

# 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)

## 2026 年中期报告

2026 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

送出日期：2026 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设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                             | 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                       | 6  |
| 3.1  | 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2  | 基金净值表现                              | 7  |
| § 4  | 管理人报告                               | 8  |
| 4.1  | 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2  | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3  | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 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             | 12 |
| 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                 | 13 |
| 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       | 13 |
| § 5  | 托管人报告                               | 13 |
| 5.1  | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2  | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、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                                 | 15 |
| 6.3  | 净资产变动表                              | 16 |
| 6.4  | 报表附注                                | 17 |
| § 7  | 投资组合报告                              | 36 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况                          | 36 |
| 7.2  | 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 36 |
| 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       | 37 |
| 7.4  | 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38 |
| 7.5  | 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41 |
| 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      | 41 |
| 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   | 41 |
| 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   | 42 |
| 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      | 42 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策                      | 42 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                | 42 |

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.12 | 投资组合报告附注 .....                      | 42 |
| § 8  | 基金份额持有人信息 .....                     | 43 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 43 |
| 8.2  | 盈利投资者数量占比 .....                     | 43 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 43 |
| 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 .....  | 44 |
| 8.5  | 发起式基金发起资金持有份额情况 .....               | 44 |
| § 9  | 开放式基金份额变动 .....                     | 44 |
| § 10 | 重大事件揭示 .....                        | 44 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 44 |
| 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 .....   | 44 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 44 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 44 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 45 |
| 10.6 | 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 45 |
| 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 .....   | 45 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                        | 49 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 50 |
| 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 ..... | 50 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 50 |
| § 12 | 备查文件目录 .....                        | 50 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                        | 50 |
| 12.2 | 存放地点 .....                          | 50 |
| 12.3 | 查阅方式 .....                          | 51 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称         | 中信保诚深度价值混合 (LOF)        |
| 场内简称         | 中信保诚深度 LOF              |
| 基金主代码        | 165508                  |
| 基金运作方式       | 契约型、上市开放式               |
| 基金合同生效日      | 2010 年 07 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            |
| 报告期末基金份额总额   | 10,740,014.81 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         | 2010 年 09 月 20 日        |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 通过对公司基本面的研究,深入剖析股票价值被低估的原因,从而挖掘具有深度价值的股票,以力争获取资本的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略:本基金定位为混合型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。</p> <p>2、股票投资策略:本基金的投资理念是价值投资,即投资于市场价格低于其内在价值的股票。公司内在价值的评估和判断包括公司的历史纪录和未来前景两方面。具体考量因素包括公司未来的预期收益和股息以及未来预期收益和股息的乘数(既包括历史可测的纪录影响,也要考虑一些重要的其他因素,例如行业的性质、公司的竞争地位、管理层的才能等等)是否在股价中被完全反映;公司的分红情况即股息收益率是否稳定并在将来可以持续;公司的资产本身是否会因重组、并购等行为发生重大变化等等。</p> <p>3、债券投资策略:本产品采用自上而下的投资方法,通过整体债券配置、类属配置和个券选择三个层次进行积极投资、控制风险、增加投资收益,提高整体组合的收益率水平,追求债券资产的长期稳定增值。</p> <p>4、其他金融工具的投资策略:本基金对权证等衍生金融工具的投资以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的证券的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资或运用衍生工具。在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露比例。</p> <p>5、存托凭证投资策略:本基金将根据本基金的投资目标和股票投资</p> |

|        |                                                                        |
|--------|------------------------------------------------------------------------|
|        | 策略, 深入研究基础证券投资价值, 选择投资价值较高的存托凭证进行投资。                                   |
| 业绩比较基准 | 上证 180 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%                                        |
| 风险收益特征 | 本基金为主动投资的混合型基金, 预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金, 低于股票型基金, 属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 |

## 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                            | 王小飞                    |
|         | 联系电话 | 021-68649788                  | 021-60637103           |
|         | 电子邮箱 | hao.zhou@citicprufunds.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 400-666-0066                  | 021-60637228           |
| 传真      |      | 021-50120895                  | 021-60635778           |
| 注册地址    |      | 中国(上海)自由贸易试验区银城路 16 号 19 层    | 北京市西城区金融大街 25 号        |
| 办公地址    |      | 中国(上海)自由贸易试验区银城路 16 号 19 层    | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  |
| 邮政编码    |      | 200120                        | 100033                 |
| 法定代表人   |      | 涂一锴                           | 张金良                    |

## 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                    |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.citicprufunds.com.cn |
| 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 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日) |
|---------------|------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,898,761.93                             |
| 本期利润          | -2,347,330.83                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1998                                  |
| 本期加权平均净值利润率   | -9.03%                                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -9.45%                                   |
| 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     | 11,133,548.35           |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0366                  |
| 期末基金资产净值     | 21,873,563.16           |
| 期末基金份额净值     | 2.0366                  |
| 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  | 164.03%                 |

