

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 08 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2022 年 08 月 26 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6	半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	16
6.3	净资产 (基金净值) 变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	45
7.1	期末基金资产组合情况	45
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	62
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	62
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	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62

7.12	投资组合报告附注 .....	62
§ 8	基金份额持有人信息 .....	63
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	64
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
8.4	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 .....	64
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	65
§ 9	开放式基金份额变动 .....	65
§ 10	重大事件揭示 .....	65
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
10.4	基金投资策略的改变 .....	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	66
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
10.8	其他重大事件 .....	70
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
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 .....	70
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
§ 12	备查文件目录 .....	70
12.1	备查文件目录 .....	70
12.2	存放地点 .....	71
12.3	查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	中信保诚中证 500 指数 (LOF)	
场内简称	信诚 500LOF	
基金主代码	165511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	147,951,926.32 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021 年 02 月 03 日	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	信诚 500LOF	-
下属分级基金的交易代码	165511	013119
报告期末下属分级基金的份额总额	142,470,869.71 份	5,481,056.61 份

注：自 2021 年 8 月 23 日起，本基金场内简称扩位为“信诚 500LOF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 500 指数的有效跟踪,为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。
投资策略	<p>本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股(含存托凭证)及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:</p> <p>(1) 基本面替代:按照与被替代股票所属行业,基本面及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库;</p>

	<p>(2)相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，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将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，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>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、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	021-60637111
传真	021-50120895	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	涂一锴	田国立

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	-9,598,657.46	-421,828.47
本期利润	-25,697,246.54	-4,148,989.32
加权平均基金份额本期利润	-0.1876	-0.4085
本期加权平均净值利润率	-11.48%	-24.31%
本期基金份额净值增长率	-10.86%	-11.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022 年 06 月 30 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
期末可供分配利润	115,938,401.69	4,425,212.55
期末可供分配基金份额利润	0.8138	0.8074
期末基金资产净值	238,191,122.44	9,128,319.21
期末基金份额净值	1.6719	1.6654
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 年 06 月 30 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	12.21%	-7.39%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.23%	1.04%	6.74%	1.05%	0.49%	-0.01%
过去三个月	3.19%	1.64%	1.99%	1.66%	1.20%	-0.02%

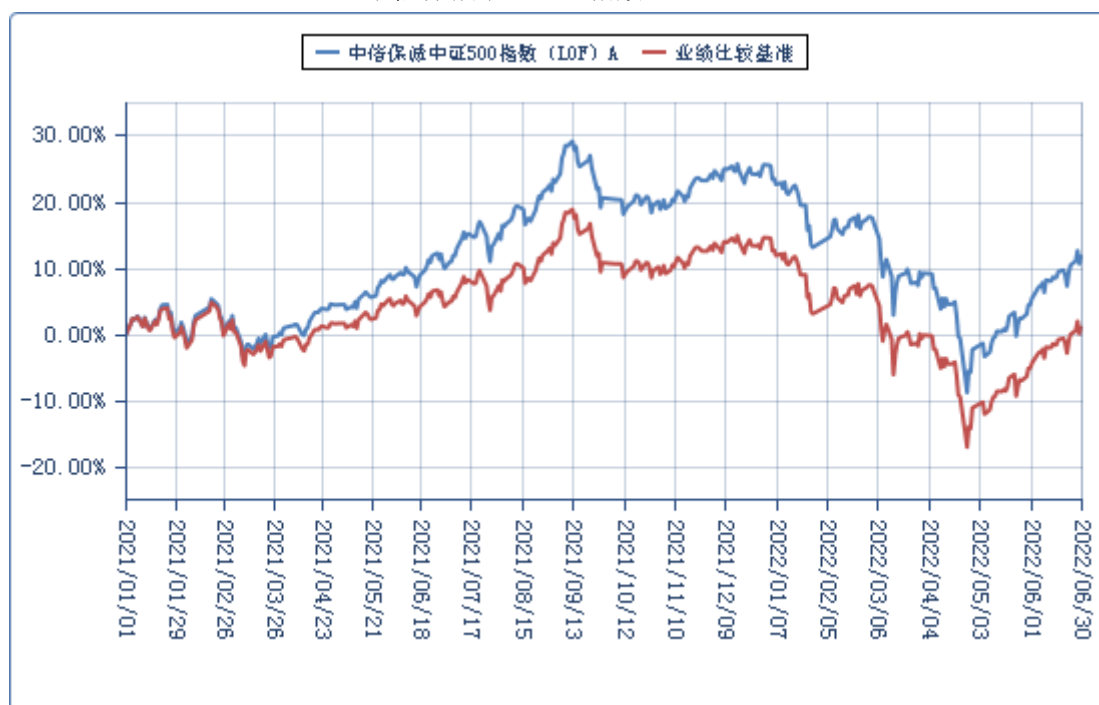
过去六个月	-10.86%	1.53%	-11.65%	1.55%	0.79%	-0.02%
过去一年	-0.13%	1.25%	-4.83%	1.26%	4.70%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.21%	1.15%	1.46%	1.16%	10.75%	-0.01%

中信保诚中证 500 指数 (LOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.18%	1.04%	6.74%	1.05%	0.44%	-0.01%
过去三个月	3.08%	1.64%	1.99%	1.66%	1.09%	-0.02%
过去六个月	-11.11%	1.53%	-11.65%	1.55%	0.54%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-7.39%	1.29%	-9.21%	1.31%	1.82%	-0.02%

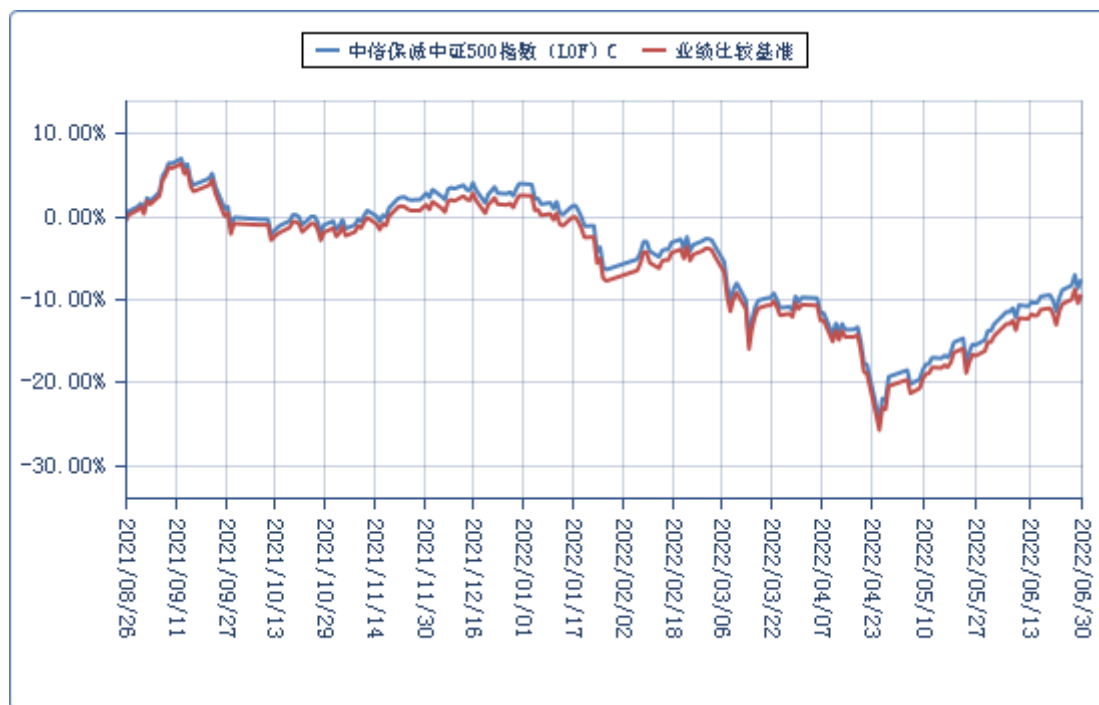
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A



中信保诚中证 500 指数 (LOF) C





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 79 只，分别为：信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金 (LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金 (LOF)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF)、信诚周期轮

动混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金 (LOF)、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金 (LOF)、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金。

