

中泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1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	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	9
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	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	17
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	45
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12	投资组合报告附注	64
§ 8	基金份额持有人信息	66
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66

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.....	67
§ 9 开放式基金份额变动.....	67
§ 10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	71
§ 12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	中泰沪深300指数增强	
基金主代码	008238	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	205,896,432.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	008238	008239
报告期末下属分级基金的份额总额	45,594,390.54份	160,302,042.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深300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	$95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王洪懿	石立平
	联系电话	021-20521199	010-63639180
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-821-0808	95595
传真		021-50933716	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	北京市西城区太平桥大街25 号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄文卿	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
本期已实现收益	10,567,075.14	27,619,572.46
本期利润	5,514,166.63	11,893,749.91
加权平均基金份额本期利润	0.0986	0.0694
本期加权平均净值利润率	6.31%	4.47%
本期基金份额净值增长率	4.22%	4.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	26,985,671.36	93,611,726.63
期末可供分配基金份额利润	0.5919	0.5840
期末基金资产净值	72,580,061.90	253,913,768.73
期末基金份额净值	1.5919	1.5840
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	59.19%	58.40%

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

中泰沪深300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
过去一个月	-0.10%	0.73%	-1.91%	0.76%	1.81%	-0.03%
过去三个月	5.63%	0.92%	3.32%	0.93%	2.31%	-0.01%
过去六个月	4.22%	1.21%	0.29%	1.25%	3.93%	-0.04%
过去一年	40.18%	1.24%	24.19%	1.27%	15.99%	-0.03%
自基金合同生效起至今	59.19%	1.18%	39.46%	1.20%	19.73%	-0.02%

中泰沪深300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
过去一个月	-0.13%	0.73%	-1.91%	0.76%	1.78%	-0.03%
过去三个月	5.52%	0.92%	3.32%	0.93%	2.20%	-0.01%
过去六个月	4.01%	1.21%	0.29%	1.25%	3.72%	-0.04%
过去一年	39.62%	1.24%	24.19%	1.27%	15.43%	-0.03%
自基金合同生效起至今	58.40%	1.18%	39.46%	1.20%	18.94%	-0.02%

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

中泰沪深300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
(2020年04月01日-2021年06月30日)



中泰沪深300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
(2020年04月01日-2021年06月30日)



§ 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2021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、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、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、中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰兴诚价值一年期持有期混合型证券投资基金和中泰星宇价值成长一年封闭运作混合型证券投资基金共十一只证券投资基金。

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；中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理	2020-04-01	-	7	国籍：中国。学历：华东师范大学统计系硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司财务部IT运维工程师；上海国泰君安证券资产管理有限公司运营部副总经理、量化投资部首席研究员。2014年10月加入中泰证券

					(上海)资产管理有限公司任对冲基金部副总经理、现任基金业务部副总经理。2019年12月11日起至今担任中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理。2020年4月1日起至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《证券业从业人员资格管理规定》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,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。

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。

4.3.2 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。公司管理的同一产品或不同产品之间在同一交易日内进行的反向交易，关联交易，以及买卖法规、产品管理合同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。产品收盘前15 分钟的密集交易达到当日市场交易量的10%，则认定为交易时间异常型异常交易。不同产品临近交易日的同向交易价格差达到5%以上，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品单独或共同在单个交易日的交易量占市场交易量比例达到30%以上，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，要求基金经理（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

2021年上半年，沪深300指数在一季度经历了一轮上涨之后迅速回调，然后保持一种区间震荡的走势。从本季度沪深300指数的不同行业表现来看，汽车、生物制药、硬件等行业涨幅明显，而地产、保险、而耐用消费等行业则表现较差。

通过在维持指数跟踪基础上的组合优化，并利用持仓参与新股申购，2021年上半年本基金取得一定的超额收益。同时，通过量化方法约束跟踪误差，跟踪误差控制在一个适当的水平。我们将进一步优化基于价值投资理念的投资策略，争取在控制好跟踪误差的基础上更好的提高组合收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰沪深300指数增强A基金份额净值为1.5919元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.22%，同期业绩比较基准收益率为0.29%；截至报告期末中泰沪深300指数增强C基金份额净值为1.5840元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.01%，同期业绩比较基准收益率为0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从大方向上看，以中美为主引领世界经济复苏强劲势头有所变缓，随着主要经济体疫苗接种的基本完成，我们认为过去一段时间对世界经济复苏的乐观预期也将兑现见顶。另一方面，全球性的货币宽松还将继续一段时间，通胀压力也将持续。

反映到市场上，我们认为大宗商品还有一定的上涨趋势。对于股票市场而言，由于不同行业受疫情的影响程度不同，其后在各种政策刺激下恢复进度也有所差异，我们认为下半年股票市场也结构性行情分化的特性将依然继续，我们认为前期恢复较慢医药、农产品、食品等行业，以及旅游、酒店、航空等消费服务业，存在更多的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的

风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中泰沪深300指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中泰沪深300指数增强型证券投资基金2021年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中泰沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	34,894,086.25	26,311,565.42
结算备付金		1,288,633.02	1,386,354.75
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	300,943,115.00	403,006,303.84
其中：股票投资		300,781,902.49	402,935,303.84
基金投资		-	-
债券投资		161,212.51	71,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	15,000,037.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,106.14	7,259.09
应收股利		-	-
应收申购款		107,192.52	522,853.79
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		337,241,132.93	446,234,374.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,182,779.29	638,228.08
应付管理人报酬		220,600.19	287,780.44
应付托管费		27,575.04	35,972.56
应付销售服务费		86,793.11	95,089.66
应付交易费用	6.4.7.6	-	-
应交税费		0.34	309.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	229,554.33	200,840.73
负债合计		10,747,302.30	1,258,220.47
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	205,896,432.64	291,901,305.81
未分配利润	6.4.7.9	120,597,397.99	153,074,848.11
所有者权益合计		326,493,830.63	444,976,153.92
负债和所有者权益总计		337,241,132.93	446,234,374.39

