

中泰中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年4月1日（基金合同生效日）起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	51
7.1 期末基金资产组合情况.....	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	71
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	72
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	72
§8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	74
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	74
§9 开放式基金份额变动.....	75
§10 重大事件揭示.....	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	75
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
§11 备查文件目录.....	77
11.1 备查文件目录.....	77
11.2 存放地点.....	77
11.3 查阅方式.....	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中泰中证A500指增发起	
基金主代码	022781	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年04月01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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	66,098,351.83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A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C
下属分级基金的交易代码	022781	022782
报告期末下属分级基金的份额总额	35,958,263.59份	30,140,088.24份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票增强型指数基金，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。 指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整。此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳

	的个股，将采用合理方法进行适当的替代。由于受到各项投资比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时基金将会采用合理方法进行适当的替代。 本基金通过构建多因子量化增强模型来实现量化增强策略。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。同时本基金为股票指数增强型基金，通过跟踪标的指数表现，理论上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。 本基金投资于港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	方圆
	联系电话	021-20521199	95559
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-821-0808	95559
传真		021-50933716	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号24楼05室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		黄文卿	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年04月01日（基金合同生效日）-2025年06月30日)	
	中泰中证A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C
本期已实现收益	291,231.22	-572,543.12
本期利润	707,371.84	313,800.29
加权平均基金份额本期利润	0.0135	0.0033
本期加权平均净值利润率	1.37%	0.34%
本期基金份额净值增长率	1.75%	1.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	期末可供分配利润	313,068.44 233,068.92
	期末可供分配基金份额利润	0.0087 0.0077
	期末基金资产净值	36,586,784.90 30,636,956.64

期末基金份额净值	1.0175	1.0165
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.75%	1.65%

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）。

4、本基金基金合同在当期生效，生效日为2025年4月1日。

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

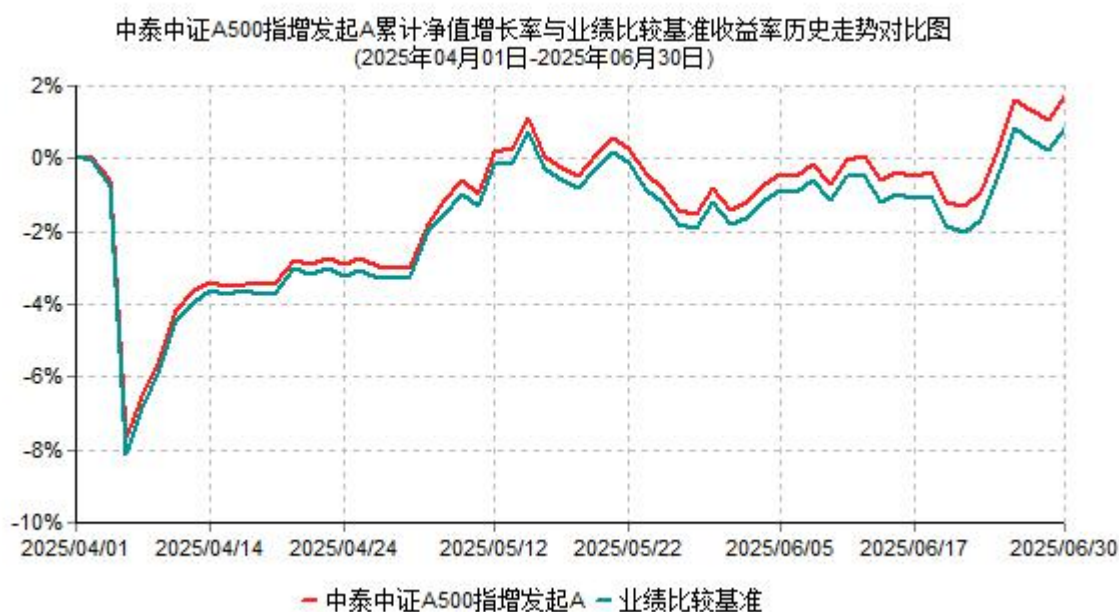
中泰中证A500指增发起A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.18%	0.55%	2.68%	0.57%	0.50%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	1.75%	1.10%	0.83%	1.14%	0.92%	-0.04%

中泰中证A500指增发起C

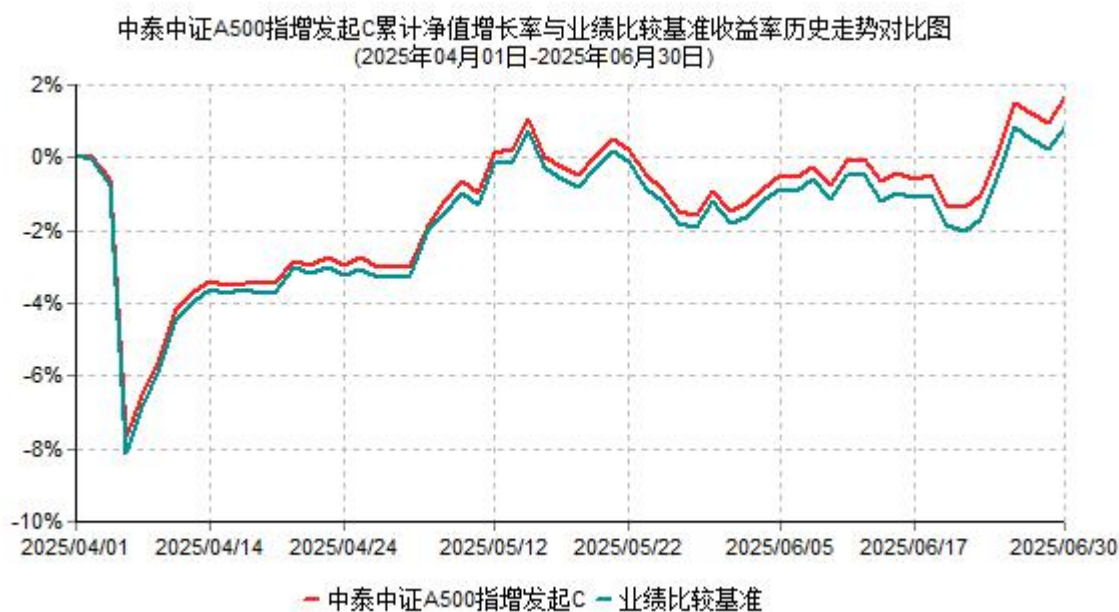
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.15%	0.55%	2.68%	0.57%	0.47%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	1.65%	1.10%	0.83%	1.14%	0.82%	-0.04%

