

中泰中证 500 指数增强型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	76
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	77
8.12 投资组合报告附注.....	77
§9 基金份额持有人信息.....	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	79
§10 开放式基金份额变动.....	80
§11 重大事件揭示.....	80
11.1 基金份额持有人大会决议.....	80
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
11.4 基金投资策略的改变.....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
11.8 其他重大事件.....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1 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.....	83
§13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	84
13.2 存放地点.....	84
13.3 查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中泰中证500指数增强	
基金主代码	008112	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月11日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	44,081,675.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	008112	008113
报告期末下属分级基金的份额总额	10,333,246.65份	33,748,428.68份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有 限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王洪懿	龚小武
	联系电话	021-20521199	021-52629999-212056
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-821-0808	95561
传真		021-50933716	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	福州市湖东路154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	上海市银城路167号兴业大厦 4楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		黄文卿	吕家进

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道 中心11楼
注册登记机构	中泰证券（上海）资产管理有 限公司	上海市浦东新区银城中路488号太平 金融大厦1002-1003室

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年		2020年		2019年12月11日(基金合同生效日)- 2019年12月31日	
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C
本期已实现收益	2,471,223.32	6,745,663.80	13,868,168.15	21,688,246.26	388,789.35	652,056.81
本期利润	2,522,305.73	6,834,051.73	12,868,963.41	17,258,928.21	2,558,151.38	4,564,820.52
加权平均基金份额本期利润	0.2429	0.2101	0.3111	0.2699	0.0238	0.0238
本期加权平均净值利润率	16.73%	14.51%	27.11%	23.66%	2.36%	2.36%
本期基金份额净值增长率	15.94%	15.47%	31.07%	30.55%	2.39%	2.37%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	5,744,606.20	18,331,383.20	11,671,194.89	13,112,231.43	390,406.17	660,543.30
期末可供分配基金份额利润	0.5559	0.5432	0.3420	0.3364	0.0036	0.0034
期末基金资产净值	16,077,852.85	52,079,811.88	45,794,847.07	52,093,802.76	110,454,304.46	198,997,131.77
期末基金份额净值	1.5559	1.5432	1.3420	1.3364	1.0239	1.0237
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	55.59%	54.32%	34.20%	33.64%	2.39%	2.37%

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

中泰中证500指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.01%	0.71%	3.43%	0.72%	-2.42%	-0.01%
过去六个月	6.71%	0.88%	7.72%	0.91%	-1.01%	-0.03%
过去一年	15.94%	0.90%	14.83%	0.92%	1.11%	-0.02%
自基金合同生效起至今	55.59%	1.21%	43.40%	1.26%	12.19%	-0.05%

中泰中证500指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.91%	0.71%	3.43%	0.72%	-2.52%	-0.01%
过去六个月	6.51%	0.88%	7.72%	0.91%	-1.21%	-0.03%
过去一年	15.47%	0.90%	14.83%	0.92%	0.64%	-0.02%
自基金合同生效起至今	54.32%	1.21%	43.40%	1.26%	10.92%	-0.05%

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

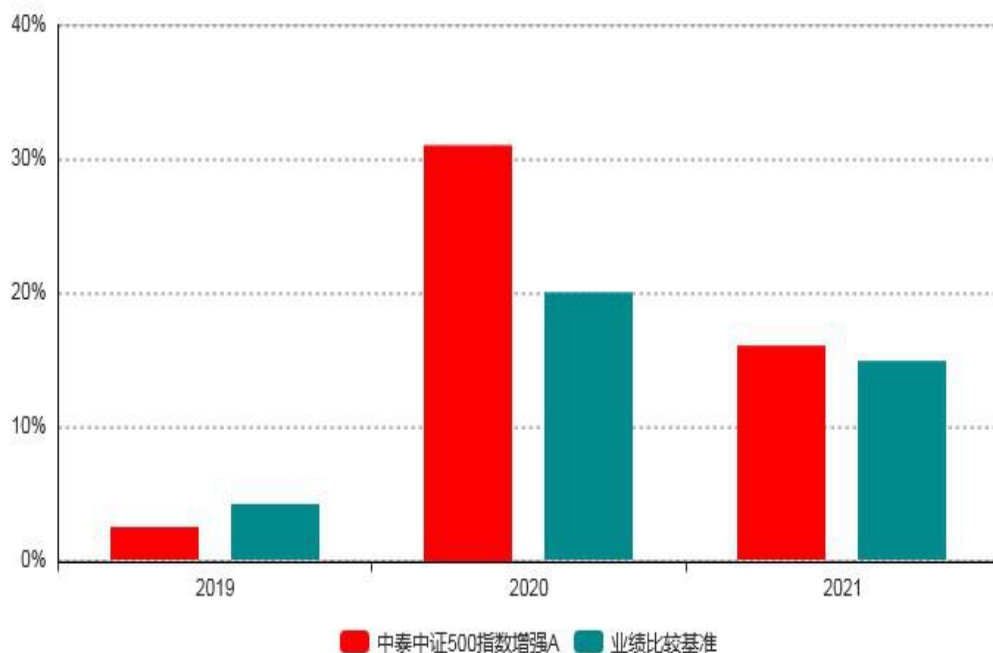
中泰中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月11日-2021年12月31日)



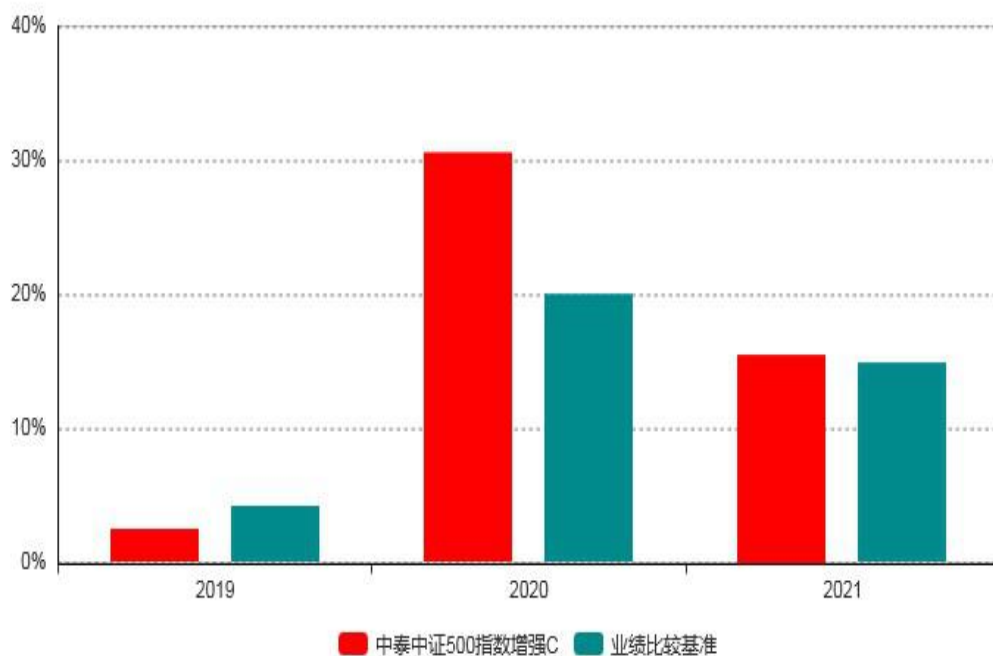
中泰中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月11日-2021年12月31日)



