

---

# 中泰中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 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:2025 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2025年3月24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2024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.....	5
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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
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.....	18
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.....	18
§5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告.....	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80
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.....	81
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.....	81
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.....	81
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.....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	81

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
§9 基金份额持有人信息 .....	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
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 .....	83
§10 开放式基金份额变动 .....	83
§11 重大事件揭示 .....	84
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
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 .....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8 其他重大事件 .....	85
§12 备查文件目录 .....	86
12.1 备查文件目录 .....	86
12.2 存放地点 .....	86
12.3 查阅方式 .....	86

## §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	50,519,428.75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	14,634,601.82份	35,884,826.93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	冯萌
	联系电话	021-20521199	021-52629999-213310
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	fengmeng@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	2024年		2023年		2022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	150,168.85	-237,473.79	-1,388,938.32	-4,037,980.32	-2,108,549.70	-6,582,508.84
本期利润	1,342,534.51	2,147,945.03	-1,154,543.45	-3,389,862.22	-2,917,614.80	-9,260,992.49
加权平均基金份额本期利润	0.0997	0.0603	-0.0907	-0.0937	-0.2497	-0.2634
本期加权平均净值利润率	8.48%	5.23%	-6.92%	-7.25%	-18.42%	-19.60%
本期基金份额净值增长率	5.75%	5.32%	-7.22%	-7.59%	-17.19%	-17.52%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	3,864,589.90	8,567,567.65	2,593,316.43	6,444,487.92	3,702,991.69	9,996,581.43
期末可供分配基金份额利润	0.2641	0.2388	0.1954	0.1762	0.2884	0.2728
期末基金资产净值	18,499,191.72	44,452,394.58	15,862,354.22	43,022,414.08	16,541,640.90	46,646,860.39
期末基金份额净值	1.2641	1.2388	1.1954	1.1762	1.2884	1.2728
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	26.41%	23.88%	19.54%	17.62%	28.84%	27.28%

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	-0.95%	1.83%	-0.23%	1.93%	-0.72%	-0.10%
过去六个月	12.79%	1.82%	15.14%	1.91%	-2.35%	-0.09%
过去一年	5.75%	1.64%	5.40%	1.73%	0.35%	-0.09%
过去三年	-18.75%	1.26%	-20.91%	1.33%	2.16%	-0.07%
过去五年	23.46%	1.24%	8.93%	1.31%	14.53%	-0.07%
自基金合同生效起至今	26.41%	1.24%	13.41%	1.30%	13.00%	-0.06%

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	-1.05%	1.83%	-0.23%	1.93%	-0.82%	-0.10%
过去六个月	12.57%	1.82%	15.14%	1.91%	-2.57%	-0.09%
过去一年	5.32%	1.64%	5.40%	1.73%	-0.08%	-0.09%
过去三年	-19.73%	1.26%	-20.91%	1.33%	1.18%	-0.07%
过去五年	21.01%	1.24%	8.93%	1.31%	12.08%	-0.07%
自基金合同生效起至今	23.88%	1.24%	13.41%	1.30%	10.47%	-0.06%

#### 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-2024年12月31日)



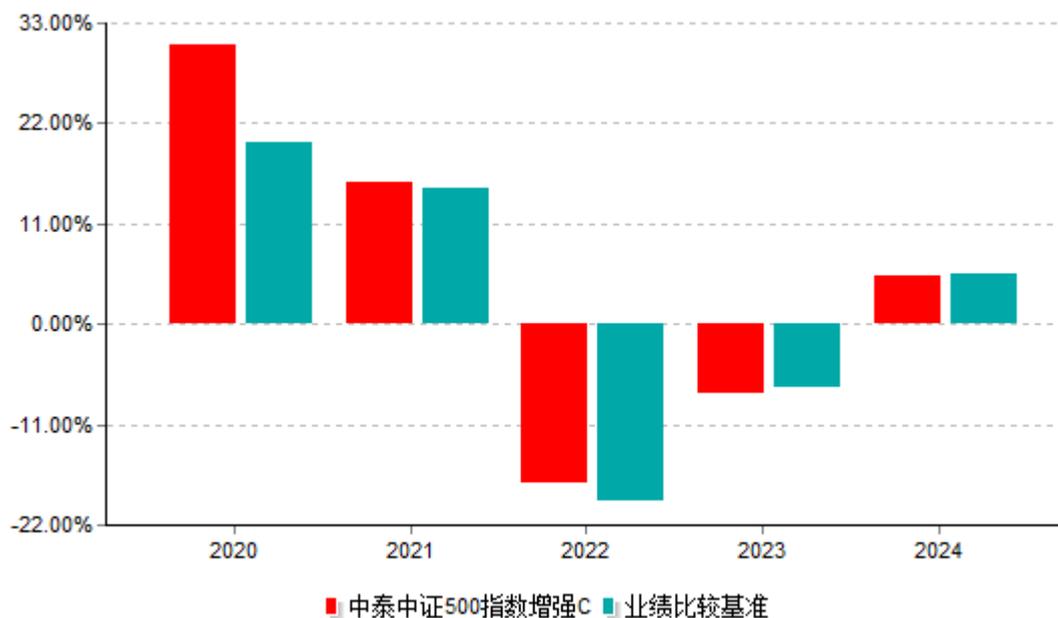
中泰中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月11日-2024年12月31日)



### 3.2.3 过去五年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

本基金过去三年未实施利润分配。

## §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2024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、中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中泰ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金、中泰福瑞稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金和中泰安弘债券型证券投资基金共31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；中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理；量化公募投资部副总经理。	2019-12-11	-	20	国籍：中国。学历：华东师范大学硕士研究生。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，历任对冲基金部副总经理、基金业务部副总经理，现任量化公募投资部副总经理。2019年12月11日至今担任中泰中证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。2024年6月4日至今担任中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。
李玉刚	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；中泰研究精选6个月持有期股票	2022-01-04	-	23	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

	型证券投资基金基金经理；中泰ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理；研究部总经理兼量化公募投资部总经理。			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，历任对冲基金部总经理、研究部总经理，现任研究部总经理兼量化公募投资部总经理。2022年1月4日至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金和中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理。2022年1月4日至2024年12月25日期间担任沪深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。2024年1月23日至今担任中泰ESG主题6个月持有期混合型发起式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。

#### 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，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

2024年，中证500指数在上半年的五月之前呈现出温和的上涨趋势。然而，随后市场转冷，中证500指数也开始缓慢下滑。直至三季度末，随着一系列组合经济刺激政策的出台，指数在短短几天内连续大幅上涨，并创下了年内的最高点。此后，指数虽短暂回落，但整个四季度呈现出一种震荡的走势。年初时，指数为5429.23点，年末收盘时则为5725.73点，相较于年初略有上涨。全年指数的波动率为28.3%，较上年度有明显提升，这主要是由于三季度末的剧烈震荡所致。

按照中证指数的行业分类来看，2024年中证500指数的成分股中，通信、金融与地产行业涨幅较大，而医药与消费行业则出现了下跌。

在本年度的基金运作过程中，我们基本保持了以往的投资策略，并在主动选股的方法上进行了一定的调整，旨在在不增加跟踪误差的前提下，为选择更具增长潜力的股票提供更多的操作空间。从基金实际运作的结果来看，我们采用的统计量化方式在控制跟踪误差方面依然取得了成功，投资组合的跟踪误差本年度一直保持在极低的水平。然而，