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变动的比较



注：

- (1) 本基金基金合同生效日期为2025年4月1日，至本报告期末本基金成立未满1年。
- (2) 根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。



注：

- （1）本基金基金合同生效日期为2025年4月1日，至本报告期末本基金成立未满1年。
- （2）根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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2025年6月30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、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、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、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰安睿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、中泰锦泉汇金货币市场基金、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、中泰星汇优选平衡三个月持有期混合型基金中基金

（FOF）、中泰双利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、中泰稳固30天持有期中短债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ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金、中泰安弘债券型证券投资基金、中泰中证A500指数增强

型发起式证券投资基金和中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金共三十三只证券投资基金。

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；量化公募投资部副总经理。	2025-04-01	-	21	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。2025年4月1日至今担任中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
李玉刚	本基金基金经理；研究部总经理兼量化公募投资部总经理。	2025-04-01	-	24	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，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1月4日至2025年4月16日期间担任中泰中证500指数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2025年5月11日期间担任中泰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。2025年4月1日至今担任中泰中证A500指数增强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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平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。

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 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

2025年上半年,虽然外部有美国“对等关税”冲击影响,但宏观政策持续发力支撑基本面,财政端专项债扩容,货币政策维持宽松,提振基建投资与流动性。消费专项行动推动社会消费品零售总额同比增长,新能源汽车和家电等耐用品消费韧性凸显。市场主题轮动明显, AI算力应用、人形机器人、创新药领涨,中小盘成长股显著占优。

判断市场风格,并根据市场的风格偏好调整组合,既不符合我们遵循的固有安全性原则,也超出我们的能力范围。本基金策略是选择那些能够持续创造价值并且估值合理的优秀公司,在控制跟踪误差的前提下,用它们来替代相同类型的成分股。

本基金仅利用多因子模型来解释波动和控制跟踪误差,而不是用它来预测收益和选股。从长期回报的角度来说,股票的收益来源只能来自于公司长期经营的积累。那些能够持续创造价值的优秀公司,它们的平均回报要高过市场的平均回报。所谓优秀公司,指的是从生意和商业逻辑的角度,通过深度研究筛选出来的能够持续创造超额价值的公司。这个筛选过程是基于个案的深度研究驱动,而不是量化指标驱动。量化指标仅是历史结果,我们希望通过深度研究理解造就优秀的原因,以及是否可以持续。

在控制跟踪误差方面,我们基于聚类分析和因子分析,对股票进行重新分类,并约束“类中性”,而不是因子中性和行业中性。最终合意的增强组合,是求解一个数学规划问题,目标是最大化预期的超额回报,同时最小化跟踪误差。

本基金的超额收益来源主要体现在两方面:

一是用处于合理估值范围的优秀公司替代平庸的、并且是同类型的成份股公司。从长期来看,以合理价格持有优秀公司获得的回报要高于平庸公司的回报。

二是指数编制决定了成交越活跃、市值越大的股票越容易进入指数,但并没有考虑成份股公司是否有持续创造价值的能力,且成分股按照市值加权,成份股涨幅越大、市值越大权重就越大,所以我们会改变投资组合权重的决定方式,综合考虑预期回报和跟踪误差的约束,而不是按照市值加权。

本基金并不会去判断接下来市场会偏好哪些风格,或者哪些因子会表现好。我们的策略始终是用低估或合理估值的优秀公司替代同类型的成份股。当市场风格比较极端时,我们可能会落后市场。但因为严格地控制了跟踪误差,即便在不利的市场环境下,我们也不会落后指数太多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰中证A500指增发起A基金份额净值为1.0175元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.75%,同期业绩比较基准收益率为0.83%;截至报告期末中泰中证A500指增发起C基金份额净值为1.0165元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.65%,同期业绩比较基准收益率为0.83%。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，中泰证券（上海）资产管理有限公司在中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中泰证券（上海）资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	10,397,925.25
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	62,509,333.44
其中：股票投资		62,507,633.33
基金投资		-
债券投资		1,700.11
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-

衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		1,699.80
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		72,908,958.49
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		5,551,623.16
应付管理人报酬		56,147.49
应付托管费		7,018.40
应付销售服务费		13,289.88
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	57,138.02
负债合计		5,685,216.95
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	66,098,351.83
未分配利润	6.4.7.8	1,125,389.71
净资产合计		67,223,741.54
负债和净资产总计		72,908,958.49

注：1、报告截止日2025年6月30日，基金份额总额66,098,351.83份，其中A类份额35,958,263.59份，C类份额30,140,088.24份。A类份额净值1.0175元，C类份额净值1.0165元。

2、本财务报表的实际编制期间为2025年4月1日(基金合同生效日)至2025年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年04月01日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
一、营业总收入		1,480,301.62
1.利息收入		19,011.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,011.34
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）		95,112.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-837,065.37
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,180.11
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	929,997.76
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,302,484.03

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	63,693.75
减：二、营业总支出		459,129.49
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	286,777.66
2.托管费	6.4.10.2.2	35,847.21
3.销售服务费	6.4.10.2.3	92,424.62
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	6.4.7.16	44,080.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,021,172.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,021,172.13
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,021,172.13

6.3 净资产变动表

会计主体：中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	217,877,365.26	-	217,877,365.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-151,779,013.43	1,125,389.71	-150,653,623.72

填列)			
(一)、综合收益总额	-	1,021,172.13	1,021,172.13
(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)	-151,779,013.43	104,217.58	-151,674,795.85
其中: 1.基金申购款	1,846,876.68	5,565.87	1,852,442.55
2.基金赎回款	-153,625,890.11	98,651.71	-153,527,238.40
(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	66,098,351.83	1,125,389.71	67,223,741.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金(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[2024]1674号《关于准予中泰中证A500指数增强型发起式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A500指数增强型发起式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217,828,036.29元。经向中国证监会备案,《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2025年4月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为217,877,365.26份,其中认购资金利息折合49,328.97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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中泰中证A500指数增强型发起式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A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于其他依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、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）、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的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%，其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证A500指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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8月27日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和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2025年6月30日的财务状况以及2025年4月1日(基金合同生效日)至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年4月1日(基金合同生效日)至2025年6月30日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

对证券投资基金从中国内地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。

(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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联交所”）上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