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



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



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2019年12月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2021年12月31日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰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、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、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、中泰星宇价值成长一年封闭运作混合型证券投资基金和中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金共十二只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹巍	本基金基金经理；中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理。	2019-12-11	-	8	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

					<p>国泰君安证券资产管理有限公司运营部副总经理、量化投资部首席研究员。2014年10月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司任对冲基金部副总经理、现任基金业务部副总经理。2019年12月11日起至今担任中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理。2020年4月1日起至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2021年7月5日起至今担任中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

异常交易是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理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，中证500指数由年初的6367点上涨到年末的7359点，上涨幅度超过15%。从行业分布来看，500指数中资本品、汽车汽配、媒体等行业收益较高；而生物制药、房地产、零售等行业则出现负收益。

本基金本年运行期内，我们严格采取量化方法约束跟踪误差，同时利用价值逻辑优化选股力求通过有限的主动策略获得超额收益。从2021实际运行的结果来看，本基金对指数的跟踪误差保持不错。前三季度也取得一定得超额收益，而四季度市场的实际运行结果与本基金的投资增强逻辑出现背离，部分拖累了全年增强收益的实现，因此全年来看以来超额收益不如人意。

我们将在价值投资理性逻辑的基础上继续优化已有的投资策略，力求在保持对指数的有效跟踪的基础上进一步提高超额收益的实现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰中证500指数增强A基金份额净值为1.5559元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.94%，同期业绩比较基准收益率为14.83%；截至报告期末中泰中证500指数增强C基金份额净值为1.5432元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.47%，同期业绩比较基准收益率为14.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2021年，新冠疫情持续全球传播带来的影响超出了我们原有预期，尽管中国制造业及出口数据在国外疫情控制不力的情况下获得不错的增长，但美元持续放水导致原材料价格的上涨也带来了企业成本的快速上升。同时，疫情终将结束，投资人对出口繁

荣的可持续性也难免充满担忧。因此尽管有比较亮眼的宏观经济及出口数据，证券市场还是表现得非常谨慎。

展望2022年，我们认为以中国已有的巨大经济体量与全球经济整体疲软的现实，继续预期国内经济高速增长是不现实的，普遍预期2022年的GDP增速将回落到5.5%左右，中国经济的发展必然走向更加注重“质量”的阶段。同时我们也看到，国家提出力争2030年碳达峰，2060年碳中和的战略目标，也正是对经济发展方式转变的回应。

因此回到证券市场上，基于经济发展速度上的放缓与国家经济政策的调整，我们认为2022年各种不确定因素广泛存在。不同产业之间可能会表现出巨大的差异。符合国家政策以及人类社会发展进程的行业仍将充满机遇。但不符合国家政策方面的行业则充满较高的风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：

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

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

3、加强内部监察稽核力度。公司每季度针对投资、研究、交易、风控、基金运营等内部控制各方面开展定期核查，并针对发现的问题采取有效措施完善制度、改进流程；在此基础上，公司根据业务开展情况及监管要求，适时开展专项稽核，对专项稽核中发现问题明确要求相关部门整改到位，不断提升内部控制和风险管理水平。

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

5、积极开展合规培训。报告期内，公司合规管理部门及时向公司管理层和员工传达最新的监管要求和违规案例通报，积极保持与各个业务部门的沟通与联络，根据各板

块业务的开展情况适时开展合规督导，及时提示合规风险，妥善解答业务人员在展业过程中遇到的法律、合规问题；并根据法律法规变化和最新监管动态，统筹协调外部律师事务所和内部合规力量，有针对性地开展合规培训项目，不断提升员工的风险、合规意识，营造合规经营氛围。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第21976号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中泰中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了中泰中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“中泰中证500指数增强基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表</p>

	<p>附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了中泰中证500指数增强基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中泰中证500指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中泰中证500指数增强基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中泰中证500指数增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中泰中证500指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中泰中证500指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出</p>

具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中泰中证500指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中泰中证500指数增强基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注

	的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张 振 波	金 诗 涛
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2022-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	5,934,699.80	7,339,872.61
结算备付金		1,177,057.30	1,913,333.75
存出保证金		206,578.40	-
交易性金融资产	7.4.7.2	61,230,859.94	89,851,638.29
其中：股票投资		61,218,283.34	89,800,838.29
基金投资		-	-
债券投资		12,576.60	50,800.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,540.33	3,327.81
应收股利		-	-
应收申购款		257,736.52	96,916.74
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		68,809,472.29	99,205,089.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		342,508.15	1,057,463.79
应付管理人报酬		28,769.07	41,092.19
应付托管费		2,876.90	4,109.21
应付销售服务费		17,569.78	17,036.47
应付交易费用	7.4.7.6	-	-
应交税费		-	0.15
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	260,083.66	196,737.56
负债合计		651,807.56	1,316,439.37
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.8	44,081,675.33	73,105,223.51
未分配利润	7.4.7.9	24,075,989.40	24,783,426.32
所有者权益合计		68,157,664.73	97,888,649.83
负债和所有者权益总计		68,809,472.29	99,205,089.20

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额44,081,675.33份，其中中泰中证500指数增强A类份额10,333,246.65份，中泰中证500指数增强C类份额33,748,428.68份。A类份额净值1.5559元，C类份额净值1.5432元（于2020年12月31日，基金份额总额73,105,223.51份，其中中泰中证500指数增强A类份额34,123,652.18份，中泰中证500指数增强C类份额38,981,571.33份。A类份额净值1.3420元，C类份额净值1.3364元）。

7.2 利润表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		10,994,324.53	33,108,185.90
1. 利息收入		47,394.66	132,259.39
其中：存款利息收入	7.4.7.10	47,360.36	123,865.31
债券利息收入		34.30	183.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,211.07
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,676,258.66	38,095,952.59
其中：股票投资收益	7.4.7.11	9,776,099.14	37,129,522.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	34,783.97	255,785.98
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	228,624.46	-103,088.93
股利收益	7.4.7.14	636,751.09	813,732.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	139,470.34	-5,428,522.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	7.4.7.16	131,200.87	308,496.71

号填列)			
减：二、费用		1,637,967.07	2,980,294.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	311,134.04	619,735.55
2. 托管费	7.4.10.2.2	31,113.23	61,973.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	188,269.16	301,621.07
4. 交易费用	7.4.7.17	773,326.36	1,654,365.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,393.90	511.22
7. 其他费用	7.4.7.18	332,730.38	342,087.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,356,357.46	30,127,891.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,356,357.46	30,127,891.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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)	73,105,223.51	24,783,426.32	97,888,649.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利	-	9,356,357.46	9,356,357.46

润)			
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)	-29,023,548.18	-10,063,794.38	-39,087,342.56
其中:1.基金申购款	43,711,824.24	19,838,708.41	63,550,532.65
2.基金赎回款	-72,735,372.42	-29,902,502.79	-102,637,875.21
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)	44,081,675.33	24,075,989.40	68,157,664.73
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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)	302,277,987.16	7,173,449.07	309,451,436.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,127,891.62	30,127,891.62
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)	-229,172,763.65	-12,517,914.37	-241,690,678.02
其中:1.基金申购款	79,109,342.13	18,058,270.50	97,167,612.63

