

# 中泰中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 26 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。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月25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。

本报告期自2023年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告.....	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	84
8.6 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.....	84
8.7 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.....	84
8.8 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.....	85
8.9 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.....	85
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	85

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	85
8.12 投资组合报告附注.....	85
§9 基金份额持有人信息.....	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	87
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	87
§10 开放式基金份额变动.....	87
§11 重大事件揭示.....	88
11.1 基金份额持有人大会决议.....	88
11.2 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.....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
11.4 基金投资策略的改变.....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	89
11.8 其他重大事件.....	89
§12 备查文件目录.....	91
12.1 备查文件目录.....	91
12.2 存放地点.....	91
12.3 查阅方式.....	91

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中泰中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中泰中证500指数增强	
基金主代码	008112	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月11日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,846,963.95份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰中证500指数增强 A	中泰中证500指数增强 C
下属分级基金的交易代码	008112	008113
报告期末下属分级基金的份额总额	13,269,037.79份	36,577,926.16份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为中证500指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场组合相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有 限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王洪懿	龚小武
	联系电话	021-20521199	021-52629999-212056
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-821-0808	95561
传真		021-50933716	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	福建省福州市台江区江滨中 大道398号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路488 号太平金融大厦1002-1003室	上海市浦东新区银城路167号 4楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		黄文卿	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特 殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马 威大楼8层
注册登记机构	中泰证券（上海）资产管理有 限公司	上海市浦东新区银城中路488号太平 金融大厦1002-1003室

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2023年		2022年		2021年	
	中泰中证500 指数增强A	中泰中证500 指数增强C	中泰中证500 指数增强A	中泰中证500 指数增强C	中泰中证500 指数增强A	中泰中证500 指数增强C
本期已实现收益	-1,388,938.32	-4,037,980.32	-2,108,549.70	-6,582,508.84	2,471,223.32	6,745,663.80
本期利润	-1,154,543.45	-3,389,862.22	-2,917,614.80	-9,260,992.49	2,522,305.73	6,834,051.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0907	-0.0937	-0.2497	-0.2634	0.2429	0.2101
本期加权平均净值利润率	-6.92%	-7.25%	-18.42%	-19.60%	16.73%	14.51%
本期基金份额净值增长率	-7.22%	-7.59%	-17.19%	-17.52%	15.94%	15.47%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	2,593,316.43	6,444,487.92	3,702,991.69	9,996,581.43	5,744,606.20	18,331,383.20
期末可供分配基金份额利润	0.1954	0.1762	0.2884	0.2728	0.5559	0.5432
期末基金资产净值	15,862,354.22	43,022,414.08	16,541,640.90	46,646,860.39	16,077,852.85	52,079,811.88
期末基金份额净值	1.1954	1.1762	1.2884	1.2728	1.5559	1.5432
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	19.54%	17.62%	28.84%	27.28%	55.59%	54.32%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、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（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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

中泰中证500指数增强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
过去三个月	-6.00%	0.75%	-4.36%	0.82%	-1.64%	-0.07%
过去六个月	-10.37%	0.76%	-9.01%	0.81%	-1.36%	-0.05%
过去一年	-7.22%	0.74%	-7.01%	0.78%	-0.21%	-0.04%

过去三年	-10.92%	0.98%	-13.83%	1.03%	2.91%	-0.05%
自基金合同生效起至今	19.54%	1.12%	7.61%	1.17%	11.93%	-0.05%

中泰中证500指数增强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
过去三个月	-6.09%	0.75%	-4.36%	0.82%	-1.73%	-0.07%
过去六个月	-10.54%	0.76%	-9.01%	0.81%	-1.53%	-0.05%
过去一年	-7.59%	0.74%	-7.01%	0.78%	-0.58%	-0.04%
过去三年	-11.99%	0.98%	-13.83%	1.03%	1.84%	-0.05%
自基金合同生效起至今	17.62%	1.12%	7.61%	1.17%	10.01%	-0.05%

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

中泰中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月11日-2023年12月31日)

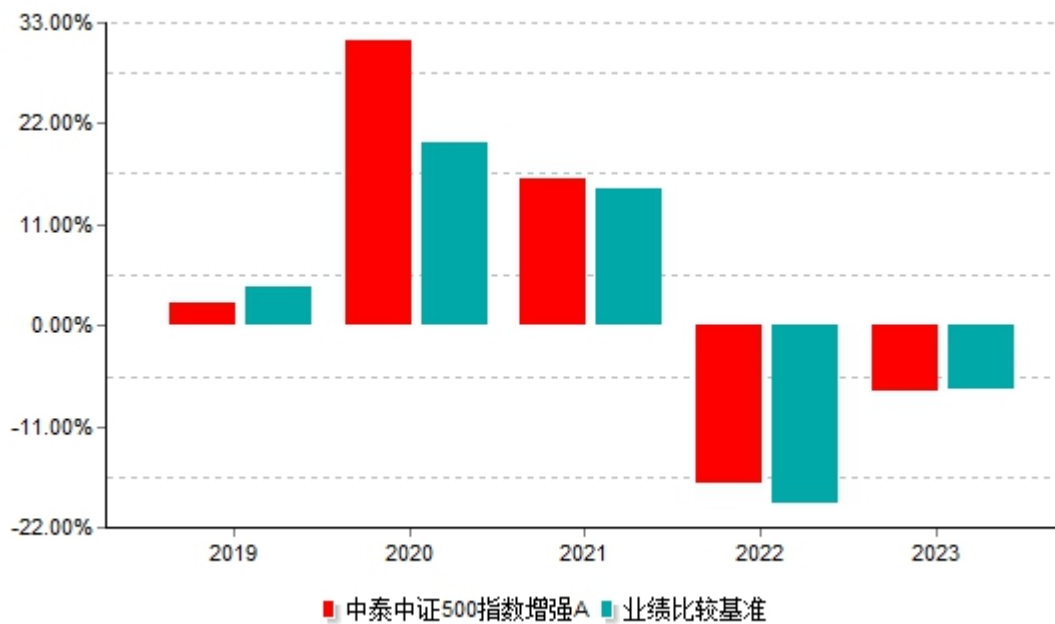




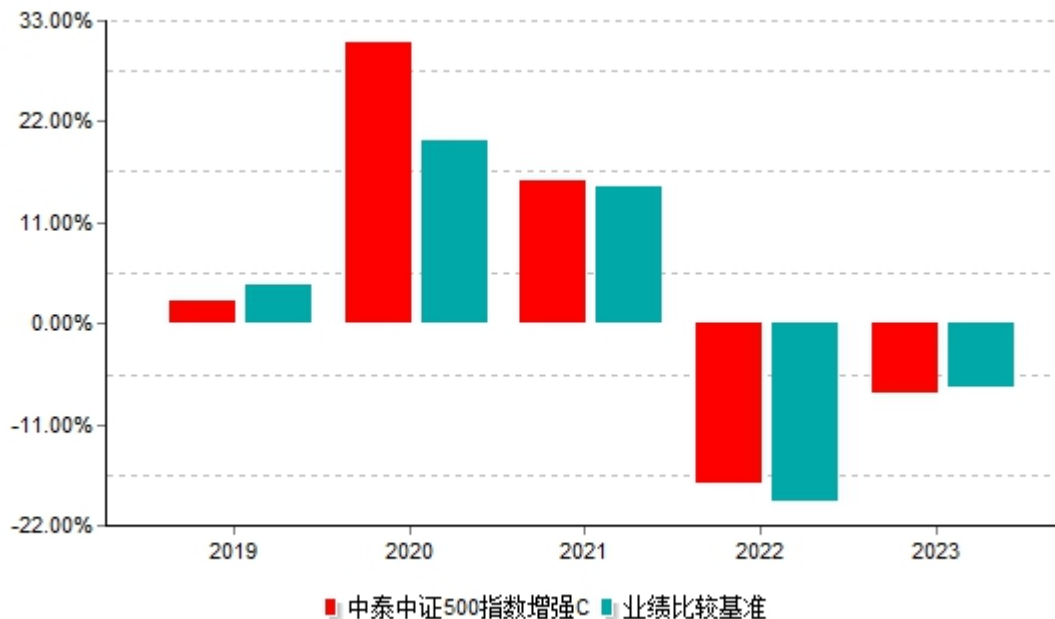
中泰中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月11日-2023年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于2019年12月11日生效。基金合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金的基金合同于2019年12月11日生效。基金合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2023年12月31日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰兴为价值精选混合型证券投资基金、中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券

投资基金、中泰双利债券型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰安益利率债债券型证券投资基金、中泰安睿债券型证券投资基金、中泰安悦6个月定期开放债券型证券投资基金、中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金、中泰星汇优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、中泰元和价值精选混合型证券投资基金、中泰天择稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）、中泰星锐景气成长混合型证券投资基金和中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金共27只证券投资基金。

#### 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		
邹巍	本基金基金经理；中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理；中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理。	2019-12-11	-	11	国籍：中国。学历：华东师范大学统计系硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司财务部IT运维工程师；上海国泰君安证券资产管理有限公司运营部副总经理、量化投资部首席研究员。2014年10月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司任对冲基金部副总经理、现任基金业务部副总经理。2019年12月11日起至今担任中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理。2020年4月1日起至

					今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2021年7月5日起至今担任中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。2023年2月7日起至今担任中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理。
李玉刚	本基金经理；中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理；中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金基金经理；研究部总经理。	2022-01-04	-	22	国籍：中国。学历：北京大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所、新产品部和衍生产品部研究员、资产管理总部研究员；上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理。2014年11月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司担任对冲基金部总经理，现任公司研究部总经理。2022年1月4日起至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金和中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。2022年11月11日起至今担任中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人

员及从业人员监督管理办法》的相关规定；

3、报告期后，基金管理人内部组织架构调整，不再设置基金业务部，新设权益公募投资部、固收公募投资部和量化公募投资部，自2024年1月29日起，邹巍担任量化公募投资部副总经理，李玉刚担任研究部总经理兼量化公募投资部总经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，我司旗下产品所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均严格执行《中泰证券（上海）资产管理有限公司公平交易及异常交易制度》。

公司建立了针对公平交易进行事前控制、事中监控、事后分析的完整流程，形成有效的公平交易体系。

事前控制包括：通过建立投资研究沟通机制确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会；对各投资组合的重大非公开投资信息进行相互隔离；并通过投资交易系统进行公平交易和反向交易风控设置。