获取超额收益依旧困难重重。与去年相似，上半年我们优化超配的股票获得了一定的超额收益。但进入下半年后，随着市场风格的转换，我们的投资组合又逐渐弱于比较基准，未能创造出超额收益。在未来的投资实践中，我们将继续加强对中证500指数约束下的优选个股的研究，这依然是我们工作的重点所在。

#### 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1.2641元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.75%，同期业绩比较基准收益率为5.40%；截至报告期末中泰中证500指数增强C基金份额净值为1.2388元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.32%，同期业绩比较基准收益率为5.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

居民财富和经济增长来源于个体间自由交换的不断拓展。一个保护个体产权、社会分工持续深化的经济体，其经济增长和居民财富是持续向上的。这是权益投资的最终收益来源。本基金希望通过“以合理的价格、分散化的持有能持续创造价值的优秀公司”，来分享国家经济增长的成果，并实现基金资产的增值。

但是，宏观变量并非本基金投资决策的依赖变量。大部分的宏观经济事件是一个很长的因果链条，反映的是一系列的事件和可能性，任何一个环节的微小变动，都有可能导向完全不同的结果。基于宏观变量进行的判断，往往是不可靠的。

对具体公司和具体生意的研究，更有客观性和科学性，由此得出的判断更有决策价值。相比于担忧经济接下会怎样，我们更关心在逆境中哪些公司会变得更强大。

#### 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、新股网下申购、员工行为管理、关联交易、债券交易等业务开展了专项稽核，对专项稽核中发现的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2502292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	<p>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2024年12月31日的资产负债表、2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
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	<p>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2024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。</p> <p>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</p>

	<p>论。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>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值处置。</p> <p>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。</p>

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	谢晶菁
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	2025-03-24	

## §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：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	5,316,337.46	3,622,680.56
结算备付金		412,964.96	379,599.25
存出保证金		137,270.40	-
交易性金融资产	7.4.7.2	57,279,484.09	55,195,693.10
其中：股票投资		57,279,484.09	55,193,392.93
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		160,457.62	139,422.42

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		63,306,514.53	59,337,395.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023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		234,584.30	140,316.72
应付管理人报酬		27,243.08	25,090.04
应付托管费		2,724.30	2,509.00
应付销售服务费		15,366.06	14,699.40
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	75,010.49	270,011.87
负债合计		354,928.23	452,627.03
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	50,519,428.75	49,846,963.95
未分配利润	7.4.7.8	12,432,157.55	9,037,804.35
净资产合计		62,951,586.30	58,884,768.30
负债和净资产总计		63,306,514.53	59,337,395.33

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额50,519,428.75份，其中A类份额14,634,601.82份，C类份额35,884,826.93份。A类份额净值1.2641元，C类份额净值1.2388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：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		4,275,152.82	-3,686,371.25
1.利息收入		28,622.79	30,267.67
其中：存款利息收入	7.4.7.9	28,622.79	30,267.67
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)		642,824.80	-4,611,958.75
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-683,341.82	-5,549,259.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,295.63	3,357.98
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	185,616.96	-
股利收益	7.4.7.13	1,139,254.03	933,942.77
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	7.4.7.14	3,577,784.48	882,512.97
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	25,920.75	12,806.86
<b>减：二、营业总支出</b>		784,673.28	858,034.42

1.管理人报酬	7.4.10.2.1	284,624.46	317,647.70
2.托管费	7.4.10.2.2	28,462.43	31,764.78
3.销售服务费	7.4.10.2.3	164,243.60	187,326.94
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		800.39	-
8.其他费用	7.4.7.16	306,542.40	321,295.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,490,479.54	-4,544,405.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,490,479.54	-4,544,405.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,490,479.54	-4,544,405.67

### 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：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024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	49,846,963.95	9,037,804.35	58,884,768.30
二、本期期初净资产	49,846,963.95	9,037,804.35	58,884,768.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填	672,464.80	3,394,353.20	4,066,818.00

列)			
(一)、综合收益总额	-	3,490,479.54	3,490,479.54
(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)	672,464.80	-96,126.34	576,338.46
其中: 1.基金申购款	20,410,742.99	3,853,537.74	24,264,280.73
2.基金赎回款	-19,738,278.19	-3,949,664.08	-23,687,942.27
(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	50,519,428.75	12,432,157.55	62,951,586.30
项目	上年度可比期间 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	358,035.78	-117,363.10	240,672.68

产减少以“-”号填列)			
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、本期期末净资产	49,846,963.95	9,037,804.35	58,884,768.30

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2025年3月24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要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况、2024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份额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。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，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。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	3,406,137.12	1,607,796.31
等于：本金	3,405,779.88	1,607,615.27
加：应计利息	357.24	181.04
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	1,910,200.34	2,014,884.25
等于：本金	1,909,747.74	2,014,549.49
加：应计利息	452.60	334.76
减：坏账准备	-	-
合计	5,316,337.46	3,622,680.56

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 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	55,486,822.10	-	57,279,484.09	1,792,661.99
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	55,486,822.10	-	57,279,484.09	1,792,661.99
项目	上年度末 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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,170,760.00	-	-	-
--股指期货	1,170,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,170,760.00	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2501	IC2501	1.00	1,143,920.00	-26,840.00

合计				-26,840.00
减：可抵销 期货暂收 款				-26,840.00
净额				-

#### 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10.49	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	25,000.00	40,000.00
指数使用费	50,000.00	150,000.00
预提费用-信息披露费	-	80,000.00
合计	75,010.49	270,011.87

#### 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 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,269,037.79	13,269,037.79
本期申购	6,092,348.01	6,092,348.01
本期赎回(以“-”号填列)	-4,726,783.98	-4,726,783.98
本期末	14,634,601.82	14,634,601.82

## 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 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	36,577,926.16	36,577,926.16
本期申购	14,318,394.98	14,318,394.98
本期赎回(以“-”号填列)	-15,011,494.21	-15,011,494.21
本期末	35,884,826.93	35,884,826.93

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 (中泰中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,780,204.57	-1,186,888.14	2,593,316.43
本期期初	3,780,204.57	-1,186,888.14	2,593,316.43
本期利润	150,168.85	1,192,365.66	1,342,534.51
本期基金份额交易产生的变动数	234,346.24	-305,607.28	-71,261.04
其中：基金申购款	1,282,674.89	-382,391.90	900,282.99

基金赎回款	-1,048,328.65	76,784.62	-971,544.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,164,719.66	-300,129.76	3,864,589.90

#### 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	9,691,248.64	-3,246,760.72	6,444,487.92
本期期初	9,691,248.64	-3,246,760.72	6,444,487.92
本期利润	-237,473.79	2,385,418.82	2,147,945.03
本期基金份额交易产生的变动数	-129,819.06	104,953.76	-24,865.30
其中：基金申购款	2,988,903.73	-35,648.98	2,953,254.75
基金赎回款	-3,118,722.79	140,602.74	-2,978,120.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,323,955.79	-756,388.14	8,567,567.65