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额205,896,432.64份，其中中泰沪深300指数增强A类份额45,594,390.54份，中泰沪深300指数增强C类份额160,302,042.10份。A类份额净值1.5919元，C类份额净值1.5840元。

6.2 利润表

会计主体：中泰沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年04月01日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		21,019,409.29	50,286,390.81
1. 利息收入		127,801.63	119,806.70
其中：存款利息收入	6.4.7.10	112,571.65	119,789.44
债券利息收入		35.58	17.26
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		15,194.40	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		41,361,988.77	35,942,610.74
其中：股票投资收益	6.4.7.11	38,782,731.24	33,411,991.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	105,661.98	15,868.36
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-108,220.78	76,252.43
股利收益	6.4.7.14	2,581,816.33	2,438,498.71
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	-20,778,731.06	13,837,742.64
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.16	308,349.95	386,230.73

号填列)			
减：二、费用		3,611,492.75	2,513,380.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,410,524.68	771,503.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	176,315.53	96,437.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	529,861.05	219,834.08
4. 交易费用	6.4.7.17	1,301,193.12	1,322,600.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		570.89	1,710.65
7. 其他费用	6.4.7.18	193,027.48	101,294.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,407,916.54	47,773,010.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,407,916.54	47,773,010.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中泰沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	291,901,305.81	153,074,848.11	444,976,153.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,407,916.54	17,407,916.54

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-86,004,873.17	-49,885,366.66	-135,890,239.83
其中:1.基金申购款	107,759,692.39	60,982,395.09	168,742,087.48
2.基金赎回款	-193,764,565.56	-110,867,761.75	-304,632,327.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	205,896,432.64	120,597,397.99	326,493,830.63
项 目	上年度可比期间		
	2020年04月01日(基金合同生效日)至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	556,129,042.30	-	556,129,042.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	47,773,010.00	47,773,010.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-383,248,264.83	-24,426,981.50	-407,675,246.33
其中:1.基金申购款	10,017,682.24	583,415.34	10,601,097.58
2.基金赎回款	-393,265,947.07	-25,010,396.84	-418,276,343.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	172,880,777.47	23,346,028.50	196,226,805.97

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

中泰沪深300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]2115号《关于准予中泰沪深300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《中泰沪深300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555,940,813.06元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0248号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》于2020年4月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为556,129,042.30份基金份额,其中认购资金利息折合188,229.24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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和《中泰沪深300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。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰沪深300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%,投资于沪深300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 $95\% \times$ 沪深300指数收益率 $+5\% \times$ 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2021年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

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

(3) 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。对基金从上市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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	13,000,064.98
定期存款	-
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	21,894,021.27
合计	34,894,086.25

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 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		286,319,260.86	300,781,902.49	14,462,641.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	141,100.00	161,212.51	20,112.51
	银行间市场	-	-	-
	合计	141,100.00	161,212.51	20,112.51

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	286,460,360.86	300,943,115.00	14,482,754.14

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,038.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	4,595.38
应收结算备付金利息	1,457.29
应收债券利息	14.56
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	8,106.14

6.4.7.6 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	248.38
预提费用	89,260.15
其他应付	140,045.80
合计	229,554.33

6.4.7.8 实收基金

6.4.7.8.1 中泰沪深300指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300指数增强A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	98,100,287.70	98,100,287.70
本期申购	29,436,341.29	29,436,341.29
本期赎回(以“-”号填列)	-81,942,238.45	-81,942,238.45
本期末	45,594,390.54	45,594,390.54

6.4.7.8.2 中泰沪深300指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300指数增强C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	193,801,018.11	193,801,018.11
本期申购	78,323,351.10	78,323,351.10
本期赎回(以“-”号填列)	-111,822,327.11	-111,822,327.11
本期末	160,302,042.10	160,302,042.10

6.4.7.9 未分配利润

6.4.7.9.1 中泰沪深300指数增强A

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300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	43,972,942.92	7,766,780.82	51,739,723.74
本期利润	10,567,075.14	-5,052,908.51	5,514,166.63
本期基金份额交易产生的变动数	-26,940,741.79	-3,327,477.22	-30,268,219.01
其中：基金申购款	15,485,093.27	1,745,736.49	17,230,829.76
基金赎回款	-42,425,835.06	-5,073,213.71	-47,499,048.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,599,276.27	-613,604.91	26,985,671.36

6.4.7.9.2 中泰沪深300指数增强C

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300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	86,022,933.89	15,312,190.48	101,335,124.37
本期利润	27,619,572.46	-15,725,822.55	11,893,749.91
本期基金份额交易产生的变动数	-17,898,388.55	-1,718,759.10	-19,617,147.65
其中：基金申购款	42,810,443.61	941,121.72	43,751,565.33
基金赎回款	-60,708,832.16	-2,659,880.82	-63,368,712.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,744,117.80	-2,132,391.17	93,611,726.63

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	31,513.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	72,892.77
结算备付金利息收入	8,165.56
其他	-
合计	112,571.65

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	809,391,640.39
减：卖出股票成本总额	770,608,909.15
买卖股票差价收入	38,782,731.24

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	105,661.98
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	105,661.98

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	355,586.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	249,900.00
减：应收利息总额	24.26
买卖债券差价收入	105,661.98

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	-108,220.78

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,581,816.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,581,816.33

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-20,778,731.06
——股票投资	-20,798,843.57
——债券投资	20,112.51
——资产支持证券投资	-

——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	-20,778,731.06

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	308,131.10
其他	182.68
转换费收入	36.17
合计	308,349.95

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,298,936.94
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	2,256.18
合计	1,301,193.12