2. 基金赎回款	-308,282,105.78	-30,576,184.87	-338,858,290.65
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)	73,105,223.51	24,783,426.32	97,888,649.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中泰中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1840号《关于准予中泰中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币297,379,816.58元,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(2019)第0696号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2019年12月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为297,488,829.64份,其中认购资金利息折合109,013.06份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份

额。本基金A类、C类两种收费模式并存，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。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《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券以及中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金和应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为95%×中证500指数收益率+5%×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2022年3月29日批准报出。

7.4.2 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》、《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》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(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	2,357,478.53	3,308,025.05
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	3,577,221.27	4,031,847.56
合计	5,934,699.80	7,339,872.61

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,445,706.65	61,218,283.34	772,576.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	10,000.00	12,576.60
	银行间市场	-	-
	合计	10,000.00	12,576.60

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	60,455,706.65	61,230,859.94	775,153.29
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,147,235.34	89,800,838.29	653,602.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	50,800.00	50,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	50,800.00	50,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	89,198,035.34	89,851,638.29	653,602.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,457,640.00	-	-	-
--股指期货	1,457,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,457,640.00	-	-	-
项目	上年度末			

	2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	261.32	298.26
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	969.96	904.41
应收结算备付金利息	1,307.18	2,120.42
应收债券利息	1.87	4.72
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	2,540.33	3,327.81

7.4.7.6 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	83.66	737.56
预提费用	210,000.00	146,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	260,083.66	196,737.56

7.4.7.8 实收基金

7.4.7.8.1 中泰中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	34,123,652.18	34,123,652.18
本期申购	8,948,140.05	8,948,140.05
本期赎回(以“-”号填列)	-32,738,545.58	-32,738,545.58
本期末	10,333,246.65	10,333,246.65

7.4.7.8.2 中泰中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	38,981,571.33	38,981,571.33
本期申购	34,763,684.19	34,763,684.19
本期赎回（以“-”号填列）	-39,996,826.84	-39,996,826.84
本期末	33,748,428.68	33,748,428.68

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

7.4.7.9.1 中泰中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,261,346.65	-590,151.76	11,671,194.89
本期利润	2,471,223.32	51,082.41	2,522,305.73
本期基金份额交易产生的变动数	-8,768,737.41	319,842.99	-8,448,894.42
其中：基金申购款	4,354,749.79	-262,881.78	4,091,868.01
基金赎回款	-13,123,487.20	582,724.77	-12,540,762.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,963,832.56	-219,226.36	5,744,606.20

7.4.7.9.2 中泰中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,783,300.46	-671,069.03	13,112,231.43
本期利润	6,745,663.80	88,387.93	6,834,051.73
本期基金份额交易产生的变动数	-1,484,001.47	-130,898.49	-1,614,899.96
其中：基金申购款	16,579,482.29	-832,641.89	15,746,840.40
基金赎回款	-18,063,483.76	701,743.40	-17,361,740.36

本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,044,962.79	-713,579.59	18,331,383.20

7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	10,585.65	57,211.55
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	24,085.12	50,040.85
结算备付金利息收入	12,689.59	16,612.91
其他	-	-
合计	47,360.36	123,865.31

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	483,791,317.55	1,058,612,256.57
减：卖出股票成本总额	474,015,218.41	1,021,482,733.73
买卖股票差价收入	9,776,099.14	37,129,522.84

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付)	34,783.97	255,785.98

差价收入		
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	34,783.97	255,785.98

7.4.7.12.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	234,587.43	1,351,724.54
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	199,671.17	1,095,700.00
减：应收利息总额	132.29	238.56
买卖债券差价收入	34,783.97	255,785.98

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日
期货投资	228,624.46	-103,088.93

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年

	12月31日	12月31日
股票投资产生的股利收益	636,751.09	813,732.70
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	636,751.09	813,732.70

7.4.7.15 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12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	121,550.34	-5,428,522.79
——股票投资	118,973.74	-5,428,522.79
——债券投资	2,576.60	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	17,920.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	17,920.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	139,470.34	-5,428,522.79

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	130,755.25	308,496.71
其他	422.08	-

转换费收入	23.54	-
合计	131,200.87	308,496.71

7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	771,543.40	1,652,242.41
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	1,782.96	2,123.18
合计	773,326.36	1,654,365.59

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	50,000.00	62,418.66
信息披露费	80,000.00	73,488.32
汇划手续费	2,330.38	6,180.21
指数使用费	200,000.00	200,000.00
开户费	400.00	-
合计	332,730.38	342,087.19

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中泰证券	927,874,535.88	100.00%	1,882,367,443.79	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例

中泰证券	287,653.43	100.00%	1,351,724.54	100.00%
------	------------	---------	--------------	---------

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
中泰证券	-	-	31,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	205,413.72	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	415,074.84	100.00%	-	-

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

2. 管理人从关联方获得的服务包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	311,134.04	619,735.55
其中：支付销售机构的客户维护费	116,472.59	215,966.93

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,113.23	61,973.66

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	2,453.77	2,453.77
中泰证券股份有限	0.00	166,910.53	166,910.53

公司			
中泰证券 (上海)资产 管理有限公司	0.00	10,143.41	10,143.41
合计	0.00	179,507.71	179,507.71
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	合计
兴业银行 股份有限 公司	0.00	16,740.30	16,740.30
中泰证券 股份有限 公司	0.00	251,900.12	251,900.12
中泰证券 (上海)资 产管理有 限公司	0.00	9,378.04	9,378.04
合计	0.00	278,018.46	278,018.46

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：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中泰中证500指数增强A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	1,999,560.32	1,999,560.32
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	999,560.32	1,999,560.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.67%	5.86%

中泰中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期其他关联方未持有本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

兴业银行	2,357,478.53	10,585.65	3,308,025.05	57,211.55
中泰证券	3,577,221.27	24,085.12	4,031,847.56	50,040.85

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31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	603213.SH	镇洋发展	首次公开发行	799	4,786.01
中泰证券	600955.SH	维远股份	首次公开发行	1,694	50,074.64
中泰证券	001207.SZ	联科科技	首次公开发行	682	9,732.14
中泰证券	605296.SH	神农集团	首次公开发行	569	31,909.52

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

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
113634	珀莱转债	2021-12-08	2022-01-04	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

注: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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	宏大爆破	2021-12-20	重大资产重组	30.12	2022-01-04	31.00	4,700	136,113.13	141,564.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

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

业投资委员会制定的投资策略和资产配置方案，协助专业投资委员会进行投资策略的风险检验，以及制定相应的投资风险控制标准。

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

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当

信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

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

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

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

7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	12,576.60	50,800.00
未评级	-	-
合计	12,576.60	50,800.00

7.4.13.3 流动性风险

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

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

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	5,934,699.80	-	-	-	-	-	5,934,699.80
结算备付金	1,177,057.30	-	-	-	-	-	1,177,057.30
存出保证金	-	-	-	-	-	206,578.40	206,578.40
交易性金融资产	-	-	12,576.60	-	-	61,218,283.34	61,230,859.94
应收利息	-	-	-	-	-	2,540.33	2,540.33
应收申购款	-	-	-	-	-	257,736.52	257,736.52
资产总计	7,111,757.10	-	12,576.60	-	-	61,685,138.59	68,809,472.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	342,508.15	342,508.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,769.07	28,769.07
应付托管费	-	-	-	-	-	2,876.90	2,876.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,569.78	17,569.78
其他负债	-	-	-	-	-	260,083.66	260,083.66
负债总计	-	-	-	-	-	651,807.56	651,807.56
利率敏感度缺口	7,111,757.10	-	12,576.60	-	-	61,033,331.03	68,157,664.73