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	6,126.71	8,258.83
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	17,309.83	15,446.57
结算备付金利息收入	5,186.25	6,562.27
其他	-	-
合计	28,622.79	30,267.67

#### 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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	210,724,641.56	202,011,767.62
减：卖出股票成本总额	211,185,155.12	207,279,479.34
减：交易费用	222,828.26	281,547.78
买卖股票差价收入	-683,341.82	-5,549,259.50

#### 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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	2.17	2.94
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	1,293.46	3,355.04
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	1,295.63	3,357.98

##### 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 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	19,597.15	22,359.38

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,300.00	19,000.00
减：应计利息总额	2.34	2.77
减：交易费用	1.35	1.57
买卖债券差价收入	1,293.46	3,355.04

#### 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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
期货投资	185,616.96	-

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
股票投资产生的股利收益	1,139,254.03	933,942.77
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,139,254.03	933,942.77

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	3,604,624.48	882,512.97
——股票投资	3,604,624.48	882,512.97
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-26,840.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-26,840.00	-
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	3,577,784.48	882,512.97

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	25,734.32	12,697.35
其他	3.00	-
基金转换费收入	183.43	109.51
合计	25,920.75	12,806.86

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	25,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
汇划手续费	1,507.33	1,295.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
存托服务费	35.07	-

合计	306,542.40	321,295.00
----	------------	------------

#### 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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	420,391,263.36	100.00%	405,288,569.52	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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	19,597.15	100.00%	22,359.38	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 2024年01月01日至2024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	90,497.79	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

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。

2.2024年7月1日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自2024年7月1日起，佣金协议的服务范围不再包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	284,624.46	317,647.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	114,499.03	127,073.02
应支付基金管理人的净管理费	170,125.43	190,574.68

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 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,462.43	31,764.78

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 2024年01月01日至2024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	2,330.72	2,330.72
中泰证券	0.00	143,014.01	143,014.01
中泰资管	0.00	150.11	150.11
合计	0.00	145,494.84	145,494.84

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023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	6.83%	7.53%

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
	2024年01月01日至 2024年12月31日	2023年01月01日至 2023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%

注：1、关联方投资本基金适用的费率按照公告的费率条款执行，符合本基金法律文件约定。

2、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。

#### 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	
	2024年01月01日至2024年12月31日		2023年01月01日至2023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	3,406,137.12	6,126.71	1,607,796.31	8,258.83
中泰证券	1,910,200.34	17,309.83	2,014,884.25	15,446.57

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（2024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

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

##### 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
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。于本报告期末，本基金无债券投资。

#### 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 2024年12月31日	上年度末 2023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。

##### 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%。本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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 2024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	5,316,337.46	-	-	-	-	-	5,316,337.46
结算备付金	412,964.96	-	-	-	-	-	412,964.96
存出保证金	-	-	-	-	-	137,270.40	137,270.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	57,279,484.09	57,279,484.09
应收申购款	-	-	-	-	-	160,457.62	160,457.62
资产总计	5,729,302.42	-	-	-	-	57,577,212.11	63,306,514.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	234,584.30	234,584.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,243.08	27,243.08
应付托管费	-	-	-	-	-	2,724.30	2,724.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,366.06	15,366.06
其他负债	-	-	-	-	-	75,010.49	75,010.49
负债总计	-	-	-	-	-	354,928.23	354,928.23
利率敏感度缺口	5,729,302.42	-	-	-	-	57,222,283.88	62,951,586.30
上年度末 2023年12月31 日							
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

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，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，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 2024年12月31日		上年度末 2023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	57,279,484.09	90.99	55,193,392.93	93.73
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	57,279,484.09	90.99	55,195,693.10	93.74

#### 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系数来衡量股票及基金投资的系统性风险，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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	比较基准上升5%	3,492,567.75	2,346,706.31
比较基准下降5%	-3,492,567.75	-2,346,706.31	

## 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	57,264,484.09	55,163,128.93
第二层次	15,000.00	32,564.17
第三层次	-	-
合计	57,279,484.09	55,195,693.10

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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（2023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	57,279,484.09	90.48
	其中：股票	57,279,484.09	90.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,729,302.42	9.05
8	其他各项资产	297,728.02	0.47
9	合计	63,306,514.53	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	320,378.00	0.51
B	采矿业	942,730.00	1.50
C	制造业	31,726,046.82	50.40
D	电力、热力、燃气及水生	1,659,592.70	2.64

	产和供应业		
E	建筑业	633,272.00	1.01
F	批发和零售业	1,583,860.00	2.52
G	交通运输、仓储和邮政业	521,379.00	0.83
H	住宿和餐饮业	113,846.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,939,641.41	7.85
J	金融业	4,814,526.60	7.65
K	房地产业	486,301.00	0.77
L	租赁和商务服务业	486,464.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	486,320.97	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	237,736.80	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	327,685.40	0.52
R	文化、体育和娱乐业	589,863.00	0.94
S	综合	22,580.00	0.04
	合计	49,892,223.70	79.25

### 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	20,354.00	0.03
B	采矿业	394,875.00	0.63
C	制造业	4,675,066.72	7.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	231,531.00	0.37
E	建筑业	192,858.00	0.31
F	批发和零售业	106,692.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	325,676.00	0.52

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	184,802.83	0.29
J	金融业	945,243.00	1.50
K	房地产业	67,274.00	0.11
L	租赁和商务服务业	4,921.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	160,746.84	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	77,220.00	0.12
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	7,387,260.39	11.73

### 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	002625	光启技术	12,700	607,060.00	0.96
2	600418	江淮汽车	14,500	543,750.00	0.86
3	002273	水晶光电	20,600	457,732.00	0.73
4	301236	软通动力	7,200	422,712.00	0.67
5	002966	苏州银行	51,000	413,610.00	0.66
6	688536	思瑞浦	4,400	407,000.00	0.65

7	300002	神州泰岳	32,500	376,675.00	0.60
8	000683	远兴能源	67,200	375,648.00	0.60
9	601128	常熟银行	49,000	370,930.00	0.59
10	002472	双环传动	11,500	352,130.00	0.56
11	300037	新宙邦	9,100	340,704.00	0.54
12	000034	神州数码	9,700	339,985.00	0.54
13	601456	国联证券	25,000	338,000.00	0.54
14	600536	中国软件	7,149	333,786.81	0.53
15	600765	中航重机	16,200	331,614.00	0.53
16	002156	通富微电	11,000	325,050.00	0.52
17	600497	驰宏锌锗	56,100	312,477.00	0.50
18	688120	华海清科	1,895	308,866.05	0.49
19	002797	第一创业	36,400	303,940.00	0.48
20	600177	雅戈尔	34,100	303,490.00	0.48
21	600642	申能股份	31,500	298,935.00	0.47
22	000932	华菱钢铁	71,200	297,616.00	0.47
23	002738	中矿资源	8,360	296,780.00	0.47
24	002152	广电运通	25,400	296,164.00	0.47
25	002850	科达利	3,000	293,040.00	0.47
26	600352	浙江龙盛	28,200	290,178.00	0.46
27	600839	四川长虹	29,400	283,710.00	0.45
28	600153	建发股份	26,800	281,936.00	0.45
29	000883	湖北能源	56,300	280,374.00	0.45
30	002138	顺络电子	8,800	277,024.00	0.44
31	600988	赤峰黄金	17,700	276,297.00	0.44
32	601099	太平洋	62,900	267,954.00	0.43
33	600511	国药股份	7,800	266,916.00	0.42
34	002353	杰瑞股份	7,200	266,328.00	0.42
35	002409	雅克科技	4,500	260,775.00	0.41
36	002756	永兴材料	6,900	260,268.00	0.41
37	000988	华工科技	6,000	259,800.00	0.41