#### 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		
黄稚	基金经理	2018 年 07 月 25 日	-	10	黄稚女士, 理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司, 担任资产管理部产品经理; 于平安证券有限责任公司, 担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司, 历任金融工程师、基金经理助理。现任中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚中证建设工程指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金 (LOF) 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》中关于证券投资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合规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规,

没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司拟定的《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》，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，确保所有投资经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会：对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，事后根据《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资经理出具情况说明后签字确认。报告期内，未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每周对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年上半年，海外高通胀持续发酵、流动性收紧趋势加快。国内方面，上半年国内经济面临压力，受疫情影响 2 季度经济走弱，国内流动性环境总体维持宽松。

报告期内，A 股市场先跌后涨，市场持续调整至 4 月下旬低点后逐步企稳反弹。上证指数跌幅 6.63%，沪深 300 跌幅 9.22%，中证 500 跌幅 12.30%，创业板指跌幅 15.41%。其中，煤炭行业收益

居前，而电子、计算机、传媒、国防军工等行业表现较差。

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数。报告期内，本基金在严格控制指数跟踪偏离的基础上，采用数量化方法构建指数化投资组合，实现对标的指数的有效跟踪。本基金认真应对投资者日常申购、赎回，根据市场情况、成分股停复牌等合理安排权益仓位和头寸，有效管理跟踪误差。本基金运用股指期货进行多头套保以提高投资效率，同时通过参与网下新股申购以提高基金收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚中证 500 指数 (LOF) A 份额净值增长率为-10.86%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%；中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 份额净值增长率为-11.11%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

#### 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 2022 年下半年，国内外宏观经济形势对比可能会发生变化。海外方面，流动性持续收紧，对经济压力有所增加，市场对于美国经济衰退的担忧抬升。国内方面，随着疫情后消费恢复和输入性通胀影响减弱，国内经济内外部压力有所缓解。今年新增专项债在 6 月底前基本发行完毕，下半年转化为实物工作量有望对宏观经济形成支撑。

总体来看，目前 A 股市场估值水平处于合理区间，但行业之间的估值分化有所加大。预计下半年国内权益市场面临的流动性环境仍相对比较友好，市场风险偏好仍处于修复过程中。下半年 A 股有望保持韧性，市场或以结构性机会为主，可关注估值调整合理并且有望持续兑现基本面的行业。长期来看，中国经济发展模式从高增长转变为高质量发展，居民资产配置也或将从以房地产为主逐步转向资本市场，A 股具备长期配置价值和投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设置了估值决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

在每个估值日, 本基金管理人使用估值政策确定的估值方法, 确定证券投资基金的份额净值, 托管人复核无误后, 由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 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基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期, 本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内, 本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		16,804,714.83	19,401,152.00
结算备付金		2,180,904.77	1,992,545.68
存出保证金		647,476.14	715,177.60
交易性金融资产		229,206,910.04	258,256,075.29
其中：股票投资		229,190,006.85	258,235,075.29
基金投资		-	-
债券投资		16,903.19	21,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		-	71,116.17
应收股利		-	-
应收申购款		1,215,373.50	1,126,512.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	2,272.15
资产总计		250,055,379.28	281,564,850.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		816,283.39	6.05
应付赎回款		1,241,172.65	2,392,712.33
应付管理人报酬		196,498.89	224,382.16
应付托管费		43,229.75	49,364.07
应付销售服务费		3,228.60	9,732.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	14,735.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		435,524.35	493,005.98
负债合计		2,735,937.63	3,183,938.32
<b>净资产：</b>			

实收基金		114,917,488.52	115,300,499.68
未分配利润		132,401,953.13	163,080,412.89
净资产合计		247,319,441.65	278,380,912.57
负债和净资产总计		250,055,379.28	281,564,850.89

注：截止本报告期末，基金份额总额 147,951,926.32 份。下属分级基金：中信保诚中证 500 指数 (LOF) A 的基金份额净值 1.6719 元，基金份额总额 142,470,869.71 份；中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 的基金份额净值 1.6654 元，基金份额总额 5,481,056.61 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-28,148,876.44	23,836,464.31
1. 利息收入		37,343.62	27,664.92
其中：存款利息收入		37,343.62	27,638.58
债券利息收入		-	26.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,451,257.96	27,853,278.19
其中：股票投资收益		-10,748,453.90	26,012,751.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益		29,376.15	21,507.89
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-206,815.40	280,970.87
股利收益		2,474,635.19	1,538,048.01
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-19,825,749.93	-4,176,334.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		90,787.83	131,855.95
<b>减：二、营业总支出</b>		1,697,359.42	1,706,232.20
1. 管理人报酬		1,195,288.00	857,689.58
2. 托管费		262,963.35	188,691.60
3. 销售服务费		34,668.95	-
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		-	-
7. 税金及附加		0.09	1,011.52
8. 其他费用		204,439.03	658,839.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-29,846,235.86	22,130,232.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-29,846,235.86	22,130,232.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-29,846,235.86	22,130,232.11

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	115,300,499.68	-	163,080,412.89	278,380,912.57
二、本期期初净资产（基金净值）	115,300,499.68	-	163,080,412.89	278,380,912.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-383,011.16	-	-30,678,459.76	-31,061,470.92
（一）、综合收益总额	-	-	-29,846,235.86	-29,846,235.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-383,011.16	-	-832,223.90	-1,215,235.06
其中：1. 基金申购款	96,509,414.85	-	112,500,330.22	209,009,745.07
2. 基金赎回款	-96,892,426.01	-	-113,332,554.12	-210,224,980.13
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	114,917,488.52	-	132,401,953.13	247,319,441.65
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	103,568,999.92	-	95,095,997.31	198,664,997.23
二、本期期初净资产（基金	103,568,999.92	-	95,095,997.31	198,664,997.23

净值)				
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	3,010,449.54	-	28,045,570.28	31,056,019.82
(一)、综合收益总额	-	-	22,130,232.11	22,130,232.11
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	3,010,449.54	-	5,915,338.17	8,925,787.71
其中: 1. 基金申购款	52,402,389.45	-	54,479,434.72	106,881,824.17
2. 基金赎回款	-49,391,939.91	-	-48,564,096.55	-97,956,036.46
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	106,579,449.46	-	123,141,567.59	229,721,017.05

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:

张翔燕

陈逸辛

刘卓

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (原“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 《关于核准信诚中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》 (证监许可[2010]1877 号文) 批准, 由中信保诚基金管理有限公司 (原“信诚基金管理有限公司”) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2011 年 2 月 11 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集资金总额人民币 374,254,300.10 元。上述募集资金已由会计师事务所验证, 并出具了验资报告。根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》和《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金名称变更的公告》, 本基金于 2020 年 12 月 31 日终止分级运作, 《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效。基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日, 对在该日登记在册的信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额办理向场内信诚中证 500 份额折算。于 2021 年 1 月 1 日, 《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效, 基金名称由“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)”, 取消分级机制, 基金规模为 133,346,991.28 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司, 基金托管

人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人中信保诚基金管理有限公司 2021 年 08 月 26 日《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，自 2021 年 08 月 26 日起本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同，将本基金的基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，不计提销售服务费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费用。在本基金的基金份额分类实施后，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止

期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产;及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则,嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来,而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险,因此在新金融工具准则下,本基金信用损失的确

认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款、应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 19,401,152.00 元、1,992,545.68 元、715,177.60 元、71,116.17 元、2,272.15 元和 1,126,512.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 19,403,001.38 元、1,992,953.01 元、715,190.60 元、71,116.17 元和 1,126,512.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 258,256,075.29 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 258,256,077.73 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，对应的账面

价值分别为人民币 6.05 元、2,392,712.33 元、224,382.16 元、49,364.07 元、9,732.00 元、128,045.71 元和 364,960.27 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 6.05 元、2,392,712.33 元、224,382.16 元、49,364.07 元、9,732.00 元和 493,005.98 元。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则,将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示,无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时,调整了部分财务报表科目的列报和披露,未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税

务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值

税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。



本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	16,804,714.83
等于：本金	16,803,275.74
加：应计利息	1,439.09
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	16,804,714.83

