

# 中泰沪深 300 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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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.....	8
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	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.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告.....	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	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.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
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.....	78
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.....	79
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.....	79
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.....	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	79

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
8.12 投资组合报告附注.....	80
§9 基金份额持有人信息.....	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
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.....	82
§10 开放式基金份额变动.....	82
§11 重大事件揭示.....	83
11.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
11.4 基金投资策略的改变.....	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
11.8 其他重大事件.....	84
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	87
§13 备查文件目录.....	87
13.1 备查文件目录.....	87
13.2 存放地点.....	88
13.3 查阅方式.....	88

## § 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	151,228,822.97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	38,840,172.42份	112,388,650.55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%×沪深300指数收益率+5%×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04月01日（基金合同生效日） - 2020年12月31日	
	中泰沪深300指 数增强A	中泰沪深300指 数增强C	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	12,370,793.68	33,083,264.43	40,492,822.94	54,318,940.87
本期利 润	3,983,592.47	6,696,030.53	53,684,838.32	76,388,410.69
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0827	0.0453	0.5095	0.4743
本期加 权平均 净值利 润率	5.32%	2.93%	41.82%	38.13%
本期基 金份额 净值增 长率	2.07%	1.65%	52.74%	52.29%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021年末		2020年末	
期末可 供分配 利润	21,711,879.89	61,604,136.97	43,972,942.92	86,022,933.89
期末可 供分配	0.5590	0.5481	0.4482	0.4439

基金份额利润				
期末基金资产净值	60,552,052.31	173,992,787.52	149,840,011.44	295,136,142.48
期末基金份额净值	1.5590	1.5481	1.5274	1.5229
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	55.90%	54.81%	52.74%	52.29%

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
过去三个月	1.92%	0.74%	1.46%	0.75%	0.46%	-0.01%
过去六个月	-2.07%	1.00%	-5.13%	0.97%	3.06%	0.03%
过去一年	2.07%	1.10%	-4.85%	1.11%	6.92%	-0.01%



自基金合同生效起至今	55.90%	1.13%	32.31%	1.14%	23.59%	-0.01%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

## 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
过去三个月	1.82%	0.74%	1.46%	0.75%	0.36%	-0.01%
过去六个月	-2.27%	1.00%	-5.13%	0.97%	2.86%	0.03%
过去一年	1.65%	1.10%	-4.85%	1.11%	6.50%	-0.01%
自基金合同生效起至今	54.81%	1.13%	32.31%	1.14%	22.50%	-0.01%

### 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

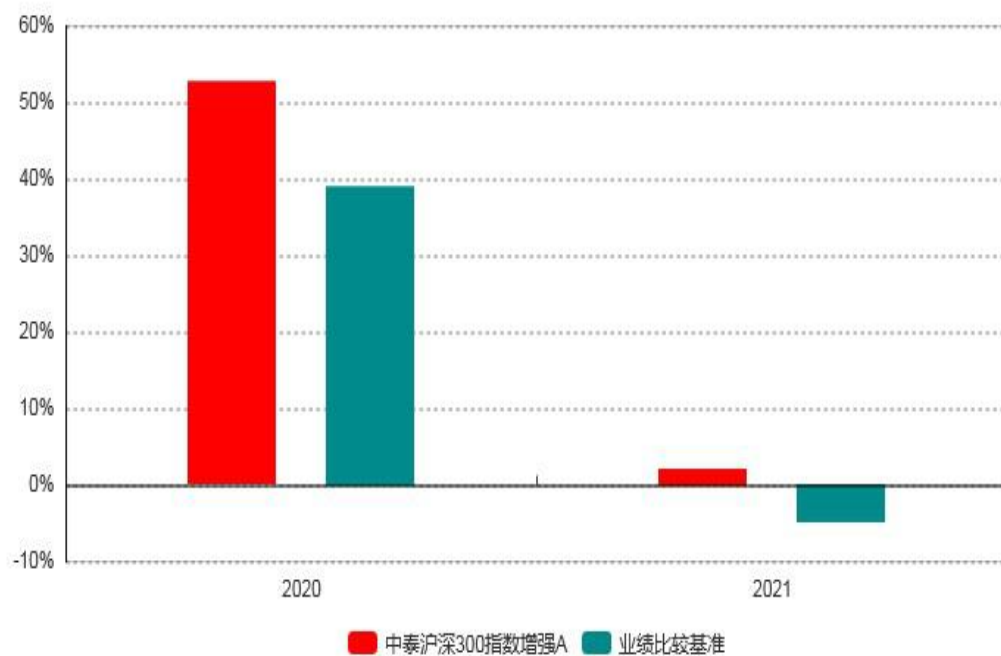
(2020年04月01日-2021年12月31日)



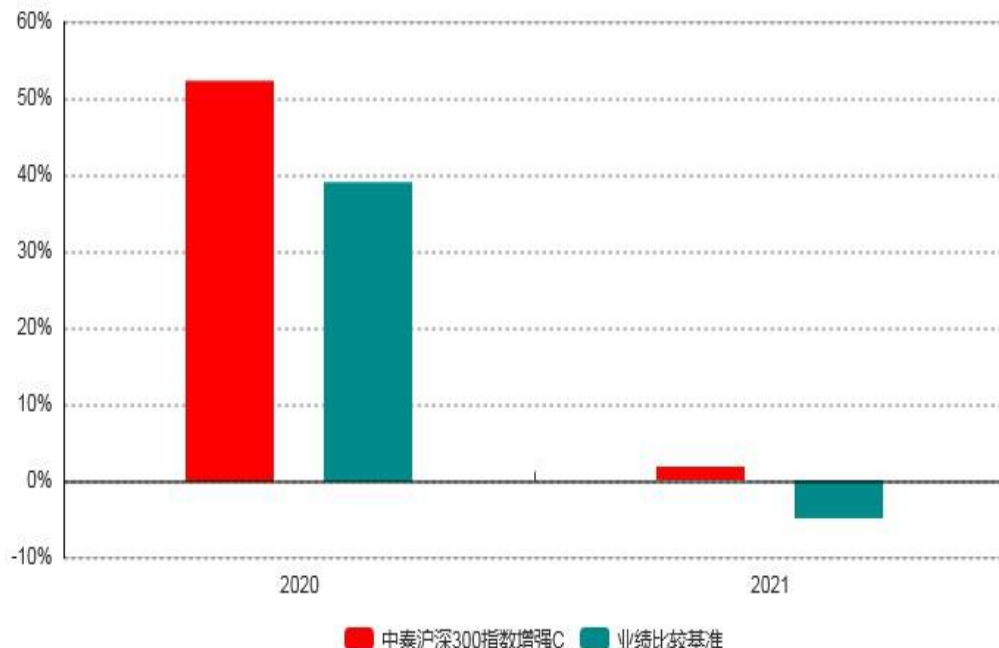
中泰沪深300指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年04月01日-2021年12月31日)