(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。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与香港联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	5,425,111.16
等于：本金	5,425,062.23
加：应计利息	48.93
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	4,972,814.09
等于：本金	4,972,255.57
加：应计利息	558.52
减：坏账准备	-
合计	10,397,925.25

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		61,205,149.30	-	62,507,633.33	1,302,484.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,700.00	0.11	1,700.11	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,700.00	0.11	1,700.11	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		61,206,849.30	0.11	62,509,333.44	1,302,484.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,312.42
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	13,898.43
预提费用-信息披露费	29,781.57
其他应付	145.60
合计	57,138.02

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中泰中证A500指增发起A

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起A)	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	59,681,493.78	59,681,493.78

本期申购	1,420,577.00	1,420,577.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,143,807.19	-25,143,807.19
本期末	35,958,263.59	35,958,263.59

6.4.7.7.2 中泰中证A500指增发起C

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起C)	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	158,195,871.48	158,195,871.48
本期申购	426,299.68	426,299.68
本期赎回（以“-”号填列）	-128,482,082.92	-128,482,082.92
本期末	30,140,088.24	30,140,088.24

注：1、本基金自2025年3月21日至2025年3月28日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币217,828,036.29元，折合为217,828,036.29份基金份额。根据《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币49,328.97元在本基金成立后，折合为49,328.97份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》和《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于2025年5月6日起每个开放日办理日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中泰中证A500指增发起A

单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	291,231.22	416,140.62	707,371.84

本期基金份额交易产生的变动数	21,837.22	-100,687.75	-78,850.53
其中：基金申购款	-5,498.84	9,961.71	4,462.87
基金赎回款	27,336.06	-110,649.46	-83,313.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	313,068.44	315,452.87	628,521.31

6.4.7.8.2 中泰中证A500指增发起C

单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-572,543.12	886,343.41	313,800.29
本期基金份额交易产生的变动数	805,612.04	-622,543.93	183,068.11
其中：基金申购款	-231.22	1,334.22	1,103.00
基金赎回款	805,843.26	-623,878.15	181,965.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,068.92	263,799.48	496,868.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	1,762.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,248.60
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	19,011.34
----	-----------

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出股票成交总额	199,076,829.71
减：卖出股票成本总额	199,692,042.55
减：交易费用	221,852.53
买卖股票差价收入	-837,065.37

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	1.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,178.42
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	2,180.11

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,180.58

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,000.00
减：应计利息总额	1.58
减：交易费用	0.58
买卖债券差价收入	2,178.42

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	929,997.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	929,997.76

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	1,302,484.03
——股票投资	1,302,484.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,302,484.03

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金赎回费收入	63,693.75
合计	63,693.75

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	13,898.43
信息披露费	29,781.57
开户费	400.00
合计	44,080.00

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中泰证券（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
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	459,966,864.76	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中泰证券	8,180.58	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	92,818.48	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.根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	286,777.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	104,685.02
应支付基金管理人的净管理费	182,092.64

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0.80%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X0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,847.21

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值X0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C	合计
交通银行	0.00	789.81	789.81
中泰证券	0.00	91,351.82	91,351.82
中泰资管	0.00	0.05	0.05
合计	0.00	92,141.68	92,141.68

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值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。A类基金份额不收取销售服务费。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×0.40%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中泰中证A500指增发起A

份额单位：份

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金合同生效日（2025年04月01日）持有的基金份额	10,001,333.47
报告期初持有的基金份额	10,001,333.47
报告期间申购/买入总份额	0.00

报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,001,333.47
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.81%

中泰中证A500指增发起C

份额单位：份

项目	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金合同生效日（2025年04月01日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,425,111.16	1,762.74

中泰证券	4,972,814.09	17,248.60
------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——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。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股锁定	19.88	43.81	36	715.68	1,577.16	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025-06-16	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	17	1,700.00	1,700.11	-

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

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

3、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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 2025年06月30日
AAA	-
AAA以下	1,700.11

未评级	-
合计	1,700.11

6.4.13.3 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无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的，A股和港股通标的股票合并计算）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6.4.12。此外，本基金可通过卖出

回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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、5%以内债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年 06月30 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	10,397,925.25	-	-	-	-	-	10,397,925.25
交易性金融资产	-	-	-	-	1,700.11	62,507,633.33	62,509,333.44

应收申购款	-	-	-	-	-	1,699.80	1,699.80
资产总计	10,397,925.25	-	-	-	1,700.11	62,509,333.13	72,908,958.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,551,623.16	5,551,623.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,147.49	56,147.49
应付托管费	-	-	-	-	-	7,018.40	7,018.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,289.88	13,289.88
其他负债	-	-	-	-	-	57,138.02	57,138.02
负债总计	-	-	-	-	-	5,685,216.95	5,685,216.95
利率敏感度缺口	10,397,925.25	-	-	-	1,700.11	56,824,116.18	67,223,741.54

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有债券资产市值占资产净值比例不足5%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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。

本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；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%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	62,507,633.33	92.98
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,700.11	-
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	62,509,333.44	92.99

6.4.13.4.3.2 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，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 2025年06月30日
	比较基准上升5%	3,371,572.00
	比较基准下降5%	-3,371,572.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日
第一层次	62,506,056.17
第二层次	1,700.11
第三层次	1,577.16
合计	62,509,333.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	62,507,633.33	85.73
	其中：股票	62,507,633.33	85.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,700.11	0.00
	其中：债券	1,700.11	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	10,397,925.25	14.26
8	其他各项资产	1,699.80	0.00

9	合计	72,908,958.49	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	205,790.00	0.31
B	采矿业	3,099,587.00	4.61
C	制造业	34,805,072.87	51.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,710,882.00	2.55
E	建筑业	1,323,263.00	1.97
F	批发和零售业	363,222.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,088,976.00	3.11
H	住宿和餐饮业	56,019.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,231,740.24	6.30
J	金融业	9,661,909.00	14.37
K	房地产业	589,888.00	0.88
L	租赁和商务服务业	589,211.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	826,571.00	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	69,711.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	230,822.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	134,443.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	59,987,107.11	89.24

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	283,528.00	0.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,304,763.22	1.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	167,125.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	18,861.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,585.00	0.13
J	金融业	638,024.00	0.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,640.00	0.03
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	2,520,526.22	3.75