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	7,339,872.61	-	-	-	-	-	7,339,872.61
结算备付金	1,913,333.75	-	-	-	-	-	1,913,333.75
交易性金融资产	-	-	50,800.00	-	-	89,800,838.29	89,851,638.29
应收利息	-	-	-	-	-	3,327.81	3,327.81
应收申购款	-	-	-	-	-	96,916.74	96,916.74
资产总计	9,253,206.36	-	50,800.00	-	-	89,901,082.84	99,205,089.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,057,463.79	1,057,463.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,092.19	41,092.19
应付托管费	-	-	-	-	-	4,109.21	4,109.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,036.47	17,036.47
应交税费	-	-	-	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	-	-	-	196,737.56	196,737.56
负债总计	-	-	-	-	-	1,316,439.37	1,316,439.37
利率敏感度缺口	9,253,206.36	-	50,800.00	-	-	88,584,643.47	97,888,649.83

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，本基金将建立专门的风险预算控制模型，力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	61,218,283.34	89.82	89,800,838.29	91.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	12,576.60	0.02	50,800.00	0.05
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	61,230,859.94	89.84	89,851,638.29	91.79

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	比较基准上升5%	1,768,754.23	4,622,485.31
	比较基准下降5%	-1,768,754.23	-4,622,485.31

于2019年12月31日，本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.14 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12月31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61,081,791.45元，属于第二层次的余额为149,068.49元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次89,779,048.75元，第二层次72,589.54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12月31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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	61,218,283.34	88.97

	其中：股票	61,218,283.34	88.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,576.60	0.02
	其中：债券	12,576.60	0.02
	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	7,111,757.10	10.34
8	其他各项资产	466,855.25	0.68
9	合计	68,809,472.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	409,278.00	0.60
B	采矿业	2,083,518.00	3.06
C	制造业	29,364,077.89	43.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,111,267.00	3.10
E	建筑业	907,835.00	1.33
F	批发和零售业	950,227.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,654,319.80	2.43
H	住宿和餐饮业	329,025.00	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,718,918.00	6.92
J	金融业	3,784,507.60	5.55
K	房地产业	1,478,405.00	2.17

L	租赁和商务服务业	661,512.00	0.97
M	科学研究和技术服务业	126,973.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	245,733.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	137,637.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	958,995.00	1.41
S	综合	396,936.00	0.58
	合计	50,319,164.29	73.83

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	589,443.00	0.86
C	制造业	7,633,431.84	11.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	656,981.00	0.96
E	建筑业	41,716.53	0.06
F	批发和零售业	42,361.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	213,654.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	398,396.00	0.58
J	金融业	549,329.68	0.81
K	房地产业	106,611.00	0.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	320,246.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	324,675.00	0.48

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,274.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,899,119.05	15.99

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000733	振华科技	5,900	733,252.00	1.08
2	000988	华工科技	19,300	537,698.00	0.79
3	601333	广深铁路	237,700	532,448.00	0.78
4	601615	明阳智能	20,300	529,830.00	0.78
5	600201	生物股份	29,700	485,595.00	0.71
6	600867	通化东宝	43,800	480,048.00	0.70
7	000636	风华高科	16,100	479,780.00	0.70
8	002340	格林美	43,400	449,190.00	0.66
9	600728	佳都科技	51,300	427,329.00	0.63
10	600487	亨通光电	28,000	423,360.00	0.62
11	002797	第一创业	57,800	423,096.00	0.62
12	600885	宏发股份	5,600	417,984.00	0.61
13	300037	新宙邦	3,500	395,500.00	0.58
14	601128	常熟银行	57,100	377,431.00	0.55
15	000031	大悦城	97,800	364,794.00	0.54
16	600765	中航重机	7,100	358,479.00	0.53

17	688521	芯原股份	4,600	355,856.00	0.52
18	600157	永泰能源	194,000	353,080.00	0.52
19	002936	郑州银行	108,280	342,164.80	0.50
20	300751	迈为股份	500	321,150.00	0.47
21	600737	中粮糖业	33,600	315,840.00	0.46
22	600511	国药股份	9,700	305,841.00	0.45
23	600884	杉杉股份	9,300	304,761.00	0.45
24	601555	东吴证券	34,280	303,720.80	0.45
25	601689	拓普集团	5,700	302,100.00	0.44
26	600066	宇通客车	27,300	300,846.00	0.44
27	605358	立昂微	2,500	300,025.00	0.44
28	600649	城投控股	71,000	291,810.00	0.43
29	603613	国联股份	2,700	290,250.00	0.43
30	601000	唐山港	105,400	289,850.00	0.43
31	688099	晶晨股份	2,200	286,440.00	0.42
32	600879	航天电子	34,600	285,104.00	0.42
33	600256	广汇能源	43,500	284,490.00	0.42
34	600522	中天科技	16,100	273,056.00	0.40
35	002183	怡亚通	40,600	268,772.00	0.39
36	300223	北京君正	2,000	268,000.00	0.39
37	002384	东山精密	9,800	265,580.00	0.39
38	601016	节能风电	40,700	264,957.00	0.39
39	002273	水晶光电	15,200	264,328.00	0.39
40	603156	养元饮品	9,300	264,213.00	0.39
41	600754	锦江酒店	4,500	263,700.00	0.39
42	600875	东方电气	12,300	263,466.00	0.39
43	601168	西部矿业	18,900	257,229.00	0.38
44	688005	容百科技	2,200	254,276.00	0.37
45	300363	博腾股份	2,800	250,460.00	0.37
46	600141	兴发集团	6,600	250,008.00	0.37
47	002131	利欧股份	100,400	246,984.00	0.36

48	002233	塔牌集团	23,300	246,514.00	0.36
49	000009	中国宝安	16,800	242,424.00	0.36
50	002266	浙富控股	34,000	242,080.00	0.36
51	603456	九洲药业	4,300	241,918.00	0.35
52	000723	美锦能源	14,900	241,827.00	0.35
53	002249	大洋电机	27,500	241,725.00	0.35
54	600298	安琪酵母	4,000	241,440.00	0.35
55	300463	迈克生物	8,200	239,358.00	0.35
56	601117	中国化学	19,900	238,800.00	0.35
57	000983	山西焦煤	28,800	238,176.00	0.35
58	000807	云铝股份	21,300	237,921.00	0.35
59	600862	中航高科	6,500	232,440.00	0.34
60	600170	上海建工	64,100	230,760.00	0.34
61	000156	华数传媒	27,100	229,266.00	0.34
62	002673	西部证券	28,400	229,188.00	0.34
63	002065	东华软件	28,900	225,420.00	0.33
64	603712	七一二	5,200	225,160.00	0.33
65	600863	内蒙华电	57,000	224,580.00	0.33
66	002078	太阳纸业	19,500	224,055.00	0.33
67	603077	和邦生物	65,700	224,037.00	0.33
68	600486	扬农化工	1,700	223,040.00	0.33
69	000519	中兵红箭	8,300	221,361.00	0.32
70	600188	兖矿能源	9,400	221,182.00	0.32
71	601717	郑煤机	19,000	220,210.00	0.32
72	601598	中国外运	48,800	218,624.00	0.32
73	601456	国联证券	15,600	217,932.00	0.32
74	002465	海格通信	19,800	216,216.00	0.32
75	601928	凤凰传媒	26,700	216,003.00	0.32
76	002867	周大生	12,100	215,138.00	0.32
77	600536	中国软件	4,300	214,699.00	0.32
78	600967	内蒙一机	17,900	213,905.00	0.31