### 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 2020 年 4 月 1 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 2020 年 4 月 1 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2020年4月1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；中泰中证500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。	2020-04-01	-	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。
--	--	--	--	--	---------------------

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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

异常交易是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理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，沪深300指数在年初短暂上升后迅速回调，而后全年维持一种平缓震动的走势，指数从年初的5211点回调至年末的4940点，全年指数总体下行约5.2%。

本基金在全年依旧在严格采取量化方法约束跟踪误差的基础上，通过有限度的主动策略力求获得超额收益，同时通过参与新股申购增厚投资收益。从全年实际运行下来的结果看，本基金有效地维持了对指数的有效跟踪，跟踪误差保持得非常理想。与此同时，全年下来也取得了一定的超额收益。但从全年的情况来回顾，第四季度，由于市场的实际运行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。

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

截至报告期末中泰沪深300指数增强A基金份额净值为1.5590元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.07%，同期业绩比较基准收益率为-4.85%；截至报告期末中泰沪深300指数增强C基金份额净值为1.5481元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.65%，同期业绩比较基准收益率为-4.85%。

#### 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

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 托管人对本年度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年年度报告》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 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21981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	中泰沪深300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 我们审计了中泰沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“中泰沪深300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,公允反映了中泰沪深300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	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，我们独立于中泰沪深300指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	中泰沪深300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沪深300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沪深300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沪深300指数增强基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（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

	<p>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，就可能导致对中泰沪深300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沪深300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。</p>	
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：中泰沪深300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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	23,637,299.54	26,311,565.42
结算备付金		1,492,342.07	1,386,354.75
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	217,259,129.55	403,006,303.84
其中：股票投资		217,081,441.25	402,935,303.84
基金投资		-	-
债券投资		177,688.30	71,000.00
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	-	15,000,037.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,581.70	7,259.09
应收股利		-	-
应收申购款		340,440.80	522,853.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		242,734,793.66	446,234,374.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,721,241.95	638,228.08
应付管理人报酬		159,494.71	287,780.44
应付托管费		19,936.86	35,972.56
应付销售服务费		59,260.79	95,089.66
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	309.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	230,019.52	200,840.73
负债合计		8,189,953.83	1,258,220.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	151,228,822.97	291,901,305.81
未分配利润	7.4.7.10	83,316,016.86	153,074,848.11
所有者权益合计		234,544,839.83	444,976,153.92
负债和所有者权益总计		242,734,793.66	446,234,374.39

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额151,228,822.97份，其中中泰沪深300指数增强A类份额38,840,172.42份，中泰沪深300指数增强C类份额112,388,650.55份。A类份额净值1.5590元，C类份额净值1.5481元（于2020年12月31日，基金份额总额291,901,305.81份，其中中泰沪深300指数增强A类份额98,100,287.70份，中泰沪深300指数增强C类份额193,801,018.11份。A类份额净值1.5274元，C类份额净值1.5229元）。

## 7.2 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04月01日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
----	-----	-----------------------------------	---

<b>一、收入</b>		17,318,331.56	135,841,357.92
1. 利息收入		203,751.29	234,371.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	188,489.91	224,941.15
债券利息收入		66.98	59.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,194.40	9,371.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		51,517,780.69	99,636,648.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	46,928,424.91	94,219,058.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	192,567.30	119,556.09
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	87,919.22	1,331,564.27
股利收益	7.4.7.15	4,308,869.26	3,966,469.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-34,774,435.11	35,261,485.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	371,234.69	708,852.69
<b>减：二、费用</b>		6,638,708.56	5,768,108.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,439,128.26	1,979,008.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	304,890.96	247,376.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	917,403.14	604,477.56

4. 交易费用	7.4.7.18	2,589,201.62	2,626,971.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		570.98	5,003.79
7. 其他费用	7.4.7.19	387,513.60	305,271.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,679,623.00	130,073,249.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,679,623.00	130,073,249.01

### 7.3 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)	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)	-	10,679,623.00	10,679,623.00
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)	-140,672,482.84	-80,438,454.25	-221,110,937.09
其中：1. 基金申购款	151,509,923.90	84,278,900.12	235,788,824.02
2. 基金赎回	-292,182,406.74	-164,717,354.37	-456,899,761.11



回款			
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）	151,228,822.97	83,316,016.86	234,544,839.83
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）	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）	-	130,073,249.01	130,073,249.01
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）	-264,227,736.49	23,001,599.10	-241,226,137.39
其中：1. 基金申购款	278,255,889.74	99,782,403.25	378,038,292.99
2. 基金赎回款	-542,483,626.23	-76,780,804.15	-619,264,430.38
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）	291,901,305.81	153,074,848.11	444,976,153.92

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,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%×沪深300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》、《中泰沪深300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	上年度末
----	-----	------



	2021年12月31日	2020年12月31日
活期存款	12,518,380.40	13,762,674.67
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	11,118,919.14	12,548,890.75
合计	23,637,299.54	26,311,565.42

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	216,604,079.46	217,081,441.25	477,361.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	168,000.00	177,688.30
	银行间市场	-	-
	合计	168,000.00	177,688.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	216,772,079.46	217,259,129.55	487,050.09
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	367,673,818.64	402,935,303.84	35,261,485.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	71,000.00	71,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	71,000.00	71,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		367,744,818.64	403,006,303.84	35,261,485.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,037.50	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,037.50	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 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	1,617.52	3,182.65
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	2,416.09	4,748.03
应收结算备付金利息	1,541.15	1,563.50
应收债券利息	6.94	2.32
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-2,237.41
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	5,581.70	7,259.09

注：根据交易所实施的债券质押式回购新规，质押式回购计息天数采用资金实际占款天数，故回购到期日为节假日前一日的交易所回购利息余额可能出现负值，未提利息将于节假日期间完成计提。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

#### 7.4.7.7 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。

#### 7.4.7.8 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	19.52	840.73
预提费用	180,000.00	150,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	230,019.52	200,840.73

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 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12月31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	40,748,887.63	40,748,887.63
本期赎回(以“-”号填列)	-100,009,002.91	-100,009,002.91
本期末	38,840,172.42	38,840,172.42

## 7.4.7.9.2 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12月31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	110,761,036.27	110,761,036.27
本期赎回(以“-”号填列)	-192,173,403.83	-192,173,403.83
本期末	112,388,650.55	112,388,650.55

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 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	12,370,793.68	-8,387,201.21	3,983,592.47
本期基金份额交易产	-31,172,100.63	-2,839,335.69	-34,011,436.32