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,800	2,537,136.00	3.77
2	300750	宁德时代	7,600	1,916,872.00	2.85
3	600036	招商银行	41,300	1,897,735.00	2.82
4	601318	中国平安	32,400	1,797,552.00	2.67
5	601899	紫金矿业	66,400	1,294,800.00	1.93
6	601398	工商银行	166,100	1,260,699.00	1.88
7	000333	美的集团	15,400	1,111,880.00	1.65
8	600900	长江电力	34,900	1,051,886.00	1.56
9	002594	比亚迪	2,900	962,539.00	1.43
10	300059	东方财富	39,400	911,322.00	1.36
11	601668	中国建筑	156,600	903,582.00	1.34
12	600030	中信证券	29,800	823,076.00	1.22
13	601166	兴业银行	32,900	767,886.00	1.14
14	600938	中国海油	27,500	718,025.00	1.07
15	603259	药明康德	10,100	702,455.00	1.04
16	000858	五粮液	5,800	689,620.00	1.03
17	600276	恒瑞医药	12,900	669,510.00	1.00
18	688981	中芯国际	7,500	661,275.00	0.98
19	601288	农业银行	110,000	646,800.00	0.96
20	002230	科大讯飞	13,200	632,016.00	0.94
21	600919	江苏银行	49,100	586,254.00	0.87
22	000651	格力电器	12,400	557,008.00	0.83
23	300760	迈瑞医疗	2,400	539,400.00	0.80
24	601601	中国太保	14,000	525,140.00	0.78
25	600048	保利发展	64,600	523,260.00	0.78
26	000100	TCL科技	117,700	509,641.00	0.76
27	002371	北方华创	1,100	486,431.00	0.72

28	002475	立讯精密	13,100	454,439.00	0.68
29	601816	京沪高铁	77,100	443,325.00	0.66
30	300274	阳光电源	6,400	433,728.00	0.65
31	688041	海光信息	2,947	416,381.63	0.62
32	601088	中国神华	9,800	397,292.00	0.59
33	002352	顺丰控股	7,900	385,204.00	0.57
34	601919	中远海控	25,400	382,016.00	0.57
35	603019	中科曙光	5,400	380,160.00	0.57
36	300308	中际旭创	2,600	379,236.00	0.56
37	000001	平安银行	31,000	374,170.00	0.56
38	603501	豪威集团	2,900	370,185.00	0.55
39	600760	中航沈飞	6,300	369,306.00	0.55
40	600941	中国移动	3,200	360,160.00	0.54
41	002472	双环传动	10,600	354,994.00	0.53
42	603986	兆易创新	2,800	354,284.00	0.53
43	000933	神火股份	20,700	344,448.00	0.51
44	601728	中国电信	44,200	342,550.00	0.51
45	688012	中微公司	1,840	335,432.00	0.50
46	601766	中国中车	46,500	327,360.00	0.49
47	600887	伊利股份	11,700	326,196.00	0.49
48	601021	春秋航空	5,800	322,770.00	0.48
49	600309	万华化学	5,900	320,134.00	0.48
50	300124	汇川技术	4,800	309,936.00	0.46
51	600031	三一重工	17,200	308,740.00	0.46
52	688256	寒武纪	510	306,765.00	0.46
53	300502	新易盛	2,340	297,226.80	0.44
54	000338	潍柴动力	19,200	295,296.00	0.44
55	601127	赛力斯	2,100	282,072.00	0.42
56	600570	恒生电子	8,200	275,028.00	0.41
57	000807	云铝股份	16,900	270,062.00	0.40
58	601390	中国中铁	47,900	268,719.00	0.40

59	600660	福耀玻璃	4,600	262,246.00	0.39
60	601012	隆基绿能	16,900	253,838.00	0.38
61	000425	徐工机械	32,600	253,302.00	0.38
62	600406	国电南瑞	11,300	253,233.00	0.38
63	601225	陕西煤业	13,100	252,044.00	0.37
64	600690	海尔智家	10,100	250,278.00	0.37
65	688235	百济神州	1,003	234,340.92	0.35
66	000938	紫光股份	9,700	232,703.00	0.35
67	300476	胜宏科技	1,700	228,446.00	0.34
68	002027	分众传媒	31,200	227,760.00	0.34
69	000568	泸州老窖	2,000	226,800.00	0.34
70	002179	中航光电	5,600	226,016.00	0.34
71	600418	江淮汽车	5,500	220,495.00	0.33
72	600585	海螺水泥	10,200	218,994.00	0.33
73	300002	神州泰岳	18,400	217,120.00	0.32
74	300408	三环集团	6,300	210,420.00	0.31
75	600795	国电电力	43,200	209,088.00	0.31
76	688111	金山办公	743	208,077.15	0.31
77	002064	华峰化学	31,400	207,554.00	0.31
78	000683	博源化工	42,500	203,575.00	0.30
79	600183	生益科技	6,700	202,005.00	0.30
80	000063	中兴通讯	6,200	201,438.00	0.30
81	300433	蓝思科技	8,900	198,470.00	0.30
82	300394	天孚通信	2,400	191,616.00	0.29
83	600426	华鲁恒升	8,800	190,696.00	0.28
84	002050	三花智控	7,200	189,936.00	0.28
85	002714	牧原股份	4,500	189,045.00	0.28
86	688036	传音控股	2,314	184,425.80	0.27
87	688271	联影医疗	1,420	181,390.80	0.27
88	600547	山东黄金	5,600	178,808.00	0.27
89	600111	北方稀土	7,000	174,300.00	0.26