事中监控通过执行集中交易制度，将投资管理与交易执行相分离，交易由交易部集中执行。交易部以公平交易为原则，保证投资组合的交易得到公平、及时、准确、高效地执行，确保不同产品享有公平的交易执行机会；对不同帐户的交易指令按照“时间优先、价格优先”原则执行；同时接收的交易指令在分配和执行过程中，避免因投资组合资产的大小、成交额的大小及交易难易等客观因素或个人主观好恶而出现执行时间及执行数量比例的明显不均现象；同时收到不同投资组合账户同种证券同向买卖指令时，避免交易因执行的时间、比例明显不同而出现交易均价明显差异的现象。

事后分析主要集中在对不同投资组合同日或者临近交易日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，监督检验公平交易原则实施情况，识别是否存在不公平交易和任何利益输送嫌疑的交易行为。

1、同向交易价差分析，主要是通过分析产品间不同时间窗口（1日、3日、5日）的同向交易价差，来分析判断同向交易是否存在违反公平交易原则和利益输送的行为，分析判断的方法和指标包括同向交易价差T检验、差价率均值、占优比率、差价贡献率等。

2、反向交易分析，主要通过分析产品不同时间窗口（同日、隔日、3日、5日）反向交易成交较少的单边交易量占相关证券当日成交量情况的分析，识别是否存在任何利益输送嫌疑的交易行为。

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

- 1、报告期内不存在产品间同向交易行为导致利益输送的结果；
- 2、报告期内不存在产品间反向交易行为导致利益输送的结果。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易及异常交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未出现违反制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

异常交易，是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理产品买卖法规、产品管理合同、交易制度等限制投资对象的交易均认定为交易对象异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在收盘前15分钟的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过15%，则认定为交易时间异常型异常交易。产品在连续竞价阶段委托价格超过最新价格的3%，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在交易当日的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过30%，即作为交易数量异常型异常交易。内幕交易，频繁申报与撤单，不能列示有充分投资研究成果支持的交易，以及投资管理人员受他人干预，未能就投资、交易等事项做出客观、公正的独立判断与决策的交易，均作为交易理由异常型异常交易。

风险管理部通过系统或人工手段，监控各产品的异常交易，如果发现某笔交易符合异常交易界定标准，将其列为异常交易，并建立异常交易档案，系统记录异常交易发生的时间、具体交易情况及认定人和认定依据，对于风险管理部识别出的异常交易，要求投资经理进行合理解释，并提交书面说明至风险管理部备案。

本报告期内，未发生异常交易行为。

### 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

2023年以来，在市场从疫情防控恢复正常的乐观预期中出现了比较明显的上涨，一季度中证500指数出现显著的上涨，指数从年初的5864点，上涨到6476点。市场乐观情绪退潮后，500指数下半年单边下行，年终收盘在5429点。全年区间内指数年化波动率为12.7%，处于历史极低水平，继续反映出中证500成分股市场活跃度的持续下降。

按照中证指数行业分类看，2023年500指数成分股中通信与能源行业取得相对不错的上涨，其余大多数行业，尤其是消费与地产行业则出现比较大的下跌。

全年基金在运作过程中，投资策略与过去相比较没有做出大的调整。从基金实际运作的结果来看，在通过统计量化方式控制跟踪误差方面是我们一直做得相对比较成功的地方，投资组合的跟踪误差本年一直在极低的水平。从全年来看，优化超配的股票上半年创造了一定的超额收益，但进入三季度后，市场风格转换，我们的组合开始走弱，基金整体表现最后基本与业绩基准持平，未能创造超额收益。我们将在日后的投资实践中继续加强对中证500指数约束下的优选个股的研究，力求为投资者创造价值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰中证500指数增强A基金份额净值为1.1954元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.22%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%；截至报告期末中泰中证500指数增强C基金份额净值为1.1762元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.59%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年证券市场的羸弱表现大大超出我们年初的预期，也击穿了许多投资者的心理预期。总结下来，对股市的悲观预期主要来自对宏观经济的不看好，归结下来主要包括以下方面的担心或疑虑：对出生率快速下降，伴随人口老龄化，人口红利消失担忧；对民营企业发展受限，经济活力下降的担忧；对房地产及建筑产业进入长期衰退，拖累经济下行的担忧；对投资收益断崖下滑，资产泡沫破裂，类似三十年前日本的“资产负债表衰退”的担忧；对西方国家科技与经济与中国“脱钩”，中国产业升级受困，出口衰退的担忧。

对于这些担忧，经过理智的分析，我们认为，其中有些真问题，但已经在市场得到了相当充分甚至过头的反应，有些担心存在误读国家制度政策或者过度悲观的解读的倾向。我们认为人口出生率下降和老龄化是事实，但对经济的影响是非常渐进的过程。人口结构改变的不是突发事件，对于决策层而言，有足够的时间去采取应对措施避免对经济的负面影响。关于民营企业经营状况的担心，我们认为存在一些对政策的曲解误读，当然我们也发现民营企业目前的确面临不小的困难，对民企的歧视也局部存在。但正如经济学家林毅夫所指出的：民营企业的困境更多是经济增速下滑的结果，而不是经济增速下滑的原因。民营企业所在的竞争性较强的行业，更容易受到经济下滑的拖累。房地产及建筑业的下滑实际上是国家产业转型必然要面对和克服的问题，我们认为并不会因此拖累经济长期下行；反而我们认为应该更加关注产业转型中数字经济与人工智能等新产业带来的产业革命，能否为中国经济带来新的动力。此外，中国与三十年前日本的实际经济环境、制度逻辑等都有很多的不同，我们并不认为中国重蹈日本的覆辙有多大的可

能性。至于中西方“脱钩”的担心，我们认为只要我们自身坚持改革和开放，这并不太可能成为一个真问题。

综上所述，站在目前的时点上，我们认为尽管宏观经济目前有这样或那样的困难，但证券市场的反应依然是明显的过度了，我们继续乐观预期2024年的市场表现，尤其乐观预期新能源、科技、消费等行业的估值回复。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人以维护基金份额持有人利益为宗旨，坚持合规运作，不断完善内部控制制度和流程，加强日常监察稽核力度，推动各项内部控制制度、措施得到全面、有效落实。督察长和合规管理部门根据独立、客观、公正的原则，审慎履行职责，通过合规审查、投资风控、内部稽核等工作，推进内部控制和风险管理的不断完善，为各项经营活动和基金投资运作的合规开展提供有力保障。

本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、不断完善制度流程。报告期内，公司继续加强制度建设，密切关注监管动态，依照最新法律法规和自律规则要求，结合公司各项业务实际开展情况，组织相关部门及时对公司的各类制度、流程开展梳理、修订与完善。

2、积极配合外部审计、检查。报告期内，公司积极协调内部各个部门，全力配合监管机构、母公司及外部审计机构对公司开展的业务检查、经营审计、内部控制评价、合规有效性评估，针对上述检查、审计项目开展过程中发现的问题以及提出的改进建议，公司高度重视，严格督促相关部门完善制度、改进流程，以有效控制相关风险，不断提升内控管理水平。

3、加强内部监察稽核力度。公司每季度针对投资、研究、交易、风控、基金运营等内部控制各方面开展定期核查，并针对发现的问题采取有效措施完善制度、改进流程；在此基础上，报告期内公司针对投资者适当性管理、基金销售、员工行为管理、关联交易、债券交易等业务开展了专项稽核，对专项稽核中发现问题明确要求相关部门整改到位，不断提升内部控制和风险管理水平。

4、有效发挥合规审查作用。报告期内，督察长和合规管理部门认真履行合规审查职责，对新制定或修订的各项制度、新产品方案、基金销售文件、重要投资决策、基金关联交易、基金信息披露文件等开展合规审查，有效发挥合规审查在防范、控制风险方面的积极作用。

5、积极开展合规培训。报告期内，公司合规管理部门及时向公司管理层和员工传达最新的监管要求和违规案例通报，积极保持与各个业务部门的沟通与联络，根据各版块业务的开展情况适时开展合规督导，及时提示合规风险，妥善解答业务人员在展业过程中遇到的法律、合规问题；并根据法律法规变化和最新监管动态，统筹协调外部律师



事务所和内部合规力量，有针对性地开展合规培训项目，不断提升员工的风险、合规意识，营造合规经营氛围。

通过以上工作的开展，在本报告期内，本基金运作整体合法合规。基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，确保基金资产的规范运作，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

基金管理人设立了估值委员会，由公司总经理、主管基金运营的公司高管、合规负责人及投资管理、风险管理、基金运营等方面的专业人员担任委员。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，形成估值委员会决议。运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.8 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利润分配。

#### 4.9 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2400409号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中泰中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中泰中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"该基金")财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表、2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称"企业会计准则")及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果

	和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2023年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价

	<p>值处置。该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结</p>

	构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张楠	倪益
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2024-03-25	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	3,622,680.56	4,504,130.04
结算备付金		379,599.25	873,036.98
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	55,195,693.10	58,064,570.64
其中：股票投资		55,193,392.93	58,064,570.64
基金投资		-	-
债券投资		2,300.17	-
资产支持证券投 资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		139,422.42	102,650.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		59,337,395.33	63,544,388.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023年12月31日</b>	<b>2022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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		140,316.72	49,921.69
应付管理人报酬		25,090.04	27,191.43
应付托管费		2,509.00	2,719.16
应付销售服务费		14,699.40	16,054.73
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	7.4.7.6	270,011.87	260,000.00
负债合计		452,627.03	355,887.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	49,846,963.95	49,488,928.17
未分配利润	7.4.7.8	9,037,804.35	13,699,573.12
净资产合计		58,884,768.30	63,188,501.29
负债和净资产总计		59,337,395.33	63,544,388.30

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额49,846,963.95份，其中A类份额13,269,037.79份，C类份额36,577,926.16份。A类份额净值1.1954元，C类份额净值1.1762元。

## 7.2 利润表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		-3,686,371.25	-11,312,275.20
1.利息收入		30,267.67	36,754.41
其中：存款利息收入	7.4.7.9	30,267.67	36,754.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,611,958.75	-7,877,254.93
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-5,549,259.50	-8,938,061.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	3,357.98	28,598.24
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-7,595.51
股利收益	7.4.7.13	933,942.77	1,039,803.74
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	7.4.7.14	882,512.97	-3,487,548.75