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	3,767.33
指数使用费	100,000.00
合计	193,027.48

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露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
中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年04月01日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,410,524.68	771,503.65
其中：支付销售机构的客户维护费	318,936.02	297,595.73

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×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年04月01日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	176,315.53	96,437.96

注：支付基金托管人光大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×0.10%/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	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

名称	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C	合计
光大银行股份有限公司	0.00	68,065.09	68,065.09
中泰证券股份有限公司	0.00	47,191.45	47,191.45
中泰证券(上海)资产管理有限公司	0.00	320,967.42	320,967.42
合计	0.00	436,223.96	436,223.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年04月01日(基金合同生效日)至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C	合计
光大银行股份有限公司	0.00	35,727.49	35,727.49
中泰证券股份有限公司	0.00	97,380.82	97,380.82
中泰证券(上海)资产管理有限公司	0.00	24,053.89	24,053.89
合计	0.00	157,162.20	157,162.20

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，按月支付给中泰证券（上海）资产管理有限公司，再由中泰证券（上海）资产管理有限公司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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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**

本报告期基金管理人未持有本基金。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年04月01日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	13,000,064.98	31,513.32	4,403,815.25	33,502.70

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中泰证券	688662.SH	富信科技	首次公开发行	2,556	39,899.16
中泰证券	688663.SH	新风光	首次公开发行	3,279	47,479.92
中泰证券	688383.SH	新益昌	首次公开发行	2,701	52,885.58
中泰	605296.SH	神农集团	首次公开发行	569	31,909.52

证券					
中泰 证券	300996.SZ	普联软件	首次公开发行	2,410	50,152.10

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的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（2021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	可流通日	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
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	限售股	150.50	524.08	918	138,159.00	481,105.44	-
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	限售股	41.79	43.69	7,237	302,434.23	316,184.53	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	限售股	43.22	63.82	3,936	170,113.92	251,195.52	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	限售股	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688630	芯碁微装	2021-03-25	2021-10-08	限售股	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	限售股	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	限售股	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	限售股	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	限售股	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	限售股	24.60	163.00	512	12,595.20	83,456.00	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	限售股	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	限售股	47.33	251.96	241	11,406.53	60,722.36	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	限售股	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	限售股	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	限售股	28.28	115.71	312	8,823.36	36,101.52	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	限售股	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	限售股	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	限售股	48.59	90.39	249	12,098.91	22,507.11	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	限售股	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-

中泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告

301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	限售股	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	限售股	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	限售股	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	限售股	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	限售股	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	限售股	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	限售股	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	限售股	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	限售股	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	限售股	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	限售股	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	限售股	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	限售股	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	限售股	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	限售股	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	限售股	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	限售股	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	限售股	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	限售股	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	限售股	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	限售股	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	限售股	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	限售股	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	限售股	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	限售股	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	限售股	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	限售股	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	限售股	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	限售股	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	限售股	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	限售股	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	限售股	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	限售股	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	限售股	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	限售股	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	限售股	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	限售股	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	限售股	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	限售股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	限售股	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	限售股	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	限售股	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	限售股	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-

中泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告

300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	限售股	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	限售股	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	限售股	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	限售股	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	限售股	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	限售股	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-01-06	限售股	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

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	可流通日	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
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	430	43,000.00	43,000.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新债未上市	100.00	100.00	320	32,000.00	32,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新债未上市	100.00	100.00	12	1,200.00	1,200.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

5、以上可流通日的日期为预估日期，实际流通日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	6,400	40,960.00	35,776.00	-

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	75,000.00	11,000.00
AAA以下	86,212.51	60,000.00
未评级	-	-
合计	161,212.51	71,000.00

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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							
银行存款	34,894,086.25	-	-	-	-	-	34,894,086.25
结算备付金	1,288,633.02	-	-	-	-	-	1,288,633.02
交易性金融资产	-	-	161,212.51	-	-	300,781,902.49	300,943,115.00
应收利息	-	-	-	-	-	8,106.14	8,106.14
应收申购款	-	-	-	-	-	107,192.52	107,192.52
资产总计	36,182,719.27	-	161,212.51	-	-	300,897,201.15	337,241,132.93

中泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,182,779.29	10,182,779.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	220,600.19	220,600.19
应付托管费	-	-	-	-	-	27,575.04	27,575.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	86,793.11	86,793.11
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	229,554.33	229,554.33
负债总计	-	-	-	-	-	10,747,302.30	10,747,302.30
利率敏感度缺口	36,182,719.27	-	161,212.51	-	-	290,149,898.85	326,493,830.63
上年度末 2020年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,311,565.42	-	-	-	-	-	26,311,565.42
结算备付金	1,386,354.75	-	-	-	-	-	1,386,354.75
交易性金融资产	-	-	71,000.00	-	-	402,935,303.84	403,006,303.84
买入返售金融资产	15,000,037.50	-	-	-	-	-	15,000,037.50
应收利息	-	-	-	-	-	7,259.09	7,259.09
应收申购款	-	-	-	-	-	522,853.79	522,853.79
资产总计	42,697,957.67	-	71,000.00	-	-	403,465,416.72	446,234,374.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	638,228.08	638,228.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	287,780.44	287,780.44
应付托管费	-	-	-	-	-	35,972.56	35,972.56
应付销	-	-	-	-	-	95,089.66	95,089.66

售服务费							
应交税费	-	-	-	-	-	309.00	309.00
其他负债	-	-	-	-	-	200,840.73	200,840.73
负债总计	-	-	-	-	-	1,258,220.47	1,258,220.47
利率敏感度缺口	42,697,957.67	-	71,000.00	-	-	402,207,196.25	444,976,153.92

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

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。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于沪深300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%。