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。

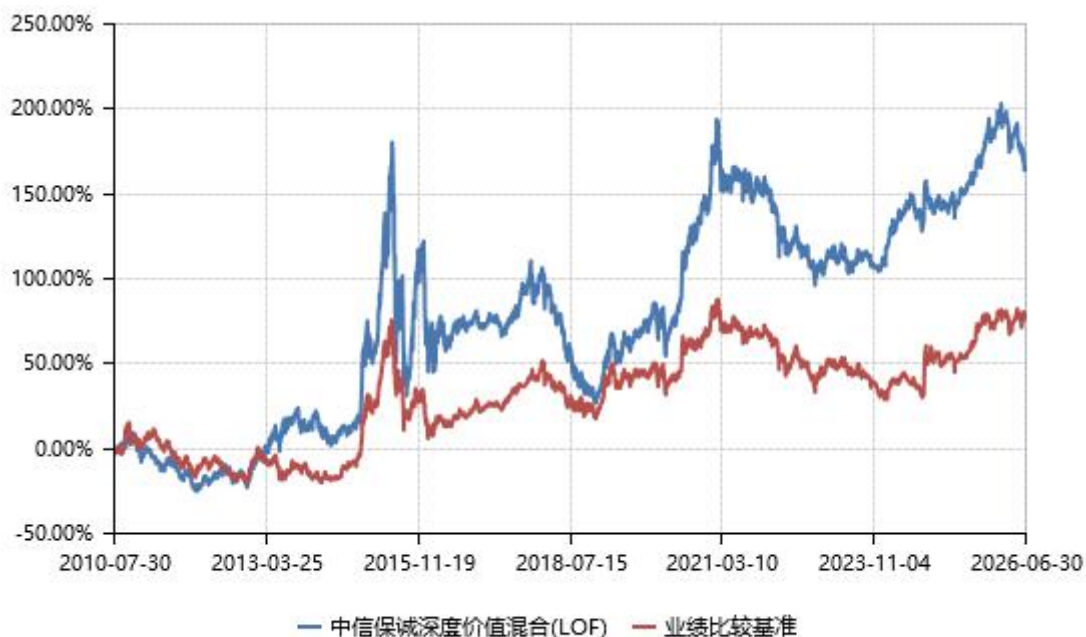
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | -5.68%       | 0.73%               | 6.02%              | 0.92%                 | -11.70% | -0.19% |
| 过去六个月          | -9.45%       | 0.83%               | 2.48%              | 0.88%                 | -11.93% | -0.05% |
| 过去一年           | 3.87%        | 0.73%               | 14.89%             | 0.79%                 | -11.02% | -0.06% |
| 过去三年           | 27.43%       | 0.73%               | 24.43%             | 0.82%                 | 3.00%   | -0.09% |
| 过去五年           | -0.29%       | 0.82%               | 3.19%              | 0.84%                 | -3.48%  | -0.02% |
| 过去七年           | 60.02%       | 0.95%               | 24.34%             | 0.87%                 | 35.68%  | 0.08%  |
| 过去十年           | 56.42%       | 1.01%               | 55.17%             | 0.87%                 | 1.25%   | 0.14%  |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 164.03%      | 1.41%               | 79.71%             | 1.05%                 | 84.32%  | 0.36%  |

### 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

本基金管理人于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，本基金管理人于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”更名为“中信保诚基金管理有限公司”。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中的基金为 95 只，分别为：中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚新机遇混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚全球商品主题证券投资基金 (LOF)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚双盈债券型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 医药指数型证券

投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证建筑工程指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金、中信保诚薪金宝货币市场基金、中信保诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳健债券型证券投资基金、中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳悦债券型证券投资基金、中信保诚稳鑫债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、中信保诚稳泰债券型证券投资基金、中信保诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金、中信保诚先进制造混合型证券投资基金、中信保诚远见成长混合型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚景气优选混合型证券投资基金、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚 90 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚周期优选混合型发起式证券

投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚乾元 30 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中信保诚汇利债券型证券投资基金、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金、中信保诚消费机遇混合型发起式证券投资基金、中信保诚稳和利率债债券型证券投资基金、中信保诚医药精选混合型发起式证券投资基金、中信保诚科技智选混合型证券投资基金、中信保诚新能源主题混合型发起式证券投资基金、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金。

#### 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<br>（助理）期限 |                     | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                       |
|-----|------------|---------------------|---------------------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |            | 任职日期                | 离任日期                |            |                                                                                                                                                                          |
| 马文文 | 基金经理       | 2026 年 02 月<br>02 日 | —                   | 12         | 马文文先生，经济学硕士。曾担任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、基金经理；中欧基金管理有限公司投资经理。2025 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司。现任中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚新机遇混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。                                   |
| 吴昊  | 研究部总监、基金经理 | 2025 年 05 月<br>06 日 | 2026 年<br>05 月 15 日 | 19         | 吴昊先生，经济学硕士，CFA。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司，从事研究工作。2010 年 11 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总监。现任研究部总监，中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚全球商品主题证券投资基金 (LOF)、中信保诚恒生港股通科技主题指数型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析。报告期内，本投资组合与公司旗下管理的其它投资组合之间未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 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 2 季度，A 股市场极致分化，以 AI 产业链、半导体为代表的新兴行业大幅上行价值和蓝筹类资产持续新低，消费、能源、有色等相关类资产和制造板块显著回调。

上半年，本基金聚焦深度价值风格资产，但产品风格定位与市场上涨方向背离较大，因此仓位上做了进一步下调，目的在于控制组合的整体风险和回撤。结构上，增持了部分估值极低、业绩增长持续的成长类资产，如工程机械等，此外增加了基本面表现良好但估值低位的非银等，未来存在见底回升预期的困境反转类资产继续保持一定持仓，但该类资产控制持仓比例，其长尾风险在组合中暴露有限，另外减持了部分周期品，并向同铜、金、煤炭等基本面扎实的品种做了聚焦。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为-9.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，外部环境变数在于地缘冲突和经贸摩擦频发，我国经济运行总体平稳，GDP 同比增长 4.7%，但二季度增长强度相对一季度有所走缓，或继续面临供强需弱、外部冲击等问题和挑战。局部方向持续发生积极变化并延续自一季度以来的向上趋势，例如价格指数 PPI、CPI 持续回暖，出口继续高增，地产二手房交易量价双改善，企业拿地积极性有所提升，平均房价继续保持降幅收窄甚至上行趋势。

市场估值层面，沪深 300 等宽基指数市盈率分位数已来到过去 5 年中高位数的水平，面临着不对称的上、下行风险，后续市场定价的运行方向，或取决于基本面、流动性和风险偏好的综合影响，波动率较可能边际放大。行业层面，估值 K 型分化十分明显，以传统行业为例，市盈率分位数回落至五年期后 5%-10% 分位数，定价风险较年初大幅释放，和宏观经济关联度较高的资产，风险释放更为彻底，而电子、通信、机械、建材等行业估值提升至历史前 5% 分位数。