以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.15	12,806.86	15,774.07
<b>减：二、营业总支出</b>		858,034.42	866,332.09
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	317,647.70	314,853.27
2.托管费	7.4.10.2.2	31,764.78	31,485.36
3.销售服务费	7.4.10.2.3	187,326.94	188,715.04
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		-	-
8.其他费用	7.4.7.16	321,295.00	331,278.42
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-4,544,405.67	-12,178,607.29
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-4,544,405.67	-12,178,607.29
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,544,405.67	-12,178,607.29

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计



一、上期期末净资产	49,488,928.17	13,699,573.12	63,188,501.29
二、本期期初净资产	49,488,928.17	13,699,573.12	63,188,501.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	358,035.78	-4,661,768.77	-4,303,732.99
（一）、综合收益总额	-	-4,544,405.67	-4,544,405.67
（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）	358,035.78	-117,363.10	240,672.68
其中：1.基金申购款	14,754,100.64	4,327,719.05	19,081,819.69
2.基金赎回款	-14,396,064.86	-4,445,082.15	-18,841,147.01
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	49,846,963.95	9,037,804.35	58,884,768.30
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	44,081,675.33	24,075,989.40	68,157,664.73
二、本期期初净资产	44,081,675.33	24,075,989.40	68,157,664.73

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,407,252.84	-10,376,416.28	-4,969,163.44
（一）、综合收益总额	-	-12,178,607.29	-12,178,607.29
（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）	5,407,252.84	1,802,191.01	7,209,443.85
其中：1.基金申购款	21,919,068.87	7,738,581.01	29,657,649.88
2.基金赎回款	-16,511,816.03	-5,936,390.00	-22,448,206.03
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	49,488,928.17	13,699,573.12	63,188,501.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中泰中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2019]1840号《关于准予中泰中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民

《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币297,379,816.58元。经向中国证监会备案，《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2019年12月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为297,488,829.64份，其中认购资金利息折合109,013.06份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券以及中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金和应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证500指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2024年3月25日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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。

### 7.4.3 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7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资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2023年12月31日的财务状况、2023年度的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、衍生工具等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式,在此情形下,所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类,否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,分类为以摊余成本计量的金融资产:

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;
- 该金融资产的合同条款规定,在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外,本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 后续计量

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

##### - 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察

输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。



#### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《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《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《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》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) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。

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。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

(c) 对基金从上市公司、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。

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

(d) 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) 对基金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附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,607,796.31	2,693,110.88
等于：本金	1,607,615.27	2,692,840.55
加：应计利息	181.04	270.33
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	2,014,884.25	1,811,019.16
等于：本金	2,014,549.49	1,810,604.63
加：应计利息	334.76	414.53
减：坏账准备	-	-
合计	3,622,680.56	4,504,130.04

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	57,005,355.42	-	55,193,392.93	-1,811,962.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,300.00	0.17	2,300.17
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,300.00	0.17	2,300.17
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,007,655.42	0.17	55,195,693.10	-1,811,962.49
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	60,759,046.10	-	58,064,570.64	-2,694,475.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	60,759,046.10	-	58,064,570.64	-2,694,475.46

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	11.87	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用-审计费	40,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	80,000.00	160,000.00
指数使用费	150,000.00	50,000.00
合计	270,011.87	260,000.00

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 中泰中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,838,649.21	12,838,649.21
本期申购	3,769,161.49	3,769,161.49
本期赎回（以“-”号填列）	-3,338,772.91	-3,338,772.91
本期末	13,269,037.79	13,269,037.79

##### 7.4.7.7.2 中泰中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,650,278.96	36,650,278.96
本期申购	10,984,939.15	10,984,939.15
本期赎回（以“-”号填列）	-11,057,291.95	-11,057,291.95
本期末	36,577,926.16	36,577,926.16

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 中泰中证500指数增强A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

(中泰中证500指数增强A)			
上年度末	5,035,600.96	-1,332,609.27	3,702,991.69
本期期初	5,035,600.96	-1,332,609.27	3,702,991.69
本期利润	-1,388,938.32	234,394.87	-1,154,543.45
本期基金份额交易产生的变动数	133,541.93	-88,673.74	44,868.19
其中：基金申购款	1,416,643.13	-252,674.99	1,163,968.14
基金赎回款	-1,283,101.20	164,001.25	-1,119,099.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,780,204.57	-1,186,888.14	2,593,316.43

## 7.4.7.8.2 中泰中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,773,133.50	-3,776,552.07	9,996,581.43
本期期初	13,773,133.50	-3,776,552.07	9,996,581.43
本期利润	-4,037,980.32	648,118.10	-3,389,862.22
本期基金份额交易产生的变动数	-43,904.54	-118,326.75	-162,231.29
其中：基金申购款	3,903,602.69	-739,851.78	3,163,750.91
基金赎回款	-3,947,507.23	621,525.03	-3,325,982.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,691,248.64	-3,246,760.72	6,444,487.92

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日

活期存款利息收入	8,258.83	8,004.59
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	15,446.57	15,145.24
结算备付金利息收入	6,562.27	13,604.58
其他	-	-
合计	30,267.67	36,754.41

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	202,011,767.62	222,275,728.24
减：卖出股票成本总额	207,279,479.34	230,852,465.88
减：交易费用	281,547.78	361,323.76
买卖股票差价收入	-5,549,259.50	-8,938,061.40

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	2.94	23.05
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	3,355.04	28,575.19
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	3,357.98	28,598.24



## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,359.38	172,110.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,000.00	143,500.00
减：应计利息总额	2.77	24.92
减：交易费用	1.57	10.76
买卖债券差价收入	3,355.04	28,575.19

## 7.4.7.12 衍生工具收益

## 7.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
期货投资	-	-7,595.51

## 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
股票投资产生的股利收益	933,942.77	1,039,803.74
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	933,942.77	1,039,803.74

## 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	882,512.97	-3,469,628.75
——股票投资	882,512.97	-3,467,052.15
——债券投资	-	-2,576.60
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-17,920.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-17,920.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	882,512.97	-3,487,548.75

## 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	12,697.35	15,754.78
基金转换费收入	109.51	14.26
其他	-	5.03
合计	12,806.86	15,774.07

## 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
汇划手续费	1,295.00	1,278.42
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	321,295.00	331,278.42

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“中泰资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
深圳派特纳投资企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳前海山小投资企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
-------	-------------------------------	------------------------------------

	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中泰证券	405,288,569.52	100.00%	452,714,461.22	100.00%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
中泰证券	22,359.38	100.00%	172,110.87	100.00%

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	91,934.67	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
中泰证券	101,920.55	100.00%	-	-

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

2.管理人从关联方获得的服务包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	317,647.70	314,853.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	127,073.02	125,129.21
应支付基金管理人的净管理费	190,574.68	189,724.06

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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X0.50%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,764.78	31,485.36

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.05%/当年天数。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	合计
兴业银行	0.00	2,905.81	2,905.81
中泰证券	0.00	170,792.48	170,792.48
中泰资管	0.00	150.46	150.46
合计	0.00	173,848.75	173,848.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	合计
兴业银行	0.00	2,613.25	2,613.25
中泰证券	0.00	175,311.69	175,311.69
中泰资管	0.00	572.51	572.51
合计	0.00	178,497.45	178,497.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰资管，再由中泰资管计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值 X 0.40%/ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中泰中证500指数增强A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年12月31日	2022年01月01日至 2022年12月31日

报告期初持有的基金份额	999,560.32	999,560.32
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	999,560.32	999,560.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.53%	7.79%

## 中泰中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年12月31日	2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

## 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年12月31日		2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,607,796.31	8,258.83	2,693,110.88	8,004.59
中泰证券	2,014,884.25	15,446.57	1,811,019.16	15,145.24

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构中泰证券保管，按协议约定利率计息。

**7.4.10.6 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证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
127100	神码转债	2023-12-21	20个交易日	新债未上市	100.00	100.01	23	2,300.00	2,300.17	-

**7.4.12.2 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
000657	中钨高新	2023-12-26	重大事项	8.48	2024-01-10	9.33	1,800	15,654.60	15,264.00	-
400174	中天3	2023-05-19	重大事项	0.40	-	-	37,500	64,085.52	15,000.00	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 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作为抵押的债券。

**7.4.12.3.2 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作为抵押的债券。

**7.4.13 金融工具风险及管理**



本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。风险控制委员会负责建立公司全面风险管理体系，对公司重大业务和管理工作的风险进行评估并对重大风险的处理方案进行审核。风险管理部根据专业投资委员会制定的投资策略和资产配置方案，协助专业投资委员会进行投资策略的风险检验，以及制定相应的投资风险控制标准。

事中控制流程包括：风险管理部根据本基金资产实际投资运作状况，实时测算各种风险指标，并监测本基金资产各项风险控制指标的变化，识别、分析和评价相关业务的风险状况，出具业务风险评估报告，提出风险预警。如在风险监测中发现异常现象或存在重大隐患时，需要立即对风险进行识别，明确风险种类并对其进行度量，测算该风险的危害程度，及时向专业投资委员会提出处理措施，控制风险程度的上升。

事后控制流程包括：在风险处理措施实施以后，风险管理部实时监控处理效果并提出阶段性总结报告，进一步提出改善整体和局部风险管理的建议。此外，对本基金资产的投资组合风险状况进行定期或不定期分析和总结，定期或不定期编写风险管理报告提交风险控制委员会和专业投资委员会及投资决策委员会。风险管理部应根据市场环境的变化对投资组合的风险进行情景分析或模拟分析，在估计可能产生重大风险隐患时，及时通报专业投资委员会和投资决策委员会，并提出降低风险的建议。当市场环境的变化导致风险控制模型的适用性降低时，风险管理部应及时对所使用的风险控制模型进行重新检验和修正，包括但不限于压力测试、敏感性分析等。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系。公司业务的风险管理体系共分四个层次：第一层次为董事会，董事会是公司风险管理的最高决策机构，风险控制委员会为董事会风险管理的专门工作机构，负责制订公司风险管理总体目标和政策，审批公司风险管理的制度、流程与指标，并对公司重大经营及决策进行风险评估并提出意见；第二层次为行政办公会，行政办公会是公司风险管理的决策监督机构，风险控制执行委员会为行政办公会风险管理的常设机构，承担日常风险管理决策职责，负责提出公司业务经营管理过程中风险防范的指导意见、制定风险管理策略、对公司风险状况和风险管理能力进行评估、监督风控措施执行情况；第三层次为风险管理部及相关职能部门。风险管理部是公司风险管理的专职日常工作机构，在首席风险官领导下监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；第四层次为各业务部门的一线风险管理。各业务部门承担一线的风控职能，执行