生的变动数			
其中：基金申购款	22,687,141.75	740,055.88	23,427,197.63
基金赎回款	-53,859,242.38	-3,579,391.57	-57,438,633.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,171,635.97	-3,459,756.08	21,711,879.89

## 7.4.7.10.2 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	33,083,264.43	-26,387,233.90	6,696,030.53
本期基金份额交易产生的变动数	-47,549,084.63	1,122,066.70	-46,427,017.93
其中：基金申购款	63,152,320.04	-2,300,617.55	60,851,702.49
基金赎回款	-110,701,404.67	3,422,684.25	-107,278,720.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,557,113.69	-9,952,976.72	61,604,136.97

## 7.4.7.11 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04月01日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	48,362.76	68,020.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	122,952.10	139,852.37
结算备付金利息收入	17,175.05	17,068.10
其他	-	-
合计	188,489.91	224,941.15

## 7.4.7.12 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04月01日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,605,573,540.29	1,535,267,073.94
减：卖出股票成本总额	1,558,645,115.38	1,441,048,015.88
买卖股票差价收入	46,928,424.91	94,219,058.06

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月01日（基金合同生效 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） 差价收入	192,567.30	119,556.09
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	192,567.30	119,556.09

## 7.4.7.13.2 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04月01日（基金合同生效日） 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	732,431.47	504,214.61
减：卖出债券（、	539,800.00	384,600.00

债转股及债券到期 兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	64.17	58.52
买卖债券差价收入	192,567.30	119,556.09

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 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04月01日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
期货投资	87,919.22	1,331,564.27

#### 7.4.7.15 股利收益

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04月01日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,308,869.26	3,966,469.72
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,308,869.26	3,966,469.72

#### 7.4.7.16 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20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年04月01日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-34,774,435.11	35,261,485.20
——股票投资	-34,784,123.41	35,261,485.20
——债券投资	9,688.30	-
——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	-34,774,435.11	35,261,485.20

## 7.4.7.17 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04月01日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	370,826.66	708,852.69
其他	340.73	-
转换费收入	67.30	-
合计	371,234.69	708,852.69

## 7.4.7.18 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04月01日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,585,430.81	2,624,841.57
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	3,770.81	2,129.85
合计	2,589,201.62	2,626,971.42

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

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04月01日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	90,000.00
汇划手续费	7,113.60	5,271.63
指数使用费	200,000.00	150,000.00
开户费	400.00	-
合计	387,513.60	305,271.63

#### 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
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
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

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。

#### 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 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。

#### 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04月01日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,439,128.26	1,979,008.49
其中：支付销售机构的客户维护费	527,866.15	639,850.06

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%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。

##### 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04月01日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	304,890.96	247,376.02

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。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期

服务费的各关联方名称	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		
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C	合计
中国光大银行股份有限公司	0.00	102,099.99	102,099.99
中泰证券股份有限公司	0.00	85,462.96	85,462.96
中泰证券（上海）资产管理有限公司	0.00	592,236.12	592,236.12
合计	0.00	779,799.07	779,799.07
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12月31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
中国光大银行股份有限公司	0.00	99,306.87	99,306.87
中泰证券股份有限公司	0.00	168,036.99	168,036.99
中泰证券（上海）资产管理有限公司	0.00	197,088.38	197,088.38
合计	0.00	464,432.24	464,432.24

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

本报告期基金管理人未持有本基金。

##### 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年04月01日（基金合同生效日） 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
光大银行	12,518,380.40	48,362.76	13,762,674.67	68,020.68

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。

#### 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	688501.SH	青达环保	首次公开发行	1,759	18,592.63

中泰证券	001207.SZ	联科科技	首次公开发行	682	9,732.14
中泰证券	300996.SZ	普联软件	首次公开发行	2,410	50,152.10
中泰证券	605296.SH	神农集团	首次公开发行	569	31,909.52
中泰证券	688383.SH	新益昌	首次公开发行	2,701	52,885.58
中泰证券	688663.SH	新风光	首次公开发行	3,279	47,479.92
中泰证券	688662.SH	富信科技	首次公开发行	2,556	39,899.16
上年度可比期间 2020年04月01日（基金合同生效日）至2020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	688557.SH	兰剑智能	首次公开发行	1,812	50,192.40

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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
688187	时代电气	2021-08-30	2022-03-07	限售股	31.38	76.65	4,741	148,772.58	363,397.65	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	限售股	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688778	厦钨新能	2021-07-29	2022-02-07	限售股	24.50	100.74	3,018	73,941.00	304,033.32	-
688110	东芯股份	2021-12-03	2022-06-10	限售股	30.18	40.37	2,622	79,131.96	105,850.14	-
688167	炬光科技	2021-12-17	2022-06-24	限售股	78.69	176.67	575	45,246.75	101,585.25	-

688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	2,003	84,085.94	84,085.94	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,096	74,649.92	74,649.92	-
688272	富吉瑞	2021-10-08	2022-04-18	限售股	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	限售股	60.64	234.74	140	8,489.60	32,863.60	-
688701	卓锦股份	2021-09-08	2022-03-16	限售股	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	限售股	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	限售股	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	限售股	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	限售股	22.04	56.28	395	8,705.80	22,230.60	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	限售股	60.66	96.75	211	12,799.26	20,414.25	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	限售股	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	限售股	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	限售股	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	限售股	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	限售股	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	限售股	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	限售股	10.07	16.76	873	8,791.11	14,631.48	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	限售股	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	限售股	12.03	17.12	828	9,960.84	14,175.36	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	限售股	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301211	亨迪	2021-12-14	2022-06-22	限售	25.80	33.65	387	9,984.60	13,022.55	-

	药业			股						
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	限售股	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	限售股	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	限售股	22.70	49.02	255	5,788.50	12,500.10	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	限售股	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	限售股	26.91	43.36	274	7,373.34	11,880.64	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	限售股	116.88	116.08	99	11,571.12	11,491.92	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	限售股	12.37	19.23	592	7,323.04	11,384.16	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	限售股	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	限售股	93.09	75.34	144	13,404.96	10,848.96	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	限售股	26.17	44.86	225	5,888.25	10,093.50	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	限售股	10.45	11.22	883	9,227.35	9,907.26	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	限售股	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	限售股	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	限售股	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	限售股	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	限售股	66.18	56.62	160	10,588.80	9,059.20	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	限售股	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	限售股	39.08	52.13	168	6,565.44	8,757.84	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	限售股	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	限售股	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	限售股	27.81	31.14	262	7,286.22	8,158.68	-