38	600529	山东药玻	9,900	255,123.00	0.41
39	600096	云天化	10,900	243,070.00	0.39
40	600885	宏发股份	7,600	241,832.00	0.38
41	600298	安琪酵母	6,700	241,535.00	0.38
42	603444	吉比特	1,100	240,724.00	0.38
43	002444	巨星科技	7,400	239,390.00	0.38
44	002078	太阳纸业	16,000	237,920.00	0.38
45	601233	桐昆股份	20,100	237,180.00	0.38
46	000738	航发控制	10,600	235,744.00	0.37
47	300395	菲利华	6,200	233,182.00	0.37
48	002384	东山精密	7,900	230,680.00	0.37
49	002185	华天科技	19,600	227,556.00	0.36
50	300373	扬杰科技	5,200	226,304.00	0.36
51	300866	安克创新	2,300	224,572.00	0.36
52	600704	物产中大	44,200	223,652.00	0.36
53	000887	中鼎股份	17,000	223,040.00	0.35
54	600486	扬农化工	3,810	220,484.70	0.35
55	002223	鱼跃医疗	6,000	218,940.00	0.35
56	600282	南钢股份	45,600	213,864.00	0.34
57	300803	指南针	2,200	211,090.00	0.34
58	603606	东方电缆	4,000	210,200.00	0.33
59	300339	润和软件	4,100	205,123.00	0.33
60	603129	春风动力	1,300	204,191.00	0.32
61	300024	机器人	11,200	201,040.00	0.32
62	300474	景嘉微	2,150	201,003.50	0.32
63	600820	隧道股份	27,700	199,163.00	0.32
64	600879	航天电子	22,000	197,120.00	0.31
65	600737	中粮糖业	19,300	197,053.00	0.31
66	300136	信维通信	7,700	195,888.00	0.31
67	600801	华新水泥	16,000	193,600.00	0.31
68	002085	万丰奥威	10,200	193,290.00	0.31

69	601933	永辉超市	30,400	192,736.00	0.31
70	688578	艾力斯	3,175	190,182.50	0.30
71	002465	海格通信	17,300	189,954.00	0.30
72	000066	中国长城	12,800	186,496.00	0.30
73	600582	天地科技	30,100	186,018.00	0.30
74	300207	欣旺达	8,300	185,173.00	0.29
75	002195	岩山科技	46,300	183,811.00	0.29
76	002244	滨江集团	21,300	183,393.00	0.29
77	002831	裕同科技	6,700	181,570.00	0.29
78	000783	长江证券	26,600	181,412.00	0.29
79	300383	光环新网	12,400	180,916.00	0.29
80	603589	口子窖	4,600	180,504.00	0.29
81	000831	中国稀土	6,400	179,520.00	0.29
82	603605	珀莱雅	2,100	177,870.00	0.28
83	002008	大族激光	7,100	177,500.00	0.28
84	002281	光迅科技	3,400	177,378.00	0.28
85	002436	兴森科技	15,900	176,649.00	0.28
86	600378	昊华科技	6,100	176,351.00	0.28
87	603298	杭叉集团	9,800	175,322.00	0.28
88	600863	内蒙华电	40,300	174,499.00	0.28
89	688777	中控技术	3,504	174,043.68	0.28
90	002262	恩华药业	7,100	172,885.00	0.27
91	300496	中科创达	2,900	172,724.00	0.27
92	600369	西南证券	36,800	171,856.00	0.27
93	600873	梅花生物	17,100	171,513.00	0.27
94	601615	明阳智能	13,600	171,496.00	0.27
95	601000	唐山港	36,100	170,031.00	0.27
96	600483	福能股份	17,000	169,490.00	0.27
97	002064	华峰化学	20,700	169,326.00	0.27
98	000021	深科技	8,700	165,822.00	0.26
99	002595	豪迈科技	3,300	165,627.00	0.26

100	603345	安井食品	2,000	162,960.00	0.26
101	600566	济川药业	5,600	162,848.00	0.26
102	600155	华创云信	22,000	162,800.00	0.26
103	601231	环旭电子	9,800	161,700.00	0.26
104	002673	西部证券	19,800	161,370.00	0.26
105	000009	中国宝安	17,200	157,380.00	0.25
106	000400	许继电气	5,700	156,921.00	0.25
107	300142	沃森生物	12,900	155,832.00	0.25
108	000513	丽珠集团	4,100	155,800.00	0.25
109	601965	中国汽研	8,800	155,056.00	0.25
110	601198	东兴证券	14,000	154,140.00	0.24
111	603893	瑞芯微	1,400	154,084.00	0.24
112	603179	新泉股份	3,600	153,720.00	0.24
113	601636	旗滨集团	27,400	153,714.00	0.24
114	300058	蓝色光标	16,500	153,120.00	0.24
115	002532	天山铝业	19,400	152,678.00	0.24
116	002025	航天电器	3,100	150,536.00	0.24
117	600580	卧龙电驱	8,700	149,553.00	0.24
118	688617	惠泰医疗	400	148,932.00	0.24
119	603568	伟明环保	6,760	146,218.80	0.23
120	002568	百润股份	5,200	145,652.00	0.23
121	000623	吉林敖东	8,400	145,068.00	0.23
122	600563	法拉电子	1,200	142,704.00	0.23
123	002044	美年健康	30,800	141,372.00	0.22
124	002407	多氟多	11,720	140,640.00	0.22
125	600637	东方明珠	18,000	139,680.00	0.22
126	002385	大北农	32,200	139,426.00	0.22
127	600521	华海药业	7,800	139,386.00	0.22
128	300724	捷佳伟创	2,200	139,062.00	0.22
129	000739	普洛药业	8,500	138,210.00	0.22
130	600109	国金证券	15,800	137,934.00	0.22

131	300144	宋城演艺	14,800	137,492.00	0.22
132	000426	兴业银锡	12,300	136,776.00	0.22
133	002318	久立特材	5,800	135,778.00	0.22
134	000997	新大陆	6,800	135,660.00	0.22
135	600060	海信视像	6,800	135,592.00	0.22
136	688180	君实生物	4,941	135,037.53	0.21
137	300558	贝达药业	2,500	134,825.00	0.21
138	000723	美锦能源	29,800	134,398.00	0.21
139	603885	吉祥航空	9,700	132,890.00	0.21
140	601928	凤凰传媒	11,500	132,710.00	0.21
141	600516	方大炭素	27,100	130,893.00	0.21
142	000733	振华科技	3,100	130,727.00	0.21
143	688521	芯原股份	2,486	130,340.98	0.21
144	300017	网宿科技	12,200	128,954.00	0.20
145	000060	中金岭南	27,300	128,037.00	0.20
146	600909	华安证券	21,100	127,866.00	0.20
147	600970	中材国际	13,400	127,032.00	0.20
148	000629	钒钛股份	44,100	127,008.00	0.20
149	600312	平高电气	6,600	126,720.00	0.20
150	600535	天士力	8,700	125,802.00	0.20
151	688047	龙芯中科	950	125,666.00	0.20
152	601098	中南传媒	8,300	124,583.00	0.20
153	300285	国瓷材料	7,300	124,392.00	0.20
154	300012	华测检测	10,000	124,300.00	0.20
155	600862	中航高科	4,900	123,774.00	0.20
156	600143	金发科技	14,300	123,552.00	0.20
157	601990	南京证券	14,100	122,106.00	0.19
158	600859	王府井	7,900	121,739.00	0.19
159	002507	涪陵榨菜	8,600	121,518.00	0.19
160	000960	锡业股份	8,600	120,658.00	0.19
161	300529	健帆生物	4,100	120,294.00	0.19