具体的风险管理制度，并承担风险管理有效性的直接责任。公司建立了完善的内部控制制度，交易部门、投资管理部门以及风险管理部门互相独立、互相制约。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了证券及交易对手库管理办法，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化组合投资以分散信用风险；管理人实行交易对手白名单制度，并根据交易对手的资信状况分别限定交易额度。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	2,300.17	-
未评级	-	-
合计	2,300.17	-

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金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，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控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以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

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上市公司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上述比例限制)。

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7.4.12。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%。于本报告期末，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。于本报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	3,622,680.56	-	-	-	-	-	3,622,680.56
结算备付金	379,599.25	-	-	-	-	-	379,599.25
交易性金融资产	-	-	-	-	2,300.17	55,193,392.93	55,195,693.10
应收申购款	-	-	-	-	-	139,422.42	139,422.42
资产总计	4,002,279.81	-	-	-	2,300.17	55,332,815.35	59,337,395.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	140,316.72	140,316.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,090.04	25,090.04

应付托管费	-	-	-	-	-	2,509.00	2,509.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,699.40	14,699.40
其他负债	-	-	-	-	-	270,011.87	270,011.87
负债总计	-	-	-	-	-	452,627.03	452,627.03
利率敏感度缺口	4,002,279.81	-	-	-	2,300.17	54,880,188.32	58,884,768.30
上年度末 2022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							
货币资金	4,504,130.04	-	-	-	-	-	4,504,130.04
结算备付金	873,036.98	-	-	-	-	-	873,036.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	58,064,570.64	58,064,570.64
应收申购款	-	-	-	-	-	102,650.64	102,650.64
资产总计	5,377,167.02	-	-	-	-	58,167,221.28	63,544,388.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	49,921.69	49,921.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,191.43	27,191.43
应付托管费	-	-	-	-	-	2,719.16	2,719.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,054.73	16,054.73
其他负债	-	-	-	-	-	260,000.00	260,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	355,887.01	355,887.01
利率敏感度缺口	5,377,167.02	-	-	-	-	57,811,334.27	63,188,501.29

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金仅持有交易所可转换公司债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金为增强型指数基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金和应收申购款等。

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，本基金将建立专门的风险预算控制模型，力争使基金净值增长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0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	55,193,392.93	93.73	58,064,570.64	91.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,300.17	-	-	-

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	55,195,693.10	93.74	58,064,570.64	91.89

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假设基金的市场价格风险主要源于系统性风险，公司采用beta系数来衡量股票投资的系统性风险，股票基准值为沪深300指数；2、假设除比较基准变动外，影响基金资产净值的其他价格风险变量保持不变；3、假设比较基准变动5%，采用线性回归法分析，因而业绩比较基准的变化对基金的净值影响线性相关。		
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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	比较基准上升5%	2,346,706.31	2,690,543.23
	比较基准下降5%	-2,346,706.31	-2,690,543.23

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	55,163,128.93	57,900,425.64
第二层次	32,564.17	164,145.00
第三层次	-	-
合计	55,195,693.10	58,064,570.64

#### 7.4.14.2 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，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，确定相关股票的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2022年12月31日：同）。

#### 7.4.14.4 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和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	55,193,392.93	93.02
	其中：股票	55,193,392.93	93.02



2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,300.17	0.00
	其中：债券	2,300.17	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,002,279.81	6.74
8	其他各项资产	139,422.42	0.23
9	合计	59,337,395.33	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	445,116.00	0.76
B	采矿业	1,919,131.00	3.26
C	制造业	30,024,173.28	50.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,286,300.00	2.18
E	建筑业	449,528.00	0.76
F	批发和零售业	1,572,894.82	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	964,804.00	1.64
H	住宿和餐饮业	92,158.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,591,024.26	6.10
J	金融业	2,425,259.00	4.12
K	房地产业	535,727.00	0.91
L	租赁和商务服务业	400,757.00	0.68

M	科学研究和技术服务业	278,456.17	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	217,330.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	141,168.00	0.24
Q	卫生和社会工作	388,384.00	0.66
R	文化、体育和娱乐业	951,131.00	1.62
S	综合	203,155.00	0.35
	合计	45,886,496.53	77.93

### 8.2.2 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	94,694.00	0.16
B	采矿业	378,921.00	0.64
C	制造业	5,221,917.40	8.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	204,590.00	0.35
E	建筑业	38,511.00	0.07
F	批发和零售业	106,538.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	107,426.00	0.18
H	住宿和餐饮业	6,088.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	158,799.00	0.27
J	金融业	2,386,750.00	4.05
K	房地产业	79,742.00	0.14
L	租赁和商务服务业	34,334.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	227,442.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	149,426.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	30,840.00	0.05
Q	卫生和社会工作	41,132.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	39,746.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	9,306,896.40	15.81

### 8.2.3 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股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 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	002078	太阳纸业	48,700	592,679.00	1.01
2	600497	驰宏锌锗	104,700	528,735.00	0.90
3	000630	铜陵有色	138,300	453,624.00	0.77
4	600486	扬农化工	7,110	448,783.20	0.76
5	002422	科伦药业	12,400	360,220.00	0.61
6	600352	浙江龙盛	37,900	318,360.00	0.54
7	600298	安琪酵母	8,800	309,584.00	0.53
8	002152	广电运通	24,500	300,370.00	0.51
9	601233	桐昆股份	19,800	299,574.00	0.51
10	002738	中矿资源	7,960	296,987.60	0.50
11	600177	雅戈尔	43,000	281,650.00	0.48
12	600901	江苏金租	58,160	281,494.40	0.48
13	002028	思源电气	5,400	281,016.00	0.48
14	000975	银泰黄金	17,900	268,500.00	0.46
15	300502	新易盛	5,400	266,328.00	0.45
16	600642	申能股份	40,900	262,578.00	0.45

17	300418	昆仑万维	7,000	261,800.00	0.44
18	601058	赛轮轮胎	22,000	258,500.00	0.44
19	300394	天孚通信	2,800	256,256.00	0.44
20	601128	常熟银行	39,000	249,210.00	0.42
21	000933	神火股份	14,700	246,960.00	0.42
22	601098	中南传媒	23,800	242,046.00	0.41
23	600161	天坛生物	7,800	241,332.00	0.41
24	601162	天风证券	76,300	235,767.00	0.40
25	301236	软通动力	5,100	235,620.00	0.40
26	002439	启明星辰	8,700	234,900.00	0.40
27	600079	人福医药	9,200	228,712.00	0.39
28	002444	巨星科技	10,000	225,200.00	0.38
29	600153	建发股份	23,200	223,416.00	0.38
30	300037	新宙邦	4,700	222,310.00	0.38
31	002465	海格通信	17,200	221,020.00	0.38
32	002384	东山精密	12,000	218,160.00	0.37
33	002008	大族激光	10,500	217,560.00	0.37
34	000932	华菱钢铁	42,200	217,330.00	0.37
35	600873	梅花生物	22,700	216,785.00	0.37
36	600867	通化东宝	19,900	215,517.00	0.37
37	000988	华工科技	7,200	214,272.00	0.36
38	600885	宏发股份	7,600	210,064.00	0.36
39	600418	江淮汽车	13,000	209,950.00	0.36
40	688099	晶晨股份	3,312	207,430.56	0.35
41	002463	沪电股份	9,300	205,716.00	0.35
42	300144	宋城演艺	20,500	202,335.00	0.34
43	600820	隧道股份	34,600	199,296.00	0.34
44	600704	物产中大	44,800	198,464.00	0.34
45	603444	吉比特	800	196,096.00	0.33
46	603883	老百姓	6,500	194,285.00	0.33
47	600985	淮北矿业	11,600	192,908.00	0.33

48	300724	捷佳伟创	2,600	192,426.00	0.33
49	000423	东阿阿胶	3,900	192,348.00	0.33
50	002368	太极股份	6,500	191,945.00	0.33
51	600862	中航高科	8,500	188,275.00	0.32
52	600546	山煤国际	10,700	187,357.00	0.32
53	002138	顺络电子	6,900	186,369.00	0.32
54	000060	中金岭南	43,000	185,760.00	0.32
55	300682	朗新科技	11,300	185,207.00	0.31
56	688072	拓荆科技	800	185,040.00	0.31
57	300285	国瓷材料	7,900	182,648.00	0.31
58	600155	华创云信	21,800	181,812.00	0.31
59	603882	金域医学	2,900	181,453.00	0.31
60	300207	欣旺达	12,200	180,072.00	0.31
61	601179	中国西电	36,200	178,466.00	0.30
62	600583	海油工程	29,900	177,606.00	0.30
63	300395	菲利华	4,800	175,488.00	0.30
64	601000	唐山港	49,900	174,650.00	0.30
65	600399	抚顺特钢	17,700	172,044.00	0.29
66	002273	水晶光电	12,600	170,604.00	0.29
67	002517	恺英网络	15,200	169,784.00	0.29
68	688169	石头科技	600	169,770.00	0.29
69	603606	东方电缆	3,900	166,725.00	0.28
70	600415	小商品城	22,600	165,432.00	0.28
71	002532	天山铝业	27,300	164,073.00	0.28
71	002044	美年健康	27,300	164,073.00	0.28
73	002340	格林美	29,800	162,708.00	0.28
74	600597	光明乳业	18,400	160,632.00	0.27
75	000400	许继电气	7,300	160,308.00	0.27
76	002025	航天电器	3,300	158,466.00	0.27
77	600369	西南证券	38,300	156,647.00	0.27
78	600282	南钢股份	42,300	156,510.00	0.27