展望下半年，我国经济或仍面临供强需弱、结构分化、外部冲击等问题和挑战，预计宏观政策

将更加积极有为，实现全年经济社会发展目标任务，我们将重点关注中央政治局会议及中央经济工作会议对明年经济工作的部署。在此基础上，本产品继续聚焦于价值方向，严格遵守本基金合同所聚焦的低估值、高股息、困境反转类投资方向，进行行业比较和个股精选，并做了充分的储备。未来半年到一年周期，我们重点关注宏观经济见底回升和企业盈利拐点明确的方向以及受益于 PPI 转正、CPI 持续上行的产业链条，积极寻找盈利底部反转驱动、估值保护充足、投资赔率较高的资产，以期获得较好回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本基金自 2025 年 2 月 13 日起至本报告期末基金资产净值低于五千万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

自 2025 年 5 月 14 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金如涉及信息披露费、审计费、持有人大会费用、银行间账户维护费、注册登记费等固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

## § 5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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：中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)

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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 3,716,590.02            | 4,982,986.23             |
| 结算备付金       |         | 89,037.84               | 26,739.55                |
| 存出保证金       |         | 7,975.39                | 1,654.62                 |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 18,391,440.01           | 25,680,194.69            |
| 其中：股票投资     |         | 15,814,587.00           | 24,266,059.68            |
| 基金投资        |         | —                       | —                        |
| 债券投资        |         | 2,576,853.01            | 1,414,135.01             |
| 资产支持证券投资    |         | —                       | —                        |
| 贵金属投资       |         | —                       | —                        |
| 其他投资        |         | —                       | —                        |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 41,993.03                  | 21,657.56                   |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | 4,500.00                   | 4,500.00                    |
| 资产总计          |            | 22,251,536.29              | 30,717,732.65               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2025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        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 223,650.42                 | 1,999,751.32                |
| 应付赎回款         |            | 93,358.64                  | 86,230.02                   |
| 应付管理人报酬       |            | 22,659.49                  | 28,181.29                   |
| 应付托管费         |            | 3,776.59                   | 4,696.89                    |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 80.23                      | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 34,447.76                  | 69,567.10                   |
| 负债合计          |            | 377,973.13                 | 2,188,426.62                |
| <b>净资产:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 10,740,014.81              | 12,684,918.38               |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 11,133,548.35              | 15,844,387.65               |
| 净资产合计         |            | 21,873,563.16              | 28,529,306.03               |
| 负债和净资产总计      |            | 22,251,536.29              | 30,717,732.65               |

注：截止本报告期末，基金份额净值 2.0366 元，基金份额总额 10,740,014.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)

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<br>2026年01月01<br>日至2026年06月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日<br>至2025年06月30<br>日 |
|---------|-----|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 一、营业总收入 |     | -2,166,144.81                         | -803,385.79                                |
| 1. 利息收入 |     | 10,604.99                             | 16,018.10                                  |

|                            |          |               |               |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.9  | 5,725.18      | 14,544.05     |
| 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                 |          | 4,879.81      | 1,474.05      |
| 其他利息收入                     |          | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |          | 3,065,116.46  | 9,030,324.66  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10 | 2,769,396.19  | 8,675,176.13  |
| 基金投资收益                     |          | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.11 | 1,581.12      | 3,903.55      |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.12 | -             | -             |
| 贵金属投资收益                    |          | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.13 | -             | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.14 | 294,139.15    | 351,244.98    |
| 其他投资收益                     |          | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.15 | -5,246,092.76 | -9,945,591.91 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |          | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.16 | 4,226.50      | 95,863.36     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 181,186.02    | 378,226.45    |
| 1. 管理人报酬                   |          | 155,121.27    | 262,115.24    |
| 2. 托管费                     |          | 25,853.50     | 43,685.87     |
| 3. 销售服务费                   |          | -             | -             |
| 4. 投资顾问费                   |          | -             | -             |
| 5. 利息支出                    |          | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -             | -             |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.17 | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |          | 31.25         | 0.04          |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18 | 180.00        | 72,425.30     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -2,347,330.83 | -1,181,612.24 |
| 减：所得税费用                    |          | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -2,347,330.83 | -1,181,612.24 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | -2,347,330.83 | -1,181,612.24 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)

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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |               |               |
|-----------|------------------------------------------|---------------|---------------|
|           | 实收基金                                     | 未分配<br>利润     | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产 | 12,684,918.38                            | 15,844,387.65 | 28,529,306.03 |
| 二、本期期初净资产 | 12,684,918.38                            | 15,844,387.65 | 28,529,306.03 |

|                                          |                                               |                |                 |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|-----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -1,944,903.57                                 | -4,710,839.30  | -6,655,742.87   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                             | -2,347,330.83  | -2,347,330.83   |
| （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）      | -1,944,903.57                                 | -2,363,508.47  | -4,308,412.04   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 924,014.99                                    | 1,132,318.68   | 2,056,333.67    |
| 2. 基金赎回款                                 | -2,868,918.56                                 | -3,495,827.15  | -6,364,745.71   |
| （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                                | 10,740,014.81                                 | 11,133,548.35  | 21,873,563.16   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 74,270,478.37                                 | 68,551,831.49  | 142,822,309.86  |
| 二、本期期初净资产                                | 74,270,478.37                                 | 68,551,831.49  | 142,822,309.86  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -60,020,500.96                                | -54,859,771.21 | -114,880,272.17 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                             | -1,181,612.24  | -1,181,612.24   |
| （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）      | -60,020,500.96                                | -53,678,158.97 | -113,698,659.93 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2,929,916.68                                  | 2,585,664.80   | 5,515,581.48    |
| 2. 基金赎回款                                 | -62,950,417.64                                | -56,263,823.77 | -119,214,241.41 |
| （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                                | 14,249,977.41                                 | 13,692,060.28  | 27,942,037.69   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 董元星      | 桂思毅       | 刘卓      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) (原“信诚深度价值股票型证券投资基金 (LOF)”) (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”) 《关于核准信诚深度价值股票型证券投资基金 (LOF) 募集的批复》(证监许可[2010]679 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《信诚深度价值股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》发售, 基金合同于 2010 年 7 月 30 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 524,136,365.45 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。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 299 号文审核同意，本基金 31,723,252 份基金份额于 2010 年 9 月 20 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。根据《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》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，自 2015 年 8 月 3 日起，本基金名称变更为“信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)”，基金类别变更为“混合型”，同时相应修改基金合同等相关文件的表述。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。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》，经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准，公司名称由“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”，并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称及部分深交所基金变更证券简称事宜的公告》，自 2023 年 9 月 12 日起，本基金名称变更为“中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)”，同时相应修改基金合同相关表述。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《中信保诚深度价值混合型证券投资基金(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，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股指期货等），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：股票资产占基金资产的比例不低于 60%，其中投资于本基金定义的价值型股票的资产占股票资产的比例不低于 80%；债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的比例不高于 40%；现金或到期日在一年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；权证不超过基金资产净值的 3%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为：上证 180 指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)发布的《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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况。