162	300601	康泰生物	7,000	120,050.00	0.19
163	600598	北大荒	8,100	119,475.00	0.19
164	600380	健康元	10,600	119,462.00	0.19
165	002926	华西证券	14,300	118,833.00	0.19
166	002439	启明星辰	7,500	118,650.00	0.19
167	002414	高德红外	15,800	117,394.00	0.19
168	000729	燕京啤酒	9,700	116,788.00	0.19
169	000636	风华高科	8,100	116,235.00	0.18
170	300567	精测电子	1,800	115,740.00	0.18
171	688005	容百科技	3,665	115,630.75	0.18
172	600549	厦门钨业	6,000	115,620.00	0.18
173	601577	长沙银行	12,900	114,681.00	0.18
174	002603	以岭药业	7,100	113,671.00	0.18
175	300003	乐普医疗	10,000	113,400.00	0.18
176	603000	人民网	5,100	112,404.00	0.18
177	601179	中国西电	14,800	112,332.00	0.18
178	002558	巨人网络	8,800	111,672.00	0.18
179	002120	韵达股份	14,800	111,296.00	0.18
180	600583	海油工程	20,200	110,494.00	0.18
181	300676	华大基因	2,600	109,122.00	0.17
182	002368	太极股份	4,600	108,928.00	0.17
183	600435	北方导航	11,100	108,336.00	0.17
184	688361	中科飞测	1,225	107,248.75	0.17
185	000598	兴蓉环境	14,000	106,260.00	0.17
186	300595	欧普康视	5,600	106,120.00	0.17
187	600316	洪都航空	3,300	105,996.00	0.17
188	300476	胜宏科技	2,500	105,225.00	0.17
189	002500	山西证券	16,700	104,876.00	0.17
190	600763	通策医疗	2,361	104,828.40	0.17
191	600895	张江高科	3,900	104,520.00	0.17
192	002268	电科网安	6,400	104,000.00	0.17

193	300212	易华录	4,400	102,960.00	0.16
194	688772	珠海冠宇	6,388	102,719.04	0.16
195	002261	拓维信息	5,600	102,536.00	0.16
196	600906	财达证券	14,400	102,240.00	0.16
197	689009	九号公司	2,152	102,220.00	0.16
198	300251	光线传媒	10,800	101,952.00	0.16
199	002340	格林美	15,600	101,868.00	0.16
200	600129	太极集团	4,100	101,352.00	0.16
201	688385	复旦微电	2,618	100,505.02	0.16
202	300888	稳健医疗	2,380	100,150.40	0.16
203	002653	海思科	3,000	99,750.00	0.16
204	600707	彩虹股份	12,100	99,462.00	0.16
205	600872	中炬高新	4,500	99,090.00	0.16
206	600739	辽宁成大	9,400	97,290.00	0.15
207	600416	湘电股份	8,600	97,094.00	0.15
208	600131	国网信通	5,100	96,441.00	0.15
209	300118	东方日升	8,000	95,840.00	0.15
210	002670	国盛金控	7,300	95,557.00	0.15
211	600606	绿地控股	45,500	95,550.00	0.15
212	000818	航锦科技	5,000	95,500.00	0.15
213	000998	隆平高科	8,500	94,945.00	0.15
214	600517	国网英大	17,200	94,772.00	0.15
215	688567	孚能科技	8,128	94,284.80	0.15
216	688213	思特威	1,213	94,274.36	0.15
217	002624	完美世界	9,100	94,003.00	0.15
218	002423	中粮资本	7,000	93,730.00	0.15
219	600764	中国海防	3,300	93,456.00	0.15
220	603087	甘李药业	2,100	92,610.00	0.15
221	002080	中材科技	6,900	90,252.00	0.14
222	601966	玲珑轮胎	5,000	90,200.00	0.14
223	688017	绿的谐波	833	90,013.98	0.14

224	601399	国机重装	29,200	89,936.00	0.14
225	002372	伟星新材	7,100	89,673.00	0.14
226	688525	佰维存储	1,441	89,298.77	0.14
227	600959	江苏有线	26,600	89,110.00	0.14
228	000987	越秀资本	12,680	89,013.60	0.14
229	688220	翱捷科技	1,635	88,437.15	0.14
230	600392	盛和资源	8,500	87,380.00	0.14
231	600118	中国卫星	3,200	87,360.00	0.14
232	002373	千方科技	8,600	87,204.00	0.14
233	600500	中化国际	21,600	86,832.00	0.14
234	300699	光威复材	2,500	86,625.00	0.14
235	601016	节能风电	27,310	86,572.70	0.14
236	000032	深桑达 A	4,900	86,436.00	0.14
237	603456	九洲药业	6,300	86,184.00	0.14
238	002410	广联达	7,300	85,848.00	0.14
239	603737	三棵树	2,000	85,200.00	0.14
240	688297	中无人机	2,092	84,265.76	0.13
241	002266	浙富控股	26,900	83,928.00	0.13
242	002821	凯莱英	1,100	83,699.00	0.13
243	002508	老板电器	3,900	83,577.00	0.13
244	600008	首创环保	25,400	83,312.00	0.13
245	688249	晶合集成	3,529	82,366.86	0.13
246	300957	贝泰妮	1,900	81,111.00	0.13
247	601212	白银有色	28,500	79,230.00	0.13
248	688099	晶晨股份	1,148	78,844.64	0.13
249	002939	长城证券	9,600	78,720.00	0.13
250	000893	亚钾国际	3,900	78,624.00	0.12
251	000958	电投产融	12,600	78,498.00	0.12
252	002065	东华软件	10,800	78,408.00	0.12
253	002128	电投能源	4,000	78,320.00	0.12
254	688778	厦钨新能	1,702	77,679.28	0.12

