002236	大华股份	8,200	135,218.00	0.19
147	000708	中信特钢	10,300	129,986.00	0.18
148	601018	宁波港	41,000	129,150.00	0.18
149	600028	中国石化	28,800	128,448.00	0.18
150	688009	中国通号	26,900	128,044.00	0.18
151	002028	思源电气	700	121,100.00	0.17
152	002142	宁波银行	3,900	115,791.00	0.16
153	600938	中国海油	4,200	114,030.00	0.16
154	300433	蓝思科技	2,000	107,320.00	0.15
155	600160	巨化股份	2,000	106,020.00	0.15
156	601077	渝农商行	16,900	103,259.00	0.14
157	002625	光启技术	3,300	100,056.00	0.14
158	000408	藏格矿业	1,400	97,048.00	0.13
159	000938	紫光股份	3,300	95,238.00	0.13
160	000776	广发证券	4,000	93,600.00	0.13
161	000630	铜陵有色	14,700	93,492.00	0.13
162	000807	云铝股份	4,200	92,988.00	0.13
163	002353	杰瑞股份	600	91,500.00	0.13
164	002050	三花智控	2,000	87,660.00	0.12
165	002202	金风科技	3,400	81,260.00	0.11
166	601872	招商轮船	4,600	80,822.00	0.11
167	601888	中国中免	1,500	80,565.00	0.11
168	002049	紫光国微	900	79,875.00	0.11
169	002027	分众传媒	16,100	77,924.00	0.11
170	605117	德业股份	700	74,326.00	0.10
171	600460	士兰微	1,300	71,058.00	0.10
172	300760	迈瑞医疗	500	67,915.00	0.09
173	600016	民生银行	20,900	67,298.00	0.09
174	600362	江西铜业	1,500	64,950.00	0.09
175	601100	恒立液压	600	64,536.00	0.09

176	688111	金山办公	300	63,915.00	0.09
177	002230	科大讯飞	1,500	61,260.00	0.08
178	002532	天山铝业	5,700	61,161.00	0.08
179	600406	国电南瑞	2,600	59,410.00	0.08
180	688396	华润微	600	58,530.00	0.08
181	600426	华鲁恒升	2,400	57,408.00	0.08
182	002714	牧原股份	1,600	55,984.00	0.08
183	002648	卫星化学	2,300	54,027.00	0.07
184	600482	中国动力	1,600	52,480.00	0.07
185	603296	华勤技术	700	51,989.00	0.07
186	600941	中国移动	600	51,678.00	0.07
187	601012	隆基绿能	3,900	51,168.00	0.07
188	601727	上海电气	7,300	51,100.00	0.07
189	002558	巨人网络	1,800	49,608.00	0.07
190	002179	中航光电	1,000	46,200.00	0.06
191	002352	顺丰控股	1,400	43,764.00	0.06
192	000301	东方盛虹	3,700	42,365.00	0.06
193	002938	鹏鼎控股	400	42,152.00	0.06
194	688036	传音控股	700	41,265.00	0.06
195	600026	中远海能	2,200	39,468.00	0.05
196	600233	圆通速递	2,500	39,375.00	0.05
197	603501	豪威集团	400	37,940.00	0.05
198	600875	东方电气	1,300	37,401.00	0.05
199	300803	指南针	400	36,668.00	0.05
200	000425	徐工机械	4,400	35,596.00	0.05
201	600660	福耀玻璃	700	35,308.00	0.05
202	688472	阿特斯	2,800	30,296.00	0.04
203	603260	合盛硅业	600	28,956.00	0.04
204	000977	浪潮信息	400	28,000.00	0.04
205	002304	洋河股份	700	26,705.00	0.04
206	300498	温氏股份	2,100	25,872.00	0.04
207	300033	同花顺	100	24,100.00	0.03
208	002837	英维克	300	23,868.00	0.03
209	601021	春秋航空	500	22,790.00	0.03
210	600009	上海机场	900	20,790.00	0.03
211	601633	长城汽车	1,300	19,617.00	0.03
212	600845	宝信软件	1,000	16,630.00	0.02
213	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.02
214	300999	金龙鱼	700	16,282.00	0.02