79	002128	电投能源	10,900	155,543.00	0.26
80	000778	新兴铸管	40,600	155,092.00	0.26
81	600066	宇通客车	11,600	153,700.00	0.26
82	600529	山东药玻	6,000	153,600.00	0.26
83	603228	景旺电子	6,800	153,408.00	0.26
84	600129	太极集团	3,300	153,318.00	0.26
85	600884	杉杉股份	11,200	152,544.00	0.26
86	300474	景嘉微	2,150	152,026.50	0.26
87	002353	杰瑞股份	5,400	151,794.00	0.26
88	002155	湖南黄金	13,500	150,390.00	0.26
89	000893	亚钾国际	5,700	149,568.00	0.25
90	000998	隆平高科	10,600	149,460.00	0.25
91	603658	安图生物	2,600	148,226.00	0.25
92	300088	长信科技	22,000	147,180.00	0.25
93	600060	海信视像	7,000	146,300.00	0.25
94	002409	雅克科技	2,600	144,898.00	0.25
95	300136	信维通信	6,100	143,960.00	0.24
96	600141	兴发集团	7,800	142,350.00	0.24
97	600521	华海药业	9,700	142,299.00	0.24
98	300118	东方日升	8,000	141,200.00	0.24
99	002607	中公教育	34,600	141,168.00	0.24
100	603589	口子窖	3,100	140,430.00	0.24
101	603233	大参林	5,620	139,938.00	0.24
102	600118	中国卫星	5,400	139,428.00	0.24
103	600663	陆家嘴	15,900	139,125.00	0.24
104	002372	伟星新材	9,600	138,912.00	0.24
105	000750	国海证券	39,100	138,414.00	0.24
106	688122	西部超导	2,600	138,398.00	0.24
107	600499	科达制造	13,100	138,205.00	0.23
108	688114	华大智造	1,600	137,632.00	0.23
109	000683	远兴能源	23,300	136,771.00	0.23

110	300604	长川科技	3,600	136,764.00	0.23
111	601928	凤凰传媒	15,400	135,674.00	0.23
112	600598	北大荒	11,200	134,064.00	0.23
113	600536	中国软件	3,689	133,763.14	0.23
114	688052	纳芯微	800	133,480.00	0.23
115	000513	丽珠集团	3,800	133,038.00	0.23
116	601456	国联证券	12,200	132,248.00	0.22
117	600566	济川药业	4,200	132,006.00	0.22
118	600895	张江高科	6,800	131,240.00	0.22
119	603568	伟明环保	8,160	130,560.00	0.22
120	600170	上海建工	55,700	130,338.00	0.22
121	603688	石英股份	1,500	130,320.00	0.22
122	600435	北方导航	11,100	130,314.00	0.22
123	688301	奕瑞科技	400	130,104.00	0.22
124	002195	岩山科技	42,200	129,554.00	0.22
125	000066	中国长城	12,800	129,536.00	0.22
126	002156	通富微电	5,600	129,472.00	0.22
127	002670	国盛金控	13,800	128,616.00	0.22
128	600863	内蒙华电	32,900	128,310.00	0.22
129	300748	金力永磁	6,320	127,790.40	0.22
130	002262	恩华药业	4,700	127,464.00	0.22
131	002407	多氟多	8,320	126,630.40	0.22
132	002064	华峰化学	18,800	126,148.00	0.21
133	300888	稳健医疗	3,380	125,905.00	0.21
134	600839	四川长虹	23,600	124,844.00	0.21
135	002120	韵达股份	16,700	124,582.00	0.21
136	688390	固德威	952	124,312.16	0.21
137	300017	网宿科技	15,800	124,030.00	0.21
138	300251	光线传媒	15,200	123,880.00	0.21
139	601966	玲珑轮胎	6,400	123,072.00	0.21
140	600699	均胜电子	6,800	122,128.00	0.21

141	600160	巨化股份	7,400	122,026.00	0.21
142	600998	九州通	17,222	120,726.22	0.21
143	600906	财达证券	15,900	119,250.00	0.20
144	300568	星源材质	7,700	118,734.00	0.20
145	603596	伯特利	1,700	117,810.00	0.20
146	600416	湘电股份	7,400	117,512.00	0.20
147	603160	汇顶科技	1,700	117,470.00	0.20
148	002531	天顺风能	10,100	117,160.00	0.20
149	300487	蓝晓科技	2,200	116,732.00	0.20
150	601717	郑煤机	9,200	116,380.00	0.20
151	000830	鲁西化工	11,500	115,345.00	0.20
152	002557	洽洽食品	3,300	114,906.00	0.20
153	600977	中国电影	9,300	113,832.00	0.19
154	600131	国网信通	7,500	113,625.00	0.19
155	002653	海思科	4,900	113,435.00	0.19
156	600859	王府井	7,100	113,387.00	0.19
157	688120	华海清科	600	112,620.00	0.19
158	601555	东吴证券	15,400	112,574.00	0.19
159	603000	人民网	4,000	111,920.00	0.19
160	002472	双环传动	4,300	111,886.00	0.19
161	000009	中国宝安	9,500	111,530.00	0.19
162	300058	蓝色光标	15,500	111,290.00	0.19
163	601158	重庆水务	19,600	111,132.00	0.19
164	300212	易华录	3,500	110,075.00	0.19
165	688521	芯原股份	2,200	109,912.00	0.19
166	002203	海亮股份	9,800	109,270.00	0.19
167	600580	卧龙电驱	9,300	109,089.00	0.19
168	600398	海澜之家	14,700	109,074.00	0.19
169	000519	中兵红箭	7,700	108,108.00	0.18
170	688032	禾迈股份	400	108,000.00	0.18
171	002831	裕同科技	3,900	107,289.00	0.18



172	600827	百联股份	11,300	107,237.00	0.18
173	600021	上海电力	12,500	105,750.00	0.18
174	002572	索菲亚	6,600	105,270.00	0.18
175	603816	顾家家居	3,000	105,000.00	0.18
176	601231	环旭电子	6,900	104,259.00	0.18
177	300026	红日药业	24,400	103,456.00	0.18
178	002299	圣农发展	6,000	103,080.00	0.18
179	600004	白云机场	10,500	102,690.00	0.17
180	002625	光启技术	6,900	101,982.00	0.17
181	300003	乐普医疗	6,300	101,808.00	0.17
182	688772	珠海冠宇	4,600	101,246.00	0.17
183	688188	柏楚电子	400	101,244.00	0.17
184	000723	美锦能源	14,900	99,234.00	0.17
185	002558	巨人网络	8,900	99,146.00	0.17
186	601696	中银证券	9,600	98,784.00	0.17
187	688220	翱捷科技	1,400	98,616.00	0.17
188	600380	健康元	7,900	98,197.00	0.17
189	300558	贝达药业	1,900	97,945.00	0.17
190	002925	盈趣科技	5,000	97,350.00	0.17
191	600095	湘财股份	12,900	96,879.00	0.16
192	688029	南微医学	1,000	96,800.00	0.16
193	300861	美畅股份	2,900	96,541.00	0.16
194	605358	立昂微	3,500	95,865.00	0.16
195	000970	中科三环	9,205	95,271.75	0.16
196	002595	豪迈科技	3,200	95,264.00	0.16
197	002326	永太科技	8,100	94,122.00	0.16
198	002281	光迅科技	3,300	94,050.00	0.16
199	000021	深科技	5,800	94,018.00	0.16
200	002080	中材科技	5,900	93,928.00	0.16
201	300024	机器人	7,900	93,773.00	0.16
202	600765	中航重机	4,860	92,874.60	0.16

203	688385	复旦微电	2,400	92,712.00	0.16
204	600143	金发科技	11,600	92,684.00	0.16
205	688234	天岳先进	1,400	92,498.00	0.16
206	688208	道通科技	3,888	92,340.00	0.16
207	002500	山西证券	17,100	92,169.00	0.16
208	600258	首旅酒店	5,900	92,158.00	0.16
209	601139	深圳燃气	13,300	91,637.00	0.16
210	600673	东阳光	12,500	91,625.00	0.16
211	000738	航发控制	4,600	91,540.00	0.16
212	002508	老板电器	4,200	91,476.00	0.16
213	300676	华大基因	1,900	91,200.00	0.15
214	000960	锡业股份	6,300	90,216.00	0.15
215	600535	天士力	5,300	90,206.00	0.15
215	000997	新大陆	4,600	90,206.00	0.15
217	688728	格科微	4,400	90,068.00	0.15
218	000598	兴蓉环境	15,800	89,902.00	0.15
219	601298	青岛港	14,500	89,610.00	0.15
220	688002	睿创微纳	2,000	88,440.00	0.15
221	688082	盛美上海	847	88,435.27	0.15
222	300073	当升科技	2,300	87,860.00	0.15
223	002487	大金重工	3,300	87,846.00	0.15
224	688536	思瑞浦	600	87,780.00	0.15
225	002497	雅化集团	6,700	87,703.00	0.15
226	603885	吉祥航空	7,300	87,600.00	0.15
227	600737	中粮糖业	10,600	87,344.00	0.15
228	002739	万达电影	6,700	87,234.00	0.15
229	688331	荣昌生物	1,400	86,884.00	0.15
230	300601	康泰生物	3,200	86,880.00	0.15
231	002600	领益智造	12,800	86,528.00	0.15
232	002223	鱼跃医疗	2,500	86,450.00	0.15
233	600970	中材国际	9,200	85,928.00	0.15

234	688349	三一重能	3,000	85,860.00	0.15
235	603712	七一二	2,700	85,077.00	0.14
236	603379	三美股份	2,500	85,000.00	0.14
237	001914	招商积余	7,100	84,916.00	0.14
238	601991	大唐发电	35,000	84,700.00	0.14
239	300383	光环新网	8,700	84,564.00	0.14
240	002850	科达利	1,000	84,460.00	0.14
241	300357	我武生物	2,900	84,100.00	0.14
242	688180	君实生物	2,000	83,660.00	0.14
243	600498	烽火通信	4,900	81,536.00	0.14
244	002568	百润股份	3,300	81,213.00	0.14
245	600329	达仁堂	2,400	80,760.00	0.14
246	300373	扬杰科技	2,200	80,740.00	0.14
247	600511	国药股份	2,800	80,136.00	0.14
248	600062	华润双鹤	4,300	79,980.00	0.14
249	002032	苏泊尔	1,500	79,515.00	0.14
250	300595	欧普康视	3,500	79,030.00	0.13
251	000729	燕京啤酒	9,100	78,533.00	0.13
252	600801	华新水泥	6,300	78,309.00	0.13
253	600582	天地科技	14,300	77,792.00	0.13
254	600959	江苏有线	24,400	76,616.00	0.13
255	002056	横店东磁	5,600	75,824.00	0.13
256	002624	完美世界	6,400	75,776.00	0.13
257	000623	吉林敖东	5,000	75,700.00	0.13
258	600528	中铁工业	10,000	74,400.00	0.13
259	300114	中航电测	1,700	74,375.00	0.13
260	300699	光威复材	2,760	73,609.20	0.13
261	688348	昱能科技	600	73,428.00	0.12
262	000959	首钢股份	21,100	73,006.00	0.12
263	603305	旭升集团	3,700	73,001.00	0.12
264	601933	永辉超市	25,700	72,474.00	0.12