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 2021年06月30日		上年度末 2020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	300,781,902.49	92.12	402,935,303.84	90.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	161,212.51	0.05	71,000.00	0.02
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	300,943,115.00	92.17	403,006,303.84	90.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设 1、假设基金的市场价格风险主要源于系统性风险，公司采用beta系数来衡量股票投资的系统性风险，股票基准值为沪深300指数； 2、假设除比较基准变动外，影响基金资产净值的其他价格风险变量保持不变； 3、假设比较基准变动5%，采用线性回归法分析，因而业绩比较基准的变化对基金的净值影响线性相关。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	比较基准上升5%	16,133,221.28	20,794,261.52

	比较基准下降5%	-16, 133, 221. 28	-20, 794, 261. 52
--	----------	-------------------	-------------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为297, 572, 252. 13元，属于第二层次的余额为3, 370, 862. 87元，无属于第三层次的余额（2020年12月31日：第一层次399, 080, 062. 29元，第二层次3, 926, 241. 55元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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资产（2020年12月31日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债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相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	300,781,902.49	89.19
	其中：股票	300,781,902.49	89.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	161,212.51	0.05
	其中：债券	161,212.51	0.05
	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	36,182,719.27	10.73
8	其他各项资产	115,298.66	0.03
9	合计	337,241,132.93	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	545,184.20	0.17
B	采矿业	5,704,387.00	1.75
C	制造业	153,646,547.78	47.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,729,897.96	1.14
E	建筑业	1,994,014.00	0.61
F	批发和零售业	1,959,731.00	0.60

G	交通运输、仓储和邮政业	3,162,873.60	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,687,520.20	1.74
J	金融业	65,245,090.35	19.98
K	房地产业	6,563,642.00	2.01
L	租赁和商务服务业	6,457,714.90	1.98
M	科学研究和技术服务业	5,736,041.52	1.76
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,470,464.90	0.76
R	文化、体育和娱乐业	709,323.80	0.22
S	综合	-	-
	合计	263,612,433.21	80.74

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	173,884.00	0.05
C	制造业	26,721,646.56	8.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	2,695,419.37	0.83
F	批发和零售业	1,129,851.32	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	1,119,686.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	2,888,364.73	0.88

	术服务业		
J	金融业	429,470.10	0.13
K	房地产业	82,368.00	0.03
L	租赁和商务服务业	163,491.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,071,534.20	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	669,443.33	0.21
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	37,169,469.28	11.38

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	8,853	18,207,965.10	5.58
2	600036	招商银行	238,246	12,910,550.74	3.95
3	601318	中国平安	180,500	11,602,540.00	3.55
4	000858	五粮液	33,795	10,067,192.55	3.08
5	002415	海康威视	105,600	6,811,200.00	2.09
6	601012	隆基股份	64,200	5,703,528.00	1.75

7	603259	药明康德	36,328	5,688,601.52	1.74
8	000333	美的集团	73,400	5,238,558.00	1.60
9	000001	平安银行	227,100	5,137,002.00	1.57
10	000568	泸州老窖	21,200	5,001,928.00	1.53
11	601211	国泰君安	281,400	4,823,196.00	1.48
12	601888	中国中免	15,749	4,726,274.90	1.45
13	000651	格力电器	89,000	4,636,900.00	1.42
14	600887	伊利股份	114,697	4,224,290.51	1.29
15	002594	比亚迪	16,700	4,191,700.00	1.28
16	603501	韦尔股份	13,000	4,186,000.00	1.28
17	600030	中信证券	163,200	4,070,208.00	1.25
18	600919	江苏银行	561,380	3,985,798.00	1.22
19	600276	恒瑞医药	57,892	3,934,919.24	1.21
20	300059	东方财富	119,116	3,905,813.64	1.20
21	002475	立讯精密	74,855	3,443,330.00	1.05
22	603288	海天味业	26,297	3,390,998.15	1.04
23	601398	工商银行	652,800	3,374,976.00	1.03
24	600900	长江电力	159,839	3,299,076.96	1.01
25	000002	万科 A	138,300	3,292,923.00	1.01
26	000063	中兴通讯	95,000	3,156,850.00	0.97
27	601319	中国人保	514,200	3,049,206.00	0.93
28	600309	万华化学	27,500	2,992,550.00	0.92
29	601899	紫金矿业	299,900	2,906,031.00	0.89
30	300122	智飞生物	15,300	2,856,969.00	0.88
31	002142	宁波银行	73,138	2,850,187.86	0.87
32	000725	京东方 A	456,700	2,849,808.00	0.87
33	300124	汇川技术	37,900	2,814,454.00	0.86
34	000661	长春高新	6,700	2,592,900.00	0.79
35	600585	海螺水泥	61,700	2,532,785.00	0.78
36	601377	兴业证券	260,900	2,520,294.00	0.77

37	600031	三一重工	86,602	2,517,520.14	0.77
38	600660	福耀玻璃	44,500	2,485,325.00	0.76
39	002179	中航光电	30,100	2,378,502.00	0.73
40	603986	兆易创新	12,084	2,270,583.60	0.70
41	601988	中国银行	664,700	2,047,276.00	0.63
42	002007	华兰生物	55,200	2,024,736.00	0.62
43	603019	中科曙光	71,700	1,979,637.00	0.61
44	002311	海大集团	23,500	1,917,600.00	0.59
45	601668	中国建筑	398,900	1,854,885.00	0.57
46	600019	宝钢股份	241,800	1,847,352.00	0.57
47	600048	保利地产	145,500	1,751,820.00	0.54
48	601919	中远海控	57,300	1,749,942.00	0.54
49	002027	分众传媒	184,000	1,731,440.00	0.53
50	002271	东方雨虹	28,600	1,582,152.00	0.48
51	601607	上海医药	73,700	1,557,281.00	0.48
52	600845	宝信软件	30,280	1,541,252.00	0.47
53	002230	科大讯飞	22,700	1,534,066.00	0.47
54	300015	爱尔眼科	20,355	1,444,797.90	0.44
55	600436	片仔癀	3,150	1,412,145.00	0.43
56	603993	洛阳钼业	266,800	1,376,688.00	0.42
57	000977	浪潮信息	45,800	1,288,354.00	0.39
58	601877	正泰电器	37,100	1,238,398.00	0.38
59	600690	海尔智家	44,700	1,158,177.00	0.35
60	601633	长城汽车	26,200	1,142,058.00	0.35
61	300408	三环集团	26,700	1,132,614.00	0.35
62	002841	视源股份	9,100	1,131,039.00	0.35
63	000538	云南白药	9,650	1,116,698.00	0.34
64	002008	大族激光	27,000	1,090,530.00	0.33
65	300529	健帆生物	12,600	1,088,136.00	0.33
66	603659	璞泰来	7,600	1,038,160.00	0.32