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	232,210,540.16	-	229,190,006.85	-3,020,533.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	16,900.00	3.19	16,903.19
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,900.00	3.19	16,903.19
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	232,227,440.16	3.19	229,206,910.04	-3,020,533.31

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,575,040.00	-	-	-
IC2212	3,575,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,575,040.00	-	-	-

### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2212	IC2212	3.00	3,756,120.00	181,080.00
合计				181,080.00
减：可抵销期货暂收款				181,080.00
净额				0.00

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

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	2,563.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	128,772.03
其中：交易所市场	128,772.03
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	44,630.98
应付信息披露费	159,507.37
应付指数使用费	100,050.00
合计	435,524.35

#### 6.4.7.7 实收基金

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	127,597,582.52	99,107,889.59
本期申购	57,352,709.32	44,546,957.59
本期赎回 (以“-”号填列)	-42,479,422.13	-32,994,598.83
本期末	142,470,869.71	110,660,248.35

中信保诚中证 500 指数 (LOF) C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	20,847,775.31	16,192,610.09
本期申购	66,900,380.06	51,962,457.26
本期赎回 (以“-”号填列)	-82,267,098.76	-63,897,827.18
本期末	5,481,056.61	4,257,240.17

注：1、申购含红利再投 (如有)、转换入份额 (如有)，赎回含转换出份额 (如有)。

2、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

基金代码	基金名称	本报告期末		上年度末	
		场内	场外	场内	场外
165811	中信保诚中证500指数 (LOF) A	16,556,585.00	125,914,284.71	17,229,573.00	110,368,009.52
013119	中信保诚中证500指数 (LOF) C	-	5,481,056.61	-	20,847,775.31

#### 6.4.7.8 未分配利润

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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	112,621,141.71	27,593,978.88	140,215,120.59
本期利润	-9,598,657.46	-16,098,589.08	-25,697,246.54
本期基金份额交易产生的变动数	12,915,917.44	97,082.60	13,013,000.04
其中：基金申购款	49,374,047.98	-77,667.64	49,296,380.34
基金赎回款	-36,458,130.54	174,750.24	-36,283,380.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,938,401.69	11,592,472.40	127,530,874.09

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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	18,356,265.94	4,509,026.36	22,865,292.30
本期利润	-421,828.47	-3,727,160.85	-4,148,989.32
本期基金份额交易产生的变动数	-13,509,224.92	-335,999.02	-13,845,223.94
其中：基金申购款	58,240,017.53	4,963,932.35	63,203,949.88
基金赎回款	-71,749,242.45	-5,299,931.37	-77,049,173.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,425,212.55	445,866.49	4,871,079.04

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	30,086.47
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	6,894.15
其他	363.00
合计	37,343.62

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	185,147,724.36
减：卖出股票成本总额	195,344,838.32
减：交易费用	551,339.94
买卖股票差价收入	-10,748,453.90

##### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	37.16
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付） 差价收入	29,338.99
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	29,376.15

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	204,482.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	175,100.00
减：应计利息总额	37.21
减：交易费用	6.60
买卖债券差价收入	29,338.99

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至2022年06月30日
股指期货投资收益	-206,815.40

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,474,635.19
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	2,474,635.19

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-19,937,449.54
-- 股票投资	-19,937,449.54
-- 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	109,360.00
-- 权证投资	-
-- 期货投资	109,360.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-2,339.61
合计	-19,825,749.93

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	90,438.10
转换费收入	349.73
合计	90,787.83

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,050.00
银行费用	245.00
存托服务费	5.68
合计	204,439.03

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,195,288.00	857,689.58
其中：支付销售机构的客户维护费	451,480.15	305,009.62

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费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。计算公式为：日基金管理费=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 2022年01月01日至2022年 06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	262,963.35	188,691.60

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生应支付给关联方的销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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



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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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
建设银行	16,804,714.83	30,086.47	15,771,286.82	21,376.73

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末 2022 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
300834	星辉环材	2022年01月06日	1-6个月(含)	锁定期股票	55.57	30.03	187	10,391.59	5,615.61	-
301102	兆讯传媒	2022年03月15日	1-6个月(含)	锁定期股票	39.88	31.09	252	10,049.76	7,834.68	-
301103	何氏眼科	2022年03月14日	1-6个月(含)	锁定期股票	42.50	32.02	201	8,542.50	6,436.02	-
301103	何氏眼科	2022年06月01日	1-6个月(含)	锁定期股票-转增	-	32.02	60	-	1,921.20	-
301110	青木股份	2022年03月04日	1-6个月(含)	锁定期股票	63.10	39.85	125	7,887.50	4,981.25	-
301116	益客食品	2022年01月10日	1-6个月(含)	锁定期股票	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年01月07日	1-6个月(含)	锁定期股票	46.80	54.44	213	9,968.40	11,595.72	-
301120	新特电气	2022年04月11日	1-6个月(含)	锁定期股票	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301122	采纳股份	2022年01月19日	1-6个月(含)	锁定期股票	50.31	70.37	197	9,911.07	13,862.89	-
301123	奕东电子	2022年01月14日	1-6个月(含)	锁定期股票	37.23	25.39	259	9,642.57	6,576.01	-
301130	西点药业	2022年02月16日	1-6个月(含)	锁定期股票	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年04月01日	1-6个月(含)	锁定期股票	31.98	26.26	296	9,466.08	7,772.96	-
301133	哈焊	2022年	1-6个月(含)	锁定期	15.37	15.99	596	9,160.52	9,530.04	-

7	华通	03 月 14 日	月(含)	股票						
301151	冠龙节能	2022 年 03 月 30 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	30.82	21.46	300	9,246.00	6,438.00	-
301158	德石股份	2022 年 01 月 07 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301163	宏德股份	2022 年 04 月 11 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301181	标榜股份	2022 年 02 月 11 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	40.25	30.59	235	9,458.75	7,188.65	-
301196	唯科科技	2022 年 01 月 04 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	64.08	37.52	103	6,600.24	3,864.56	-
301206	三元生物	2022 年 01 月 26 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	109.30	45.69	135	14,755.50	6,168.15	-
301206	三元生物	2022 年 06 月 17 日	1-6 个月(含)	锁定期股票-转增	-	45.69	68	-	3,106.92	-
301212	联盛化学	2022 年 04 月 07 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	29.67	33.28	305	9,049.35	10,150.40	-
301215	中汽股份	2022 年 02 月 28 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	3.80	6.39	2,825	10,735.00	18,051.75	-
301222	浙江恒威	2022 年 03 月 02 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	33.98	28.96	246	8,359.08	7,124.16	-
301235	华康医疗	2022 年 01 月 21 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	39.30	37.93	327	12,851.10	12,403.11	-
301236	软通动力	2022 年 03 月 08 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	72.88	31.38	187	13,628.56	5,868.06	-
301236	软通动力	2022 年 06 月 09 日	1-6 个月(含)	锁定期股票-转增	-	31.38	94	-	2,949.72	-
301237	和顺科技	2022 年 03 月 16 日	1-6 个月(含)	锁定期股票	56.69	41.86	161	9,127.09	6,739.46	-

		日								
301256	华融化学	2022年03月14日	1-6个月(含)	锁定期股票	8.05	10.08	1,115	8,975.75	11,239.20	-
301258	富士莱	2022年03月21日	1-6个月(含)	锁定期股票	48.30	41.68	162	7,824.60	6,752.16	-
301263	泰恩康	2022年03月22日	1-6个月(含)	锁定期股票	19.93	31.38	374	7,453.82	11,736.12	-
301279	金道科技	2022年04月06日	1-6个月(含)	锁定期股票	31.20	22.81	272	8,486.40	6,204.32	-
688175	高凌信息	2022年03月08日	1-6个月(含)	锁定期股票	51.68	32.23	1,973	101,964.64	63,589.79	-

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022年05月19日	1-6个月	新债待上市	100.00	100.00	169	16,900.00	16,900.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

受限期为该股票依据相关法律法规及监管要求不得转让或者锁定的期限。

#### 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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年06月	拟筹划重大事	9.60	2022年07	9.99	44,500	440,284.09	427,200.00	-

		01 日	项		月 14					
					日					

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

公司风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计与风控委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等等。董事会下设审计与风控委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽

核部日常向督察长汇报工作。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	16,903.19	21,000.00
未评级	-	-
合计	16,903.19	21,000.00

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

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合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(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。)

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂

时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

本报告期末，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----------------------	-------	--------	----------	-------	-------	-----	----



日							
资产							
银行存款	16,804,714.83	-	-	-	-	-	16,804,714.83
结算备付金	2,180,904.77	-	-	-	-	-	2,180,904.77
存出保证金	46,496.94	-	-	-	600,979.20	-	647,476.14
交易性金融资产	-	-	-	16,903.19	229,190,006.85	-	229,206,910.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	1,215,373.50	-	1,215,373.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,032,116.54	-	-	16,903.19	231,006,359.55	-	250,055,379.28
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	816,283.39	-	816,283.39
应付赎回款	-	-	-	-	1,241,172.65	-	1,241,172.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	196,498.89	-	196,498.89
应付托管费	-	-	-	-	43,229.75	-	43,229.75
应付销售服务费	-	-	-	-	3,228.60	-	3,228.60
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	-	-	-	-	435,524.35	-	435,524.35
负债总计	-	-	-	-	2,735,937.63	-	2,735,937.63
利率敏感度缺口	19,032,116.54	-	-	16,903.19	228,270,421.92	-	247,319,441.65

上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,401,152.00	-	-	-	-	-	19,401,152.00
结算备付金	1,992,545.68	-	-	-	-	-	1,992,545.68
存出保证金	28,988.80	-	-	-	-	686,188.80	715,177.60
交易性金融资产	-	-	-	-	21,000.00	258,235,075.29	258,256,075.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	71,116.17	71,116.17
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,126,512.00	1,126,512.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	2,272.15	2,272.15
资产总计	21,422,686.48	-	-	-	21,000.00	260,121,164.41	281,564,850.89
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	6.05	6.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,392,712.33	2,392,712.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	224,382.16	224,382.16
应付托管费	-	-	-	-	-	49,364.07	49,364.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,732.00	9,732.00
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	14,735.73	14,735.73
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	493,005.98	493,005.98
负债总计	-	-	-	-	-	3,183,938.32	3,183,938.32
利率敏感度缺口	21,422,686.48	-	-	-	21,000.00	256,937,226.09	278,380,912.57

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	229,190,006.85	92.67	258,235,075.29	92.76
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	229,190,006.85	92.67	258,235,075.29	92.76

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末(2022 年 06 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	11,624,013.76	13,063,863.07
业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-11,624,013.76	-13,063,863.07	

#### 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 2022 年 06 月 30 日	上年末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	228,443,700.51	255,863,602.91
第二层次	444,103.19	929,198.27
第三层次	319,106.34	1,463,274.11
合计	229,206,910.04	258,256,075.29

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末: 无)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末, 本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	229,190,006.85	91.66
	其中: 股票	229,190,006.85	91.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,903.19	0.01
	其中: 债券	16,903.19	0.01
	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	18,985,619.60	7.59
8	其他各项资产	1,862,849.64	0.74
9	合计	250,055,379.28	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	1,501,799.92	0.61
B	采矿业	10,301,217.74	4.17
C	制造业	135,679,692.72	54.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,140,554.00	2.89
E	建筑业	2,993,472.00	1.21
F	批发和零售业	8,934,910.64	3.61

G	交通运输、仓储和邮政业	6,162,277.89	2.49
H	住宿和餐饮业	486,080.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,110,390.01	6.92
J	金融业	20,531,718.83	8.30
K	房地产业	5,274,024.10	2.13
L	租赁和商务服务业	2,801,008.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	2,886,562.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,681,875.21	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	544,250.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	3,091,551.52	1.25
S	综合	1,701,362.00	0.69
	合计	228,822,746.58	92.52

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	283,482.64	0.11
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	11,736.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,394.75	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,834.68	0.00
M	科学研究和技术服务业	30,454.86	0.01
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	8,357.22	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	367,260.27	0.15

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600522	中天科技	96,100	2,219,910.00	0.90
2	601615	明阳智能	59,200	2,000,960.00	0.81
3	600256	广汇能源	161,800	1,705,372.00	0.69
4	300769	德方纳米	3,700	1,512,116.00	0.61
5	600096	云天化	45,300	1,426,044.00	0.58
6	300012	华测检测	59,200	1,374,032.00	0.56
7	002497	雅化集团	40,600	1,325,590.00	0.54
8	002407	多氟多	27,000	1,320,570.00	0.53
9	002240	盛新锂能	21,300	1,285,668.00	0.52
10	300390	天华超净	14,500	1,267,300.00	0.51
11	002180	纳思达	24,900	1,260,438.00	0.51
12	600157	永泰能源	782,100	1,243,539.00	0.50
13	600885	宏发股份	29,320	1,227,042.00	0.50
14	000009	中国宝安	90,800	1,224,892.00	0.50
15	600141	兴发集团	27,400	1,205,326.00	0.49
16	300073	当升科技	12,500	1,129,250.00	0.46
17	600392	盛和资源	49,400	1,116,440.00	0.45
18	002384	东山精密	48,200	1,105,226.00	0.45
19	603613	国联股份	12,295	1,089,337.00	0.44
20	002756	永兴材料	7,100	1,080,691.00	0.44
21	600418	江淮汽车	61,500	1,055,340.00	0.43
22	300285	国瓷材料	28,300	1,016,536.00	0.41
23	600765	中航重机	31,060	999,510.80	0.40
24	600399	抚顺特钢	55,500	993,450.00	0.40
25	600233	圆通速递	48,400	986,876.00	0.40
26	600563	法拉电子	4,800	984,768.00	0.40
27	601555	东吴证券	141,030	977,337.90	0.40
28	601058	赛轮轮胎	86,300	972,601.00	0.39
29	600487	亨通光电	66,600	968,364.00	0.39
30	000983	山西焦煤	72,150	966,088.50	0.39
31	300037	新宙邦	18,300	961,848.00	0.39
32	600499	科达制造	46,500	959,760.00	0.39
33	600732	爱旭股份	28,700	947,674.00	0.38
34	603077	和邦生物	217,600	926,976.00	0.37
35	688180	君实生物	12,100	911,614.00	0.37
36	603456	九洲药业	17,600	909,920.00	0.37

37	002385	大北农	116,400	909,084.00	0.37
38	601108	财通证券	114,400	900,328.00	0.36
39	300363	博腾股份	11,500	896,885.00	0.36
40	002268	卫士通	20,900	896,819.00	0.36
41	603345	安井食品	5,200	872,924.00	0.35
42	688099	晶晨股份	8,586	867,186.00	0.35
43	600486	扬农化工	6,500	866,320.00	0.35
44	600298	安琪酵母	17,600	858,000.00	0.35
45	000519	中兵红箭	29,400	857,010.00	0.35
46	300144	宋城演艺	55,100	845,785.00	0.34
47	000630	铜陵有色	259,400	845,644.00	0.34
48	600862	中航高科	29,400	826,140.00	0.33
49	603605	珀莱雅	4,960	819,292.80	0.33
50	000988	华工科技	35,300	817,901.00	0.33
51	002353	杰瑞股份	20,200	814,060.00	0.33
52	000783	长江证券	136,300	808,259.00	0.33
53	601077	渝农商行	217,900	806,230.00	0.33
54	601168	西部矿业	67,100	793,793.00	0.32
55	002625	光启技术	45,500	785,785.00	0.32
56	601696	中银证券	58,700	780,710.00	0.32
57	300146	汤臣倍健	35,900	777,235.00	0.31
58	601162	天风证券	244,000	775,920.00	0.31
59	300724	捷佳伟创	8,600	768,410.00	0.31
60	002028	思源电气	21,500	766,690.00	0.31
61	002056	横店东磁	28,600	761,332.00	0.31
62	002797	第一创业	118,300	758,303.00	0.31
63	688777	中控技术	10,400	756,704.00	0.31
64	002507	涪陵榨菜	21,900	755,988.00	0.31
65	603517	绝味食品	13,000	751,660.00	0.30
66	600988	赤峰黄金	46,900	748,055.00	0.30
67	603589	口子窖	12,700	744,347.00	0.30
68	000932	华菱钢铁	145,900	742,631.00	0.30
69	002185	华天科技	78,800	739,144.00	0.30
70	601128	常熟银行	96,500	737,260.00	0.30
71	603026	石大胜华	5,000	726,750.00	0.29
72	601636	旗滨集团	56,600	721,650.00	0.29
73	600521	华海药业	31,500	715,050.00	0.29
74	600039	四川路桥	67,700	712,881.00	0.29
75	002603	以岭药业	29,320	712,476.00	0.29
76	002326	永太科技	21,600	711,288.00	0.29
77	601607	上海医药	39,100	706,928.00	0.29