265	601156	东航物流	4,900	72,422.00	0.12
266	688779	长远锂科	9,800	71,540.00	0.12
267	003022	联泓新科	3,900	71,409.00	0.12
268	688778	厦钨新能	1,800	71,352.00	0.12
269	689009	九号公司	2,400	71,184.00	0.12
270	601216	君正集团	18,900	70,686.00	0.12
271	688425	铁建重工	17,800	70,666.00	0.12
272	000547	航天发展	8,400	70,308.00	0.12
273	603529	爱玛科技	2,800	70,112.00	0.12
274	300677	英科医疗	3,000	70,080.00	0.12
275	000930	中粮科技	10,500	69,720.00	0.12
276	601636	旗滨集团	10,100	69,084.00	0.12
277	002244	滨江集团	9,500	69,065.00	0.12
278	600879	航天电子	8,900	68,619.00	0.12
279	601778	晶科科技	19,600	68,600.00	0.12
280	300253	卫宁健康	9,500	68,305.00	0.12
281	002683	广东宏大	3,400	68,272.00	0.12
282	000739	普洛药业	4,400	67,716.00	0.11
283	300776	帝尔激光	1,120	67,491.20	0.11
284	600378	昊华科技	2,200	67,056.00	0.11
285	002429	兆驰股份	12,000	66,960.00	0.11
286	603866	桃李面包	8,720	66,795.20	0.11
287	601598	中国外运	12,700	66,548.00	0.11
288	000553	安道麦A	9,500	65,930.00	0.11
289	002294	信立泰	2,000	65,320.00	0.11
290	603267	鸿远电子	1,300	65,260.00	0.11
291	600166	福田汽车	23,900	65,247.00	0.11
292	600563	法拉电子	700	64,820.00	0.11
293	002430	杭氧股份	2,200	64,262.00	0.11
294	601866	中远海发	27,400	64,116.00	0.11
295	002867	周大生	4,200	63,756.00	0.11

296	688063	派能科技	600	63,600.00	0.11
297	600316	洪都航空	3,000	63,510.00	0.11
298	603707	健友股份	4,225	63,375.00	0.11
299	603456	九洲药业	2,600	62,946.00	0.11
300	002373	千方科技	5,600	62,776.00	0.11
301	300438	鹏辉能源	2,200	62,238.00	0.11
302	600995	南网储能	6,300	62,118.00	0.11
303	300866	安克创新	700	62,020.00	0.11
304	002865	钧达股份	800	61,984.00	0.11
305	000537	中绿电	6,400	61,632.00	0.10
306	603127	昭衍新药	2,568	60,887.28	0.10
307	601666	平煤股份	5,200	60,112.00	0.10
308	300529	健帆生物	2,700	60,021.00	0.10
309	300012	华测检测	4,200	59,640.00	0.10
310	002414	高德红外	8,100	59,130.00	0.10
311	603826	坤彩科技	1,000	59,030.00	0.10
312	600109	国金证券	6,500	59,020.00	0.10
313	000878	云南铜业	5,400	58,806.00	0.10
314	688567	孚能科技	3,600	58,716.00	0.10
315	601118	海南橡胶	13,800	58,512.00	0.10
316	002518	科士达	2,100	57,960.00	0.10
317	000089	深圳机场	8,900	57,227.00	0.10
318	603737	三棵树	1,200	57,132.00	0.10
319	603517	绝味食品	2,100	56,406.00	0.10
320	600516	方大炭素	10,700	56,068.00	0.10
321	001286	陕西能源	6,500	55,575.00	0.09
322	601016	节能风电	18,410	55,230.00	0.09
323	688276	百克生物	1,000	54,810.00	0.09
324	688281	华秦科技	400	54,264.00	0.09
325	600348	华阳股份	5,500	53,680.00	0.09
326	688297	中无人机	1,400	53,662.00	0.09

327	603650	彤程新材	1,600	53,280.00	0.09
328	603185	弘元绿能	1,600	53,248.00	0.09
329	601828	美凯龙	13,700	53,019.00	0.09
330	600808	马钢股份	19,000	51,680.00	0.09
331	688107	安路科技	1,400	51,492.00	0.09
332	603927	中科软	1,700	50,966.00	0.09
333	600739	辽宁成大	4,300	50,654.00	0.09
334	600968	海油发展	17,700	50,445.00	0.09
335	002030	达安基因	5,200	50,336.00	0.09
336	600325	华发股份	6,900	49,749.00	0.08
337	688200	华峰测控	400	49,120.00	0.08
338	000050	深天马A	4,600	48,990.00	0.08
339	002019	亿帆医药	3,300	48,774.00	0.08
340	688005	容百科技	1,200	47,760.00	0.08
341	000559	万向钱潮	9,200	47,748.00	0.08
342	600988	赤峰黄金	3,400	47,634.00	0.08
343	002756	永兴材料	900	46,989.00	0.08
344	000591	太阳能	8,400	46,872.00	0.08
345	603317	天味食品	3,500	46,515.00	0.08
346	603056	德邦股份	3,200	46,304.00	0.08
347	600373	中文传媒	3,500	46,130.00	0.08
348	300363	博腾股份	1,800	45,270.00	0.08
349	002153	石基信息	4,594	44,745.56	0.08
350	600707	彩虹股份	6,600	44,550.00	0.08
351	000967	盈峰环境	9,100	43,225.00	0.07
352	600126	杭钢股份	8,100	43,173.00	0.07
353	300244	迪安诊断	1,800	42,858.00	0.07
354	600038	中直股份	1,100	42,383.00	0.07
355	002608	江苏国信	6,400	42,048.00	0.07
356	000785	居然之家	12,700	41,910.00	0.07
357	603858	步长制药	2,400	40,824.00	0.07

358	002268	电科网安	1,800	40,428.00	0.07
359	688387	信科移动	5,600	40,376.00	0.07
360	600764	中国海防	1,600	39,920.00	0.07
361	300146	汤臣倍健	2,300	39,169.00	0.07
362	600928	西安银行	11,700	38,961.00	0.07
363	600637	东方明珠	5,100	38,352.00	0.07
364	300009	安科生物	3,680	37,609.60	0.06
365	300070	碧水源	7,500	37,425.00	0.06
366	603026	胜华新材	800	36,688.00	0.06
367	601108	财通证券	4,700	36,472.00	0.06
368	002791	坚朗五金	900	36,441.00	0.06
369	600925	苏能股份	6,600	36,366.00	0.06
370	600517	国网英大	7,400	35,298.00	0.06
371	000539	粤电力A	7,200	35,208.00	0.06
372	002423	中粮资本	5,200	34,736.00	0.06
373	001203	大中矿业	3,400	34,578.00	0.06
374	601568	北元集团	7,260	34,412.40	0.06
375	688516	奥特维	380	34,390.00	0.06
376	600315	上海家化	1,600	33,888.00	0.06
377	688819	天能股份	1,200	33,504.00	0.06
378	601061	中信金属	4,300	33,153.00	0.06
379	002408	齐翔腾达	6,260	33,052.80	0.06
380	688690	纳微科技	1,200	32,904.00	0.06
381	601958	金钼股份	3,400	32,130.00	0.05
382	600339	中油工程	10,600	32,118.00	0.05
383	688105	诺唯赞	1,000	32,020.00	0.05
384	002240	盛新锂能	1,400	31,850.00	0.05
385	603893	瑞芯微	500	31,700.00	0.05
386	301029	怡合达	1,200	30,936.00	0.05
387	000887	中鼎股份	2,500	30,925.00	0.05
388	600755	厦门国贸	4,400	30,668.00	0.05

389	002092	中泰化学	5,000	30,500.00	0.05
390	688295	中复神鹰	1,000	30,310.00	0.05
391	000636	风华高科	2,200	30,052.00	0.05
392	600271	航天信息	2,800	29,792.00	0.05
393	000958	电投产融	7,500	29,550.00	0.05
394	002010	传化智联	6,300	29,106.00	0.05
395	603786	科博达	400	28,544.00	0.05
396	688006	杭可科技	1,200	28,176.00	0.05
397	003031	中瓷电子	300	26,469.00	0.04
398	688538	和辉光电	10,600	25,758.00	0.04
399	002945	华林证券	1,700	25,670.00	0.04
400	002761	浙江建投	2,500	25,650.00	0.04
401	603338	浙江鼎力	500	25,585.00	0.04
402	300850	新强联	800	25,464.00	0.04
403	002926	华西证券	3,200	24,832.00	0.04
404	601106	中国一重	8,300	23,904.00	0.04
405	601228	广州港	7,400	23,162.00	0.04
406	600390	五矿资本	4,800	22,464.00	0.04
407	001872	招商港口	1,400	22,344.00	0.04
408	300257	开山股份	1,400	22,064.00	0.04
409	600482	中国动力	1,200	21,612.00	0.04
410	688520	神州细胞	400	21,548.00	0.04
411	000703	恒逸石化	3,200	21,504.00	0.04
412	600056	中国医药	1,880	20,999.60	0.04
413	002065	东华软件	3,400	20,978.00	0.04
414	000629	钒钛股份	6,300	20,664.00	0.04
415	600967	内蒙一机	2,400	19,824.00	0.03
416	601608	中信重工	4,900	18,914.00	0.03
417	002563	森马服饰	3,200	18,464.00	0.03
418	688248	南网科技	737	18,402.89	0.03
419	600909	华安证券	3,700	18,056.00	0.03