255	002299	圣农发展	5,300	76,744.00	0.12
256	600487	亨通光电	4,400	75,768.00	0.12
257	600901	江苏金租	14,500	75,690.00	0.12
258	688390	固德威	1,846	75,501.40	0.12
259	600079	人福医药	3,200	74,816.00	0.12
260	605358	立昂微	3,000	74,310.00	0.12
261	300009	安科生物	8,600	74,304.00	0.12
262	603927	中科软	3,420	74,214.00	0.12
263	600998	九州通	14,400	73,728.00	0.12
264	301358	湖南裕能	1,600	72,512.00	0.12
265	600126	杭钢股份	14,900	71,222.00	0.11
266	000563	陕国投A	19,900	70,844.00	0.11
267	600170	上海建工	26,700	70,755.00	0.11
268	000878	云南铜业	5,800	70,702.00	0.11
269	300140	节能环保	11,800	70,682.00	0.11
270	688363	华熙生物	1,383	70,588.32	0.11
271	603728	鸣志电器	1,300	70,200.00	0.11
272	601568	北元集团	16,700	70,140.00	0.11
273	600754	锦江酒店	2,600	69,836.00	0.11
274	002432	九安医疗	1,700	69,326.00	0.11
275	300919	中伟股份	1,900	68,628.00	0.11
276	600056	中国医药	6,000	66,600.00	0.11
276	600032	浙江新能	9,000	66,600.00	0.11
278	600928	西安银行	18,400	66,424.00	0.11
279	300604	长川科技	1,500	66,195.00	0.11
280	601158	重庆水务	13,500	66,150.00	0.11
281	000825	太钢不锈	19,000	66,120.00	0.11
282	003022	联泓新科	4,800	66,096.00	0.10
283	600007	中国国贸	2,700	66,042.00	0.10
284	600166	福田汽车	26,200	65,762.00	0.10
285	688248	南网科技	2,033	65,238.97	0.10

286	603160	汇顶科技	800	64,432.00	0.10
287	002517	恺英网络	4,700	63,967.00	0.10
288	002557	洽洽食品	2,200	63,910.00	0.10
289	603899	晨光股份	2,100	63,525.00	0.10
290	601608	中信重工	15,100	63,420.00	0.10
291	000750	国海证券	14,600	62,488.00	0.10
292	601155	新城控股	5,200	62,192.00	0.10
293	000537	中绿电	6,800	62,016.00	0.10
294	002531	天顺风能	7,800	61,698.00	0.10
295	000967	盈峰环境	12,400	61,628.00	0.10
296	002019	亿帆医药	5,700	61,104.00	0.10
297	600095	湘财股份	8,400	60,480.00	0.10
298	300765	新诺威	2,200	58,498.00	0.09
299	002867	周大生	4,000	58,120.00	0.09
300	601168	西部矿业	3,600	57,852.00	0.09
301	600688	上海石化	19,100	57,682.00	0.09
302	003031	中瓷电子	1,100	57,629.00	0.09
303	688172	燕东微	2,826	56,661.30	0.09
304	601216	君正集团	10,700	56,282.00	0.09
305	688281	华秦科技	600	55,860.00	0.09
306	688122	西部超导	1,301	55,708.82	0.09
307	600390	五矿资本	8,600	55,470.00	0.09
308	603185	弘元绿能	3,400	55,250.00	0.09
309	601666	平煤股份	5,500	55,110.00	0.09
310	000559	万向钱潮	8,800	54,120.00	0.09
311	688520	神州细胞	1,485	53,801.55	0.09
312	600655	豫园股份	8,300	53,369.00	0.08
313	000050	深天马 A	5,900	53,277.00	0.08
314	300073	当升科技	1,300	52,364.00	0.08
315	688387	信科移动	8,700	51,852.00	0.08
316	002841	视源股份	1,400	51,674.00	0.08

317	600867	通化东宝	6,400	51,584.00	0.08
318	000785	居然智家	14,400	51,408.00	0.08
319	000539	粤电力 A	11,100	50,283.00	0.08
320	688114	华大智造	1,072	50,158.88	0.08
321	600848	上海临港	4,900	49,490.00	0.08
322	300054	鼎龙股份	1,900	49,438.00	0.08
323	688276	百克生物	1,959	49,190.49	0.08
324	002690	美亚光电	3,300	48,906.00	0.08
325	300573	兴齐眼药	700	48,846.00	0.08
326	600612	老凤祥	900	48,843.00	0.08
327	601918	新集能源	6,800	48,824.00	0.08
328	601866	中远海发	18,700	48,807.00	0.08
329	600271	航天信息	5,300	48,283.00	0.08
330	688072	拓荆科技	312	47,945.04	0.08
331	300487	蓝晓科技	1,000	47,870.00	0.08
332	688516	奥特维	1,086	47,034.66	0.07
333	688331	荣昌生物	1,549	46,640.39	0.07
334	002408	齐翔腾达	9,200	46,276.00	0.07
335	601567	三星医疗	1,500	46,140.00	0.07
336	301267	华夏眼科	2,400	45,696.00	0.07
337	688065	凯赛生物	1,165	45,202.00	0.07
338	601696	中银证券	4,000	44,640.00	0.07
339	688032	禾迈股份	396	44,605.44	0.07
340	600339	中油工程	12,400	44,392.00	0.07
341	600258	首旅酒店	3,000	44,010.00	0.07
342	300114	中航电测	600	43,068.00	0.07
343	002739	万达电影	3,500	42,490.00	0.07
344	600927	永安期货	3,200	42,208.00	0.07
345	000591	太阳能	8,800	41,888.00	0.07
346	000728	国元证券	4,900	40,964.00	0.07
347	300223	北京君正	600	40,920.00	0.07

348	600685	中船防务	1,700	40,290.00	0.06
349	688375	国博电子	813	40,129.68	0.06
350	603712	七一二	2,000	38,940.00	0.06
351	601156	东航物流	2,300	38,801.00	0.06
352	688301	奕瑞科技	400	38,228.00	0.06
353	000519	中兵红箭	2,600	37,570.00	0.06
354	002563	森马服饰	5,300	37,206.00	0.06
355	002683	广东宏大	1,400	37,072.00	0.06
356	002487	大金重工	1,800	36,882.00	0.06
357	600361	创新新材	9,300	35,898.00	0.06
358	603816	顾家家居	1,300	35,854.00	0.06
359	603882	金域医学	1,300	35,789.00	0.06
360	301301	川宁生物	3,000	35,580.00	0.06
361	002945	华林证券	2,300	35,259.00	0.06
362	603650	彤程新材	1,000	34,970.00	0.06
363	300146	汤臣倍健	2,900	34,945.00	0.06
364	600720	中交设计	3,900	34,554.00	0.05
365	603883	老百姓	2,100	34,377.00	0.05
366	688469	芯联集成	6,557	33,637.41	0.05
367	688052	纳芯微	254	33,096.20	0.05
368	603486	科沃斯	700	32,900.00	0.05
369	003035	南网能源	7,800	32,604.00	0.05
370	600884	杉杉股份	4,300	32,035.00	0.05
371	601061	中信金属	4,300	31,218.00	0.05
372	600956	新天绿能	4,100	30,914.00	0.05
373	603658	安图生物	700	30,548.00	0.05
374	600348	华阳股份	4,300	30,487.00	0.05
375	601118	海南橡胶	5,400	29,214.00	0.05
376	601108	财通证券	3,500	28,595.00	0.05
377	002056	横店东磁	2,200	28,512.00	0.05
378	300677	英科医疗	1,100	27,808.00	0.04