78	600109	国金证券	78,500	706,500.00	0.29
79	605117	德业股份	2,500	699,725.00	0.28
80	002078	太阳纸业	56,800	699,208.00	0.28
81	000830	鲁西化工	40,400	698,516.00	0.28
82	002624	完美世界	47,700	685,449.00	0.28
83	600153	建发股份	52,200	682,254.00	0.28
84	600546	山煤国际	34,800	677,208.00	0.27
85	603939	益丰药房	12,600	665,658.00	0.27
86	603267	鸿远电子	4,900	658,217.00	0.27
87	601872	招商轮船	114,200	657,792.00	0.27
88	688390	固德威	2,100	657,321.00	0.27
89	002422	科伦药业	35,100	656,370.00	0.27
90	600348	华阳股份	42,300	653,958.00	0.26
91	600705	中航产融	188,100	650,826.00	0.26
92	600497	驰宏锌锗	125,200	649,788.00	0.26
93	601990	南京证券	77,900	649,686.00	0.26
94	000738	航发控制	23,100	649,110.00	0.26
95	600549	厦门钨业	30,000	648,600.00	0.26
96	600177	雅戈尔	97,600	647,088.00	0.26
97	000831	五矿稀土	20,700	646,875.00	0.26
98	000970	中科三环	34,212	642,501.36	0.26
99	300699	光威复材	10,900	641,683.00	0.26
100	600875	东方电气	39,000	641,550.00	0.26
101	300088	长信科技	86,300	640,346.00	0.26
102	603127	昭衍新药	5,600	637,280.00	0.26
103	000999	华润三九	13,900	625,500.00	0.25
104	600160	巨化股份	47,470	624,230.50	0.25
105	300676	华大基因	8,700	623,790.00	0.25
106	600859	王府井	23,900	620,922.00	0.25
107	002572	索菲亚	22,500	618,750.00	0.25
108	002138	顺络电子	22,700	618,575.00	0.25
109	002673	西部证券	94,200	616,068.00	0.25
110	601699	潞安环能	42,100	615,502.00	0.25
111	600516	方大炭素	80,400	611,040.00	0.25
112	002557	洽洽食品	10,700	609,151.00	0.25
113	002508	老板电器	16,700	601,701.00	0.24
114	000807	云铝股份	60,900	601,692.00	0.24
115	000039	中集集团	43,180	598,043.00	0.24
116	601997	贵阳银行	102,800	597,268.00	0.24
117	600482	中国动力	38,000	596,980.00	0.24
118	002030	达安基因	34,460	592,367.40	0.24

119	002273	水晶光电	48,840	591,452.40	0.24
120	002465	海格通信	64,900	589,941.00	0.24
121	000960	锡业股份	35,156	589,566.12	0.24
122	603444	吉比特	1,500	582,000.00	0.24
123	300357	我武生物	11,100	577,533.00	0.23
124	000629	攀钢钒钛	151,200	574,560.00	0.23
125	300136	信维通信	34,000	572,900.00	0.23
126	300058	蓝色光标	87,700	572,681.00	0.23
127	000728	国元证券	92,000	572,240.00	0.23
128	000975	银泰黄金	58,676	571,504.24	0.23
129	600170	上海建工	187,700	568,731.00	0.23
130	600536	中国软件	13,960	566,636.40	0.23
131	600704	物产中大	109,600	562,248.00	0.23
132	002092	中泰化学	72,400	561,824.00	0.23
133	002409	雅克科技	10,100	560,651.00	0.23
133	601577	长沙银行	70,700	560,651.00	0.23
135	689009	九号公司	12,500	556,250.00	0.22
136	600079	人福医药	34,500	552,000.00	0.22
137	600739	辽宁成大	37,600	548,208.00	0.22
138	002294	信立泰	19,500	547,950.00	0.22
139	603198	迎驾贡酒	8,400	547,176.00	0.22
140	300244	迪安诊断	17,500	544,250.00	0.22
141	300474	景嘉微	7,950	543,700.50	0.22
142	002223	鱼跃医疗	21,150	542,709.00	0.22
143	300418	昆仑万维	33,700	539,200.00	0.22
144	002372	伟星新材	22,420	538,976.80	0.22
145	000547	航天发展	45,100	538,494.00	0.22
146	600415	小商品城	96,500	537,505.00	0.22
147	002739	万达电影	39,300	536,445.00	0.22
148	002506	协鑫集成	144,200	536,424.00	0.22
149	000636	风华高科	28,500	535,515.00	0.22
150	300558	贝达药业	8,800	535,040.00	0.22
151	300253	卫宁健康	60,400	530,312.00	0.21
152	600699	均胜电子	33,660	528,798.60	0.21
153	600372	中航电子	27,200	527,408.00	0.21
154	300308	中际旭创	16,900	524,745.00	0.21
155	300296	利亚德	71,500	521,950.00	0.21
156	002683	广东宏大	18,500	514,855.00	0.21
157	600637	东方明珠	71,900	514,085.00	0.21
158	600315	上海家化	12,000	513,000.00	0.21
159	600867	通化东宝	49,400	510,796.00	0.21

160	600985	淮北矿业	34,900	508,144.00	0.21
161	601016	节能风电	105,700	507,360.00	0.21
162	000887	中鼎股份	27,800	507,072.00	0.21
163	600236	桂冠电力	83,200	506,688.00	0.20
164	601198	东兴证券	56,800	505,520.00	0.20
165	600026	中远海能	48,800	504,104.00	0.20
166	002156	通富微电	32,700	503,580.00	0.20
167	600171	上海贝岭	20,100	503,103.00	0.20
168	002299	圣农发展	26,200	502,516.00	0.20
169	300832	新产业	11,100	500,721.00	0.20
170	002065	东华软件	78,900	498,648.00	0.20
171	600380	健康元	40,300	497,705.00	0.20
172	600879	航天电子	76,600	497,134.00	0.20
173	600642	申能股份	86,300	490,184.00	0.20
174	300026	红日药业	63,300	487,410.00	0.20
175	000750	国海证券	133,950	486,238.50	0.20
176	600258	首旅酒店	19,600	486,080.00	0.20
177	002936	郑州银行	180,691	486,058.79	0.20
178	002408	齐翔腾达	59,900	485,789.00	0.20
179	000623	吉林敖东	32,800	484,128.00	0.20
180	000513	丽珠集团	13,250	479,782.50	0.19
181	002203	海亮股份	41,500	479,325.00	0.19
182	000729	燕京啤酒	49,500	478,170.00	0.19
183	600673	东阳光	53,000	476,470.00	0.19
184	000400	许继电气	24,800	476,160.00	0.19
185	000878	云南铜业	41,800	476,102.00	0.19
186	600820	隧道股份	77,300	473,076.00	0.19
187	600038	中直股份	10,400	470,080.00	0.19
188	600529	山东药玻	16,800	469,560.00	0.19
189	601717	郑煤机	32,459	467,734.19	0.19
190	600580	卧龙电驱	32,400	467,208.00	0.19
191	002439	启明星辰	23,400	466,362.00	0.19
192	600801	华新水泥	23,860	465,508.60	0.19
193	600369	西南证券	117,000	464,490.00	0.19
194	300017	网宿科技	86,000	460,960.00	0.19
195	002183	怡亚通	63,900	460,719.00	0.19
196	300383	光环新网	44,200	460,564.00	0.19
197	002131	利欧股份	237,400	460,556.00	0.19
198	603568	伟明环保	13,733	458,270.21	0.19
199	600166	福田汽车	161,800	457,894.00	0.19
200	688185	康希诺	2,300	457,884.00	0.19