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

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确

全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至2027年12月31日，免征增值税；对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。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

d) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 3,716,590.02            |
| 等于：本金          | 3,716,278.55            |
| 加：应计利息         | 311.47                  |
| 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             | 3,716,590.02            |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |           |               |             |
|---------------|-------|-------------------------|-----------|---------------|-------------|
|               |       | 成本                      | 应计利息      | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            |       | 16,687,621.35           | —         | 15,814,587.00 | -873,034.35 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | —                       | —         | —             | —           |
| 债券            | 交易所市场 | 2,561,994.58            | 17,483.01 | 2,576,853.01  | -2,624.58   |
|               | 银行间市场 | —                       | —         | —             | —           |
|               | 合计    | 2,561,994.58            | 17,483.01 | 2,576,853.01  | -2,624.58   |
| 资产支持证券        |       | —                       | —         | —             | —           |
| 基金            |       | —                       | —         | —             | —           |
| 其他            |       | —                       | —         | —             | —           |
| 合计            |       | 19,249,615.93           | 17,483.01 | 18,391,440.01 | -875,658.93 |

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |
|-------|-------------------------|
| 应收利息  | —                       |
| 其他应收款 | 4,500.00                |
| 待摊费用  | —                       |
| 合计    | 4,500.00                |

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                       |
| 应付赎回费       | 212.19                  |
| 应付证券出借违约金   | —                       |
| 应付交易费用      | 29,735.57               |
| 其中：交易所市场    | 29,735.57               |
| 银行间市场       | —                       |
| 应付利息        | —                       |
| 应付账户维护费     | 4,500.00                |
| 合计          | 34,447.76               |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 12,684,918.38                            | 12,684,918.38 |
| 本期申购          | 924,014.99                               | 924,014.99    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,868,918.56                            | -2,868,918.56 |

|     |               |               |
|-----|---------------|---------------|
| 本期末 | 10,740,014.81 | 10,740,014.81 |
|-----|---------------|---------------|

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：

单位：份

| 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            |
| 165508 | 中信保诚深度价值混合 (LOF) | 216,830.00 | 10,523,184.81 | 534,007.00 | 12,150,911.38 |

#### 6.4.7.8 未分配利润

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           | 25,917,236.17 | -10,072,848.52 | 15,844,387.65 |
| 本期期初           | 25,917,236.17 | -10,072,848.52 | 15,844,387.65 |
| 本期利润           | 2,898,761.93  | -5,246,092.76  | -2,347,330.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,340,653.24 | 1,977,144.77   | -2,363,508.47 |
| 其中：基金申购款       | 2,008,337.35  | -876,018.67    | 1,132,318.68  |
| 基金赎回款          | -6,348,990.59 | 2,853,163.44   | -3,495,827.15 |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -             |
| 本期末            | 24,475,344.86 | -13,341,796.51 | 11,133,548.35 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 5,480.54                                 |
| 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 | 235.46                                   |
| 其他        | 9.18                                     |
| 合计        | 5,725.18                                 |

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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 63,372,545.60                            |
| 减：卖出股票成本总额 | 60,508,711.88                            |
| 减：交易费用     | 94,437.53                                |
| 买卖股票差价收入   | 2,769,396.19                             |

#### 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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|----------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益--利息收入                     | 10,529.31                     |
| 债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | -8,948.19                     |
| 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                               | 1,581.12                      |

##### 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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,893,113.73                  |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,885,648.66                  |
| 减：应计利息总额               | 16,395.55                     |
| 减：交易费用                 | 17.71                         |
| 买卖债券差价收入               | -8,948.19                     |

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 294,139.15                               |
| 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            | 294,139.15                               |

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -5,246,092.76                            |
| -- 股票投资                | -5,242,710.08                            |
| -- 债券投资                | -3,382.68                                |
| -- 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                     | -5,246,092.76                            |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------|------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,984.39                                 |
| 转换费收入   | 242.11                                   |
| 合计      | 4,226.50                                 |

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------|------------------------------------------|
| 审计费用    | -                                        |
| 信息披露费   | -                                        |
| 证券出借违约金 | -                                        |
| 银行费用    | 180.00                                   |

|    |        |
|----|--------|
| 合计 | 180.00 |
|----|--------|

注：本基金处于“迷你基金”期间的信息披露费、审计费、持有人大会费用、银行间账户维护费、注册登记费等固定费用由本基金的基金管理人承担。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方、关联关系

##### 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026<br>年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025<br>年 06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 155,121.27                                  | 262,115.24                                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 76,257.79                                   | 110,436.79                                       |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 78,863.48                                   | 151,678.45                                       |

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025<br>年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 25,853.50                                   | 43,685.87                                        |

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 0.20% 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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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无支付给各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固有资金投资本基金的情况

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

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

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

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国建设银行股份有限公司 | 3,716,590.02                             | 5,480.54 | 2,756,569.85                                  | 14,352.61 |

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（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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息, 或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 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。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以控制相应的信用风险。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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 2, 319, 319. 86         | 1, 414, 135. 01          |
| 合计     | 2, 319, 319. 86         | 1, 414, 135. 01          |

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。

##### 6.4.13.2.2 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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

|        |              |   |
|--------|--------------|---|
| AAA    | 257, 533. 15 | — |
| AAA 以下 | —            | — |
| 未评级    | —            | — |
| 合计     | 257, 533. 15 | — |