379	688295	中复神鹰	1,372	27,343.96	0.04
380	600699	均胜电子	1,700	26,639.00	0.04
381	600132	重庆啤酒	400	25,208.00	0.04
382	600546	山煤国际	2,100	24,843.00	0.04
383	601717	郑煤机	1,900	24,662.00	0.04
384	002608	江苏国信	3,200	24,544.00	0.04
385	603939	益丰药房	1,000	24,130.00	0.04
386	601997	贵阳银行	3,900	23,400.00	0.04
387	000921	海信家电	800	23,120.00	0.04
388	600673	东阳光	2,000	22,580.00	0.04
389	601001	晋控煤业	1,600	21,872.00	0.03
390	600398	海澜之家	2,900	21,750.00	0.03
391	600663	陆家嘴	2,100	20,664.00	0.03
392	002430	杭氧股份	900	19,620.00	0.03
393	600995	南网储能	1,900	19,228.00	0.03
394	688563	航材股份	341	19,041.44	0.03
395	601555	东吴证券	2,400	18,720.00	0.03
396	688475	萤石网络	620	18,717.80	0.03
397	688002	睿创微纳	398	18,709.98	0.03
398	600977	中国电影	1,600	18,576.00	0.03
399	600528	中铁工业	2,300	18,538.00	0.03
400	600329	达仁堂	600	18,480.00	0.03
401	600968	海油发展	4,300	18,361.00	0.03
402	600141	兴发集团	800	17,360.00	0.03
403	688153	唯捷创芯	515	17,231.90	0.03
404	002202	金风科技	1,600	16,528.00	0.03
405	300390	天华新能	700	16,135.00	0.03
406	601958	金钼股份	1,600	16,096.00	0.03
407	002155	湖南黄金	1,000	15,730.00	0.02
408	301498	乖宝宠物	200	15,664.00	0.02
409	688561	奇安信	578	15,507.74	0.02

410	601228	广州港	4,500	15,255.00	0.02
411	600373	中文传媒	1,200	15,060.00	0.02
412	601665	齐鲁银行	2,600	14,534.00	0.02
413	300748	金力永磁	800	14,304.00	0.02
414	002429	兆驰股份	2,400	13,872.00	0.02
415	000959	首钢股份	4,500	13,725.00	0.02
416	000423	东阿阿胶	200	12,544.00	0.02
417	300763	锦浪科技	200	12,214.00	0.02
418	600062	华润双鹤	600	11,880.00	0.02
419	688819	天能股份	427	11,622.94	0.02
420	603379	三美股份	300	11,514.00	0.02
421	603688	石英股份	400	11,492.00	0.02
422	688278	特宝生物	154	11,298.98	0.02
423	600499	科达制造	1,400	10,920.00	0.02
424	000778	新兴铸管	2,700	10,368.00	0.02
425	601858	中国科传	500	10,190.00	0.02
426	688425	铁建重工	2,305	10,142.00	0.02
427	601611	中国核建	1,100	9,944.00	0.02
428	600498	烽火通信	500	9,730.00	0.02
429	600925	苏能股份	1,800	9,540.00	0.02
430	603290	斯达半导	100	8,982.00	0.01
431	301308	江波龙	100	8,600.00	0.01
432	603707	健友股份	600	7,962.00	0.01
433	603826	坤彩科技	400	7,700.00	0.01
434	300070	碧水源	1,500	7,590.00	0.01
435	301165	锐捷网络	100	7,220.00	0.01
436	002153	石基信息	1,000	7,140.00	0.01
437	601991	大唐发电	2,500	7,125.00	0.01
438	601019	山东出版	600	6,810.00	0.01
439	603786	科博达	100	6,180.00	0.01
440	002240	盛新锂能	400	5,512.00	0.01

441	600021	上海电力	600	5,502.00	0.01
442	000937	冀中能源	800	5,056.00	0.01
443	600299	安迪苏	400	5,020.00	0.01
444	600295	鄂尔多斯	500	4,880.00	0.01
445	603341	龙旗科技	100	4,675.00	0.01
446	002203	海亮股份	400	4,300.00	0.01
447	603056	德邦股份	300	4,299.00	0.01
448	603529	爱玛科技	100	4,102.00	0.01
449	000039	中集集团	500	3,885.00	0.01
450	600578	京能电力	1,100	3,872.00	0.01
451	601139	深圳燃气	500	3,530.00	0.01
452	002572	索菲亚	200	3,436.00	0.01
453	688234	天岳先进	48	2,457.60	0.00

### 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	000063	中兴通讯	7,100	286,840.00	0.46
2	600176	中国巨石	23,000	261,970.00	0.42
3	600030	中信证券	7,900	230,443.00	0.37
4	688300	联瑞新材	3,299	212,455.60	0.34
5	000807	云铝股份	14,500	196,185.00	0.31
6	601211	国泰君安	10,400	193,960.00	0.31
7	300346	南大光电	4,900	189,091.00	0.30
8	600426	华鲁恒升	8,700	188,007.00	0.30
9	300776	帝尔激光	2,900	184,382.00	0.29
10	600522	中天科技	12,700	181,864.00	0.29
11	601668	中国建筑	29,800	178,800.00	0.28
12	603259	药明康德	2,900	159,616.00	0.25

13	688484	南芯科技	4,309	155,296.36	0.25
14	300059	东方财富	6,000	154,920.00	0.25
15	601899	紫金矿业	9,900	149,688.00	0.24
16	601881	中国银河	9,600	146,208.00	0.23
17	600163	中闽能源	22,200	135,198.00	0.21
18	688012	中微公司	702	132,790.32	0.21
19	601126	四方股份	7,800	132,288.00	0.21
20	002020	京新药业	10,100	129,280.00	0.21
21	600585	海螺水泥	5,300	126,034.00	0.20
22	300127	银河磁体	5,000	122,900.00	0.20
23	688085	三友医疗	5,500	116,545.00	0.19
24	603993	洛阳钼业	17,300	115,045.00	0.18
25	300470	中密控股	3,000	113,100.00	0.18
26	000408	藏格矿业	3,900	108,147.00	0.17
27	000501	武商集团	10,200	106,692.00	0.17
28	601058	赛轮轮胎	7,000	100,310.00	0.16
29	600584	长电科技	2,400	98,064.00	0.16
30	603699	纽威股份	4,400	97,548.00	0.15
31	002043	兔宝宝	8,200	97,416.00	0.15
32	601298	青岛港	10,600	96,566.00	0.15
33	601872	招商轮船	15,000	96,150.00	0.15
34	000100	TCL科技	18,900	95,067.00	0.15
35	600958	东方证券	8,200	86,592.00	0.14
36	300628	亿联网络	2,200	84,920.00	0.13
37	601838	成都银行	4,800	82,128.00	0.13
38	600285	羚锐制药	3,700	81,992.00	0.13
39	600875	东方电气	5,000	79,450.00	0.13
40	002463	沪电股份	2,000	79,300.00	0.13
41	600009	上海机场	2,300	78,545.00	0.12
42	002371	北方华创	200	78,200.00	0.12
43	601827	三峰环境	9,000	77,220.00	0.12