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	688498	源杰科技	100	188,600.00	0.26
2	600540	新赛股份	45,300	149,943.00	0.21
3	688620	安凯微	7,800	126,360.00	0.17
4	688173	希荻微	6,500	124,410.00	0.17
5	600641	先导基电	3,000	119,580.00	0.17
6	300838	浙江力诺	8,700	116,145.00	0.16
7	300884	狄耐克	11,600	115,072.00	0.16
8	002693	双成药业	12,100	114,466.00	0.16
9	300351	永贵电器	6,900	113,850.00	0.16
10	601609	金田股份	10,500	113,400.00	0.16
11	600773	西藏城投	8,800	113,256.00	0.16
12	001373	翔腾新材	3,700	111,555.00	0.15
13	002848	高斯贝尔	8,000	111,360.00	0.15
14	001311	多利科技	6,900	111,297.00	0.15
15	002652	扬子新材	26,100	111,186.00	0.15
16	600325	华发股份	47,800	110,418.00	0.15
17	600743	华远控股	51,100	110,376.00	0.15
18	300225	金力泰	13,900	110,366.00	0.15
19	300561	汇金科技	7,800	110,136.00	0.15
20	300492	华图山鼎	3,200	109,920.00	0.15
21	300818	耐普矿机	5,800	109,620.00	0.15
22	301359	东南电子	6,900	109,572.00	0.15
23	603936	博敏电子	4,100	109,511.00	0.15
24	300805	电声股份	15,100	109,475.00	0.15
25	600166	福田汽车	37,600	109,416.00	0.15
26	600158	中体产业	16,200	109,188.00	0.15
27	300774	倍杰特	10,100	108,575.00	0.15
28	300883	龙利得	17,200	108,532.00	0.15
29	605077	华康股份	10,000	108,100.00	0.15
30	688196	卓越新能	3,000	107,700.00	0.15
31	300093	金刚光伏	4,100	107,502.00	0.15
32	603813	原尚股份	3,100	107,260.00	0.15
33	002529	海源复材	15,700	107,074.00	0.15
34	600961	株冶集团	3,300	106,887.00	0.15
35	600497	驰宏锌锗	8,800	106,568.00	0.15
36	000504	南华生物	14,800	106,560.00	0.15
37	301169	零点有数	1,500	105,990.00	0.15
38	300159	新研股份	31,700	105,878.00	0.15
39	688051	佳华科技	4,600	105,708.00	0.15
40	002076	星光股份	48,400	105,512.00	0.15
41	000668	荣丰控股	4,800	105,504.00	0.15

42	003032	传智教育	20,400	105,060.00	0.15
43	603261	立航科技	2,100	104,895.00	0.14
44	601975	招商南油	27,500	102,575.00	0.14
45	688818	电科蓝天	497	34,859.58	0.05
46	688820	盛合晶微	233	32,967.17	0.05
47	688797	臻宝科技	58	27,182.86	0.04
48	688712	北芯生命	692	24,856.64	0.03
49	688635	长进光子	67	20,648.73	0.03
50	688785	恒运昌	44	20,378.60	0.03
51	688811	有研复材	507	12,233.91	0.02
52	603459	红板科技	106	8,937.92	0.01
53	603407	长裕集团	108	7,933.68	0.01
54	688816	易思维	69	3,939.90	0.01
55	603435	嘉德利	73	3,409.83	0.00
56	601112	振石股份	170	2,990.30	0.00
57	603352	至信股份	61	1,556.72	0.00
58	603284	林平发展	34	1,185.58	0.00
59	603293	埃泰克	29	983.97	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	300308	中际旭创	7,901,727.00	4.78
2	300750	宁德时代	6,351,731.00	3.84
3	601899	紫金矿业	4,235,171.00	2.56
4	603986	兆易创新	4,213,442.00	2.55
5	600519	贵州茅台	3,703,037.00	2.24
6	688256	寒武纪	3,667,830.02	2.22
7	002384	东山精密	3,613,785.00	2.19
8	300476	胜宏科技	3,462,075.00	2.09
9	601318	中国平安	3,213,486.00	1.94
10	688008	澜起科技	3,193,763.00	1.93
11	688041	海光信息	3,129,475.98	1.89
12	300274	阳光电源	3,106,569.00	1.88
13	688012	中微公司	2,926,886.17	1.77
14	002475	立讯精密	2,714,427.00	1.64
15	688981	中芯国际	2,581,696.23	1.56
16	000333	美的集团	2,393,784.00	1.45
17	603993	洛阳钼业	2,204,595.00	1.33
18	002463	沪电股份	2,044,831.00	1.24