79	600803	新奥股份	11,600	212,976.00	0.31
80	000547	航天发展	12,700	212,090.00	0.31
81	002500	山西证券	32,000	211,200.00	0.31
82	603444	吉比特	500	210,925.00	0.31
83	002156	通富微电	10,800	209,844.00	0.31
84	600704	物产中大	35,300	208,976.00	0.31
85	002408	齐翔腾达	19,760	207,480.00	0.30
86	600315	上海家化	5,000	202,050.00	0.30
87	000090	天健集团	34,200	200,754.00	0.29
88	600446	金证股份	14,000	200,480.00	0.29
89	002185	华天科技	15,700	199,547.00	0.29
90	000990	诚志股份	12,600	199,332.00	0.29
91	000960	锡业股份	10,200	199,206.00	0.29
92	300009	安科生物	15,080	197,397.20	0.29
93	300168	万达信息	15,100	196,602.00	0.29
94	600392	盛和资源	9,800	192,276.00	0.28
95	600316	洪都航空	4,900	191,394.00	0.28
96	300088	长信科技	14,400	191,232.00	0.28
97	000686	东北证券	21,700	190,526.00	0.28
98	300133	华策影视	27,900	188,883.00	0.28
99	600399	抚顺特钢	7,600	188,252.00	0.28
100	601636	旗滨集团	11,000	188,100.00	0.28
101	002013	中航机电	10,300	187,254.00	0.27
102	000027	深圳能源	22,800	184,680.00	0.27
103	601005	重庆钢铁	87,600	183,084.00	0.27
104	000739	普洛药业	5,200	182,468.00	0.27
105	688321	微芯生物	5,189	181,666.89	0.27
106	600639	浦东金桥	14,200	181,334.00	0.27
107	002153	石基信息	6,300	181,062.00	0.27
108	000898	鞍钢股份	47,900	179,625.00	0.26
109	603267	鸿远电子	1,000	179,440.00	0.26

110	002368	太极股份	6,500	179,010.00	0.26
111	002745	木林森	11,800	178,534.00	0.26
112	002180	纳思达	3,700	176,712.00	0.26
113	002212	天融信	8,900	170,613.00	0.25
114	603589	口子窖	2,400	170,088.00	0.25
115	600516	方大炭素	15,700	169,874.00	0.25
116	600497	驰宏锌锗	33,900	169,161.00	0.25
117	600755	厦门国贸	23,400	168,714.00	0.25
118	002468	申通快递	18,500	168,165.00	0.25
119	600549	厦门钨业	7,400	167,462.00	0.25
120	000930	中粮科技	15,200	165,224.00	0.24
121	000998	隆平高科	7,100	165,146.00	0.24
122	000656	金科股份	36,800	164,864.00	0.24
123	000987	越秀金控	18,900	164,430.00	0.24
124	002191	劲嘉股份	10,600	160,378.00	0.24
125	300058	蓝色光标	14,700	157,731.00	0.23
126	002028	思源电气	3,200	157,472.00	0.23
127	600673	东阳光	17,400	154,512.00	0.23
128	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.23
129	002294	信立泰	5,600	152,992.00	0.22
130	600372	中航电子	6,800	152,252.00	0.22
131	002670	国盛金控	15,800	151,680.00	0.22
132	002203	海亮股份	12,200	151,646.00	0.22
133	600733	北汽蓝谷	15,100	151,302.00	0.22
134	002195	二三四五	63,900	149,526.00	0.22
135	000932	华菱钢铁	29,200	149,212.00	0.22
136	601866	中远海发	45,900	149,175.00	0.22
137	601179	中国西电	26,600	147,630.00	0.22
138	300182	捷成股份	23,300	147,489.00	0.22
139	002939	长城证券	11,300	146,335.00	0.21
140	000685	中山公用	16,500	146,025.00	0.21

141	002268	卫 士 通	2,600	145,444.00	0.21
142	002985	北摩高科	1,200	144,552.00	0.21
143	002372	伟星新材	5,900	143,488.00	0.21
144	600380	健康元	11,100	142,524.00	0.21
145	600908	无锡银行	25,000	141,750.00	0.21
146	002683	宏大爆破	4,700	141,564.00	0.21
147	600171	上海贝岭	5,500	141,130.00	0.21
148	002399	海普瑞	8,200	140,220.00	0.21
149	000630	铜陵有色	40,100	139,548.00	0.20
150	600642	申能股份	18,900	139,293.00	0.20
151	300244	迪安诊断	4,100	137,637.00	0.20
152	000513	丽珠集团	3,400	136,714.00	0.20
153	300418	昆仑万维	5,900	136,585.00	0.20
154	002701	奥瑞金	19,500	136,500.00	0.20
155	002092	中泰化学	14,300	136,422.00	0.20
156	002353	杰瑞股份	3,400	136,000.00	0.20
157	601699	潞安环能	12,000	135,720.00	0.20
158	002557	洽洽食品	2,200	134,992.00	0.20
159	000623	吉林敖东	7,300	134,831.00	0.20
160	002422	科伦药业	7,000	132,510.00	0.19
161	002174	游族网络	8,600	131,064.00	0.19
162	002030	达安基因	6,500	130,390.00	0.19
163	002409	雅克科技	1,600	129,872.00	0.19
164	601778	晶科科技	15,200	129,656.00	0.19
165	002385	大北农	12,300	129,027.00	0.19
166	002223	鱼跃医疗	3,400	128,520.00	0.19
167	688208	道通科技	1,600	127,040.00	0.19
168	603127	昭衍新药	1,100	126,973.00	0.19
169	300072	三聚环保	16,000	126,880.00	0.19
170	300724	捷佳伟创	1,100	125,730.00	0.18
171	000738	航发控制	4,100	124,148.00	0.18

172	002532	天山铝业	15,000	122,250.00	0.18
173	300136	信维通信	4,800	121,536.00	0.18
174	600216	浙江医药	7,100	121,268.00	0.18
175	002155	湖南黄金	11,700	121,212.00	0.18
176	000778	新兴铸管	27,500	119,075.00	0.17
177	000629	攀钢钒钛	30,600	119,034.00	0.17
178	002444	巨星科技	3,900	118,989.00	0.17
179	300146	汤臣倍健	4,400	118,624.00	0.17
180	300257	开山股份	7,400	117,512.00	0.17
181	603000	人民网	8,100	116,802.00	0.17
182	601139	深圳燃气	13,100	115,673.00	0.17
183	000559	万向钱潮	18,000	114,660.00	0.17
184	002038	双鹭药业	10,600	114,586.00	0.17
185	603290	斯达半导	300	114,300.00	0.17
186	600699	均胜电子	5,200	114,244.00	0.17
187	600008	首创环保	33,500	114,235.00	0.17
188	000709	河钢股份	46,200	113,652.00	0.17
189	300376	易事特	11,300	113,565.00	0.17
190	002138	顺络电子	2,900	110,722.00	0.16
191	300285	国瓷材料	2,600	110,682.00	0.16
192	002416	爱施德	9,700	110,386.00	0.16
193	000671	阳光城	36,500	110,230.00	0.16
194	000959	首钢股份	19,200	110,016.00	0.16
195	002925	盈趣科技	3,200	108,896.00	0.16
196	600348	华阳股份	9,100	107,835.00	0.16
197	002507	涪陵榨菜	2,800	105,840.00	0.16
198	002440	闰土股份	10,900	104,531.00	0.15
199	300026	红日药业	13,300	104,139.00	0.15
200	002124	天邦股份	16,100	103,684.00	0.15
201	002958	青农商行	26,100	100,746.00	0.15
202	000961	中南建设	24,300	100,602.00	0.15