44	002014	永新股份	6,700	73,432.00	0.12
45	600887	伊利股份	2,200	66,396.00	0.11
46	601088	中国神华	1,500	65,220.00	0.10
47	600938	中国海油	2,200	64,922.00	0.10
48	002048	宁波华翔	5,100	64,362.00	0.10
49	600161	天坛生物	3,100	63,550.00	0.10
50	600183	生益科技	2,600	62,530.00	0.10
51	002648	卫星化学	3,000	56,370.00	0.09
52	600048	保利发展	5,900	52,274.00	0.08
53	000786	北新建材	1,600	48,496.00	0.08
54	600036	招商银行	1,200	47,160.00	0.07
54	002179	中航光电	1,200	47,160.00	0.07
56	600276	恒瑞医药	1,000	45,900.00	0.07
57	600160	巨化股份	1,900	45,828.00	0.07
58	002032	苏泊尔	800	42,568.00	0.07
59	603558	健盛集团	3,400	36,584.00	0.06
60	002028	思源电气	500	36,350.00	0.06
61	600760	中航沈飞	700	35,504.00	0.06
62	603565	中谷物流	3,500	34,300.00	0.05
63	000338	潍柴动力	2,500	34,250.00	0.05
64	600795	国电电力	7,300	33,434.00	0.05
65	688408	中信博	455	32,760.00	0.05
66	600803	新奥股份	1,400	30,352.00	0.05
67	002422	科伦药业	1,000	29,930.00	0.05
68	600562	国睿科技	1,200	23,916.00	0.04
69	601865	福莱特	1,200	23,628.00	0.04
70	000951	中国重汽	1,300	22,074.00	0.04
71	600019	宝钢股份	2,800	19,600.00	0.03
72	600233	圆通速递	1,300	18,447.00	0.03
73	600886	国投电力	1,100	18,282.00	0.03
74	002271	东方雨虹	1,400	18,172.00	0.03

75	688702	盛科通信	200	16,800.00	0.03
76	300498	温氏股份	1,000	16,510.00	0.03
77	603100	川仪股份	700	15,085.00	0.02
78	400174	中天3	37,500	15,000.00	0.02
79	300274	阳光电源	200	14,766.00	0.02
80	300633	开立医疗	500	14,695.00	0.02
81	605090	九丰能源	500	14,265.00	0.02
82	601390	中国中铁	2,200	14,058.00	0.02
83	603195	公牛集团	200	14,048.00	0.02
84	688568	中科星图	249	12,706.47	0.02
85	688100	威胜信息	347	12,561.40	0.02
86	601777	力帆科技	1,600	12,240.00	0.02
87	000425	徐工机械	1,400	11,102.00	0.02
88	000902	新洋丰	800	10,432.00	0.02
89	601702	华峰铝业	500	9,160.00	0.01
90	002003	伟星股份	600	8,502.00	0.01
91	300661	圣邦股份	100	8,178.00	0.01
92	002327	富安娜	900	7,956.00	0.01
93	002461	珠江啤酒	800	7,912.00	0.01
94	300735	光弘科技	200	5,598.00	0.01
95	002884	凌霄泵业	300	5,481.00	0.01
96	002027	分众传媒	700	4,921.00	0.01
97	002332	仙琚制药	400	3,976.00	0.01
98	002714	牧原股份	100	3,844.00	0.01
99	600999	招商证券	200	3,832.00	0.01
100	300394	天孚通信	40	3,654.40	0.01
101	000528	柳工	300	3,618.00	0.01
102	000895	双汇发展	100	2,596.00	0.00
103	001213	中铁特货	400	1,668.00	0.00
104	603127	昭衍新药	68	1,130.84	0.00

## 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	601555	东吴证券	1,322,978.00	2.25
2	601668	中国建筑	1,290,488.00	2.19
3	601128	常熟银行	1,286,031.00	2.18
4	601077	渝农商行	1,115,970.00	1.90
5	600585	海螺水泥	1,115,485.00	1.89
6	600036	招商银行	1,090,105.00	1.85
7	600820	隧道股份	992,081.00	1.68
8	002078	太阳纸业	977,276.00	1.66
9	600177	雅戈尔	955,404.00	1.62
10	600030	中信证券	926,110.00	1.57
11	002966	苏州银行	841,575.00	1.43
12	600096	云天化	840,076.00	1.43
13	600380	健康元	833,650.50	1.42
14	600519	贵州茅台	803,847.00	1.37
15	000513	丽珠集团	766,472.00	1.30
16	600079	人福医药	757,727.00	1.29
17	000932	华菱钢铁	753,225.00	1.28
18	601058	赛轮轮胎	747,118.00	1.27
19	600352	浙江龙盛	736,421.00	1.25
20	002273	水晶光电	731,363.00	1.24

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	002078	太阳纸业	1,437,887.00	2.44
2	600030	中信证券	1,366,588.00	2.32
3	601128	常熟银行	1,282,239.10	2.18
4	601555	东吴证券	1,281,176.00	2.18
5	600036	招商银行	1,272,276.00	2.16
6	601077	渝农商行	1,157,930.00	1.97
7	601668	中国建筑	1,143,211.00	1.94
8	300502	新易盛	1,080,048.00	1.83
9	600820	隧道股份	1,068,704.00	1.81
10	600585	海螺水泥	1,050,697.00	1.78
11	601058	赛轮轮胎	999,636.00	1.70
12	600177	雅戈尔	985,333.00	1.67
13	000933	神火股份	916,142.00	1.56
14	002028	思源电气	911,010.00	1.55
15	600079	人福医药	871,878.00	1.48
16	000630	铜陵有色	869,099.00	1.48
17	600901	江苏金租	863,855.00	1.47
18	601211	国泰君安	848,086.00	1.44
19	600497	驰宏锌锗	841,608.00	1.43
20	600352	浙江龙盛	834,784.00	1.42

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	209,666,621.80
卖出股票收入（成交）总额	210,724,641.56

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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	137,270.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	160,457.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	297,728.02

**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	1,164	12,572.68	2,898,286.37	19.80%	11,736,315.45	80.20%

中泰中证500指数增强C	3,726	9,630.93	0.00	0.00%	35,884,826.93	100.00%
合计	4,890	10,331.17	2,898,286.37	5.74%	47,621,142.38	94.26%

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	189,290.58	1.29%
	中泰中证500指数增强C	62,937.04	0.18%
	合计	252,227.62	0.50%

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	0~10
	中泰中证500指数增强C	0
	合计	0~10
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：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	13,269,037.79	36,577,926.16
本报告期基金总申购份额	6,092,348.01	14,318,394.98

减：本报告期基金总赎回份额	4,726,783.98	15,011,494.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,634,601.82	35,884,826.93

## §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，基金管理人于2024年4月8日增聘史少杰先生担任公司副总经理职务。  
本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币25,000.00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：  
自2023年12月12日起至今。

### 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因本基金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	420,391,263.36	100.00%	90,497.79	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	19,597.15	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2023年第4季度报告	中国证监会规定网站	2024-01-19
2	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定网站	2024-03-26
3	中泰中证500指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定网站	2024-04-22
4	中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2024年第1号	中国证监会规定网站	2024-05-17
5	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	2024-05-17
6	中泰中证500指数增强型证券投资基金2024年第2季度报告	中国证监会规定网站	2024-07-18

7	中泰中证500指数增强型证券投资基金2024年中期报告	中国证监会规定网站	2024-08-28
8	中泰中证500指数增强型证券投资基金2024年第3季度报告	中国证监会规定网站	2024-10-25

## §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  
二〇二五年三月二十六日