67	600176	中国巨石	64,059	993,555.09	0.30
68	000656	金科股份	169,700	982,563.00	0.30
69	600763	通策医疗	2,300	945,300.00	0.29
70	600183	生益科技	39,900	934,059.00	0.29
71	600426	华鲁恒升	29,800	922,310.00	0.28
72	002129	中环股份	23,800	918,680.00	0.28
73	603799	华友钴业	7,800	890,760.00	0.27
74	002812	恩捷股份	3,800	889,580.00	0.27
75	002049	紫光国微	5,700	878,883.00	0.27
76	000100	TCL科技	114,700	877,455.00	0.27
77	002001	新和成	28,600	820,248.00	0.25
78	600570	恒生电子	8,400	783,300.00	0.24
79	600584	长电科技	20,700	779,976.00	0.24
80	601088	中国神华	39,800	776,896.00	0.24
81	600438	通威股份	17,879	773,624.33	0.24
82	002241	歌尔股份	16,673	712,604.02	0.22
83	600104	上汽集团	31,600	694,252.00	0.21
84	002050	三花智控	28,900	693,022.00	0.21
85	601100	恒立液压	7,900	678,768.00	0.21
86	300433	蓝思科技	21,600	635,256.00	0.19
87	300413	芒果超媒	8,903	610,745.80	0.19
88	300014	亿纬锂能	5,700	592,401.00	0.18
89	600132	重庆啤酒	2,900	574,055.00	0.18
90	000625	长安汽车	21,800	572,904.00	0.18
91	600406	国电南瑞	23,920	555,900.80	0.17
92	000157	中联重科	48,300	446,292.00	0.14
93	002714	牧原股份	7,310	444,594.20	0.14
94	600741	华域汽车	16,700	438,709.00	0.13
95	002414	高德红外	15,800	435,764.00	0.13
96	601155	新城控股	10,300	428,480.00	0.13

97	000786	北新建材	10,900	427,825.00	0.13
98	002410	广联达	6,200	422,840.00	0.13
99	601288	农业银行	135,700	411,171.00	0.13
100	600600	青岛啤酒	3,300	381,645.00	0.12
101	000708	中信特钢	17,700	368,868.00	0.11
102	600362	江西铜业	16,200	362,556.00	0.11
103	603899	晨光文具	4,200	355,152.00	0.11
104	002460	赣锋锂业	2,800	339,052.00	0.10
105	603939	益丰药房	6,000	336,540.00	0.10
106	600588	用友网络	10,100	335,926.00	0.10
107	002352	顺丰控股	4,828	326,855.60	0.10
108	002304	洋河股份	1,500	310,800.00	0.10
109	601225	陕西煤业	26,100	309,285.00	0.09
110	600989	宝丰能源	21,300	291,384.00	0.09
111	601872	招商轮船	59,100	273,042.00	0.08
112	601658	邮储银行	54,300	272,586.00	0.08
113	600760	中航沈飞	4,500	271,350.00	0.08
114	601555	东吴证券	30,700	256,038.00	0.08
115	600050	中国联通	58,000	250,560.00	0.08
116	601601	中国太保	8,600	249,142.00	0.08
117	601360	三六零	19,400	236,874.00	0.07
118	601328	交通银行	48,200	236,180.00	0.07
119	600011	华能国际	55,400	233,788.00	0.07
120	600196	复星医药	3,100	223,603.00	0.07
121	601021	春秋航空	3,900	221,910.00	0.07
122	002032	苏泊尔	3,400	216,886.00	0.07
123	601901	方正证券	23,100	216,216.00	0.07
124	601138	工业富联	17,300	214,693.00	0.07
125	002157	正邦科技	17,800	212,710.00	0.07
126	600000	浦发银行	20,600	206,000.00	0.06

127	600999	招商证券	10,500	199,710.00	0.06
128	600522	中天科技	19,700	197,000.00	0.06
129	601990	南京证券	17,800	187,256.00	0.06
130	601006	大秦铁路	27,600	181,608.00	0.06
131	600958	东方证券	17,900	178,821.00	0.05
132	600028	中国石化	39,600	172,656.00	0.05
133	601108	财通证券	16,400	172,036.00	0.05
134	002202	金风科技	14,000	170,240.00	0.05
135	600016	民生银行	38,400	169,344.00	0.05
136	601878	浙商证券	12,900	168,732.00	0.05
137	600837	海通证券	14,100	162,150.00	0.05
138	000783	长江证券	21,400	156,648.00	0.05
139	601229	上海银行	18,700	153,340.00	0.05
140	300142	沃森生物	2,400	148,080.00	0.05
141	002736	国信证券	13,600	146,200.00	0.04
142	601628	中国人寿	4,200	142,338.00	0.04
143	600352	浙江龙盛	10,100	138,774.00	0.04
144	601231	环旭电子	8,000	134,480.00	0.04
145	002673	西部证券	16,100	132,825.00	0.04
146	000166	申万宏源	28,200	131,976.00	0.04
147	601169	北京银行	26,400	128,568.00	0.04
148	600111	北方稀土	6,200	128,340.00	0.04
149	601857	中国石油	24,100	127,489.00	0.04
150	600018	上港集团	25,500	121,635.00	0.04
151	002493	荣盛石化	7,000	120,890.00	0.04
152	002601	龙蟠佰利	3,300	114,114.00	0.03
153	300595	欧普康视	1,100	113,905.00	0.03
154	002371	北方华创	400	110,952.00	0.03
155	600009	上海机场	2,300	110,699.00	0.03
156	601009	南京银行	10,500	110,460.00	0.03