203	002080	中材科技	2,900	98,658.00	0.14
204	600131	国网信通	4,500	98,325.00	0.14
205	603707	健友股份	2,330	97,860.00	0.14
206	002396	星网锐捷	4,100	96,637.00	0.14
207	000415	渤海租赁	32,400	94,284.00	0.14
208	600039	四川路桥	7,800	93,912.00	0.14
209	600177	雅戈尔	13,600	93,704.00	0.14
210	002506	协鑫集成	24,600	93,480.00	0.14
211	002423	中粮资本	11,500	93,150.00	0.14
212	601118	海南橡胶	17,500	92,400.00	0.14
213	300474	景嘉微	600	91,320.00	0.13
214	600126	杭钢股份	17,700	90,801.00	0.13
215	600482	中国动力	4,600	90,620.00	0.13
216	600580	卧龙电驱	4,900	89,621.00	0.13
217	000825	太钢不锈	12,500	88,000.00	0.13
218	300383	光环新网	5,900	87,556.00	0.13
219	600597	光明乳业	6,000	87,120.00	0.13
220	000750	国海证券	20,900	85,899.00	0.13
221	601718	际华集团	28,600	85,228.00	0.13
222	603866	桃李面包	3,000	85,200.00	0.13
223	601869	长飞光纤	2,600	85,124.00	0.12
224	000729	燕京啤酒	9,800	83,006.00	0.12
225	600839	四川长虹	24,500	81,095.00	0.12
226	002505	鹏都农牧	20,700	79,074.00	0.12
227	300024	机器人	7,000	78,190.00	0.11
228	600415	小商品城	16,100	78,085.00	0.11
229	300212	易华录	2,200	77,770.00	0.11
230	000039	中集集团	4,500	77,220.00	0.11
231	000537	广宇发展	3,200	77,120.00	0.11
232	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.11
233	000728	国元证券	10,000	77,000.00	0.11

234	601198	东兴证券	6,500	75,595.00	0.11
235	600373	中文传媒	6,100	75,396.00	0.11
236	600282	南钢股份	20,300	75,110.00	0.11
237	300357	我武生物	1,300	74,490.00	0.11
238	600038	中直股份	900	72,270.00	0.11
239	300308	中际旭创	1,700	72,250.00	0.11
240	000046	泛海控股	37,800	71,064.00	0.10
241	600787	中储股份	11,200	69,888.00	0.10
242	600563	法拉电子	300	69,720.00	0.10
243	600339	中油工程	22,600	69,608.00	0.10
244	300763	锦浪科技	300	69,465.00	0.10
245	600764	中国海防	1,700	69,122.00	0.10
246	002439	启明星辰	2,400	68,472.00	0.10
247	603893	瑞芯微	500	68,450.00	0.10
248	600369	西南证券	12,800	67,712.00	0.10
249	000877	天山股份	4,400	67,364.00	0.10
250	300166	东方国信	6,200	66,960.00	0.10
251	600435	北方导航	6,200	66,216.00	0.10
252	000970	中科三环	4,100	65,805.00	0.10
253	000887	中鼎股份	3,000	65,430.00	0.10
254	600258	首旅酒店	2,500	65,325.00	0.10
255	002831	裕同科技	1,900	64,011.00	0.09
256	600507	方大特钢	8,100	63,180.00	0.09
257	300482	万孚生物	1,600	63,008.00	0.09
258	002966	苏州银行	9,300	62,961.00	0.09
259	000937	冀中能源	11,400	62,814.00	0.09
260	002010	传化智联	7,200	62,640.00	0.09
261	603605	珀莱雅	300	62,493.00	0.09
262	002815	崇达技术	3,700	62,345.00	0.09
263	600529	山东药玻	1,400	61,460.00	0.09
264	000158	常山北明	8,800	60,896.00	0.09

265	000598	兴蓉环境	9,600	60,672.00	0.09
266	002430	杭氧股份	2,000	60,020.00	0.09
267	000878	云南铜业	4,400	58,828.00	0.09
268	300253	卫宁健康	3,500	58,660.00	0.09
269	002511	中顺洁柔	3,500	58,485.00	0.09
270	002926	华西证券	5,900	58,115.00	0.09
271	000997	新大陆	3,200	57,984.00	0.09
272	002375	亚厦股份	7,700	57,673.00	0.08
273	000400	许继电气	2,200	57,420.00	0.08
274	600517	国网英大	7,800	56,862.00	0.08
275	300618	寒锐钴业	700	56,126.00	0.08
276	600968	海油发展	19,000	55,670.00	0.08
277	600307	酒钢宏兴	25,100	55,220.00	0.08
278	600377	宁沪高速	6,300	54,306.00	0.08
279	300251	光线传媒	4,200	53,970.00	0.08
280	600027	华电国际	10,000	53,500.00	0.08
281	002434	万里扬	3,600	53,064.00	0.08
282	600153	建发股份	5,800	52,606.00	0.08
283	000717	韶钢松山	11,000	52,250.00	0.08
284	600988	赤峰黄金	3,500	52,150.00	0.08
285	000975	银泰黄金	5,800	50,924.00	0.07
286	600259	广晟有色	1,000	49,240.00	0.07
287	603198	迎驾贡酒	700	48,615.00	0.07
288	002002	鸿达兴业	8,000	48,480.00	0.07
289	600598	北大荒	3,300	48,048.00	0.07
290	002739	万达电影	3,100	47,988.00	0.07
291	000999	华润三九	1,400	47,936.00	0.07
292	300741	华宝股份	1,000	47,850.00	0.07
293	002152	广电运通	4,000	47,600.00	0.07
294	600623	华谊集团	5,200	47,320.00	0.07
295	688002	睿创微纳	600	47,142.00	0.07