90	600862	中航高科	6,500	169,520.00	0.25
91	601888	中国中免	2,700	164,619.00	0.24
92	600010	包钢股份	90,200	161,458.00	0.24
93	002223	鱼跃医疗	4,500	160,200.00	0.24
94	002001	新 和 成	7,400	157,398.00	0.23
95	002625	光启技术	3,800	151,924.00	0.23
96	300015	爱尔眼科	12,100	151,008.00	0.22
97	601633	长城汽车	6,800	146,064.00	0.22
98	601100	恒立液压	2,000	144,000.00	0.21
99	003816	中国广核	39,400	143,416.00	0.21
100	002241	歌尔股份	6,100	142,252.00	0.21
101	601985	中国核电	15,100	140,732.00	0.21
102	002422	科伦药业	3,900	140,088.00	0.21
103	600436	片仔癀	700	140,007.00	0.21
104	002049	紫光国微	2,100	138,306.00	0.21
105	688008	澜起科技	1,641	134,562.00	0.20
106	600176	中国巨石	11,800	134,520.00	0.20
107	603799	华友钴业	3,600	133,272.00	0.20
108	600332	白云山	5,000	131,800.00	0.20
109	601006	大秦铁路	19,900	131,340.00	0.20
110	600153	建发股份	12,400	128,588.00	0.19
111	600905	三峡能源	29,800	126,948.00	0.19
112	000988	华工科技	2,700	126,927.00	0.19
113	600150	中国船舶	3,900	126,906.00	0.19
114	600085	同仁堂	3,400	122,604.00	0.18
115	600885	宏发股份	5,440	121,366.40	0.18
116	601989	中国重工	26,100	121,104.00	0.18
117	002129	TCL中环	15,700	120,576.00	0.18
118	002595	豪迈科技	2,000	118,440.00	0.18
119	002460	赣锋锂业	3,500	118,195.00	0.18
120	300017	网宿科技	10,500	112,560.00	0.17

121	000977	浪潮信息	2,200	111,936.00	0.17
122	300339	润和软件	2,200	111,826.00	0.17
123	002709	天赐材料	6,100	110,532.00	0.16
124	300207	欣旺达	5,500	110,330.00	0.16
125	002456	欧菲光	9,200	109,020.00	0.16
126	601872	招商轮船	17,300	108,298.00	0.16
127	600009	上海机场	3,400	108,018.00	0.16
128	600584	长电科技	3,200	107,808.00	0.16
129	002384	东山精密	2,800	105,756.00	0.16
130	002273	水晶光电	5,200	103,844.00	0.15
131	600089	特变电工	8,600	102,598.00	0.15
132	002466	天齐锂业	3,200	102,528.00	0.15
133	300661	圣邦股份	1,390	101,150.30	0.15
134	002318	久立特材	4,300	100,577.00	0.15
135	600839	四川长虹	10,200	99,144.00	0.15
136	002130	沃尔核材	4,100	97,662.00	0.15
137	000975	山金国际	5,100	96,594.00	0.14
138	600438	通威股份	5,700	95,475.00	0.14
139	002236	大华股份	6,000	95,280.00	0.14
140	002078	太阳纸业	7,000	94,220.00	0.14
141	002812	恩捷股份	3,200	93,728.00	0.14
142	600588	用友网络	7,000	93,590.00	0.14
143	002465	海格通信	6,600	92,004.00	0.14
144	002410	广联达	6,700	89,847.00	0.13
145	300474	景嘉微	1,200	87,600.00	0.13
146	301236	软通动力	1,600	87,424.00	0.13
147	300896	爱美客	500	87,405.00	0.13
148	000786	北新建材	3,300	87,384.00	0.13
149	300919	中伟股份	2,600	85,488.00	0.13
150	000066	中国长城	5,700	84,360.00	0.13
151	601360	三六零	8,200	83,640.00	0.12

152	002415	海康威视	3,000	83,190.00	0.12
153	300251	光线传媒	4,100	83,107.00	0.12
154	002195	岩山科技	14,700	82,761.00	0.12
155	000725	京东方 A	20,600	82,194.00	0.12
156	601877	正泰电器	3,600	81,612.00	0.12
157	600745	闻泰科技	2,400	80,472.00	0.12
158	600104	上汽集团	5,000	80,250.00	0.12
159	002439	启明星辰	4,900	78,351.00	0.12
160	002389	航天彩虹	3,000	76,800.00	0.11
161	000625	长安汽车	6,000	76,560.00	0.11
162	600563	法拉电子	700	76,363.00	0.11
163	000831	中国稀土	2,100	75,852.00	0.11
164	002624	完美世界	5,000	75,850.00	0.11
165	600879	航天电子	7,200	75,384.00	0.11
166	601799	星宇股份	600	75,000.00	0.11
167	300316	晶盛机电	2,700	73,305.00	0.11
168	688099	晶晨股份	1,019	72,359.19	0.11
169	688777	中控技术	1,590	71,406.90	0.11
170	000733	振华科技	1,400	70,070.00	0.10
171	300413	芒果超媒	3,200	69,824.00	0.10
172	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.10
173	002156	通富微电	2,700	69,174.00	0.10
174	600415	小商品城	3,300	68,244.00	0.10
175	300866	安克创新	600	68,160.00	0.10
176	600316	洪都航空	1,800	67,860.00	0.10
177	002459	晶澳科技	6,600	65,868.00	0.10
178	002085	万丰奥威	4,100	65,149.00	0.10
179	300136	信维通信	2,900	64,960.00	0.10
180	300142	沃森生物	5,900	64,900.00	0.10
181	002176	江特电机	8,900	64,614.00	0.10
182	300450	先导智能	2,600	64,610.00	0.10

183	002281	光迅科技	1,300	64,116.00	0.10
184	600096	云天化	2,900	63,713.00	0.09
185	300346	南大光电	2,000	63,280.00	0.09
186	300496	中科创达	1,100	62,942.00	0.09
187	603885	吉祥航空	4,600	61,962.00	0.09
188	600143	金发科技	6,000	61,860.00	0.09
189	600895	张江高科	2,400	61,680.00	0.09
190	601966	玲珑轮胎	4,200	61,614.00	0.09
191	600256	广汇能源	10,200	61,404.00	0.09
192	603392	万泰生物	1,000	61,000.00	0.09
193	300122	智飞生物	3,100	60,729.00	0.09
194	000963	华东医药	1,500	60,540.00	0.09
195	000034	神州数码	1,600	60,224.00	0.09
196	000661	长春高新	600	59,508.00	0.09
197	688617	惠泰医疗	200	59,400.00	0.09
198	605589	圣泉集团	2,100	58,275.00	0.09
199	601179	中国西电	9,400	57,716.00	0.09
200	002252	上海莱士	8,200	56,334.00	0.08
201	300395	菲利华	1,100	56,210.00	0.08
202	002008	大族激光	2,300	56,051.00	0.08
203	600765	中航重机	3,300	55,704.00	0.08
204	000547	航天发展	6,500	54,600.00	0.08
205	002185	华天科技	5,400	54,540.00	0.08
206	603288	海天味业	1,400	54,474.00	0.08
207	002407	多氟多	4,400	53,636.00	0.08
208	688047	龙芯中科	399	53,222.61	0.08
209	002065	东华软件	5,500	52,800.00	0.08
210	688122	西部超导	1,015	52,658.20	0.08
211	600486	扬农化工	900	52,200.00	0.08
212	600460	士兰微	2,100	52,122.00	0.08
213	300253	卫宁健康	4,900	51,940.00	0.08