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。

#### 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》等法规的要求建立了流动性风险管理的内部控制体系, 审慎评估各类资产的流动性, 并通过对基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值等指标进行监控, 以及定期开展压力测试等方式防范流动性风险。

本基金投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具, 所持大部分证券在证券交易所或者银行间同业市场交易, 除在期末本基金持有的流通受限证券章节部分所列示券种暂时受限制不能自由转

让以外，其余均能及时变现。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。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026年06月30<br>日 | 1个月内         | 1-3个月         | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上           | 不计息       | 合计            |
|------------------------|--------------|---------------|--------|------|----------------|-----------|---------------|
| 资产                     |              |               |        |      |                |           |               |
| 货币资金                   | 3,716,590.02 | -             | -      | -    | -              | -         | 3,716,590.02  |
| 结算备付金                  | 89,037.84    | -             | -      | -    | -              | -         | 89,037.84     |
| 存出保证金                  | 7,975.39     | -             | -      | -    | -              | -         | 7,975.39      |
| 交易性金融资产                | -            | -2,576,853.01 | -      | -    | -15,814,587.00 | -         | 18,391,440.01 |
| 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                  | -            | -             | -      | -    | -              | 41,993.03 | 41,993.03     |
| 递延所得税资产                | -            | -             | -      | -    | -              | -         | -             |
| 其他资产                   | -            | -             | -      | -    | -              | 4,500.00  | 4,500.00      |
| 资产总计                   | 3,813,603.25 | -2,576,853.01 | -      | -    | -15,861,080.03 | -         | 22,251,536.29 |
| 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<br>产款               | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应付清算款                       | -            | -             | -            | -     | -     | 223,650.42    | 223,650.42    |
| 应付赎回款                       | -            | -             | -            | -     | -     | 93,358.64     | 93,358.64     |
| 应付管理人报酬                     | -            | -             | -            | -     | -     | 22,659.49     | 22,659.49     |
| 应付托管费                       | -            | -             | -            | -     | -     | 3,776.59      | 3,776.59      |
| 应付销售服务费                     | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应付投资顾问费                     | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应交税费                        | -            | -             | -            | -     | -     | 80.23         | 80.23         |
| 应付利润                        | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 递延所得税负债                     | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 其他负债                        | -            | -             | -            | -     | -     | 34,447.76     | 34,447.76     |
| 负债总计                        | -            | -             | -            | -     | -     | 377,973.13    | 377,973.13    |
| 利率敏感度缺口                     | 3,813,603.25 | -2,576,853.01 | -            | -     | -     | 15,483,106.90 | 21,873,563.16 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31<br>日 | 1 个月以内       | 1-3 个月        | 3 个月-1 年     | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                          |              |               |              |       |       |               |               |
| 货币资金                        | 4,982,986.23 | -             | -            | -     | -     | -             | 4,982,986.23  |
| 结算备付金                       | 26,739.55    | -             | -            | -     | -     | -             | 26,739.55     |
| 存出保证金                       | 1,654.62     | -             | -            | -     | -     | -             | 1,654.62      |
| 交易性金融资产                     | -            | -             | 1,414,135.01 | -     | -     | 24,266,059.68 | 25,680,194.69 |
| 衍生金融资产                      | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 买入返售金融资<br>产                | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应收清算款                       | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应收股利                        | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应收申购款                       | -            | -             | -            | -     | -     | 21,657.56     | 21,657.56     |
| 递延所得税资产                     | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 其他资产                        | -            | -             | -            | -     | -     | 4,500.00      | 4,500.00      |
| 资产总计                        | 5,011,380.40 | -             | 1,414,135.01 | -     | -     | 24,292,217.24 | 30,717,732.65 |
| 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<br>产款               | -            | -             | -            | -     | -     | -             | -             |
| 应付清算款                       | -            | -             | -            | -     | -     | 1,999,751.32  | 1,999,751.32  |
| 应付赎回款                       | -            | -             | -            | -     | -     | 86,230.02     | 86,230.02     |
| 应付管理人报酬                     | -            | -             | -            | -     | -     | 28,181.29     | 28,181.29     |

|         |              |               |   |   |                |               |
|---------|--------------|---------------|---|---|----------------|---------------|
| 应付托管费   | -            | -             | - | - | 4,696.89       | 4,696.89      |
| 应付销售服务费 | -            | -             | - | - | -              | -             |
| 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    | -            | -             | - | - | 69,567.10      | 69,567.10     |
| 负债总计    | -            | -             | - | - | 2,188,426.62   | 2,188,426.62  |
| 利率敏感度缺口 | 5,011,380.40 | -1,414,135.01 | - | - | -22,103,790.62 | 28,529,306.03 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                  |                             |                   |
|----|--------------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变<br>2、该利率敏感性分析不包括可转换债券和可交换债券 |                             |                   |
| 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） |
|    | 市场利率下降 25 个基点                                    | 2,451.63                    | 1,013.95          |
|    | 市场利率上升 25 个基点                                    | -2,446.01                   | -1,012.50         |

#### 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。本报告期末，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。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，并运用多种定量方法进行风险度量和分析，以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<br>2026年06月30日 |              | 上年度末<br>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 | 15,814,587.0       | 72.30        | 24,266,059.6        | 85.06        |

|               |                  |        |                  |        |
|---------------|------------------|--------|------------------|--------|
|               | 0                |        | 8                |        |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                | —      | —                | —      |
| 交易性金融资产—债券投资  | 257, 533. 15     | 1. 18  | —                | —      |
| 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            | 16, 072, 120. 15 | 73. 48 | 24, 266, 059. 68 | 85. 06 |

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

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(2026 年 06 月 30 日)       | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准中的股票指数上升 5%          | 673, 499. 75                | 727, 157. 21           |
|    | 业绩比较基准中的股票指数下降 5%          | -673, 499. 75               | -727, 157. 21          |