300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	限售股	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	限售股	58.08	49.85	156	9,060.48	7,776.60	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	限售股	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	限售股	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	限售股	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	限售股	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	限售股	27.12	30.58	238	6,454.56	7,278.04	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	限售股	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	限售股	30.73	29.14	241	7,405.93	7,022.74	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	限售股	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	限售股	29.28	32.00	212	6,207.36	6,784.00	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	限售股	43.99	50.77	131	5,762.69	6,650.87	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	限售股	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	限售股	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	限售股	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	限售股	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	限售股	27.85	27.46	227	6,321.95	6,233.42	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	限售股	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	限售股	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	限售股	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	限售股	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美	2021-10-19	2022-04-28	限售	33.16	24.67	239	7,925.24	5,896.13	-



301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	限售股	36.31	35.52	162	5,882.22	5,754.24	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	限售股	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	限售股	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	限售股	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	限售股	79.60	78.53	68	5,412.80	5,340.04	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	限售股	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	限售股	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	限售股	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	限售股	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	限售股	57.27	53.71	84	4,810.68	4,511.64	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	限售股	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	限售股	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	限售股	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	限售股	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

## 7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	1,430	143,000.00	143,000.00	-

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、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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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	143,000.00	11,000.00
AAA以下	34,688.30	60,000.00
未评级	-	-
合计	177,688.30	71,000.00

#### 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，除卖出回购金融资产将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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	23,637,299.54	-	-	-	-	-	23,637,299.54
结算备付金	1,492,342.07	-	-	-	-	-	1,492,342.07
交易性金融资产	-	-	-	-	177,688.30	217,081,441.25	217,259,129.55
应收利息	-	-	-	-	-	5,581.70	5,581.70
应收申购款	-	-	-	-	-	340,440.80	340,440.80
资产总计	25,129,641.61	-	-	-	177,688.30	217,427,463.75	242,734,793.66
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,721,241.95	7,721,241.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	159,494.71	159,494.71
应付托管费	-	-	-	-	-	19,936.86	19,936.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	59,260.79	59,260.79
其他负债	-	-	-	-	-	230,019.52	230,019.52
负债总计	-	-	-	-	-	8,189,953.83	8,189,953.83
利率敏感度缺口	25,129,641.61	-	-	-	177,688.30	209,237,509.92	234,544,839.83
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	26,311,565.42	-	-	-	-	-	26,311,565.42

款							
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
应付销售服务费	-	-	-	-	-	95,089.66	95,089.66
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。

#### 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%。

#### 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	217,081,441.25	92.55	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	177,688.30	0.08	71,000.00	0.02
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-



一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	217,259,129.55	92.63	403,006,303.84	90.57

#### 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%	11,452,005.42	20,794,261.52
	比较基准下降5%	-11,452,005.42	-20,794,261.52

#### 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214,873,699.89元，属于第二层次的余额为307,240.35元，属于第三层次的余额为2,078,189.31元（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

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具2,078,189.31元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具809,817.73元(2020年度：无)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动或当期投资收益1,268,371.58元(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为2,078,189.31元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(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	217,081,441.25	89.43
	其中：股票	217,081,441.25	89.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	177,688.30	0.07
	其中：债券	177,688.30	0.07
	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	25,129,641.61	10.35
8	其他各项资产	346,022.50	0.14
9	合计	242,734,793.66	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	1,098,617.60	0.47
B	采矿业	5,019,397.00	2.14
C	制造业	115,396,451.15	49.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,447,222.30	1.47
E	建筑业	1,691,493.00	0.72
F	批发和零售业	308,395.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,289,970.90	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	4,819,778.00	2.05

	术服务业		
J	金融业	44,460,694.31	18.96
K	房地产业	3,810,713.00	1.62
L	租赁和商务服务业	2,482,320.09	1.06
M	科学研究和技术服务业	3,794,311.24	1.62
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	2,933,495.00	1.25
R	文化、体育和娱乐业	74,386.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	193,627,244.59	82.55

### 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	101,514.00	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,556,950.58	7.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	747,950.28	0.32
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	277,430.85	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,290,129.00	0.55
H	住宿和餐饮业	60,038.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,114,440.81	0.90
J	金融业	517,472.60	0.22
K	房地产业	270,062.00	0.12
L	租赁和商务服务业	358,110.00	0.15

M	科学研究和技术服务业	129,620.78	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	958,204.07	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	42,591.92	0.02
S	综合	-	-
	合计	23,454,196.66	10.00

### 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	600519	贵州茅台	6,153	12,613,650.00	5.38
2	300750	宁德时代	14,600	8,584,800.00	3.66
3	600036	招商银行	131,946	6,427,089.66	2.74
4	600030	中信证券	234,100	6,182,581.00	2.64
5	601318	中国平安	80,700	4,068,087.00	1.73
6	601012	隆基股份	42,500	3,663,500.00	1.56
7	600887	伊利股份	78,397	3,250,339.62	1.39
8	000333	美的集团	42,300	3,122,163.00	1.33
9	000858	五粮液	13,995	3,116,126.70	1.33
10	600438	通威股份	68,079	3,060,831.84	1.31
11	002460	赣锋锂业	19,500	2,785,575.00	1.19
12	600900	长江电力	119,739	2,718,075.30	1.16
13	000001	平安银行	164,800	2,715,904.00	1.16

14	002415	海康威视	47,200	2,469,504.00	1.05
15	601398	工商银行	530,500	2,456,215.00	1.05
16	603259	药明康德	20,528	2,434,210.24	1.04
17	000725	京东方 A	477,200	2,409,860.00	1.03
18	300059	东方财富	64,516	2,394,188.76	1.02
19	002594	比亚迪	8,900	2,386,268.00	1.02
20	002475	立讯精密	48,400	2,381,280.00	1.02
21	603986	兆易创新	13,484	2,371,161.40	1.01
22	601899	紫金矿业	242,200	2,349,340.00	1.00
23	600809	山西汾酒	7,374	2,328,561.72	0.99
24	601888	中国中免	10,149	2,226,792.09	0.95
25	600276	恒瑞医药	43,892	2,225,763.32	0.95
26	601601	中国太保	74,100	2,009,592.00	0.86
27	000568	泸州老窖	7,846	1,991,864.02	0.85
28	002812	恩捷股份	7,700	1,928,080.00	0.82
29	002142	宁波银行	48,062	1,839,813.36	0.78
30	300760	迈瑞医疗	4,800	1,827,840.00	0.78
31	600309	万华化学	16,400	1,656,400.00	0.71
32	603517	绝味食品	23,200	1,585,256.00	0.68
33	603501	韦尔股份	5,000	1,553,850.00	0.66
34	002129	中环股份	34,900	1,457,075.00	0.62
35	000661	长春高新	5,200	1,411,280.00	0.60
36	601166	兴业银行	72,700	1,384,208.00	0.59
37	600760	中航沈飞	20,000	1,360,800.00	0.58
38	002241	歌尔股份	24,773	1,340,219.30	0.57
39	600926	杭州银行	104,500	1,339,690.00	0.57
40	601658	邮储银行	260,000	1,326,000.00	0.57
41	600031	三一重工	57,802	1,317,885.60	0.56
42	300124	汇川技术	18,500	1,269,100.00	0.54
43	002049	紫光国微	5,600	1,260,000.00	0.54
44	600015	华夏银行	224,100	1,254,960.00	0.54