157	000728	国元证券	13,000	103,610.00	0.03
158	601600	中国铝业	19,500	103,350.00	0.03
159	601336	新华保险	2,200	101,002.00	0.03
160	300498	温氏股份	7,000	100,590.00	0.03
161	688012	中微公司	600	99,552.00	0.03
162	601186	中国铁建	13,100	97,333.00	0.03
163	601989	中国重工	22,500	92,700.00	0.03
164	600010	包钢股份	55,000	85,250.00	0.03
165	002945	华林证券	6,100	84,302.00	0.03
166	300450	先导智能	1,400	84,196.00	0.03
167	688036	传音控股	400	83,800.00	0.03
168	600926	杭州银行	5,400	79,650.00	0.02
169	601939	建设银行	11,900	79,135.00	0.02
170	600848	上海临港	4,280	76,612.00	0.02
171	000066	中国长城	5,100	74,460.00	0.02
172	603833	欧派家居	500	70,980.00	0.02
173	600795	国电电力	28,700	69,741.00	0.02
174	300274	阳光电源	600	69,036.00	0.02
175	600161	天坛生物	2,000	68,500.00	0.02
176	600015	华夏银行	10,900	67,471.00	0.02
177	002916	深南电路	600	66,678.00	0.02
178	600886	国投电力	6,800	65,348.00	0.02
179	600029	南方航空	10,800	65,016.00	0.02
180	300144	宋城演艺	3,800	63,840.00	0.02
181	688008	澜起科技	1,000	62,380.00	0.02
182	002939	长城证券	5,600	62,328.00	0.02
183	003816	中国广核	23,200	61,944.00	0.02
184	002044	美年健康	6,700	61,037.00	0.02
185	600703	三安光电	1,900	60,895.00	0.02
186	600872	中炬高新	1,400	58,828.00	0.02

187	000425	徐工机械	9,100	57,967.00	0.02
188	601111	中国国航	7,300	56,794.00	0.02
189	002508	老板电器	1,200	55,800.00	0.02
190	600115	中国东航	10,900	55,372.00	0.02
191	300676	华大基因	400	47,440.00	0.01
192	002456	欧菲光	5,300	47,064.00	0.01
193	601838	成都银行	3,700	46,768.00	0.01
194	300033	同花顺	400	45,112.00	0.01
195	601669	中国电建	10,800	41,796.00	0.01
196	601766	中国中车	6,600	40,128.00	0.01
197	688009	中国通号	6,400	36,416.00	0.01
198	002024	苏宁易购	6,400	35,776.00	0.01
199	600489	中金黄金	4,100	35,342.00	0.01
200	002739	万达电影	2,200	34,738.00	0.01
201	600109	国金证券	2,700	34,263.00	0.01
202	600383	金地集团	3,000	30,720.00	0.01
203	600655	豫园股份	2,600	30,134.00	0.01
204	002236	大华股份	1,300	27,430.00	0.01
205	002153	石基信息	1,140	26,801.40	0.01
206	002252	上海莱士	3,500	26,215.00	0.01
207	601916	浙商银行	6,600	26,202.00	0.01
208	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.01
209	000338	潍柴动力	1,400	25,018.00	0.01
210	601998	中信银行	4,900	24,990.00	0.01
211	601236	红塔证券	1,700	23,052.00	0.01
212	002463	沪电股份	1,400	21,658.00	0.01
213	002773	康弘药业	900	20,817.00	0.01
214	300347	泰格医药	100	19,330.00	0.01
215	601066	中信建投	77	2,420.11	0.00
216	600340	华夏幸福	100	524.00	0.00

217	601238	广汽集团	39	505.05	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	601117	中国化学	304,800	2,670,048.00	0.82
2	300750	宁德时代	4,500	2,406,600.00	0.74
3	603589	口子窖	28,200	1,908,858.00	0.58
4	300760	迈瑞医疗	3,500	1,680,175.00	0.51
5	000739	普洛药业	51,400	1,511,160.00	0.46
6	002318	久立特材	123,600	1,485,672.00	0.46
7	603444	吉比特	2,200	1,166,000.00	0.36
8	600377	宁沪高速	111,400	1,087,264.00	0.33
9	600885	宏发股份	14,600	915,420.00	0.28
10	002353	杰瑞股份	19,800	885,060.00	0.27
11	002332	仙琚制药	69,100	866,514.00	0.27
12	603345	安井食品	3,400	863,668.00	0.26
13	300482	万孚生物	11,900	769,811.00	0.24
14	002078	太阳纸业	56,600	755,610.00	0.23
15	600298	安琪酵母	12,900	701,502.00	0.21
16	300012	华测检测	20,200	643,976.00	0.20
17	600323	瀚蓝环境	27,100	590,509.00	0.18
18	600271	航天信息	45,100	587,653.00	0.18
19	002727	一心堂	16,600	549,626.00	0.17
20	600153	建发股份	65,900	533,790.00	0.16
21	002511	中顺洁柔	18,800	517,940.00	0.16
22	300567	精测电子	8,000	491,200.00	0.15
23	688083	中望软件	918	481,105.44	0.15
24	600038	中直股份	8,100	427,194.00	0.13