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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 16, 072, 120. 15        | 24, 266, 059. 68         |
| 第二层次          | 2, 319, 319. 86         | 1, 414, 135. 01          |
| 第三层次          | —                       | —                        |
| 合计            | 18, 391, 440. 01        | 25, 680, 194. 69         |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 15,814,587.00 | 71.07         |
|    | 其中：股票             | 15,814,587.00 | 71.07         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,576,853.01  | 11.58         |
|    | 其中：债券             | 2,576,853.01  | 11.58         |
|    | 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      | 3,805,627.86  | 17.10         |
| 8  | 其他各项资产            | 54,468.42     | 0.24          |
| 9  | 合计                | 22,251,536.29 | 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              | 988,180.00    | 4.52         |
| C  | 制造业              | 6,750,455.00  | 30.86        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 756,635.00    | 3.46         |
| E  | 建筑业              | —             | —            |
| F  | 批发和零售业           | —             | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 141,298.00    | 0.65         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —             | —            |
| J  | 金融业              | 5,732,891.00  | 26.21        |
| K  | 房地产业             | 294,880.00    | 1.35         |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,150,248.00  | 5.26         |
| 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               | 15,814,587.00 | 72.30        |

### 7.2.2 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

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  | 601398 | 工商银行 | 150,300 | 1,062,621.00 | 4.86         |
| 2  | 600919 | 江苏银行 | 89,700  | 966,966.00   | 4.42         |
| 3  | 600926 | 杭州银行 | 66,600  | 962,370.00   | 4.40         |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 24,400  | 866,200.00   | 3.96         |
| 5  | 000425 | 徐工机械 | 103,900 | 840,551.00   | 3.84         |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 6  | 603259 | 药明康德  | 6,600  | 821,766.00 | 3.76 |
| 7  | 600887 | 伊利股份  | 31,800 | 761,928.00 | 3.48 |
| 8  | 600031 | 三一重工  | 41,800 | 722,304.00 | 3.30 |
| 9  | 000333 | 美的集团  | 9,500  | 717,535.00 | 3.28 |
| 10 | 300750 | 宁德时代  | 1,500  | 589,515.00 | 2.70 |
| 11 | 600426 | 华鲁恒升  | 23,900 | 571,688.00 | 2.61 |
| 12 | 600900 | 长江电力  | 17,300 | 457,931.00 | 2.09 |
| 13 | 601899 | 紫金矿业  | 18,200 | 457,548.00 | 2.09 |
| 14 | 601211 | 国泰海通  | 21,200 | 385,840.00 | 1.76 |
| 15 | 300308 | 中际旭创  | 300    | 381,000.00 | 1.74 |
| 16 | 603369 | 今世缘   | 15,600 | 369,876.00 | 1.69 |
| 17 | 603198 | 迎驾贡酒  | 11,600 | 343,360.00 | 1.57 |
| 18 | 300012 | 华测检测  | 23,700 | 328,482.00 | 1.50 |
| 19 | 002444 | 巨星科技  | 9,900  | 307,890.00 | 1.41 |
| 20 | 600025 | 华能水电  | 33,600 | 298,704.00 | 1.37 |
| 21 | 002244 | 滨江集团  | 38,800 | 294,880.00 | 1.35 |
| 22 | 601988 | 中国银行  | 47,700 | 272,844.00 | 1.25 |
| 23 | 601628 | 中国人寿  | 7,700  | 272,195.00 | 1.24 |
| 24 | 601009 | 南京银行  | 26,200 | 259,118.00 | 1.18 |
| 25 | 601336 | 新华保险  | 3,800  | 226,708.00 | 1.04 |
| 26 | 600938 | 中国海油  | 7,800  | 211,770.00 | 0.97 |
| 27 | 002142 | 宁波银行  | 7,100  | 210,799.00 | 0.96 |
| 28 | 000338 | 潍柴动力  | 7,000  | 190,750.00 | 0.87 |
| 29 | 601168 | 西部矿业  | 6,800  | 184,552.00 | 0.84 |
| 30 | 002487 | 大金重工  | 3,000  | 173,910.00 | 0.80 |
| 31 | 605117 | 德业股份  | 1,600  | 169,888.00 | 0.78 |
| 32 | 000776 | 广发证券  | 6,600  | 154,440.00 | 0.71 |
| 33 | 601021 | 春秋航空  | 3,100  | 141,298.00 | 0.65 |
| 34 | 002043 | 兔宝宝   | 12,700 | 140,716.00 | 0.64 |
| 35 | 601225 | 陕西煤业  | 6,600  | 134,310.00 | 0.61 |
| 36 | 603605 | 珀莱雅   | 2,200  | 131,824.00 | 0.60 |
| 37 | 600519 | 贵州茅台  | 100    | 118,549.00 | 0.54 |
| 38 | 601688 | 华泰证券  | 4,500  | 92,790.00  | 0.42 |
| 39 | 000725 | 京东方 A | 8,900  | 77,252.00  | 0.35 |
| 40 | 603766 | 隆鑫通用  | 6,300  | 75,159.00  | 0.34 |
| 41 | 300408 | 三环集团  | 400    | 66,760.00  | 0.31 |