45	601169	北京银行	276,600	1,228,104.00	0.52
46	002466	天齐锂业	11,300	1,209,100.00	0.52
47	600690	海尔智家	40,400	1,207,556.00	0.51
48	002493	荣盛石化	63,400	1,151,344.00	0.49
49	300316	晶盛机电	16,500	1,146,750.00	0.49
50	300122	智飞生物	9,200	1,146,320.00	0.49
51	600048	保利发展	71,100	1,111,293.00	0.47
52	601816	京沪高铁	226,500	1,093,995.00	0.47
53	600406	国电南瑞	27,200	1,088,816.00	0.46
54	601878	浙商证券	81,200	1,070,216.00	0.46
55	002044	美年健康	135,000	1,059,750.00	0.45
56	603486	科沃斯	6,945	1,048,347.75	0.45
57	601838	成都银行	86,700	1,040,400.00	0.44
58	603799	华友钴业	9,400	1,036,914.00	0.44
59	300347	泰格医药	8,100	1,035,180.00	0.44
60	002709	天赐材料	8,900	1,020,385.00	0.44
61	600183	生益科技	40,400	951,420.00	0.41
62	600585	海螺水泥	23,300	938,990.00	0.40
63	002271	东方雨虹	17,800	937,704.00	0.40
64	000002	万科A	47,400	936,624.00	0.40
65	002410	广联达	14,600	934,108.00	0.40
66	002230	科大讯飞	17,700	929,427.00	0.40
67	601021	春秋航空	16,000	908,800.00	0.39
68	000063	中兴通讯	26,900	901,150.00	0.38
69	603260	合盛硅业	6,500	857,805.00	0.37
70	002371	北方华创	2,400	832,848.00	0.36
71	001979	招商蛇口	62,000	827,080.00	0.35
72	300450	先导智能	11,100	825,507.00	0.35
73	000338	潍柴动力	45,700	817,573.00	0.35
74	000876	新希望	53,300	810,693.00	0.35
75	601390	中国中铁	136,400	789,756.00	0.34

76	601919	中远海控	42,210	788,904.90	0.34
77	600196	复星医药	15,600	763,464.00	0.33
78	601377	兴业证券	77,100	761,748.00	0.32
79	601696	中银证券	55,200	742,440.00	0.32
80	601088	中国神华	32,400	729,648.00	0.31
81	000166	申万宏源	140,600	719,872.00	0.31
82	601600	中国铝业	118,200	719,838.00	0.31
83	600584	长电科技	23,100	716,562.00	0.31
84	601916	浙商银行	202,200	707,700.00	0.30
85	603882	金域医学	6,100	679,357.00	0.29
86	002555	三七互娱	24,700	667,394.00	0.28
87	600660	福耀玻璃	14,000	659,960.00	0.28
88	601857	中国石油	133,900	657,449.00	0.28
89	603833	欧派家居	4,400	649,000.00	0.28
90	300015	爱尔眼科	14,600	617,288.00	0.26
91	300529	健帆生物	11,400	607,620.00	0.26
92	000651	格力电器	16,300	603,589.00	0.26
93	600489	中金黄金	73,200	602,436.00	0.26
94	601229	上海银行	82,900	591,077.00	0.25
95	600763	通策医疗	2,900	577,100.00	0.25
96	601877	正泰电器	10,700	576,623.00	0.25
97	603392	万泰生物	2,600	575,900.00	0.25
98	300408	三环集团	12,900	575,340.00	0.25
99	002736	国信证券	49,900	572,852.00	0.24
100	600176	中国巨石	30,959	563,453.80	0.24
101	601668	中国建筑	110,700	553,500.00	0.24
102	300601	康泰生物	5,600	551,824.00	0.24
103	603288	海天味业	5,097	535,745.67	0.23
104	688396	华润微	8,200	529,720.00	0.23
105	000938	紫光股份	22,900	523,265.00	0.22
106	000895	双汇发展	16,300	514,265.00	0.22



107	600079	人福医药	22,500	506,700.00	0.22
108	600958	东方证券	33,800	498,212.00	0.21
109	601688	华泰证券	27,900	495,504.00	0.21
110	002120	韵达股份	24,200	495,132.00	0.21
111	300595	欧普康视	8,400	481,908.00	0.21
112	688111	金山办公	1,800	477,000.00	0.20
113	002001	新和成	15,100	469,912.00	0.20
114	601225	陕西煤业	37,700	459,940.00	0.20
115	600018	上港集团	83,900	459,772.00	0.20
116	600426	华鲁恒升	14,600	456,980.00	0.19
117	002714	牧原股份	8,410	448,757.60	0.19
118	601995	中金公司	9,100	446,173.00	0.19
119	003816	中国广核	135,900	425,367.00	0.18
120	000425	徐工机械	70,800	424,092.00	0.18
121	688981	中芯国际	8,000	423,920.00	0.18
122	600050	中国联通	107,600	422,868.00	0.18
123	300274	阳光电源	2,700	393,660.00	0.17
124	300498	温氏股份	20,400	392,904.00	0.17
125	000625	长安汽车	25,500	387,345.00	0.17
126	600837	海通证券	31,400	384,964.00	0.16
127	600010	包钢股份	136,200	379,998.00	0.16
128	002304	洋河股份	2,300	378,879.00	0.16
129	002007	华兰生物	13,000	378,820.00	0.16
130	601155	新城控股	12,900	375,777.00	0.16
131	600019	宝钢股份	50,700	363,012.00	0.15
132	002600	领益智造	48,700	358,432.00	0.15
133	002064	华峰化学	33,300	347,652.00	0.15
134	601336	新华保险	8,801	342,182.88	0.15
135	000786	北新建材	9,200	329,636.00	0.14
136	300759	康龙化成	2,300	324,921.00	0.14
137	688012	中微公司	2,479	313,841.40	0.13