19	600150	中国船舶	2,034,973.98	1.23
20	600036	招商银行	2,031,538.00	1.23

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	300308	中际旭创	11,245,546.00	6.80
2	300750	宁德时代	10,638,762.00	6.44
3	600519	贵州茅台	6,941,811.90	4.20
4	601899	紫金矿业	5,404,962.00	3.27
5	601318	中国平安	5,374,315.00	3.25
6	688256	寒武纪	5,256,142.82	3.18
7	603986	兆易创新	5,034,173.00	3.05
8	000333	美的集团	4,285,041.00	2.59
9	002384	东山精密	4,247,083.00	2.57
10	688041	海光信息	4,226,090.53	2.56
11	688008	澜起科技	3,910,913.82	2.37
12	002475	立讯精密	3,803,020.40	2.30
13	688012	中微公司	3,648,065.70	2.21
14	300274	阳光电源	3,500,073.00	2.12
15	601166	兴业银行	3,408,072.00	2.06
16	601138	工业富联	3,341,107.00	2.02
17	300476	胜宏科技	3,155,829.00	1.91
18	600036	招商银行	2,950,709.00	1.78
19	000338	潍柴动力	2,791,936.00	1.69
20	688981	中芯国际	2,791,124.27	1.69

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	350,223,585.65
卖出股票收入（成交）总额	447,974,002.64

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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。

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。

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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

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

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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

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约定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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	33,948.12

2	应收清算款	207,633.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,452.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	275,033.44

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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。

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。

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
中信建投沪深 300 指数增强 A	1,564	29,460.79	24,591,129.31	53.3700%	21,485,538.96	46.6300%
中信建投沪深 300 指数增强 C	898	11,275.67	1,000.14	0.0099%	10,124,551.22	99.9901%
合计	2,439	23,043.14	24,592,129.45	43.7565%	31,610,090.18	56.2435%

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	中信建投沪深 300 指数增强 A	285.40	0.0006%
	中信建投沪深 300 指数增强 C	0.00	0.0000%
	合计	285.40	0.0005%

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	中信建投沪深 300 指数增强 A	0
	中信建投沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投沪深 300 指数增强 A	0
	中信建投沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投沪深 300 指数增强 A	中信建投沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 07 月 27 日）基金份额总额	157,739,925.63	122,270,860.57
本报告期期初基金份额总额	122,468,066.65	14,767,314.92
本报告期基金总申购份额	2,035,657.64	2,037,291.58
减：本报告期基金总赎回份额	78,427,056.02	6,679,055.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,076,668.27	10,125,551.36

§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

2026 年 4 月 23 日，金强先生不再担任基金管理人总经理、副董事长，转任基金管理人董事长（法定代表人），黄凌先生不再担任基金管理人董事长（法定代表人）。自 2026 年 4 月 23 日起，金强先生代为履行基金管理人总经理职务。

2026 年 6 月，经基金托管人中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金托管业务无影响。

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

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			比例			
中信建投证券股份有限公司	2	321,001,726.33	40.24%	62,888.10	40.24%	-
天风证券股份有限公司	1	303,068,728.66	37.99%	59,376.10	37.99%	-
国泰海通证券股份有限公司	1	99,574,287.94	12.48%	19,508.25	12.48%	-
华泰证券股份有限公司	1	74,156,911.69	9.30%	14,528.24	9.30%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金租用的交易单元未发生变更。

2、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。

10.8 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	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-01-22
2	中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2026-02-04
4	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金	规定报刊	2026-03-31

	2025 年年度报告提示性公告		
5	中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026-03-31
6	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公告（2025 年度）	规定网站	2026-03-31
7	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-04-22
8	中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026-04-22
9	中信建投基金管理有限公司董事长（法定代表人）、高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026-04-25

§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	1	20260101-20260630	93,047,558.05	0.00	69,000,000.00	24,047,558.05	42.7876%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

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、《中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《中信建投沪深 300 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

基金管理人及基金托管人住所。

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

二〇二六年八月三十一日