201	600848	上海临港	33,700	456,972.00	0.18
202	600316	洪都航空	15,100	456,624.00	0.18
203	002444	巨星科技	24,100	454,044.00	0.18
204	002958	青农商行	136,700	453,844.00	0.18
205	688256	寒武纪	7,000	452,900.00	0.18
206	002195	二三四五	201,160	452,610.00	0.18
207	600909	华安证券	99,080	450,814.00	0.18
208	600325	华发股份	59,530	450,642.10	0.18
209	600027	华电国际	114,600	450,378.00	0.18
210	601005	重庆钢铁	235,600	449,996.00	0.18
211	600008	首创环保	154,750	448,775.00	0.18
212	300001	特锐德	25,600	443,136.00	0.18
213	300024	机器人	43,700	440,496.00	0.18
214	300618	寒锐钴业	7,600	440,192.00	0.18
215	000825	太钢不锈	79,900	435,455.00	0.18
216	002500	山西证券	75,710	434,575.40	0.18
217	002926	华西证券	55,400	434,336.00	0.18
218	002373	千方科技	39,000	433,680.00	0.18
219	000050	深天马 A	43,300	431,701.00	0.17
220	002430	杭氧股份	13,800	431,388.00	0.17
221	603218	日月股份	16,900	429,260.00	0.17
222	000739	普洛药业	20,782	428,940.48	0.17
223	000027	深圳能源	66,880	428,700.80	0.17
224	600271	航天信息	39,100	427,754.00	0.17
225	002670	国盛金控	44,500	427,200.00	0.17
226	002250	联化科技	26,000	425,620.00	0.17
227	688521	芯原股份	8,600	424,840.00	0.17
228	002212	天融信	41,500	421,225.00	0.17
229	603233	大参林	13,400	419,420.00	0.17
230	600863	内蒙华电	114,900	419,385.00	0.17
231	601866	中远海发	139,300	417,900.00	0.17
232	600208	新湖中宝	151,100	417,036.00	0.17
233	600118	中国卫星	20,700	415,656.00	0.17
234	300677	英科医疗	16,300	413,368.00	0.17
235	688009	中国通号	90,900	411,777.00	0.17
236	000060	中金岭南	92,100	410,766.00	0.17
237	002985	北摩高科	6,979	408,829.82	0.17
238	002249	大洋电机	66,500	408,310.00	0.17
239	300009	安科生物	40,276	407,190.36	0.16
240	601992	金隅集团	146,500	405,805.00	0.16
241	603658	安图生物	8,300	405,787.00	0.16

242	000778	新兴铸管	84,100	405,362.00	0.16
243	002152	广电运通	43,700	405,099.00	0.16
244	600066	宇通客车	46,800	404,820.00	0.16
245	603156	养元饮品	17,800	404,416.00	0.16
246	300182	捷成股份	72,500	398,750.00	0.16
247	300070	碧水源	76,500	398,565.00	0.16
248	603858	步长制药	20,100	396,171.00	0.16
249	300168	万达信息	41,800	394,592.00	0.16
250	000401	冀东水泥	37,400	393,448.00	0.16
251	600998	九州通	33,000	393,030.00	0.16
252	002966	苏州银行	64,420	392,962.00	0.16
253	300251	光线传媒	41,300	391,111.00	0.16
254	002128	电投能源	27,100	388,072.00	0.16
255	600390	五矿资本	79,200	387,288.00	0.16
256	600056	中国医药	26,114	387,009.48	0.16
257	600970	中材国际	39,900	386,631.00	0.16
258	002831	裕同科技	13,020	384,741.00	0.16
259	000997	新大陆	29,100	384,411.00	0.16
260	600667	太极实业	51,900	383,022.00	0.15
261	000021	深科技	32,900	382,956.00	0.15
262	300482	万孚生物	9,360	381,045.60	0.15
263	002505	鹏都农牧	112,000	379,680.00	0.15
264	002244	滨江集团	43,800	378,870.00	0.15
265	600528	中铁工业	46,900	377,545.00	0.15
266	600062	华润双鹤	14,700	377,202.00	0.15
267	600021	上海电力	36,800	377,200.00	0.15
268	000656	金科股份	131,600	376,376.00	0.15
269	002221	东华能源	40,300	375,193.00	0.15
270	600839	四川长虹	130,200	374,976.00	0.15
271	603885	吉祥航空	20,800	374,192.00	0.15
272	000987	越秀金控	53,015	372,695.45	0.15
273	600297	广汇汽车	142,500	371,925.00	0.15
274	603707	健友股份	13,170	371,394.00	0.15
275	688002	睿创微纳	9,350	371,382.00	0.15
276	600827	百联股份	28,000	369,880.00	0.15
277	002396	星网锐捷	16,300	369,032.00	0.15
278	002127	南极电商	69,100	368,994.00	0.15
279	600598	北大荒	24,812	366,225.12	0.15
280	002019	亿帆医药	26,100	364,878.00	0.15
281	600155	华创阳安	42,900	363,792.00	0.15
282	002266	浙富控股	75,600	362,124.00	0.15

283	600498	烽火通信	24,900	360,552.00	0.15
284	600201	生物股份	39,300	359,988.00	0.15
285	600259	广晟有色	7,100	359,615.00	0.15
286	002155	湖南黄金	29,600	359,344.00	0.15
287	600409	三友化工	43,600	357,084.00	0.14
288	600511	国药股份	13,300	356,174.00	0.14
289	000012	南玻 A	47,890	355,343.80	0.14
290	000883	湖北能源	69,300	354,123.00	0.14
291	000930	中粮科技	39,100	353,464.00	0.14
292	002153	石基信息	22,140	351,361.80	0.14
293	600718	东软集团	30,400	349,904.00	0.14
294	600755	厦门国贸	46,400	348,000.00	0.14
295	002124	天邦食品	51,740	347,692.80	0.14
296	002511	中顺洁柔	27,758	347,530.16	0.14
297	603712	七一二	10,900	343,350.00	0.14
298	000686	东北证券	49,000	342,510.00	0.14
299	600060	海信视像	27,400	342,500.00	0.14
300	600282	南钢股份	108,600	342,090.00	0.14
301	600959	江苏有线	104,700	341,322.00	0.14
302	000581	威孚高科	17,700	340,725.00	0.14
303	600895	张江高科	27,300	339,885.00	0.14
304	600782	新钢股份	67,300	339,192.00	0.14
305	688188	柏楚电子	1,540	338,861.60	0.14
306	601880	辽港股份	198,800	337,960.00	0.14
307	000709	河钢股份	149,500	337,870.00	0.14
308	601179	中国西电	72,100	337,428.00	0.14
309	600566	济川药业	12,400	336,784.00	0.14
310	600064	南京高科	30,500	335,500.00	0.14
311	600022	山东钢铁	192,700	335,298.00	0.14
312	000690	宝新能源	76,500	335,070.00	0.14
313	002939	长城证券	32,800	333,248.00	0.13
314	600535	天士力	31,700	333,167.00	0.13
315	300376	易事特	40,700	330,484.00	0.13
316	002701	奥瑞金	63,400	329,680.00	0.13
317	601778	晶科科技	60,600	327,240.00	0.13
318	002002	鸿达兴业	87,900	326,109.00	0.13
319	600216	浙江医药	23,800	324,870.00	0.13
320	300630	普利制药	9,205	323,555.75	0.13
321	600808	马钢股份	85,100	322,529.00	0.13
322	000598	兴蓉环境	63,100	322,441.00	0.13
323	600663	陆家嘴	31,000	321,160.00	0.13