138	600115	中国东航	60,600	312,696.00	0.13
139	601066	中信建投	10,477	306,452.25	0.13
140	600383	金地集团	23,600	306,092.00	0.13
141	601985	中国核电	36,600	303,780.00	0.13
142	002252	上海莱士	40,300	274,846.00	0.12
143	688036	传音控股	1,739	272,849.10	0.12
144	600111	北方稀土	5,800	265,640.00	0.11
145	002157	正邦科技	26,600	256,956.00	0.11
146	002027	分众传媒	31,200	255,528.00	0.11
147	601989	中国重工	57,100	240,962.00	0.10
148	600436	片仔癀	550	240,432.50	0.10
149	603019	中科曙光	8,700	239,859.00	0.10
150	603806	福斯特	1,800	234,990.00	0.10
151	600104	上汽集团	11,100	228,993.00	0.10
152	002050	三花智控	8,800	222,640.00	0.09
153	603338	浙江鼎力	2,700	216,702.00	0.09
154	600741	华域汽车	7,500	212,250.00	0.09
155	002202	金风科技	12,600	207,522.00	0.09
156	603939	益丰药房	3,300	181,863.00	0.08
157	603658	安图生物	3,300	181,698.00	0.08
158	600848	上海临港	12,100	179,927.00	0.08
159	601990	南京证券	17,600	174,416.00	0.07
160	601998	中信银行	37,100	171,402.00	0.07
161	601138	工业富联	14,000	166,880.00	0.07
162	688169	石头科技	200	162,600.00	0.07
163	300896	爱美客	300	160,833.00	0.07
164	000800	一汽解放	15,400	158,466.00	0.07
165	002841	视源股份	1,900	154,660.00	0.07
166	002311	海大集团	2,100	153,930.00	0.07
167	601669	中国电建	17,200	138,976.00	0.06
168	600085	同仁堂	3,000	134,940.00	0.06

169	002602	世纪华通	16,000	134,240.00	0.06
170	603087	甘李药业	1,900	133,646.00	0.06
171	603659	璞泰来	800	128,488.00	0.05
172	600872	中炬高新	3,300	125,301.00	0.05
173	601881	中国银河	10,600	118,614.00	0.05
174	601186	中国铁建	14,700	114,660.00	0.05
175	300142	沃森生物	2,000	112,400.00	0.05
176	600919	江苏银行	19,080	111,236.40	0.05
177	300014	亿纬锂能	900	106,362.00	0.05
178	300866	安克创新	1,000	102,500.00	0.04
179	601009	南京银行	11,400	102,144.00	0.04
180	000157	中联重科	13,400	96,078.00	0.04
181	601618	中国中冶	24,700	94,601.00	0.04
182	688363	华熙生物	600	93,180.00	0.04
183	601100	恒立液压	1,100	89,980.00	0.04
184	002352	顺丰控股	1,300	89,596.00	0.04
185	601236	红塔证券	7,300	87,016.00	0.04
186	600016	民生银行	22,000	85,800.00	0.04
187	600332	白云山	2,200	75,240.00	0.03
188	600570	恒生电子	1,200	74,580.00	0.03
189	300413	芒果超媒	1,300	74,386.00	0.03
190	000069	华侨城 A	10,500	73,920.00	0.03
191	601006	大秦铁路	11,100	71,040.00	0.03
192	600999	招商证券	4,000	70,600.00	0.03
193	600009	上海机场	1,500	70,035.00	0.03
194	601898	中煤能源	11,000	69,190.00	0.03
195	601939	建设银行	11,300	66,218.00	0.03
196	601628	中国人寿	2,200	66,198.00	0.03
197	601231	环旭电子	4,100	65,846.00	0.03
198	002459	晶澳科技	700	64,890.00	0.03
199	000963	华东医药	1,600	64,320.00	0.03

200	603993	洛阳钼业	11,500	64,170.00	0.03
201	000100	TCL科技	10,200	62,934.00	0.03
202	002024	苏宁易购	15,100	62,212.00	0.03
203	002624	完美世界	3,000	60,930.00	0.03
204	600547	山东黄金	3,200	60,224.00	0.03
205	000977	浪潮信息	1,600	57,328.00	0.02
206	600893	航发动力	900	57,114.00	0.02
207	601633	长城汽车	900	43,686.00	0.02
208	002821	凯莱英	100	43,500.00	0.02
209	603899	晨光文具	600	38,706.00	0.02
210	000066	中国长城	2,600	36,816.00	0.02
211	600845	宝信软件	500	30,415.00	0.01
212	601328	交通银行	6,500	29,965.00	0.01
213	601865	福莱特	500	28,970.00	0.01
214	601808	中海油服	1,800	27,000.00	0.01
215	000708	中信特钢	1,300	26,624.00	0.01
216	601319	中国人保	5,600	26,320.00	0.01
217	601216	君正集团	4,700	24,581.00	0.01
218	601211	国泰君安	1,200	21,468.00	0.01
219	000776	广发证券	800	19,672.00	0.01
220	600132	重庆啤酒	100	15,132.00	0.01
221	600362	江西铜业	200	4,466.00	0.00
222	600109	国金证券	300	3,399.00	0.00
223	601238	广汽集团	39	592.41	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	600201	生物股份	62,200	1,016,970.00	0.43
2	000733	振华科技	6,500	807,820.00	0.34

3	603915	国茂股份	18,100	704,090.00	0.30
4	002508	老板电器	17,600	633,952.00	0.27
5	603444	吉比特	1,400	590,590.00	0.25
6	601000	唐山港	214,100	588,775.00	0.25
7	600377	宁沪高速	66,300	571,506.00	0.24
8	600315	上海家化	13,900	561,699.00	0.24
9	600779	水井坊	4,600	551,954.00	0.24
10	603305	旭升股份	10,300	513,764.00	0.22
11	002867	周大生	28,100	499,618.00	0.21
12	603277	银都股份	26,100	482,850.00	0.21
13	603613	国联股份	4,400	473,000.00	0.20
14	002273	水晶光电	27,100	471,269.00	0.20
15	603039	泛微网络	6,600	460,482.00	0.20
16	000636	风华高科	14,900	444,020.00	0.19
17	603588	高能环境	22,600	397,082.00	0.17
18	601128	常熟银行	58,100	384,041.00	0.16
19	300674	宇信科技	15,300	365,670.00	0.16
20	688187	时代电气	4,741	363,397.65	0.15
21	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.15
22	000799	酒鬼酒	1,700	361,250.00	0.15
23	600138	中青旅	34,500	358,110.00	0.15
24	600674	川投能源	27,600	345,000.00	0.15
25	002833	弘亚数控	10,400	334,672.00	0.14
26	002648	卫星化学	8,200	328,246.00	0.14
27	002254	泰和新材	16,500	323,565.00	0.14
28	002396	星网锐捷	13,000	306,410.00	0.13
29	688778	厦钨新能	3,018	304,033.32	0.13
30	002677	浙江美大	16,100	279,335.00	0.12
31	002436	兴森科技	19,100	267,400.00	0.11
32	601827	三峰环境	29,100	259,572.00	0.11
33	600323	瀚蓝环境	11,000	230,780.00	0.10