296	603927	中科软	1,700	46,512.00	0.07
297	600667	太极实业	5,700	46,056.00	0.07
298	600521	华海药业	2,100	45,486.00	0.07
299	002075	沙钢股份	7,800	45,474.00	0.07
300	600808	马钢股份	12,100	44,649.00	0.07
301	000540	中天金融	16,800	44,352.00	0.07
302	300630	普利制药	800	44,032.00	0.06
303	600409	三友化工	5,000	43,500.00	0.06
304	601872	招商轮船	10,600	43,460.00	0.06
305	002508	老板电器	1,200	43,224.00	0.06
306	688029	南微医学	200	42,534.00	0.06
307	002004	华邦健康	5,800	41,992.00	0.06
308	600195	中牧股份	3,200	41,824.00	0.06
309	000883	湖北能源	7,700	40,348.00	0.06
310	601611	中国核建	4,000	39,880.00	0.06
311	600909	华安证券	7,100	38,411.00	0.06
312	600233	圆通速递	2,300	38,364.00	0.06
313	600835	上海机电	2,400	38,208.00	0.06
314	000830	鲁西化工	2,500	38,150.00	0.06
315	688065	凯赛生物	200	36,856.00	0.05
316	002244	滨江集团	7,800	36,348.00	0.05
317	600643	爱建集团	5,300	35,828.00	0.05
318	002128	电投能源	2,400	35,640.00	0.05
319	603885	吉祥航空	2,000	35,500.00	0.05
320	002019	亿帆医药	2,000	35,240.00	0.05
321	600390	五矿资本	6,600	35,112.00	0.05
322	600418	江淮汽车	2,000	34,800.00	0.05
323	601228	广州港	10,000	33,300.00	0.05
324	000060	中金岭南	6,600	32,406.00	0.05
325	002603	以岭药业	1,600	31,360.00	0.05
326	600006	东风汽车	4,600	31,326.00	0.05

327	600566	济川药业	1,100	31,174.00	0.05
328	600060	海信视像	2,300	30,935.00	0.05
329	002387	维信诺	3,200	29,696.00	0.04
330	603218	日月股份	900	29,655.00	0.04
331	000021	深科技	1,800	28,512.00	0.04
332	001914	招商积余	1,400	28,364.00	0.04
333	000758	中色股份	5,000	27,300.00	0.04
334	002390	信邦制药	3,600	26,712.00	0.04
335	600705	中航产融	6,700	26,599.00	0.04
336	000690	宝新能源	4,400	26,048.00	0.04
337	000402	金融街	4,600	26,036.00	0.04
338	002146	荣盛发展	5,900	25,665.00	0.04
339	600546	山煤国际	3,000	24,630.00	0.04
340	600021	上海电力	1,900	24,358.00	0.04
341	300869	康泰医学	600	24,330.00	0.04
342	688289	圣湘生物	400	23,600.00	0.03
343	600064	南京高科	2,400	22,416.00	0.03
344	600160	巨化股份	1,700	21,947.00	0.03
345	600236	桂冠电力	3,300	21,186.00	0.03
346	600350	山东高速	4,100	21,156.00	0.03
347	300001	特锐德	800	19,896.00	0.03
348	600208	新湖中宝	1,500	4,470.00	0.01
349	600582	天地科技	1,000	4,380.00	0.01
350	600528	中铁工业	500	4,105.00	0.01
351	603568	伟明环保	100	3,653.00	0.01
352	601969	海南矿业	300	3,603.00	0.01
353	600572	康恩贝	700	3,500.00	0.01
354	603638	艾迪精密	40	1,276.80	0.00
355	600717	天津港	20	83.80	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	52,800	512,160.00	0.75
2	600116	三峡水利	39,500	460,570.00	0.68
3	000725	京东方 A	89,900	453,995.00	0.67
4	603260	合盛硅业	2,500	329,925.00	0.48
5	600438	通威股份	6,600	296,736.00	0.44
6	600183	生益科技	12,200	287,310.00	0.42
7	603986	兆易创新	1,600	281,360.00	0.41
8	002812	恩捷股份	1,100	275,440.00	0.40
9	600030	中信证券	10,000	264,100.00	0.39
10	002833	弘亚数控	8,100	260,658.00	0.38
11	000425	徐工机械	39,900	239,001.00	0.35
12	603599	广信股份	5,800	226,200.00	0.33
13	603517	绝味食品	2,900	198,157.00	0.29
14	603588	高能环境	10,700	187,999.00	0.28
15	603915	国茂股份	4,800	186,720.00	0.27
16	002049	紫光国微	800	180,000.00	0.26
17	600887	伊利股份	4,300	178,278.00	0.26
18	600019	宝钢股份	23,800	170,408.00	0.25
19	601678	滨化股份	20,000	159,400.00	0.23
20	002254	泰和新材	8,100	158,841.00	0.23
21	603043	广州酒家	5,600	134,736.00	0.20
22	603833	欧派家居	900	132,750.00	0.19
23	002677	浙江美大	7,600	131,860.00	0.19
24	002262	恩华药业	8,300	129,895.00	0.19
25	002129	中环股份	3,100	129,425.00	0.19
26	000672	上峰水泥	6,400	128,448.00	0.19
27	002832	比音勒芬	4,900	124,705.00	0.18
28	002410	广联达	1,900	121,562.00	0.18

29	300012	华测检测	4,500	120,915.00	0.18
30	603486	科沃斯	753	113,665.35	0.17
31	601827	三峰环境	12,500	111,500.00	0.16
32	603277	银都股份	6,000	111,000.00	0.16
33	002555	三七互娱	3,800	102,676.00	0.15
34	300747	锐科激光	1,700	100,487.00	0.15
35	002460	赣锋锂业	700	99,995.00	0.15
36	601688	华泰证券	5,600	99,456.00	0.15
37	002436	兴森科技	7,000	98,000.00	0.14
38	603039	泛微网络	1,400	97,678.00	0.14
39	003816	中国广核	31,100	97,343.00	0.14
40	601021	春秋航空	1,700	96,560.00	0.14
41	601965	中国汽研	5,000	93,050.00	0.14
42	002007	华兰生物	3,100	90,334.00	0.13
43	603392	万泰生物	400	88,600.00	0.13
44	000977	浪潮信息	2,400	85,992.00	0.13
45	601225	陕西煤业	6,300	76,860.00	0.11
46	300674	宇信科技	3,200	76,480.00	0.11
47	603305	旭升股份	1,500	74,820.00	0.11
48	000429	粤高速 A	10,100	74,740.00	0.11
49	300196	长海股份	4,200	73,626.00	0.11
50	600779	水井坊	600	71,994.00	0.11
51	300726	宏达电子	700	70,042.00	0.10
52	300861	美畅股份	900	69,993.00	0.10
53	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.10
54	600612	老凤祥	1,500	68,775.00	0.10
55	603658	安图生物	1,200	66,072.00	0.10
56	002497	雅化集团	2,300	65,918.00	0.10
57	002493	荣盛石化	3,600	65,376.00	0.10
58	002648	卫星化学	1,600	64,048.00	0.09
59	300347	泰格医药	500	63,900.00	0.09

60	601158	重庆水务	9,800	62,818.00	0.09
61	300316	晶盛机电	900	62,550.00	0.09
62	002206	海利得	7,000	62,160.00	0.09
63	300661	圣邦股份	200	61,800.00	0.09
64	600079	人福医药	2,700	60,804.00	0.09
65	002938	鹏鼎控股	1,400	59,402.00	0.09
66	300750	宁德时代	100	58,800.00	0.09
67	001979	招商蛇口	4,200	56,028.00	0.08
68	300638	广和通	1,000	54,500.00	0.08
69	600760	中航沈飞	800	54,432.00	0.08
70	601658	邮储银行	10,000	51,000.00	0.07
71	600383	金地集团	3,900	50,583.00	0.07
72	300601	康泰生物	500	49,270.00	0.07
73	600176	中国巨石	2,700	49,140.00	0.07
74	300623	捷捷微电	1,400	44,044.00	0.06
75	002456	欧菲光	4,400	42,680.00	0.06
76	000799	酒鬼酒	200	42,500.00	0.06
77	300759	康龙化成	300	42,381.00	0.06
78	002727	一心堂	1,100	42,361.00	0.06
79	603713	密尔克卫	300	40,434.00	0.06
80	000001	平安银行	2,300	37,904.00	0.06
81	601668	中国建筑	7,400	37,000.00	0.05
82	002773	康弘药业	1,800	36,630.00	0.05
83	600674	川投能源	2,900	36,250.00	0.05
84	002371	北方华创	100	34,702.00	0.05
85	603298	杭叉集团	2,000	34,300.00	0.05
86	600966	博汇纸业	3,300	34,122.00	0.05
87	002139	拓邦股份	1,800	33,642.00	0.05
88	603799	华友钴业	300	33,093.00	0.05
89	300390	天华超净	400	32,400.00	0.05
90	600809	山西汾酒	100	31,578.00	0.05