25	002185	华天科技	26,700	410,913.00	0.13
26	000301	东方盛虹	18,100	378,290.00	0.12
27	002439	启明星辰	12,300	356,823.00	0.11
28	300316	晶盛机电	6,800	343,400.00	0.11
29	002568	百润股份	3,600	341,244.00	0.10
30	601233	桐昆股份	14,000	337,260.00	0.10
31	603639	海利尔	18,400	331,016.00	0.10
32	600390	五矿资本	53,400	319,332.00	0.10
33	688819	天能股份	7,237	316,184.53	0.10
34	601966	玲珑轮胎	6,600	288,684.00	0.09
35	603877	太平鸟	5,400	288,252.00	0.09
36	300759	康龙化成	1,300	282,087.00	0.09
37	300474	景嘉微	2,700	264,384.00	0.08
38	688317	之江生物	3,936	251,195.52	0.08
39	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.07
40	300661	圣邦股份	950	240,093.50	0.07
41	002690	美亚光电	4,000	223,040.00	0.07
42	601636	旗滨集团	12,000	222,720.00	0.07
43	300673	佩蒂股份	9,950	221,487.00	0.07
44	300740	水羊股份	10,000	208,800.00	0.06
45	601677	明泰铝业	10,500	205,275.00	0.06
46	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.06
47	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.06
48	300496	中科创达	1,200	188,472.00	0.06
49	002572	索菲亚	7,500	181,500.00	0.06
50	603533	掌阅科技	6,300	179,550.00	0.05
51	600988	赤峰黄金	11,600	173,884.00	0.05
52	300253	卫宁健康	10,400	169,208.00	0.05
53	002156	通富微电	7,000	168,280.00	0.05
54	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.05

55	002372	伟星新材	7,600	157,092.00	0.05
56	600486	扬农化工	1,400	156,478.00	0.05
57	300369	绿盟科技	9,600	153,120.00	0.05
58	002126	银轮股份	14,700	152,880.00	0.05
59	000807	云铝股份	12,300	146,370.00	0.04
60	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.04
61	002918	蒙娜丽莎	4,600	144,394.00	0.04
62	603686	龙马环卫	9,300	141,453.00	0.04
63	002064	华峰化学	9,900	140,580.00	0.04
64	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.04
65	002878	元隆雅图	7,500	131,250.00	0.04
66	002385	大北农	18,100	123,080.00	0.04
67	603043	广州酒家	4,780	122,941.60	0.04
68	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.04
69	300383	光环新网	8,000	115,120.00	0.04
70	603486	科沃斯	500	114,040.00	0.03
71	600862	中航高科	3,700	113,886.00	0.03
72	603737	三棵树	580	102,080.00	0.03
73	600563	法拉电子	600	95,016.00	0.03
74	002541	鸿路钢构	1,600	93,360.00	0.03
75	002206	海利得	14,800	91,908.00	0.03
76	603599	广信股份	2,900	87,232.00	0.03
77	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
78	300919	中伟股份	512	83,456.00	0.03
79	601198	东兴证券	6,900	75,417.00	0.02
80	000932	华菱钢铁	10,900	71,940.00	0.02
81	603707	健友股份	1,600	66,800.00	0.02
82	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
83	300618	寒锐钴业	800	63,072.00	0.02
84	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.02

85	300957	贝泰妮	241	60,722.36	0.02
86	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.02
87	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.02
88	300285	国瓷材料	1,200	58,500.00	0.02
89	600487	亨通光电	5,100	58,140.00	0.02
90	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
91	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
92	600208	新湖中宝	15,800	48,032.00	0.01
93	002254	泰和新材	2,300	46,621.00	0.01
94	603638	艾迪精密	1,060	45,442.20	0.01
95	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
96	300674	宇信科技	1,960	36,632.40	0.01
97	300751	迈为股份	80	36,376.00	0.01
98	300973	立高食品	312	36,101.52	0.01
99	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
100	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
101	000961	中南建设	5,800	34,336.00	0.01
102	600177	雅戈尔	5,100	33,609.00	0.01
103	600004	白云机场	2,900	32,422.00	0.01
104	002127	南极电商	3,300	32,241.00	0.01
105	002080	中材科技	1,100	28,787.00	0.01
106	300726	宏达电子	400	28,196.00	0.01
107	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
108	600779	水井坊	200	25,270.00	0.01
109	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
110	002747	埃斯顿	600	23,430.00	0.01
111	002833	弘亚数控	600	23,250.00	0.01
112	300258	精锻科技	1,700	22,729.00	0.01
113	300981	中红医疗	249	22,507.11	0.01
114	600612	老凤祥	400	21,188.00	0.01

115	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
116	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
117	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
118	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
119	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
120	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
121	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
122	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
123	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
124	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
125	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
126	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
127	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
128	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
129	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
130	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
131	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
132	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
133	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
134	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
135	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
136	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
137	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
138	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
139	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
140	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
141	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
142	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
143	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
144	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00

145	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
146	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
147	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
148	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
149	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
150	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
151	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
152	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
153	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
154	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
155	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
156	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
157	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
158	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
159	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
160	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
161	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
162	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
163	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
164	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
165	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
166	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
167	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
168	603218	日月股份	100	2,708.00	0.00
169	000733	振华科技	15	916.05	0.00
170	600998	九州通	2	30.74	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例 (%)
1	601211	国泰君安	14,034,810.77	3.15
2	601988	中国银行	12,524,120.00	2.81
3	002142	宁波银行	11,783,770.68	2.65
4	601117	中国化学	10,878,457.00	2.44
5	600519	贵州茅台	10,434,739.01	2.35
6	600048	保利地产	9,926,786.55	2.23
7	600030	中信证券	9,676,649.00	2.17
8	000002	万科A	9,149,217.00	2.06
9	000651	格力电器	9,147,018.00	2.06
10	601318	中国平安	8,898,072.00	2.00
11	600919	江苏银行	8,320,438.98	1.87
12	600585	海螺水泥	7,617,508.00	1.71
13	600036	招商银行	7,472,692.00	1.68
14	603259	药明康德	7,418,184.00	1.67
15	600276	恒瑞医药	7,277,961.80	1.64
16	300059	东方财富	7,098,340.80	1.60
17	000001	平安银行	7,079,201.00	1.59
18	601398	工商银行	6,875,744.00	1.55
19	601658	邮储银行	6,772,067.00	1.52
20	300033	同花顺	6,665,370.58	1.50