34	600116	三峡水利	19,600	228,536.00	0.10
35	688366	昊海生科	1,792	225,594.88	0.10
36	601615	明阳智能	8,600	224,460.00	0.10
37	000656	金科股份	49,100	219,968.00	0.09
38	600511	国药股份	6,800	214,404.00	0.09
39	002541	鸿路钢构	3,700	198,098.00	0.08
40	002156	通富微电	10,100	196,243.00	0.08
41	601689	拓普集团	3,700	196,100.00	0.08
42	000988	华工科技	7,000	195,020.00	0.08
43	600066	宇通客车	17,500	192,850.00	0.08
44	603678	火炬电子	2,500	189,125.00	0.08
45	688180	君实生物	2,800	187,544.00	0.08
46	002262	恩华药业	10,400	162,760.00	0.07
47	002332	仙琚制药	11,300	149,160.00	0.06
48	300775	三角防务	3,000	146,670.00	0.06
49	605358	立昂微	1,200	144,012.00	0.06
50	002185	华天科技	11,300	143,623.00	0.06
51	300747	锐科激光	2,400	141,864.00	0.06
52	601139	深圳燃气	15,800	139,514.00	0.06
53	603686	龙马环卫	9,500	136,420.00	0.06
54	601555	东吴证券	15,060	133,431.60	0.06
55	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.05
56	600966	博汇纸业	12,300	127,182.00	0.05
57	002507	涪陵榨菜	3,300	124,740.00	0.05
58	300009	安科生物	9,400	123,046.00	0.05
59	603298	杭叉集团	6,900	118,335.00	0.05
60	600507	方大特钢	15,100	117,780.00	0.05
61	300363	博腾股份	1,300	116,285.00	0.05
62	300623	捷捷微电	3,600	113,256.00	0.05
63	600885	宏发股份	1,500	111,960.00	0.05
64	002153	石基信息	3,800	109,212.00	0.05

65	600460	士兰微	2,000	108,400.00	0.05
66	300661	圣邦股份	350	108,150.00	0.05
67	688110	东芯股份	2,622	105,850.14	0.05
68	002206	海利得	11,800	104,784.00	0.04
69	688167	炬光科技	575	101,585.25	0.04
70	002299	圣农发展	4,200	101,514.00	0.04
71	603712	七一二	2,300	99,590.00	0.04
72	002353	杰瑞股份	2,300	92,000.00	0.04
73	603868	飞科电器	2,000	86,840.00	0.04
74	300737	科顺股份	5,300	86,125.00	0.04
75	688262	国芯科技	2,003	84,085.94	0.04
76	603456	九洲药业	1,400	78,764.00	0.03
77	301136	招标股份	7,096	74,649.92	0.03
78	603027	千禾味业	2,900	69,832.00	0.03
79	300763	锦浪科技	300	69,465.00	0.03
80	603713	密尔克卫	500	67,390.00	0.03
81	603565	中谷物流	2,200	62,458.00	0.03
82	300088	长信科技	4,500	59,760.00	0.03
83	000932	华菱钢铁	11,400	58,254.00	0.02
84	300037	新宙邦	500	56,500.00	0.02
85	002597	金禾实业	1,100	56,485.00	0.02
86	002408	齐翔腾达	5,100	53,550.00	0.02
87	000961	中南建设	12,100	50,094.00	0.02
88	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.02
89	603848	好太太	3,400	47,090.00	0.02
90	603043	广州酒家	1,900	45,714.00	0.02
91	002139	拓邦股份	2,400	44,856.00	0.02
92	600933	爱柯迪	2,300	44,344.00	0.02
93	002402	和而泰	1,600	43,888.00	0.02
94	688029	南微医学	200	42,534.00	0.02
95	002831	裕同科技	1,200	40,428.00	0.02

96	603707	健友股份	900	37,800.00	0.02
97	600803	新奥股份	1,900	34,884.00	0.01
98	603919	金徽酒	900	34,749.00	0.01
99	301050	雷电微力	140	32,863.60	0.01
100	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.01
101	300146	汤臣倍健	1,100	29,656.00	0.01
102	600754	锦江酒店	500	29,300.00	0.01
103	003022	联泓新科	800	29,152.00	0.01
104	002180	纳思达	600	28,656.00	0.01
105	002701	奥瑞金	3,800	26,600.00	0.01
106	300832	新产业	600	26,430.00	0.01
107	600258	首旅酒店	1,000	26,130.00	0.01
108	300251	光线传媒	2,000	25,700.00	0.01
109	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
110	002511	中顺洁柔	1,500	25,065.00	0.01
111	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
112	300768	迪普科技	600	24,750.00	0.01
113	002557	洽洽食品	400	24,544.00	0.01
114	002444	巨星科技	800	24,408.00	0.01
115	000513	丽珠集团	600	24,126.00	0.01
116	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
117	603816	顾家家居	300	23,148.00	0.01
118	301035	润丰股份	395	22,230.60	0.01
119	603605	珀莱雅	100	20,831.00	0.01
120	002925	盈趣科技	600	20,418.00	0.01
121	301155	海力风电	211	20,414.25	0.01
122	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
123	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
124	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
125	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
126	300474	景嘉微	100	15,220.00	0.01



127	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
128	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.01
129	301149	隆华新材	873	14,631.48	0.01
130	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
131	301127	天源环保	828	14,175.36	0.01
132	603589	口子窖	200	14,174.00	0.01
133	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
134	301211	亨迪药业	387	13,022.55	0.01
135	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
136	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
137	301118	恒光股份	255	12,500.10	0.01
138	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
139	301101	明月镜片	274	11,880.64	0.01
140	301177	迪阿股份	99	11,491.92	0.00
141	301126	达嘉维康	592	11,384.16	0.00
142	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
143	301087	可孚医疗	144	10,848.96	0.00
144	301138	华研精机	225	10,093.50	0.00
145	301090	华润材料	883	9,907.26	0.00
146	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
147	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
148	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
149	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
150	301189	奥尼电子	160	9,059.20	0.00
151	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
152	301168	通灵股份	168	8,757.84	0.00
153	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
154	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
155	301100	风光股份	262	8,158.68	0.00
156	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
157	301093	华兰股份	156	7,776.60	0.00

158	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
159	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
160	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
161	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
162	301182	凯旺科技	238	7,278.04	0.00
163	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
164	301193	家联科技	241	7,022.74	0.00
165	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
166	301199	迈赫股份	212	6,784.00	0.00
167	301179	泽宇智能	131	6,650.87	0.00
168	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
169	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
170	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
171	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
172	301190	善水科技	227	6,233.42	0.00
173	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
174	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
175	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
176	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
177	301088	戎美股份	239	5,896.13	0.00
178	301092	争光股份	162	5,754.24	0.00
179	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
180	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
181	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
182	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
183	301096	百诚医药	68	5,340.04	0.00
184	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
185	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
186	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
187	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
188	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00