214	002074	国轩高科	1,600	51,936.00	0.08
215	600161	天坛生物	2,700	51,813.00	0.08
216	300054	鼎龙股份	1,800	51,624.00	0.08
217	002738	中矿资源	1,600	51,456.00	0.08
218	600392	盛和资源	3,900	51,363.00	0.08
219	002405	四维图新	6,000	51,240.00	0.08
220	002414	高德红外	4,900	50,225.00	0.07
221	600196	复星医药	2,000	50,180.00	0.07
222	002340	格林美	7,900	50,165.00	0.07
223	600893	航发动力	1,300	50,102.00	0.07
224	600667	太极实业	7,600	50,008.00	0.07
225	300782	卓胜微	700	49,959.00	0.07
226	688396	华润微	1,052	49,612.32	0.07
227	603659	璞泰来	2,600	48,828.00	0.07
228	002444	巨星科技	1,900	48,469.00	0.07
229	688002	睿创微纳	695	48,455.40	0.07
230	300223	北京君正	700	48,440.00	0.07
231	300073	当升科技	1,100	48,257.00	0.07
232	300568	星源材质	3,800	48,184.00	0.07
233	600741	华域汽车	2,700	47,655.00	0.07
234	603260	合盛硅业	1,000	47,400.00	0.07
235	300418	昆仑万维	1,400	47,082.00	0.07
236	600372	中航机载	3,900	47,034.00	0.07
237	603606	东方电缆	900	46,539.00	0.07
238	300383	光环新网	3,200	45,760.00	0.07
239	600352	浙江龙盛	4,500	45,720.00	0.07
240	600118	中国卫星	1,600	45,712.00	0.07
241	600704	物产中大	8,600	45,322.00	0.07
242	300285	国瓷材料	2,600	45,110.00	0.07
243	002648	卫星化学	2,600	45,058.00	0.07
244	600497	驰宏锌锗	8,500	44,965.00	0.07

245	002558	巨人网络	1,900	44,745.00	0.07
246	300442	润泽科技	900	44,577.00	0.07
247	002202	金风科技	4,300	44,075.00	0.07
248	302132	中航成飞	500	43,970.00	0.07
249	601615	明阳智能	3,800	43,662.00	0.06
250	688180	君实生物	1,282	43,562.36	0.06
251	300088	长信科技	7,300	43,508.00	0.06
252	603129	春风动力	200	43,300.00	0.06
253	600038	中直股份	1,100	42,691.00	0.06
254	002044	美年健康	8,300	42,662.00	0.06
255	002517	恺英网络	2,200	42,482.00	0.06
256	300567	精测电子	700	42,427.00	0.06
257	600498	烽火通信	2,000	42,060.00	0.06
258	000423	东阿阿胶	800	41,840.00	0.06
259	300759	康龙化成	1,700	41,718.00	0.06
260	002180	纳思达	1,800	41,292.00	0.06
261	300014	亿纬锂能	900	41,229.00	0.06
262	002436	兴森科技	3,100	41,044.00	0.06
263	603486	科沃斯	700	40,761.00	0.06
264	600018	上港集团	7,000	39,970.00	0.06
265	688126	沪硅产业	2,120	39,686.40	0.06
266	688303	大全能源	1,832	39,058.24	0.06
267	002312	川发龙蟒	3,400	39,032.00	0.06
268	600000	浦发银行	2,800	38,864.00	0.06
269	300037	新宙邦	1,100	38,720.00	0.06
270	600867	通化东宝	4,700	38,540.00	0.06
271	000999	华润三九	1,230	38,474.40	0.06
272	601117	中国化学	5,000	38,350.00	0.06
273	002409	雅克科技	700	38,283.00	0.06
274	300601	康泰生物	2,500	37,975.00	0.06
275	600177	雅戈尔	5,200	37,960.00	0.06

276	300454	深信服	400	37,672.00	0.06
277	300144	宋城演艺	4,400	37,620.00	0.06
278	600763	通策医疗	900	37,152.00	0.06
279	600335	国机汽车	5,700	36,765.00	0.05
280	601058	赛轮轮胎	2,800	36,736.00	0.05
281	300604	长川科技	800	35,928.00	0.05
282	002245	蔚蓝锂芯	2,800	35,924.00	0.05
283	000768	中航西飞	1,300	35,542.00	0.05
284	300676	华大基因	700	34,839.00	0.05
285	300751	迈为股份	500	34,780.00	0.05
286	000039	中集集团	4,400	34,584.00	0.05
287	301358	湖南裕能	1,100	34,309.00	0.05
288	600521	华海药业	1,800	33,534.00	0.05
289	002271	东方雨虹	3,100	33,263.00	0.05
290	601000	唐山港	8,100	32,886.00	0.05
291	300724	捷佳伟创	600	32,580.00	0.05
292	600988	赤峰黄金	1,300	32,344.00	0.05
293	600131	国网信通	1,800	31,860.00	0.05
294	300012	华测检测	2,700	31,563.00	0.05
295	002007	华兰生物	2,000	31,340.00	0.05
296	002025	航天电器	600	30,846.00	0.05
297	600859	王府井	2,200	30,558.00	0.05
298	600655	豫园股份	5,500	30,525.00	0.05
299	601607	上海医药	1,700	30,396.00	0.05
300	600004	白云机场	3,300	30,030.00	0.04
301	300757	罗博特科	200	29,994.00	0.04
302	002463	沪电股份	700	29,806.00	0.04
303	300118	东方日升	3,100	29,698.00	0.04
304	002497	雅化集团	2,600	29,640.00	0.04
305	300627	华测导航	840	29,400.00	0.04
306	600516	方大炭素	6,300	29,232.00	0.04