324	600500	中化国际	48,230	320,729.50	0.13
325	002532	天山铝业	49,100	320,623.00	0.13
326	600728	佳都科技	49,500	319,770.00	0.13
327	600037	歌华有线	34,000	319,260.00	0.13
328	002468	申通快递	26,700	318,264.00	0.13
329	002595	豪迈科技	14,100	314,994.00	0.13
330	600567	山鹰国际	113,700	314,949.00	0.13
331	600517	国网英大	60,400	313,476.00	0.13
332	002004	华邦健康	55,800	311,364.00	0.13
333	688208	道通科技	9,433	310,534.36	0.13
334	603866	桃李面包	18,628	308,293.40	0.12
335	603225	新风鸣	26,700	308,118.00	0.12
336	300463	迈克生物	15,000	307,350.00	0.12
337	600597	光明乳业	24,300	306,909.00	0.12
338	601456	国联证券	25,000	306,750.00	0.12
339	000785	居然之家	68,900	306,605.00	0.12
340	002429	兆驰股份	79,700	306,048.00	0.12
341	688289	圣湘生物	10,308	305,219.88	0.12
342	002745	木林森	31,000	302,870.00	0.12
343	300115	长盈精密	29,360	302,701.60	0.12
344	300888	稳健医疗	4,500	299,250.00	0.12
345	601958	金铂股份	33,800	298,792.00	0.12
346	300166	东方国信	32,200	296,884.00	0.12
347	688006	杭可科技	4,200	294,252.00	0.12
348	601106	中国一重	95,700	293,799.00	0.12
349	601860	紫金银行	102,200	293,314.00	0.12
350	002390	信邦制药	42,400	292,984.00	0.12
351	603927	中科软	12,460	290,567.20	0.12
352	300072	三聚环保	57,400	290,444.00	0.12
353	600572	康恩贝	65,100	288,393.00	0.12
354	600398	海澜之家	60,300	286,425.00	0.12
355	601118	海南橡胶	59,700	285,366.00	0.12
356	601718	际华集团	91,900	284,890.00	0.12
357	600507	方大特钢	40,674	284,311.26	0.11
358	000540	中天金融	146,600	282,938.00	0.11
359	600737	中粮糖业	37,300	280,496.00	0.11
360	603883	老百姓	8,257	279,747.16	0.11
361	000089	深圳机场	35,800	276,376.00	0.11
362	000937	冀中能源	37,000	276,020.00	0.11
363	600582	天地科技	57,700	275,806.00	0.11
364	002048	宁波华翔	17,200	275,544.00	0.11

365	000559	万向钱潮	46,100	273,834.00	0.11
366	002368	太极股份	14,139	271,610.19	0.11
367	000898	鞍钢股份	84,300	271,446.00	0.11
368	600967	内蒙一机	29,700	270,864.00	0.11
369	600435	北方导航	31,200	268,944.00	0.11
370	600871	石化油服	142,000	268,380.00	0.11
371	002690	美亚光电	12,320	267,097.60	0.11
372	601000	唐山港	103,300	266,514.00	0.11
373	001914	招商积余	14,800	265,956.00	0.11
374	601568	北元集团	41,530	263,300.20	0.11
375	000959	首钢股份	55,100	262,276.00	0.11
376	002110	三钢闽光	42,750	260,347.50	0.11
377	002281	光迅科技	14,800	260,184.00	0.11
378	600195	中牧股份	21,207	259,997.82	0.11
379	601333	广深铁路	119,200	259,856.00	0.11
380	600556	天下秀	31,500	259,245.00	0.10
381	002233	塔牌集团	29,100	257,535.00	0.10
382	000156	华数传媒	32,300	257,431.00	0.10
383	000537	广宇发展	19,500	253,305.00	0.10
384	688321	微芯生物	10,050	253,159.50	0.10
385	600811	东方集团	89,360	252,888.80	0.10
386	002705	新宝股份	11,500	252,885.00	0.10
387	002010	传化智联	39,300	252,699.00	0.10
388	003035	南网能源	39,600	251,460.00	0.10
389	600764	中国海防	9,900	249,876.00	0.10
390	002174	游族网络	25,500	249,135.00	0.10
391	000402	金融街	41,700	248,115.00	0.10
392	600329	达仁堂	10,000	245,800.00	0.10
393	300212	易华录	13,980	243,252.00	0.10
394	600120	浙江东方	60,579	242,921.79	0.10
395	000990	诚志股份	22,100	241,995.00	0.10
396	603638	艾迪精密	11,780	241,490.00	0.10
397	600126	杭钢股份	47,100	241,152.00	0.10
398	002416	爱施德	25,900	240,870.00	0.10
399	000488	晨鸣纸业	42,700	240,828.00	0.10
400	002867	周大生	15,450	239,938.50	0.10
401	600167	联美控股	31,880	238,781.20	0.10
402	600446	金证股份	23,000	238,740.00	0.10
403	601200	上海环境	23,450	238,252.00	0.10
404	000685	中山公用	30,900	237,312.00	0.10
405	002081	金螳螂	46,600	236,728.00	0.10



406	000158	常山北明	39,400	236,400.00	0.10
407	601098	中南传媒	25,008	236,075.52	0.10
408	600373	中文传媒	23,600	235,764.00	0.10
409	002382	蓝帆医疗	24,600	234,930.00	0.09
410	600707	彩虹股份	50,100	234,468.00	0.09
411	002925	盈趣科技	10,890	234,352.80	0.09
412	601611	中国核建	27,700	232,403.00	0.09
413	002399	海普瑞	13,200	232,056.00	0.09
414	600095	湘财股份	30,100	231,469.00	0.09
415	002146	荣盛发展	76,100	230,583.00	0.09
416	001965	招商公路	30,200	230,426.00	0.09
417	688029	南微医学	2,639	230,120.80	0.09
418	603317	天味食品	8,000	227,760.00	0.09
419	002387	维信诺	33,700	226,464.00	0.09
420	000967	盈峰环境	44,400	224,664.00	0.09
421	600131	国网信通	16,700	224,615.00	0.09
422	688088	虹软科技	7,098	224,225.82	0.09
423	002948	青岛银行	61,500	222,630.00	0.09
424	000528	柳工	34,040	221,600.40	0.09
425	600376	首开股份	45,000	220,950.00	0.09
426	601187	厦门银行	36,800	219,328.00	0.09
427	600623	华谊集团	26,300	218,290.00	0.09
428	603000	人民网	19,300	216,160.00	0.09
429	000563	陕国投 A	69,100	215,592.00	0.09
430	002423	中粮资本	32,100	215,391.00	0.09
431	600901	江苏租赁	41,700	213,921.00	0.09
432	601598	中国外运	55,000	213,400.00	0.09
433	600307	酒钢宏兴	109,200	211,848.00	0.09
434	600006	东风汽车	27,900	210,645.00	0.09
435	601991	大唐发电	86,500	210,195.00	0.08
436	300257	开山股份	13,900	207,944.00	0.08
437	603228	景旺电子	8,912	207,916.96	0.08
438	603650	彤程新材	6,300	205,254.00	0.08
439	000961	中南建设	67,000	204,350.00	0.08
440	600906	财达证券	22,600	203,174.00	0.08
441	600717	天津港	50,389	202,059.89	0.08
442	002242	九阳股份	10,700	196,452.00	0.08
443	002434	万里扬	22,800	194,940.00	0.08
444	000718	苏宁环球	52,900	194,672.00	0.08
445	601928	凤凰传媒	26,600	190,190.00	0.08
446	000415	渤海租赁	86,300	187,271.00	0.08

447	000553	安道麦 A	15,200	184,072.00	0.07
448	601969	海南矿业	21,300	182,967.00	0.07
449	600968	海油发展	70,900	182,922.00	0.07
450	000031	大悦城	44,900	179,600.00	0.07
451	600648	外高桥	13,000	176,800.00	0.07
452	600787	中储股份	30,600	174,114.00	0.07
453	600928	西安银行	46,500	170,655.00	0.07
454	600339	中油工程	58,400	168,776.00	0.07
455	002563	森马服饰	28,200	166,944.00	0.07
456	601228	广州港	43,200	158,544.00	0.06
457	300869	康泰医学	5,600	158,256.00	0.06
458	002815	崇达技术	12,200	156,282.00	0.06
459	600835	上海机电	11,300	155,149.00	0.06
460	000028	国药一致	5,200	154,908.00	0.06
461	688819	天能股份	4,400	152,152.00	0.06
462	600377	宁沪高速	17,300	148,261.00	0.06
463	000717	韶钢松山	42,200	147,700.00	0.06
464	603056	德邦股份	10,700	143,701.00	0.06
465	002945	华林证券	9,400	143,350.00	0.06
466	603379	三美股份	6,340	141,065.00	0.06
467	000869	张裕 A	4,700	139,778.00	0.06
468	601139	深圳燃气	20,100	139,494.00	0.06
469	000062	深圳华强	10,920	138,684.00	0.06
470	600299	安迪苏	14,000	134,120.00	0.05
471	601298	青岛港	24,400	133,468.00	0.05
472	601869	长飞光纤	4,300	132,956.00	0.05
473	603868	飞科电器	1,700	128,775.00	0.05
474	001872	招商港口	7,900	123,240.00	0.05
475	002653	海思科	7,500	120,825.00	0.05
476	601156	东航物流	6,100	120,780.00	0.05
477	300741	华宝股份	4,300	119,626.00	0.05
478	600823	世茂股份	39,300	117,114.00	0.05
479	601828	美凯龙	18,900	114,534.00	0.05
480	600350	山东高速	21,800	114,450.00	0.05
481	600927	永安期货	5,600	112,952.00	0.05
482	001227	兰州银行	21,900	107,748.00	0.04
483	603355	莱克电气	3,960	99,910.80	0.04
484	603786	科博达	1,500	92,355.00	0.04
485	603515	欧普照明	5,250	91,612.50	0.04
486	001203	大中矿业	7,900	89,270.00	0.04
487	601665	齐鲁银行	17,600	85,888.00	0.03