189	301108	洁雅股份	84	4,511.64	0.00
190	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
191	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
192	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
193	603568	伟明环保	100	3,653.00	0.00
194	600862	中航高科	100	3,576.00	0.00
195	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
196	603218	日月股份	100	3,295.00	0.00
197	603877	太平鸟	100	2,788.00	0.00
198	600998	九州通	2	29.44	0.00
199	600483	福能股份	1	16.28	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	600036	招商银行	21,219,738.00	4.77
2	600030	中信证券	18,681,088.00	4.20
3	601211	国泰君安	16,186,359.77	3.64
4	002142	宁波银行	14,425,630.96	3.24
5	300059	东方财富	14,036,241.80	3.15
6	300750	宁德时代	13,559,707.00	3.05
7	603259	药明康德	13,413,597.64	3.01
8	601988	中国银行	13,007,126.00	2.92
9	601318	中国平安	12,855,713.00	2.89
10	600519	贵州茅台	12,727,708.01	2.86
11	601117	中国化学	12,442,555.00	2.80
12	000651	格力电器	12,194,359.00	2.74
13	600276	恒瑞医药	12,027,228.40	2.70
14	601398	工商银行	11,961,281.00	2.69

15	603986	兆易创新	11,851,913.40	2.66
16	600048	保利发展	11,612,019.55	2.61
17	600919	江苏银行	11,593,190.98	2.61
18	000001	平安银行	11,574,547.00	2.60
19	601658	邮储银行	11,483,453.00	2.58
20	601166	兴业银行	11,033,617.00	2.48
21	000725	京东方 A	10,911,628.00	2.45
22	600690	海尔智家	10,748,139.31	2.42
23	000002	万 科 A	10,510,769.00	2.36
24	600309	万华化学	10,475,955.90	2.35
25	601377	兴业证券	10,044,566.00	2.26
26	600887	伊利股份	9,535,120.00	2.14
27	300033	同花顺	9,392,547.20	2.11
28	600585	海螺水泥	9,363,248.00	2.10
29	601288	农业银行	8,939,686.00	2.01

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	600036	招商银行	35,715,069.50	8.03
2	601318	中国平安	25,459,794.32	5.72
3	601211	国泰君安	24,226,061.40	5.44
4	000858	五 粮 液	20,446,701.50	4.60
5	000001	平安银行	20,286,112.67	4.56
6	000333	美的集团	18,377,801.37	4.13
7	300059	东方财富	18,370,998.02	4.13
8	600276	恒瑞医药	14,702,008.52	3.30
9	601117	中国化学	14,504,638.00	3.26
10	600900	长江电力	13,990,694.01	3.14

11	601658	邮储银行	13,903,854.00	3.12
12	600519	贵州茅台	13,844,277.00	3.11
13	600030	中信证券	13,016,830.00	2.93
14	002142	宁波银行	12,894,347.58	2.90
15	600919	江苏银行	12,537,616.00	2.82
16	601988	中国银行	12,449,795.00	2.80
17	603259	药明康德	12,255,560.58	2.75
18	000725	京东方 A	12,090,716.37	2.72
19	000568	泸州老窖	11,992,508.00	2.70
20	600887	伊利股份	11,871,845.98	2.67
21	601377	兴业证券	11,692,994.00	2.63
22	603501	韦尔股份	11,673,954.00	2.62
23	601225	陕西煤业	11,230,269.38	2.52
24	603986	兆易创新	11,228,779.80	2.52
25	002241	歌尔股份	10,772,113.42	2.42
26	600309	万华化学	10,674,313.00	2.40
27	002415	海康威视	10,672,333.00	2.40
28	002475	立讯精密	10,542,999.00	2.37
29	300033	同花顺	10,490,804.25	2.36
30	601668	中国建筑	10,472,033.00	2.35
31	601288	农业银行	10,470,597.00	2.35
32	002714	牧原股份	9,993,474.20	2.25
33	600690	海尔智家	9,963,432.00	2.24
34	600048	保利发展	9,940,377.00	2.23
35	000651	格力电器	9,864,721.06	2.22
36	601012	隆基股份	9,624,265.80	2.16
37	601888	中国中免	9,608,942.00	2.16
38	000166	申万宏源	9,322,881.80	2.10
39	601398	工商银行	9,225,392.00	2.07
40	001979	招商蛇口	9,086,245.00	2.04
41	601166	兴业银行	9,074,780.00	2.04

42	300015	爱尔眼科	8,999,140.16	2.02
----	--------	------	--------------	------

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	1,407,575,376.20
卖出股票收入（成交）总额	1,605,573,540.29

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)	177,688.30	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	177,688.30	0.08

#### 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	113052	兴业转债	1,430	143,000.00	0.06
2	113635	升21转债	220	30,800.00	0.01
3	113633	科沃转债	30	3,888.30	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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					87,919.22
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。

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

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

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

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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，多次收到中国银行保险监督管理委员会及中国人民银行公开处罚处分决定。

关于投资决策的说明：

以上证券是沪深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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,581.70
5	应收申购款	340,440.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	346,022.50

### 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
中泰沪深300指数增强A	5,497	7,065.70	297,697.73	0.77%	38,542,474.69	99.23%
中泰沪深300指数增强C	5,291	21,241.48	77,948,299.35	69.36%	34,440,351.20	30.64%
合计	10,788	14,018.24	78,245,997.08	51.74%	72,982,825.89	48.26%

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

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中泰沪深300指数增强A	882,618.03	2.2724%
	中泰沪深300指数增强C	1,009.54	0.0009%
	合计	883,627.57	0.5843%

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。

## § 10 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	40,748,887.63	110,761,036.27
减：本报告期基金总赎回份额	100,009,002.91	192,173,403.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,840,172.42	112,388,650.55

## § 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60,000.00元。

目前事务所已提供审计服务的连续年限：自2020年4月1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	
光大证券	2	2,996,248,194.22	100.00%	668,392.93	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
光大证券	732,431.47	100.00%	107,000,000.00	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	中国证券报、中国证监会	2021-04-07

	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	会规定网站	
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招募说明书（更新）2021年第1号	中国证监会规定网站	2021-04-16
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基金合同	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产品资料概要更新	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	2021-06-15
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
20	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	中国证券报、中国证监会规定网站	2021-07-12
21	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	2021-07-13
22	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2021年第2季度报告	中国证监会规定网站	2021-07-20
23	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	中国证券报、中国证监会规定网站	2021-07-22
24	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	中国证券报、中国证监会规定网站	2021-08-09
25	中泰沪深300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
26	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	2021-09-07

27	中泰沪深300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
28	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	2021-11-04

## § 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2月26日至2021年5月27日、2021年5月31日至2021年12月31日	45,004,500.45	0.00	0.00	45,004,500.45	29.76%

#### 产品特有风险

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：

- (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。
- (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。
- (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。
- (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) 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。

### 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