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	601211	国泰君安	17,307,067.40	3.89
2	600036	招商银行	16,641,970.00	3.74
3	601318	中国平安	15,750,431.32	3.54
4	000001	平安银行	14,489,679.67	3.26

5	000858	五 粮 液	12,513,773.00	2.81
6	000333	美的集团	12,247,135.43	2.75
7	601658	邮储银行	10,109,675.00	2.27
8	601988	中国银行	9,929,775.00	2.23
9	600900	长江电力	9,664,769.01	2.17
10	300059	东方财富	9,411,734.02	2.12
11	601117	中国化学	9,228,434.00	2.07
12	002142	宁波银行	9,158,546.18	2.06
13	600276	恒瑞医药	9,136,118.20	2.05
14	000166	申万宏源	8,738,429.80	1.96
15	600048	保利地产	7,631,960.00	1.72
16	601668	中国建筑	7,394,248.00	1.66
17	000725	京东方 A	7,277,582.37	1.64
18	601225	陕西煤业	7,186,094.38	1.61
19	300033	同花顺	7,016,219.00	1.58
20	601077	渝农商行	6,775,732.00	1.52

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	689,254,351.37
卖出股票收入（成交）总额	809,391,640.39

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)	161,212.51	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	161,212.51	0.05

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	127036	三花转债	649	85,012.51	0.03
2	113050	南银转债	430	43,000.00	0.01
3	113049	长汽转债	320	32,000.00	0.01
4	123117	健帆转债	12	1,200.00	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-108,220.78
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。股指期货投资本期收益已扣除金融商品转让产生的增值税。

7.10.2 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。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

1 招商银行 代码：600036.SH 因未依法履行相关职责，中国银行保险监督管理委员会于2021-05-17依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行相关职责，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局于2021-06-08依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

2 平安银行 代码：000001.SZ 因未依法履行相关职责，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于2020-10-16依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行相关职责，中国银行保险监督管理委员会云南监管局于2021-05-28依据相关法规给予：公开处罚处分决定

关于投资决策的说明： 以上证券都是沪深300指数成份股，本基金为指数型基金，为保持对指数的有效跟踪而投资以上股票。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,106.14
5	应收申购款	107,192.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,298.66

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
中泰沪深300指数增强A	7,516	6,066.31	361,683.36	0.79%	45,232,707.18	99.21%
中泰沪深300指数增强C	9,768	16,410.94	111,848,708.51	69.77%	48,453,333.59	30.23%
合计	17,284	11,912.55	112,210,391.87	54.50%	93,686,040.77	45.50%

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	中泰沪深300指数增强A	899,402.44	1.9726%
	中泰沪深300指数增强C	1,009.54	0.0006%
	合计	900,411.98	0.4373%

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	中泰沪深300指数增强A	0
	中泰沪深300指数增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中泰沪深300指数增强A	0
	中泰沪深300指数增强C	0
	合计	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
基金合同生效日(2020年04月01日)基金份额总额	225,312,271.77	330,816,770.53
本报告期期初基金份额总额	98,100,287.70	193,801,018.11
本报告期基金总申购份额	29,436,341.29	78,323,351.10
减：本报告期基金总赎回份额	81,942,238.45	111,822,327.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,594,390.54	160,302,042.10

§ 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，基金管理人原董事王丽敏离任。根据基金管理人2021年第2次股东会议所有股东选举结果，胡开南当选为第二届董事会董事，该项任职于2021年4月22日生效。

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

本报告期，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
光大证券	2	1,490,458,299.37	100.00%	332,447.68	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
光大证券	355,586.24	100.00%	107,000,000.00	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	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会规定网站	2021-01-21
2	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-03-26
3	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定网站	2021-03-29
4	关于中泰沪深300指数增强型证券投资基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-03-30
5	关于中泰沪深300指数增强型证券投资基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-04-02
6	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-04-07
7	关于中泰沪深300指数增强型证券投资基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-04-13
8	中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概	中国证监会规定网站	2021-04-16

	要更新		
9	关于中泰沪深300指数增强型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》修订基金合同部分条款的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-04-16
10	中泰沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第1号	中国证监会规定网站	2021-04-16
11	中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定网站	2021-04-16
12	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定网站	2021-04-21
13	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-04-22
14	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-05-07
15	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-05-24
16	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-05-27
17	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-06-15

	投资关联方承销期内承销证券的公告		
18	关于中泰沪深300指数增强型证券投资基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-06-21
19	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会规定网站	2021-06-23

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年2月26日至2021年5月27日、2021年5月31日至2021年6月30日	45,004,500.45	0.00	0.00	45,004,500.45	21.86%
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况时，可能会引发以下风险：</p> <p>(1) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险。</p> <p>(2) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p> <p>(3) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动。</p> <p>(4) 基金合同提前终止的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产净值连续五十个工作日低于5000万元，本基金可能面临基金合同提前终止等情形。</p> <p>(5) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>(6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p> <p>本基金管理人将通过完善的风险管理机制，有效管理上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰沪深300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、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内中泰沪深300指数增强型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿；
- 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
二〇二一年八月二十七日