420	002797	第一创业	3,100	18,011.00	0.03
421	002185	华天科技	2,100	17,892.00	0.03
422	002507	涪陵榨菜	1,200	17,148.00	0.03
423	600481	双良节能	2,000	16,920.00	0.03
424	000987	越秀资本	2,780	16,735.60	0.03
425	002468	申通快递	2,100	16,359.00	0.03
426	003035	南网能源	3,100	16,306.00	0.03
427	688375	国博电子	200	15,906.00	0.03
428	603868	飞科电器	300	15,150.00	0.03
429	601198	东兴证券	1,700	13,991.00	0.02
430	603218	日月股份	1,100	13,607.00	0.02
431	000581	威孚高科	900	13,563.00	0.02
432	688153	唯捷创芯	200	13,100.00	0.02
433	601990	南京证券	1,600	12,768.00	0.02
434	600500	中化国际	2,800	12,376.00	0.02
435	600299	安迪苏	1,500	12,000.00	0.02
436	600167	联美控股	2,000	11,340.00	0.02
437	603355	莱克电气	500	11,150.00	0.02
438	002192	融捷股份	200	10,842.00	0.02
439	000937	冀中能源	1,500	10,710.00	0.02
440	600956	新天绿能	1,300	10,569.00	0.02
441	603077	和邦生物	4,400	10,384.00	0.02
442	600377	宁沪高速	1,000	10,250.00	0.02
443	000027	深圳能源	1,500	9,675.00	0.02
444	002385	大北农	1,600	9,536.00	0.02
445	600008	首创环保	3,200	8,608.00	0.01
446	601168	西部矿业	600	8,562.00	0.01
447	603225	新凤鸣	600	8,520.00	0.01
448	601611	中国核建	1,200	8,316.00	0.01
449	002939	长城证券	1,000	8,000.00	0.01
450	600096	云天化	500	7,800.00	0.01

451	000039	中集集团	1,000	7,650.00	0.01
452	600350	山东高速	1,000	6,940.00	0.01
453	000728	国元证券	1,000	6,830.00	0.01
454	600032	浙江新能	800	6,448.00	0.01
455	002266	浙富控股	1,800	6,120.00	0.01

### 8.3.2 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	601211	国泰君安	36,700	546,096.00	0.93
2	600030	中信证券	26,300	535,731.00	0.91
3	002466	天齐锂业	6,500	362,635.00	0.62
4	601995	中金公司	8,400	319,620.00	0.54
5	600150	中国船舶	6,400	188,416.00	0.32
6	600036	招商银行	6,700	186,394.00	0.32
7	300750	宁德时代	1,140	186,116.40	0.32
8	600584	长电科技	5,500	164,230.00	0.28
9	603989	艾华集团	6,900	148,488.00	0.25
10	002206	海利得	27,000	135,540.00	0.23
11	603323	苏农银行	31,400	130,624.00	0.22
12	600821	金开新能	20,500	125,460.00	0.21
13	600219	南山铝业	42,500	124,950.00	0.21
14	300623	捷捷微电	7,000	111,090.00	0.19
15	601288	农业银行	30,000	109,200.00	0.19
16	601939	建设银行	15,300	99,603.00	0.17
17	603588	高能环境	15,000	98,100.00	0.17
18	601899	紫金矿业	7,800	97,188.00	0.17
19	601658	邮储银行	22,200	96,570.00	0.16
20	300087	荃银高科	11,300	94,694.00	0.16

21	601398	工商银行	19,300	92,254.00	0.16
22	002459	晶澳科技	4,300	89,096.00	0.15
23	600063	皖维高新	20,100	86,430.00	0.15
24	600372	中航机载	6,400	84,352.00	0.14
25	688183	生益电子	7,400	84,138.00	0.14
26	603035	常熟汽饰	4,200	79,254.00	0.13
27	000625	长安汽车	4,500	75,735.00	0.13
28	600993	马应龙	3,100	74,958.00	0.13
29	000063	中兴通讯	2,700	71,496.00	0.12
30	002484	江海股份	4,200	67,452.00	0.11
31	000776	广发证券	4,600	65,734.00	0.11
32	002967	广电计量	4,200	63,042.00	0.11
33	002386	天原股份	12,100	62,436.00	0.11
34	601088	中国神华	1,900	59,565.00	0.10
35	002493	荣盛石化	5,600	57,960.00	0.10
36	600048	保利发展	5,800	57,420.00	0.10
37	603195	公牛集团	600	57,390.00	0.10
38	300308	中际旭创	500	56,455.00	0.10
39	603899	晨光股份	1,500	56,325.00	0.10
40	300054	鼎龙股份	2,300	55,660.00	0.09
41	688036	传音控股	400	55,360.00	0.09
42	601699	潞安环能	2,400	52,584.00	0.09
43	600438	通威股份	2,100	52,563.00	0.09
44	603259	药明康德	700	50,932.00	0.09
45	600183	生益科技	2,700	49,437.00	0.08
46	301087	可孚医疗	1,300	49,270.00	0.08
47	002396	星网锐捷	2,700	48,789.00	0.08
48	300803	指南针	800	48,208.00	0.08
49	600346	恒力石化	3,600	47,412.00	0.08
50	600745	闻泰科技	1,100	46,541.00	0.08
51	600487	亨通光电	3,800	45,372.00	0.08

52	300693	盛弘股份	1,500	44,865.00	0.08
53	603507	振江股份	1,700	44,047.00	0.07
54	000100	TCL科技	10,200	43,860.00	0.07
55	300059	东方财富	3,100	43,524.00	0.07
56	600547	山东黄金	1,900	43,453.00	0.07
57	002332	仙琚制药	3,400	43,418.00	0.07
58	002063	远光软件	7,000	43,260.00	0.07
59	300725	药石科技	1,100	43,197.00	0.07
60	002573	清新环境	8,700	43,065.00	0.07
61	300887	谱尼测试	3,600	42,516.00	0.07
62	603659	璞泰来	2,000	41,860.00	0.07
63	300015	爱尔眼科	2,600	41,132.00	0.07
64	600660	福耀玻璃	1,100	41,129.00	0.07
65	600887	伊利股份	1,500	40,125.00	0.07
66	600711	盛屯矿业	9,200	39,928.00	0.07
67	603799	华友钴业	1,200	39,516.00	0.07
68	600872	中炬高新	1,400	39,340.00	0.07
69	002182	宝武镁业	2,000	39,320.00	0.07
70	601877	正泰电器	1,800	38,718.00	0.07
71	603067	振华股份	3,700	37,703.00	0.06
72	601688	华泰证券	2,700	37,665.00	0.06
73	603678	火炬电子	1,400	37,058.00	0.06
74	688008	澜起科技	600	35,256.00	0.06
75	002475	立讯精密	1,000	34,450.00	0.06
76	002048	宁波华翔	2,600	33,826.00	0.06
77	600760	中航沈飞	800	33,744.00	0.06
78	600216	浙江医药	3,100	33,263.00	0.06
79	601615	明阳智能	2,600	32,604.00	0.06
80	002050	三花智控	1,100	32,340.00	0.05
81	300981	中红医疗	2,000	32,040.00	0.05
82	002938	鹏鼎控股	1,400	31,248.00	0.05

83	600897	厦门空港	2,500	31,225.00	0.05
84	605098	行动教育	800	30,840.00	0.05
85	300294	博雅生物	900	30,312.00	0.05
86	000034	神州数码	1,000	29,910.00	0.05
87	002180	纳思达	1,300	29,419.00	0.05
88	300986	志特新材	2,300	29,279.00	0.05
89	002398	垒知集团	6,000	28,620.00	0.05
90	300226	上海钢联	1,000	28,490.00	0.05
91	000099	中信海直	3,200	28,160.00	0.05
92	688598	金博股份	400	27,960.00	0.05
93	603876	鼎胜新材	2,200	27,566.00	0.05
94	603096	新经典	1,400	27,552.00	0.05
95	600100	同方股份	3,700	27,195.00	0.05
96	002839	张家港行	7,000	27,160.00	0.05
97	600256	广汇能源	3,700	26,418.00	0.04
98	300759	康龙化成	900	26,082.00	0.04
99	600301	华锡有色	2,000	25,160.00	0.04
100	601607	上海医药	1,500	25,095.00	0.04
101	600585	海螺水泥	1,100	24,816.00	0.04
102	601998	中信银行	4,600	24,334.00	0.04
103	300451	创业慧康	3,700	24,235.00	0.04
104	601311	骆驼股份	3,000	24,030.00	0.04
105	000733	振华科技	400	23,536.00	0.04
106	002179	中航光电	600	23,400.00	0.04
107	002057	中钢天源	2,900	23,316.00	0.04
108	300841	康华生物	300	23,262.00	0.04
109	300036	超图软件	1,100	22,990.00	0.04
110	600057	厦门象屿	3,400	22,814.00	0.04
111	600098	广州发展	4,200	22,554.00	0.04
112	600971	恒源煤电	1,900	21,185.00	0.04
113	002639	雪人股份	2,800	21,000.00	0.04

114	300843	胜蓝股份	900	20,682.00	0.04
115	002149	西部材料	1,300	20,436.00	0.03
116	002045	国光电器	1,200	19,980.00	0.03
117	601619	嘉泽新能	5,600	19,768.00	0.03
118	000906	浙商中拓	2,700	19,737.00	0.03
119	601388	怡球资源	7,300	19,126.00	0.03
120	605183	确成股份	1,300	19,019.00	0.03
121	603997	继峰股份	1,400	18,858.00	0.03
122	002555	三七互娱	1,000	18,810.00	0.03
123	600522	中天科技	1,500	18,735.00	0.03
124	000429	粤高速 A	2,200	18,612.00	0.03
125	300833	浩洋股份	200	18,020.00	0.03
126	605166	聚合顺	1,800	17,856.00	0.03
127	688439	振华风光	200	17,822.00	0.03
128	002043	兔宝宝	2,000	17,720.00	0.03
129	300408	三环集团	600	17,670.00	0.03
130	300567	精测电子	200	17,524.00	0.03
131	300274	阳光电源	200	17,518.00	0.03
132	000032	深桑达 A	800	16,944.00	0.03
133	002126	银轮股份	900	16,803.00	0.03
134	688518	联赢激光	800	16,384.00	0.03
135	600741	华域汽车	1,000	16,280.00	0.03
136	688800	瑞可达	400	16,072.00	0.03
137	000059	华锦股份	2,900	15,921.00	0.03
138	000657	中钨高新	1,800	15,264.00	0.03
139	603699	纽威股份	1,100	15,246.00	0.03
140	605208	永茂泰	1,600	15,200.00	0.03
141	600803	新奥股份	900	15,138.00	0.03
142	603368	柳药集团	800	15,136.00	0.03
143	000001	平安银行	1,600	15,024.00	0.03
144	400174	中天3	37,500	15,000.00	0.03