## 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  | 601009 | 南京银行  | 1,660,119.00 | 5.82            |
| 2  | 600887 | 伊利股份  | 1,501,336.00 | 5.26            |
| 3  | 603259 | 药明康德  | 1,455,827.00 | 5.10            |
| 4  | 600519 | 贵州茅台  | 1,403,163.00 | 4.92            |
| 5  | 000425 | 徐工机械  | 1,397,677.00 | 4.90            |
| 6  | 600926 | 杭州银行  | 1,337,863.00 | 4.69            |
| 7  | 300750 | 宁德时代  | 1,312,750.00 | 4.60            |
| 8  | 300308 | 中际旭创  | 1,278,650.00 | 4.48            |
| 9  | 600025 | 华能水电  | 1,215,540.00 | 4.26            |
| 10 | 002371 | 北方华创  | 1,104,403.00 | 3.87            |
| 11 | 002384 | 东山精密  | 1,051,518.00 | 3.69            |
| 12 | 601168 | 西部矿业  | 1,045,961.00 | 3.67            |
| 13 | 688717 | 艾罗能源  | 1,036,023.92 | 3.63            |
| 14 | 601398 | 工商银行  | 936,642.00   | 3.28            |
| 15 | 600031 | 三一重工  | 917,100.00   | 3.21            |
| 16 | 002444 | 巨星科技  | 903,694.00   | 3.17            |
| 17 | 603198 | 迎驾贡酒  | 873,902.00   | 3.06            |
| 18 | 002244 | 滨江集团  | 848,631.00   | 2.97            |
| 19 | 000568 | 泸州老窖  | 830,783.00   | 2.91            |
| 20 | 000858 | 五 粮 液 | 822,184.00   | 2.88            |
| 21 | 603369 | 今世缘   | 800,483.00   | 2.81            |
| 22 | 600938 | 中国海油  | 775,619.00   | 2.72            |
| 23 | 600426 | 华鲁恒升  | 753,865.00   | 2.64            |
| 24 | 002142 | 宁波银行  | 743,002.00   | 2.60            |
| 25 | 601336 | 新华保险  | 724,280.00   | 2.54            |
| 26 | 688072 | 拓荆科技  | 723,196.39   | 2.53            |
| 27 | 000933 | 神火股份  | 711,634.00   | 2.49            |
| 28 | 605117 | 德业股份  | 703,555.00   | 2.47            |
| 29 | 002092 | 中泰化学  | 679,823.00   | 2.38            |
| 30 | 688627 | 精智达   | 677,621.85   | 2.38            |
| 31 | 601988 | 中国银行  | 674,483.00   | 2.36            |
| 32 | 603308 | 应流股份  | 658,361.00   | 2.31            |
| 33 | 600674 | 川投能源  | 644,114.00   | 2.26            |
| 34 | 002487 | 大金重工  | 636,425.00   | 2.23            |
| 35 | 002043 | 兔 宝 宝 | 597,176.00   | 2.09            |
| 36 | 603737 | 三棵树   | 587,497.00   | 2.06            |
| 37 | 600595 | 中孚实业  | 571,122.00   | 2.00            |

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|--------------|-----------------|
| 1  | 601009 | 南京银行  | 1,467,882.00 | 5.15            |
| 2  | 601688 | 华泰证券  | 1,380,906.00 | 4.84            |
| 3  | 601600 | 中国铝业  | 1,354,242.00 | 4.75            |
| 4  | 600941 | 中国移动  | 1,337,109.00 | 4.69            |
| 5  | 601077 | 渝农商行  | 1,282,082.00 | 4.49            |
| 6  | 002384 | 东山精密  | 1,262,075.00 | 4.42            |
| 7  | 300308 | 中际旭创  | 1,212,531.00 | 4.25            |
| 8  | 688717 | 艾罗能源  | 1,180,927.76 | 4.14            |
| 9  | 600519 | 贵州茅台  | 1,141,887.62 | 4.00            |
| 10 | 002371 | 北方华创  | 1,098,803.00 | 3.85            |
| 11 | 601988 | 中国银行  | 1,031,947.00 | 3.62            |
| 12 | 601899 | 紫金矿业  | 1,022,145.00 | 3.58            |
| 13 | 000338 | 潍柴动力  | 929,678.00   | 3.26            |
| 14 | 601398 | 工商银行  | 923,865.00   | 3.24            |
| 15 | 603259 | 药明康德  | 920,257.00   | 3.23            |
| 16 | 600690 | 海尔智家  | 916,645.00   | 3.21            |
| 17 | 601628 | 中国人寿  | 910,404.00   | 3.19            |
| 18 | 600025 | 华能水电  | 906,599.00   | 3.18            |
| 19 | 600711 | 盛屯矿业  | 884,384.00   | 3.10            |
| 20 | 600938 | 中国海油  | 882,906.00   | 3.09            |
| 21 | 000333 | 美的集团  | 867,767.00   | 3.04            |
| 22 | 600660 | 福耀玻璃  | 858,611.00   | 3.01            |
| 23 | 002064 | 华峰化学  | 802,917.00   | 2.81            |
| 24 | 601168 | 西部矿业  | 771,695.00   | 2.70            |
| 25 | 000858 | 五 粮 液 | 761,371.00   | 2.67            |
| 26 | 688072 | 拓荆科技  | 754,840.63   | 2.65            |
| 27 | 000568 | 泸州老窖  | 754,385.30   | 2.64            |
| 28 | 600887 | 伊利股份  | 711,884.00   | 2.50            |
| 29 | 600039 | 四川路桥  | 703,568.00   | 2.47            |
| 30 | 000933 | 神火股份  | 699,180.00   | 2.45            |
| 31 | 300750 | 宁德时代  | 698,590.00   | 2.45            |
| 32 | 000776 | 广发证券  | 687,763.00   | 2.41            |
| 33 | 603308 | 应流股份  | 686,284.00   | 2.41            |
| 34 | 601058 | 赛轮轮胎  | 668,744.00   | 2.34            |
| 35 | 600674 | 川投能源  | 661,760.00   | 2.32            |
| 36 | 688627 | 精智达   | 657,994.46   | 2.31            |
| 37 | 002092 | 中泰化学  | 642,342.00   | 2.25            |
| 38 | 600160 | 巨化股份  | 617,533.00   | 2.16            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 39 | 601298 | 青岛港  | 609,295.40 | 2.14 |
| 40 | 002444 | 巨星科技 | 605,479.00 | 2.12 |
| 41 | 605117 | 德业股份 | 589,246.00 | 2.07 |
| 42 | 688012 | 中微公司 | 584,509.66 | 2.05 |
| 43 | 002497 | 雅化集团 | 575,677.00 | 2.02 |
| 44 | 600642 | 申能股份 | 573,823.50 | 2.01 |

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 | 57,299,949.28 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 63,372,545.60 |

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      | 2,319,319.86 | 10.60        |
| 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） | 257,533.15   | 1.18         |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 2,576,853.01 | 11.78        |