488	603719	良品铺子	2,800	80,164.00	0.03
489	002946	新乳业	6,100	79,239.00	0.03
490	601003	柳钢股份	17,900	72,495.00	0.03
491	002901	大博医疗	1,600	62,624.00	0.03
492	600956	新天绿能	4,900	60,368.00	0.02
493	603983	丸美股份	1,800	48,240.00	0.02
494	600917	重庆燃气	6,000	43,320.00	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688175	高凌信息	1,973	63,589.79	0.03
2	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
3	301215	中汽股份	2,825	18,051.75	0.01
4	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.01
5	301122	采纳股份	197	13,862.89	0.01
6	301235	华康医疗	327	12,403.11	0.01
7	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
8	301263	泰恩康	374	11,736.12	0.00
9	301117	佳缘科技	213	11,595.72	0.00
10	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
11	301256	华融化学	1,115	11,239.20	0.00
12	301212	联盛化学	305	10,150.40	0.00
13	301137	哈焊华通	596	9,530.04	0.00
14	301206	三元生物	203	9,275.07	0.00
15	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
16	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
17	301236	软通动力	281	8,817.78	0.00
18	301103	何氏眼科	261	8,357.22	0.00
19	301102	兆讯传媒	252	7,834.68	0.00
20	301135	瑞德智能	296	7,772.96	0.00
21	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
22	301181	标榜股份	235	7,188.65	0.00
23	301222	浙江恒威	246	7,124.16	0.00
24	301258	富士莱	162	6,752.16	0.00
25	301237	和顺科技	161	6,739.46	0.00
26	301123	奕东电子	259	6,576.01	0.00
27	301151	冠龙节能	300	6,438.00	0.00
28	301279	金道科技	272	6,204.32	0.00
29	300834	星辉环材	187	5,615.61	0.00
30	301110	青木股份	125	4,981.25	0.00

31	301196	唯科科技	103	3,864.56	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	300769	德方纳米	1,537,966.59	0.55
2	600096	云天化	1,482,952.32	0.53
3	300012	华测检测	1,323,337.00	0.48
4	002497	雅化集团	1,312,934.00	0.47
5	002240	盛新锂能	1,276,419.00	0.46
6	300390	天华超净	1,109,049.00	0.40
7	002407	多氟多	1,096,843.00	0.39
8	300073	当升科技	1,040,658.00	0.37
9	688180	君实生物	1,006,477.49	0.36
10	002756	永兴材料	971,515.00	0.35
11	601058	赛轮轮胎	960,779.00	0.35
12	601108	财通证券	879,778.60	0.32
13	002152	广电运通	832,221.00	0.30
14	688777	中控技术	824,881.71	0.30
15	000783	长江证券	798,891.00	0.29
16	002013	中航机电	794,397.00	0.29
17	601696	中银证券	791,024.00	0.28
18	600499	科达制造	790,286.00	0.28
19	601162	天风证券	786,181.00	0.28
20	600707	彩虹股份	776,283.00	0.28

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000733	振华科技	2,101,700.00	0.75
2	600188	兖矿能源	1,937,971.00	0.70
3	002340	格林美	1,926,719.74	0.69
4	000723	美锦能源	1,849,102.00	0.66
5	601117	中国化学	1,694,197.00	0.61
6	002013	中航机电	1,656,048.00	0.59
7	688005	容百科技	1,615,788.85	0.58
8	300751	迈为股份	1,469,902.32	0.53
9	601689	拓普集团	1,467,690.40	0.53

10	300763	锦浪科技	1,437,115.00	0.52
11	600884	杉杉股份	1,294,469.26	0.46
12	605358	立昂微	1,188,740.96	0.43
13	600754	锦江酒店	1,132,290.00	0.41
14	300223	北京君正	1,036,591.00	0.37
15	603290	斯达半导	962,523.00	0.35
16	600803	新奥股份	960,142.00	0.34
17	600733	北汽蓝谷	929,346.00	0.33
18	002080	中材科技	857,874.00	0.31
19	603893	瑞芯微	813,191.00	0.29
20	002152	广电运通	809,718.00	0.29

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	186,237,219.42
卖出股票收入(成交)总额	185,147,724.36

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	16,903.19	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,903.19	0.01

#### 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	127064	杭氧转债	169	16,903.19	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货,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将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,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

### 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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体均没有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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	647,476.14
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,215,373.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,862,849.64

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688175	高凌信息	63,589.79	0.03	锁定期股票
2	301215	中汽股份	18,051.75	0.01	锁定期股票
3	301120	新特电气	15,985.68	0.01	锁定期股票
4	301122	采纳股份	13,862.89	0.01	锁定期股票

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信保诚 中证 500 指 数 (LOF) A	48,137	2,959.70	1,222,343.65	0.86%	141,248,526.06	99.14%

中信保诚 中证 500 指 数 (LOF) C	2,845	1,926.56	-	-	5,481,056.61	100.00%
合计	50,982	2,902.04	1,222,343.65	0.83%	146,729,582.67	99.17%

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

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	广州市广百股份有限公司	460,843.00	2.78%
2	杨胜华	414,335.00	2.50%
3	杨晓梅	354,750.00	2.14%
4	冯建强	251,670.00	1.52%
5	张兰芳	208,254.00	1.26%
6	孔一诺	202,381.00	1.22%
7	加建民	200,000.00	1.21%
8	陈远明	190,717.00	1.15%
9	陈慧然	172,263.00	1.04%
10	吴家英	169,246.00	1.02%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	91,915.58	0.06%
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	10,995.66	0.20%
	合计	102,911.24	0.07%

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

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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



本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	0
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

## 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2021 年 01 月 01 日) 基金份额总额	133,346,991.28	-
本报告期期初基金份额总额	127,597,582.52	20,847,775.31
本报告期基金总申购份额	57,352,709.32	66,900,380.06
减：本报告期基金总赎回份额	42,479,422.13	82,267,098.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	142,470,869.71	5,481,056.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)。该会计师事务所

所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 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

本报告期内，中国证券监督管理委员会上海监管局向本基金管理人出具处罚决定（已披露），并对公司及相关责任人员采取相关行政监管措施。基金管理人对此高度重视，积极开展整改工作，对具体问题进行深入整改，全面完善公司私募资产管理业务及其信息披露管理的内控制度体系和管理机制。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	183,629,918.76	50.13%	168,870.68	52.14%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	43,128.00	0.01%	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	67,206,763.61	18.35%	62,591.01	19.32%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券有 限公司	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-

中金财富	3	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-
中泰证券	2	115,445,666.99	31.51%	92,426.94	28.54%
中信建投	2	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

### 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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	39,465.50	10.51%	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	160,000.00	42.61%	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	23,522.40	6.26%	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	152,494.90	40.61%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 4 季度报告	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年01月21日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	同上	2022年01月21日
3	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	同上	2022年03月31日
4	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	同上	2022年03月31日
5	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 季度报告	同上	2022年04月21日
6	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	同上	2022年04月21日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、(原)信诚中证 500 指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照

- 3、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 4、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2022 年 08 月 27 日