145	601399	国机重装	5,300	14,999.00	0.03
146	688222	成都先导	1,000	14,990.00	0.03
147	000848	承德露露	1,900	14,915.00	0.03
148	000538	云南白药	300	14,745.00	0.03
149	688232	新点软件	400	14,480.00	0.02
150	002438	江苏神通	1,200	14,340.00	0.02
151	300737	科顺股份	2,300	14,122.00	0.02
152	605376	博迁新材	500	14,100.00	0.02
153	600489	中金黄金	1,400	13,944.00	0.02
154	300910	瑞丰新材	300	13,782.00	0.02
155	002829	星网宇达	500	13,520.00	0.02
156	002311	海大集团	300	13,473.00	0.02
157	603611	诺力股份	700	13,251.00	0.02
158	600933	爱柯迪	600	13,164.00	0.02
159	002832	比音勒芬	400	12,680.00	0.02
160	000708	中信特钢	900	12,636.00	0.02
161	600456	宝钛股份	400	12,556.00	0.02
162	603301	振德医疗	500	12,250.00	0.02
163	300122	智飞生物	200	12,222.00	0.02
164	601019	山东出版	1,300	12,194.00	0.02
165	600285	羚锐制药	700	11,977.00	0.02
166	603901	永创智能	1,000	11,900.00	0.02
167	603300	华铁应急	1,800	11,520.00	0.02
168	603416	信捷电气	300	11,268.00	0.02
169	002949	华阳国际	800	11,176.00	0.02
170	002389	航天彩虹	600	11,160.00	0.02
171	603100	川仪股份	400	11,088.00	0.02
172	600562	国睿科技	800	11,072.00	0.02
173	603279	景津装备	500	11,055.00	0.02
174	001965	招商公路	1,100	10,747.00	0.02
175	002706	良信股份	1,200	10,596.00	0.02

176	600938	中国海油	500	10,485.00	0.02
177	002436	兴森科技	700	10,311.00	0.02
178	000902	新洋丰	900	10,251.00	0.02
179	002001	新和成	600	10,176.00	0.02
180	603018	华设集团	1,300	9,880.00	0.02
181	603565	中谷物流	1,200	9,876.00	0.02
182	002003	伟星股份	900	9,765.00	0.02
183	605305	中际联合	300	9,693.00	0.02
184	600111	北方稀土	500	9,670.00	0.02
185	603995	甬金股份	500	9,615.00	0.02
186	601369	陕鼓动力	1,200	9,576.00	0.02
187	600361	创新新材	1,900	9,519.00	0.02
188	002790	瑞尔特	900	9,396.00	0.02
189	600419	天润乳业	800	9,384.00	0.02
190	603191	望变电气	600	9,318.00	0.02
191	603986	兆易创新	100	9,239.00	0.02
192	002675	东诚药业	500	9,165.00	0.02
193	002841	视源股份	200	9,152.00	0.02
194	600926	杭州银行	900	9,009.00	0.02
195	300596	利安隆	300	8,868.00	0.02
196	300642	透景生命	500	8,825.00	0.01
197	601965	中国汽研	400	8,824.00	0.01
198	601333	广深铁路	3,400	8,806.00	0.01
199	600295	鄂尔多斯	900	8,730.00	0.01
200	600479	千金药业	800	8,616.00	0.01
201	000501	武商集团	1,000	8,520.00	0.01
202	688658	悦康药业	400	8,344.00	0.01
203	601827	三峰环境	1,100	8,261.00	0.01
204	603915	国茂股份	500	8,240.00	0.01
205	603108	润达医疗	400	8,140.00	0.01
206	300796	贝斯美	500	8,050.00	0.01



207	000983	山西焦煤	800	7,904.00	0.01
208	600509	天富能源	1,200	7,812.00	0.01
209	603380	易德龙	300	7,683.00	0.01
210	605377	华旺科技	400	7,636.00	0.01
211	600567	山鹰国际	3,900	7,566.00	0.01
212	300762	上海瀚讯	500	7,540.00	0.01
213	600581	八一钢铁	2,100	7,539.00	0.01
214	688159	有方科技	200	7,530.00	0.01
215	600600	青岛啤酒	100	7,475.00	0.01
216	601500	通用股份	1,800	7,452.00	0.01
217	600989	宝丰能源	500	7,385.00	0.01
218	000002	万科A	700	7,322.00	0.01
219	600236	桂冠电力	1,300	7,202.00	0.01
220	002749	国光股份	600	7,188.00	0.01
221	002916	深南电路	100	7,099.00	0.01
222	002746	仙坛股份	1,000	7,040.00	0.01
223	301035	润丰股份	100	7,000.00	0.01
224	603833	欧派家居	100	6,961.00	0.01
225	002415	海康威视	200	6,944.00	0.01
226	000338	潍柴动力	500	6,825.00	0.01
227	301122	采纳股份	200	6,772.00	0.01
228	600795	国电电力	1,600	6,656.00	0.01
229	002597	金禾实业	300	6,573.00	0.01
230	300982	苏文电能	200	6,568.00	0.01
231	300687	赛意信息	300	6,534.00	0.01
232	601225	陕西煤业	300	6,267.00	0.01
233	002873	新天药业	500	6,230.00	0.01
234	600802	福建水泥	1,200	6,216.00	0.01
235	605108	同庆楼	200	6,088.00	0.01
236	300837	浙矿股份	200	5,974.00	0.01
237	002271	东方雨虹	300	5,760.00	0.01

238	603987	康德莱	600	5,724.00	0.01
239	300430	诚益通	400	5,716.00	0.01
240	601677	明泰铝业	500	5,670.00	0.01
241	000951	中国重汽	400	5,344.00	0.01
242	603351	威尔药业	200	5,274.00	0.01
243	300258	精锻科技	400	5,168.00	0.01
244	603179	新泉股份	100	5,071.00	0.01
245	002291	遥望科技	500	4,690.00	0.01
246	605009	豪悦护理	100	3,817.00	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	601128	常熟银行	1,232,173.00	1.95
2	300750	宁德时代	1,061,426.28	1.68
3	603885	吉祥航空	1,051,178.00	1.66
4	002966	苏州银行	1,036,853.00	1.64
5	002594	比亚迪	1,030,759.00	1.63
6	600298	安琪酵母	1,028,187.00	1.63
7	000932	华菱钢铁	1,004,995.00	1.59
8	600879	航天电子	999,081.00	1.58
9	000975	银泰黄金	993,832.00	1.57
10	002179	中航光电	980,782.00	1.55
11	002273	水晶光电	973,351.00	1.54
12	300144	宋城演艺	956,504.00	1.51
13	601108	财通证券	920,464.00	1.46
14	002028	思源电气	917,140.00	1.45
15	600566	济川药业	886,031.00	1.40

16	600642	申能股份	872,660.00	1.38
17	600820	隧道股份	867,827.00	1.37
18	600862	中航高科	847,060.00	1.34
19	600483	福能股份	839,593.00	1.33
20	600161	天坛生物	828,061.00	1.31

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	002273	水晶光电	1,418,374.00	2.24
2	002966	苏州银行	1,188,503.30	1.88
3	002594	比亚迪	1,128,885.00	1.79
4	601108	财通证券	1,123,424.00	1.78
5	601128	常熟银行	1,091,307.00	1.73
6	300144	宋城演艺	1,044,955.00	1.65
7	002179	中航光电	1,040,594.50	1.65
8	000975	银泰黄金	1,005,812.00	1.59
9	600879	航天电子	1,002,243.00	1.59
10	000932	华菱钢铁	946,092.00	1.50
11	603885	吉祥航空	941,302.00	1.49
12	000807	云铝股份	936,702.00	1.48
13	600566	济川药业	922,036.00	1.46
14	300308	中际旭创	885,441.00	1.40
15	600298	安琪酵母	870,872.00	1.38
16	600377	宁沪高速	848,200.00	1.34
17	600820	隧道股份	846,862.00	1.34
18	300750	宁德时代	846,180.00	1.34
19	002028	思源电气	836,657.00	1.32

20	601088	中国神华	831,815.00	1.32
----	--------	------	------------	------

注："卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 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	203,525,788.66
卖出股票收入（成交）总额	202,011,767.62

注："买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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)	2,300.17	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,300.17	0.00

### 8.6 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	127100	神码转债	23	2,300.17	0.00

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。

本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	139,422.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,422.42

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
中泰中证500指数增强A	1,232	10,770.32	999,560.32	7.53%	12,269,477.47	92.47%
中泰中证500指数增强C	4,326	8,455.37	536.76	0.00%	36,577,389.40	100.00%
合计	5,558	8,968.51	1,000,097.08	2.01%	48,846,866.87	97.99%

本表列示"占总份额比例"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。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中泰中证500指数增强A	99,344.11	0.75%
	中泰中证500指数增强C	11,164.01	0.03%
	合计	110,508.12	0.22%

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。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	中泰中证500指数增强A	0
	中泰中证500指数增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中泰中证500指数增强A	0
	中泰中证500指数增强C	0
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金。  
2、期末本基金的基金经理未持有本基金。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C
--	--------------	--------------

基金合同生效日(2019年12月11日)基金份额总额	107,120,144.91	190,368,684.73
本报告期期初基金份额总额	12,838,649.21	36,650,278.96
本报告期基金总申购份额	3,769,161.49	10,984,939.15
减：本报告期基金总赎回份额	3,338,772.91	11,057,291.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,269,037.79	36,577,926.16

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

自2023年4月11日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金2023年12月12日更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)更换为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币40,000.00元。

目前毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)向本基金提供审计服务的连续年限：本报告期。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况



本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中泰证券	3	405,288,569.52	100.00%	91,934.67	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	22,359.38	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	中泰中证500指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定网站	2023-01-20
2	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金	上海证券报、中国证监会规定网站	2023-02-17

	新增宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售渠道并参加费率优惠活动的公告		
3	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增平安证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2023-03-07
4	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2023-03-14
5	中泰中证500指数增强型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定网站	2023-03-28
6	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定网站	2023-04-20
7	中泰中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2023-05-18
8	中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2023年第1号	中国证监会规定网站	2023-05-18
9	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会规定网站	2023-07-20
10	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年中期报告	中国证监会规定网站	2023-08-29
11	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会规定网站	2023-10-25
12	中泰证券（上海）资产管理	上海证券报、中国证监会规	2023-12-14

	有限公司关于旗下部分基金 改聘会计师事务所的公告	定网站	
--	-----------------------------	-----	--

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰中证500指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰中证500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-821-0808

网站：<https://www.ztzqzg.com/>

中泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二四年三月二十六日