307	600323	瀚蓝环境	1,200	29,220.00	0.04
308	600754	锦江酒店	1,300	29,172.00	0.04
309	300558	贝达药业	500	28,975.00	0.04
310	605358	立昂微	1,200	27,960.00	0.04
311	002128	电投能源	1,400	27,692.00	0.04
312	603087	甘李药业	500	27,390.00	0.04
313	300033	同花顺	100	27,301.00	0.04
314	600258	首旅酒店	1,900	26,847.00	0.04
315	600529	山东药玻	1,200	26,568.00	0.04
316	601216	君正集团	4,800	26,496.00	0.04
317	603596	伯特利	500	26,345.00	0.04
318	300003	乐普医疗	1,900	26,182.00	0.04
319	002544	普天科技	1,100	25,795.00	0.04
320	601018	宁波港	7,000	25,620.00	0.04
321	002756	永兴材料	800	25,400.00	0.04
322	000629	钒钛股份	9,900	25,344.00	0.04
323	300457	赢合科技	1,100	25,300.00	0.04
324	002841	视源股份	700	24,220.00	0.04
325	002152	广电运通	1,800	24,192.00	0.04
326	000519	中兵红箭	1,100	24,079.00	0.04
327	000400	许继电气	1,100	23,947.00	0.04
328	600499	科达制造	2,400	23,520.00	0.03
329	688223	晶科能源	4,457	23,131.83	0.03
330	600482	中国动力	1,000	23,070.00	0.03
331	603816	顾家家居	900	22,968.00	0.03
332	600141	兴发集团	1,100	22,583.00	0.03
333	603833	欧派家居	400	22,580.00	0.03
334	002138	顺络电子	800	22,496.00	0.03
335	002028	思源电气	300	21,873.00	0.03
336	688599	天合光能	1,488	21,620.64	0.03
337	002916	深南电路	200	21,562.00	0.03

338	000408	藏格矿业	500	21,335.00	0.03
339	603806	福斯特	1,600	20,736.00	0.03
340	002920	德赛西威	200	20,426.00	0.03
341	002266	浙富控股	6,600	20,328.00	0.03
342	000035	中国天楹	4,700	20,163.00	0.03
343	002091	江苏国泰	2,700	19,629.00	0.03
344	600998	九州通	3,800	19,532.00	0.03
345	600489	中金黄金	1,300	19,019.00	0.03
345	002555	三七互娱	1,100	19,019.00	0.03
347	600050	中国联通	3,500	18,690.00	0.03
348	688578	艾力斯	200	18,608.00	0.03
349	002432	九安医疗	500	18,215.00	0.03
350	002572	索菲亚	1,300	18,213.00	0.03
351	002601	龙佰集团	1,100	17,831.00	0.03
352	601866	中远海发	7,100	17,537.00	0.03
353	600511	国药股份	600	17,496.00	0.03
354	600011	华能国际	2,400	17,136.00	0.03
355	000630	铜陵有色	5,100	17,034.00	0.03
356	002603	以岭药业	1,200	16,920.00	0.03
357	600039	四川路桥	1,700	16,830.00	0.03
358	000998	隆平高科	1,700	16,745.00	0.02
359	600845	宝信软件	700	16,534.00	0.02
360	000032	深桑达 A	800	16,184.00	0.02
361	603650	彤程新材	500	16,075.00	0.02
362	600008	首创环保	5,300	16,006.00	0.02
363	300347	泰格医药	300	15,996.00	0.02
364	600346	恒力石化	1,100	15,686.00	0.02
365	600820	隧道股份	2,500	15,250.00	0.02
366	000157	中联重科	2,100	15,183.00	0.02
367	688009	中国通号	2,913	14,972.82	0.02
368	603899	晨光股份	500	14,495.00	0.02

369	600170	上海建工	6,000	14,340.00	0.02
369	600160	巨化股份	500	14,340.00	0.02
371	603613	国联股份	600	14,214.00	0.02
372	600362	江西铜业	600	14,058.00	0.02
373	601636	旗滨集团	2,800	14,028.00	0.02
374	002739	万达电影	1,200	13,716.00	0.02
375	000426	兴业银锡	800	12,640.00	0.02
376	600549	厦门钨业	600	12,552.00	0.02
377	600535	天士力	800	12,520.00	0.02
378	603939	益丰药房	500	12,235.00	0.02
379	000967	盈峰环境	1,700	11,815.00	0.02
380	300832	新产业	200	11,344.00	0.02
381	000538	云南白药	200	11,158.00	0.02
382	002353	杰瑞股份	300	10,500.00	0.02
383	300628	亿联网络	300	10,428.00	0.02
384	000738	航发控制	500	10,375.00	0.02
385	600487	亨通光电	600	9,180.00	0.01
386	601567	三星医疗	400	8,968.00	0.01
387	002155	湖南黄金	500	8,925.00	0.01
388	600129	太极集团	400	8,524.00	0.01
389	000623	吉林敖东	500	8,475.00	0.01
390	600315	上海家化	400	8,428.00	0.01
391	002145	中核钛白	1,800	7,470.00	0.01
392	600166	福田汽车	2,700	7,317.00	0.01
393	601600	中国铝业	1,000	7,040.00	0.01
394	002831	裕同科技	300	7,026.00	0.01
395	600219	南山铝业	1,700	6,511.00	0.01
396	600398	海澜之家	900	6,264.00	0.01
397	600803	新奥股份	300	5,670.00	0.01
398	601238	广汽集团	700	5,243.00	0.01
399	000617	中油资本	700	5,110.00	0.01

400	001914	招商积余	400	4,948.00	0.01
401	000878	云南铜业	300	3,816.00	0.01
402	601677	明泰铝业	300	3,726.00	0.01
403	002938	鹏鼎控股	100	3,203.00	0.00
404	300699	光威复材	100	3,167.00	0.00
405	600312	平高电气	200	3,078.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601838	成都银行	15,200	305,520.00	0.45
2	300498	温氏股份	16,600	283,528.00	0.42
3	600282	南钢股份	46,800	196,560.00	0.29
4	600522	中天科技	12,100	174,966.00	0.26
5	601939	建设银行	18,400	173,696.00	0.26
6	600025	华能水电	17,500	167,125.00	0.25
7	002332	仙琚制药	13,600	124,712.00	0.19
8	002142	宁波银行	4,300	117,648.00	0.18
9	600298	安琪酵母	3,200	112,544.00	0.17
10	300373	扬杰科技	1,900	98,610.00	0.15
11	600600	青岛啤酒	1,400	97,244.00	0.14
12	603444	吉比特	300	90,585.00	0.13
13	002850	科达利	800	90,536.00	0.13
14	300470	中密控股	2,100	77,217.00	0.11
15	002003	伟星股份	6,200	67,642.00	0.10
16	688085	三友医疗	2,478	47,651.94	0.07
17	002311	海大集团	800	46,872.00	0.07
18	603699	纽威股份	1,500	46,755.00	0.07
19	603100	川仪股份	2,100	43,323.00	0.06