91	600085	同仁堂	700	31,486.00	0.05
92	688036	传音控股	200	31,380.00	0.05
93	002913	奥士康	400	31,368.00	0.05
94	002756	永兴材料	200	29,604.00	0.04
95	300775	三角防务	600	29,334.00	0.04
96	603995	甬金股份	500	28,930.00	0.04
97	601601	中国太保	1,000	27,120.00	0.04
98	002332	仙琚制药	2,000	26,400.00	0.04
99	603848	好太太	1,900	26,315.00	0.04
100	603365	水星家纺	1,500	25,245.00	0.04
101	688366	昊海生科	200	25,178.00	0.04
102	600323	瀚蓝环境	1,200	25,176.00	0.04
103	600219	南山铝业	4,900	23,079.00	0.03
104	000625	长安汽车	1,500	22,785.00	0.03
105	002126	银轮股份	1,800	22,608.00	0.03
106	603489	八方股份	100	22,560.00	0.03
107	603882	金域医学	200	22,274.00	0.03
108	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.01
109	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.01
110	603826	坤彩科技	100	3,828.00	0.01
111	002709	天赐材料	20	2,293.00	0.00
112	601006	大秦铁路	300	1,920.00	0.00
113	600028	中国石化	100	423.00	0.00
114	601868	中国能建	1	2.73	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600089	特变电工	2,319,715.00	2.37

2	601168	西部矿业	2,168,985.00	2.22
3	600567	山鹰国际	2,126,052.00	2.17
4	002266	浙富控股	2,111,713.67	2.16
5	000887	中鼎股份	2,072,122.00	2.12
6	603486	科沃斯	1,994,891.37	2.04
7	002185	华天科技	1,987,763.60	2.03
8	002244	滨江集团	1,910,212.00	1.95
9	002465	海格通信	1,907,040.00	1.95
10	600867	通化东宝	1,866,488.00	1.91
11	601598	中国外运	1,855,846.00	1.90
12	600008	首创环保	1,829,734.00	1.87
13	600884	杉杉股份	1,829,590.00	1.87
14	000630	铜陵有色	1,823,994.00	1.86
15	600201	生物股份	1,818,399.00	1.86
16	000156	华数传媒	1,796,659.00	1.84
17	600380	健康元	1,776,646.00	1.81
18	600446	金证股份	1,754,983.00	1.79
19	600885	宏发股份	1,732,106.98	1.77
20	000778	新兴铸管	1,723,734.00	1.76

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600089	特变电工	3,361,637.00	3.43
2	000039	中集集团	3,131,440.00	3.20
3	300244	迪安诊断	2,870,365.00	2.93
4	600039	四川路桥	2,799,067.00	2.86
5	300058	蓝色光标	2,647,497.00	2.70
6	600567	山鹰国际	2,456,764.00	2.51

7	600008	首创环保	2,453,267.00	2.51
8	600867	通化东宝	2,437,054.82	2.49
9	600885	宏发股份	2,424,699.30	2.48
10	002056	横店东磁	2,384,478.00	2.44
11	000887	中鼎股份	2,368,836.00	2.42
12	600497	驰宏锌锗	2,318,476.52	2.37
13	002138	顺络电子	2,262,329.00	2.31
14	002266	浙富控股	2,235,377.00	2.28
15	603486	科沃斯	2,200,214.00	2.25
16	600409	三友化工	2,145,089.00	2.19
17	601168	西部矿业	2,056,856.00	2.10
18	002156	通富微电	2,004,155.48	2.05
19	601098	中南传媒	1,977,136.00	2.02
20	600060	海信视像	1,957,000.00	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	445,313,689.72
卖出股票收入（成交）总额	483,791,317.55

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	12,576.60	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,576.60	0.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113633	科沃转债	60	7,776.60	0.01
2	113635	升21转债	20	2,800.00	0.00
3	113634	珀莱转债	20	2,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2201	IC2201	1	1,475,560.00	17,920.00	-
公允价值变动总额合计（元）					17,920.00
股指期货投资本期收益（元）					228,624.46
股指期货投资本期公允价值变动（元）					17,920.00

注：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。

8.10.2 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。

执行。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	206,578.40
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	2,540.33
5	应收申购款	257,736.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	466,855.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中泰中证500指数增强A	1,278	8,085.48	1,005,582.01	9.73%	9,327,664.64	90.27%

中泰中证500指数增强C	4,831	6,985.81	55,573.75	0.16%	33,692,854.93	99.84%
合计	6,109	7,215.86	1,061,155.76	2.41%	43,020,519.57	97.59%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中泰中证500指数增强A	184,234.95	1.78%
	中泰中证500指数增强C	165,865.81	0.49%
	合计	350,100.76	0.79%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C
基金合同生效日(2019年12月11日)基金份额总额	107,120,144.91	190,368,684.73
本报告期期初基金份额总额	34,123,652.18	38,981,571.33
本报告期基金总申购份额	8,948,140.05	34,763,684.19
减：本报告期基金总赎回份额	32,738,545.58	39,996,826.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,333,246.65	33,748,428.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人原董事王丽敏离任。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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费用为人民币50,000.00元。

目前事务所已提供审计服务的连续年限：自2019年12月11日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	927,874,535.88	100.00%	205,413.72	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	287,653.43	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰中证500指数增强型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会规定网站	2021-01-21
2	中泰中证500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
3	中泰中证500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
4	中泰中证500指数增强型证券投资	中国证监会规定网站	2021-04-16

	基金基金产品资料概要更新		
5	中泰中证500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
6	关于中泰中证500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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-04-16
7	中泰中证500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
8	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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-05-07
9	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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-05-24
10	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-06-10
11	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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-06-15
12	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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-06-23
13	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金开通直销渠道基金转换及定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-07-12
14	中泰中证500指数增强型证券投资	中国证监会规定网站	2021-07-20

	基金2021年第2季度报告		
15	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-07-22
16	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度小满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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-08-09
17	中泰中证500指数增强型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会规定网站	2021-08-27
18	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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-09-07
19	中泰中证500指数增强型证券投资基金2021年第3季度报告	中国证监会规定网站	2021-10-27
20	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	上海证券报、中国证监会规定网站	2021-11-04

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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1月1日至2021年1月11日	19,004,760.56	0.00	19,004,760.56	0.00	0.00%
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</p>							

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。

(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。

(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。

(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。

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰中证500指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰中证500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内中泰中证500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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二二年三月三十日