#### 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  | 019827 | 26 国债 01 | 12,000 | 1,207,778.30 | 5.52         |
| 2  | 019792 | 25 国债 19 | 11,000 | 1,111,541.56 | 5.08         |
| 3  | 132026 | G 三峡 EB2 | 2,000  | 257,533.15   | 1.18         |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

## 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中，报告编制日前一年内，招商银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚；中国工商银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚，受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚（银罚决字[2025]110号、京汇罚[2025]49号）。

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

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 | 7,975.39  |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 41,993.03 |
| 6  | 其他应收款 | 4,500.00  |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 54,468.42 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|------------|--------------|
| 1  | 132026 | G 三峡 EB2 | 257,533.15 | 1.18         |

7.12.5 期末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前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 1,687    | 6,366.34      | 2,817.00 | 0.03%      | 10,737,197.81 | 99.97%     |

8.2 盈利投资者数量占比

| 项目        | 过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） |
|-----------|-----------------------------------------|
| 盈利投资者数量占比 | 86.50%                                  |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 28,441.28 | 0.26%    |

#### 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                             | 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、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

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2010 年 07 月 30 日）基金份额总额 | 524,136,365.45 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 12,684,918.38  |
| 本报告期基金总申购份额                     | 924,014.99     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 2,868,918.56   |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 10,740,014.81  |

### § 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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及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，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 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，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人无受调查或处罚等情况。

### 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无受调查或处罚等情况。

## 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

### 10.7.1 基金租用或者通过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 |    |
| 财通证券   | 2      | 568,898.00 | 0.47%        | 259.35    | 0.47%      | —  |
| 长江证券   | 2      | 983,155.00 | 0.81%        | 448.43    | 0.82%      | —  |
| 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      | —          | —            | —         | —          | —  |
| 光大证券   | 1      | —          | —            | —         | —          | —  |

|            |   |               |        |           |        |   |
|------------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 广发证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 国金证券       | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 国联民生<br>证券 | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 国盛证券       | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 国泰海通<br>证券 | 3 | 316,573.00    | 0.26%  | 144.33    | 0.26%  | — |
| 国投证券       | 3 | —             | —      | —         | —      | — |
| 国信证券       | 2 | 40,020,621.30 | 33.16% | 18,245.43 | 33.16% | — |
| 国元证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 华创证券       | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 华福证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 华金证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 华泰证券       | 3 | 19,903,145.26 | 16.49% | 9,074.14  | 16.49% | — |
| 华西证券       | 2 | 2,590,758.00  | 2.15%  | 1,181.10  | 2.15%  | — |
| 开源证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 民生证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 平安证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 瑞银证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 申万宏源<br>证券 | 5 | —             | —      | —         | —      | — |
| 太平洋证<br>券  | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 天风证券       | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 西南证券       | 1 | 2,501,608.00  | 2.07%  | 1,140.49  | 2.07%  | — |
| 信达证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 兴业证券       | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 野村东方<br>国际 | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 招商证券       | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 浙商证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 中国银河<br>证券 | 2 | —             | —      | —         | —      | — |
| 中金公司       | 2 | 53,212,752.32 | 44.10% | 24,259.83 | 44.10% | — |
| 中泰证券       | 1 | —             | —      | —         | —      | — |
| 中信建投<br>证券 | 2 | 574,984.00    | 0.48%  | 262.15    | 0.48%  | — |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|--------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 财通证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 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   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国联民生证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国盛证    | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|        |              |        |               |        |   |   |   |   |
|--------|--------------|--------|---------------|--------|---|---|---|---|
| 券      |              |        |               |        |   |   |   |   |
| 国泰海通证券 | 260,002.85   | 5.28%  | -             | -      | - | - | - | - |
| 国投证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 国信证券   | 442,996.02   | 8.99%  | -             | -      | - | - | - | - |
| 国元证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 华创证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 华福证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 华金证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 华泰证券   | 1,199,976.00 | 24.36% | 11,142,000.00 | 17.10% | - | - | - | - |
| 华西证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 开源证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 民生证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 平安证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 瑞银证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 太平洋证券  | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 天风证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 西南证券   | 521,881.16   | 10.59% | -             | -      | - | - | - | - |
| 信达证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 兴业证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 野村东方国际 | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 招商证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |

|        |              |        |               |        |   |   |   |   |
|--------|--------------|--------|---------------|--------|---|---|---|---|
| 浙商证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 中国银河证券 | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 中金公司   | 2,501,218.00 | 50.78% | 54,005,000.00 | 82.90% | - | - | - | - |
| 中泰证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 中信证券   | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | -            | -      | -             | -      | - | - | - | - |

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

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                          | 法定披露日期      |
|----|----------------------------------------|---------------------------------|-------------|
| 1  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 2025 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 | 2026年01月21日 |
| 2  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告       | 同上                              | 2026年02月03日 |
| 3  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新     | 同上                              | 2026年02月05日 |
| 4  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书        | 同上                              | 2026年02月05日 |
| 5  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 2025 年年度报告     | 同上                              | 2026年03月30日 |
| 6  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 2026 年第 1 季度报告 | 同上                              | 2026年04月21日 |
| 7  | 关于中信保诚基金管理有限公司旗下部分基金修改托管协议的公告          | 同上                              | 2026年04月25日 |
| 8  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议           | 同上                              | 2026年04月25日 |
| 9  | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告       | 同上                              | 2026年05月16日 |
| 10 | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金                      | 同上                              | 2026年05月19日 |

|    |                                              |    |             |
|----|----------------------------------------------|----|-------------|
|    | (LOF) 更新招募说明书                                |    |             |
| 11 | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新           | 同上 | 2026年05月19日 |
| 12 | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新           | 同上 | 2026年05月29日 |
| 13 | 中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2026 年 5 月) | 同上 | 2026年05月29日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2026 年 4 月 25 日披露的《关于中信保诚基金管理有限公司旗下部分基金修改托管协议的公告》，自 2026 年 4 月 25 日起修改本基金托管协议中清算相关条款。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、(原) 信诚深度价值股票型证券投资基金 (LOF) 相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 4、中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (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

2026 年 08 月 29 日