20	601881	中国银河	2,400	41,160.00	0.06
21	600285	羚锐制药	1,700	38,539.00	0.06
22	603400	华之杰	360	20,168.28	0.03
23	601827	三峰环境	2,100	17,640.00	0.03
24	000429	粤高速 A	1,200	15,996.00	0.02
25	603195	公牛集团	240	11,580.00	0.02
26	002032	苏泊尔	100	5,239.00	0.01
27	600060	海信视像	200	4,604.00	0.01
28	603565	中谷物流	300	2,865.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	9,309,049.00	13.85
2	300750	宁德时代	6,656,294.00	9.90
3	600036	招商银行	5,912,803.00	8.80
4	601318	中国平安	5,407,464.00	8.04
5	601398	工商银行	4,363,639.00	6.49
6	601899	紫金矿业	4,286,065.00	6.38
7	002594	比亚迪	3,793,443.00	5.64
8	000333	美的集团	3,761,660.11	5.60
9	600900	长江电力	3,477,808.00	5.17
10	300059	东方财富	2,870,590.00	4.27
11	601668	中国建筑	2,713,603.00	4.04
12	600030	中信证券	2,639,217.00	3.93
13	600276	恒瑞医药	2,622,052.00	3.90
14	000858	五粮液	2,454,001.00	3.65
15	688981	中芯国际	2,448,252.88	3.64

16	600938	中国海油	2,402,701.00	3.57
17	603259	药明康德	2,359,293.00	3.51
18	600309	万华化学	2,231,438.00	3.32
19	002230	科大讯飞	2,157,490.00	3.21
20	300760	迈瑞医疗	2,014,392.00	3.00
21	002475	立讯精密	2,000,994.00	2.98
22	601166	兴业银行	1,993,036.00	2.96
23	601288	农业银行	1,965,770.00	2.92
24	000651	格力电器	1,844,227.00	2.74
25	600048	保利发展	1,814,433.00	2.70
26	601816	京沪高铁	1,798,011.00	2.67
27	600919	江苏银行	1,780,229.00	2.65
28	601601	中国太保	1,719,588.00	2.56
29	600887	伊利股份	1,708,300.00	2.54
30	603019	中科曙光	1,584,732.00	2.36
31	600941	中国移动	1,538,933.00	2.29
32	601600	中国铝业	1,533,110.00	2.28
33	600585	海螺水泥	1,516,454.00	2.26
34	002371	北方华创	1,509,927.00	2.25
35	688041	海光信息	1,494,192.91	2.22
36	601088	中国神华	1,484,677.00	2.21
37	600795	国电电力	1,465,460.00	2.18
38	601728	中国电信	1,432,675.00	2.13
39	000725	京东方 A	1,421,002.00	2.11
40	300274	阳光电源	1,390,518.00	2.07
41	603986	兆易创新	1,379,175.00	2.05
42	002352	顺丰控股	1,353,808.00	2.01
43	600674	川投能源	1,347,759.00	2.00

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	6,584,101.00	9.79
2	300750	宁德时代	4,872,473.00	7.25
3	600036	招商银行	4,278,569.00	6.36
4	601318	中国平安	3,823,278.00	5.69
5	601398	工商银行	3,378,803.00	5.03
6	601899	紫金矿业	3,239,531.00	4.82
7	002594	比亚迪	2,815,102.00	4.19
8	600900	长江电力	2,670,139.00	3.97
9	000333	美的集团	2,622,105.00	3.90
10	600276	恒瑞医药	2,024,642.08	3.01
11	601668	中国建筑	1,997,995.00	2.97
12	300059	东方财富	1,952,269.00	2.90
13	600030	中信证券	1,848,825.00	2.75
14	688981	中芯国际	1,811,143.01	2.69
15	600938	中国海油	1,695,210.00	2.52
16	000858	五粮液	1,679,736.00	2.50
17	603259	药明康德	1,613,373.00	2.40
18	600309	万华化学	1,556,904.00	2.32
19	002230	科大讯飞	1,529,045.00	2.27
20	601288	农业银行	1,505,931.00	2.24
21	300760	迈瑞医疗	1,453,952.00	2.16
22	600887	伊利股份	1,443,454.00	2.15
23	601600	中国铝业	1,406,516.00	2.09
24	600674	川投能源	1,389,154.00	2.07
25	601816	京沪高铁	1,380,454.00	2.05
26	600919	江苏银行	1,359,369.00	2.02
27	601166	兴业银行	1,345,224.00	2.00

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	260,897,191.85
卖出股票收入（成交）总额	199,076,829.71

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,700.11	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,700.11	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123257	安克转债	17	1,700.11	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,699.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,699.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中泰中证A500 指增发起A	301	119,462.67	16,523,666.72	45.95%	19,434,596.87	54.05%
中泰中证A500 指增发起C	388	77,680.64	800,186.67	2.65%	29,339,901.57	97.35%
合计	689	95,933.75	17,323,853.39	26.21%	48,774,498.44	73.79%

注：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。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中泰中证A500指 增发起A	131,875.01	0.37%
	中泰中证A500指 增发起C	36,107.23	0.12%
	合计	167,982.24	0.25%

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

8.3 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A500指增 发起A	10~50
	中泰中证A500指增 发起C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	中泰中证A500指增 发起A	0
	中泰中证A500指增 发起C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
----	--------	----------------------	--------	----------------------	--------------------

基金管理人固有资金	10,001,333.47	15.13%	10,001,333.47	15.13%	不低于三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,001,333.47	15.13%	10,001,333.47	15.13%	不低于三年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰中证A500指增发起 A	中泰中证A500指增发起 C
基金合同生效日(2025年04月01日)基金份额总额	59,681,493.78	158,195,871.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,420,577.00	426,299.68
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	25,143,807.19	128,482,082.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,958,263.59	30,140,088.24

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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日聘任姜诚先生担任公司副总经理。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	3	459,966,864.76	100.00%	92,818.48	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	8,180.58	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、中国证监会规定网站	2025-04-02
2	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	证券时报、中国证监会规定网站	2025-04-28
3	关于中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2025-04-28

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰中证A500指数增强型发起式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。

11.2 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。

11.3 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。

中泰证券（上海）资产管理有限公司
二〇二五年八月二十八日