

# 中泰沪深 300 指数量化优选增强型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。本中期报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	47
7.1	期末基金资产组合情况	47
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	50
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12	投资组合报告附注	65
§ 8	基金份额持有人信息	66
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67

§ 9	开放式基金份额变动 .....	67
§ 10	重大事件揭示 .....	67
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	68
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	68
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
10.4	基金投资策略的改变 .....	68
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
10.8	其他重大事件 .....	69
§ 11	备查文件目录 .....	71
11.1	备查文件目录 .....	71
11.2	存放地点 .....	72
11.3	查阅方式 .....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金	
基金简称	中泰沪深300量化优选增强	
基金主代码	012206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年07月05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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,528,282.07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量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C
下属分级基金的交易代码	012206	012207
报告期末下属分级基金的份额总额	69,704,552.27份	45,823,729.80份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深300指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为增强型指数基金，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	本基金业绩比较基准=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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	张燕
	联系电话	021-20521199	0755-83199084
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-821-0808	95555
传真		021-50933716	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号24楼05室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		黄文卿	缪建民

### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中泰证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中泰沪深300量化 优选增强A	中泰沪深300量化 优选增强C
本期已实现收益	-6,938,665.36	-4,962,842.24
本期利润	-4,143,306.05	-4,420,096.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0577	-0.0850
本期加权平均净值利润率	-6.56%	-9.64%
本期基金份额净值增长率	-5.58%	-5.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	-8,838,938.04	-5,964,159.94
期末可供分配基金份额利润	-0.1268	-0.1302
期末基金资产净值	64,483,967.44	42,224,340.99
期末基金份额净值	0.9251	0.9215
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-7.49%	-7.85%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中泰沪深300量化优选增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	9.70%	0.98%	9.12%	1.02%	0.58%	-0.04%
过去三个月	7.39%	1.32%	5.93%	1.36%	1.46%	-0.04%
过去六个月	-5.58%	1.33%	-8.72%	1.38%	3.14%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	-7.49%	1.15%	-11.09%	1.18%	3.60%	-0.03%

## 中泰沪深300量化优选增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	9.68%	0.98%	9.12%	1.02%	0.56%	-0.04%
过去三个月	7.29%	1.32%	5.93%	1.36%	1.36%	-0.04%
过去六个月	-5.77%	1.33%	-8.72%	1.38%	2.95%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	-7.85%	1.15%	-11.09%	1.18%	3.24%	-0.03%

### 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量化优选增强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  
(2021年07月05日-2022年06月30日)



注：

- (1) 本基金基金合同生效日期为 2021 年 7 月 5 日，至本报告期末本基金成立未满 1 年。
- (2) 根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

中泰沪深300量化优选增强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  
(2021年07月05日-2022年06月30日)



注：

- (1) 本基金基金合同生效日期为 2021 年 7 月 5 日，至本报告期末本基金成立未满 1 年。
- (2) 根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2022年6月30日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有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、中泰安睿债券型证券投资基金、中泰安益利率债债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰兴为价值精选混合型证券投资基金、中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金共十八只证券投资基金。

#### 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；中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理。	2021-07-05	-	9	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。
李玉刚	本基金基金经理；中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理；研究部总经理。	2022-01-04	-	20	国籍：中国。学历：北京大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所、新产品部和衍生产品部研究员、资产管理总部研究员；上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理。2014年11月加入中泰证券（上海）资产管理

					有限公司担任对冲基金部总经理，现任公司研究部总经理。2022年1月4日起至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金和中泰沪深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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

事中监控通过执行集中交易制度，将投资管理与交易执行相分离，交易由交易部集中执行。交易部以公平交易为原则，保证投资组合的交易得到公平、及时、准确、高效地执行，确保不同产品享有公平的交易执行机会；对不同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 异常交易行为的专项说明

异常交易，是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理产品买卖法规、产品管理合同、交易制度等限制投资对象的交易均认定为交易对象异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在收盘前15分钟的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过15%，则认定为交易时间异常型异常交易。产品在连续竞价阶段委托价格超过最新价格的3%，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在交易当日的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过30%，即作为交易数量异常型异常交易。内幕交易，频繁申报与撤单，不能列示有充分投资研究成果支持的交易，以及投资管理人员受他人干预，未能就投资、交易等事项做出客观、公正的独立判断与决策的交易，均作为交易理由异常型异常交易。

风险管理部通过系统或人工手段，监控各产品的异常交易，如果发现某笔交易符合异常交易界定标准，将其列为异常交易，并建立异常交易档案，系统记录异常交易发生

的时间、具体交易情况及认定人和认定依据，对于风险管理部识别出的异常交易，要求投资经理进行合理解释，并提交书面说明至风险管理部备案。

本报告期内，未发生异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年上半年，新冠疫情及防控行为对经济活动带来显著的不利影响，沪深300指数期初4940点，下跌23%到最低3784点，而后随着疫情防控形势有所好转，半年末上升到4485点。指数年化波动率22%。从中证指数细分行业的表现来看，上半年只有能源及地产行业取得上涨，其余行业都出现下跌。通信与信息技术业跌幅最大。

上半年来，本基金的策略未进行大的调整。从基金的实际表现上看，上半年本基金获得了一定的超额收益。相对于业绩基准的跟踪误差为年化1.69%，控制在较低的水平。我们将依旧坚持既有的价值投资逻辑来优化持仓，并根据不同统计量化指标严格约束跟踪误差，力求在以后的投资中为投资者获得跟踪误差可控前提下的投资收益。

##### 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量化优选增强A基金份额净值为0.9251元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.58%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%；截至报告期末中泰沪深300量化优选增强C基金份额净值为0.9215元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.77%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年，应该说全球经济依然面临不少的不确定性因素的挑战，新冠疫情及应对措施、俄乌战争、中美冲突等都在各方面影响全球宏观经济的发展及投资者的预期，对于中国国内经济而言，已近2年的新冠疫情防控我们认为依然是最大的不确定性变量。但随着国家防控方式的不断优化，我们相信明年对经济的影响有望告一段落。

近期地产行业陷入困境，但我们相信不会产生系统性的风险。

过去两年商品市场出现大幅的价格暴涨，随着经济活动的恢复，我们相信这个现象不会长期持续，预期明年的商品价格会逐步回归正常。

对于证券市场而言，由于经济增长整体放缓，存量博弈之下，经济增长的方式逐渐转向质量驱动也是大势所趋，目前沪深300指数PE的上升从一个侧面反映出这种变化，原因就在于指数中银行地产等行业所占的权重逐步下降，而可选消费与科技行业的权重在逐渐加大。因此，我们并不认为经济增长的放缓必然带来投资机会的消失，相反，我们认为中国经济转型过程依然充满投资机会，只是需要更理性思考与把握机会的能力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金管理人设立了估值委员会，由公司总经理、主管基金运营的公司高管、合规负责人及投资管理、风险管理、基金运营等方面的专业人员担任委员。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，形成估值委员会决议。运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,714,292.10	14,897,374.49
结算备付金		990,173.60	982,354.16
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	98,322,025.80	121,053,475.30
其中：股票投资		98,314,025.20	120,780,683.10
基金投资		-	-
债券投资		8,000.60	272,792.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		23,862.44	15,135.92
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	4,439.44
资产总计		107,050,353.94	136,952,779.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		82,730.30	6,283,580.92
应付管理人报酬		84,034.91	149,627.36
应付托管费		12,605.25	22,444.11
应付销售服务费		13,270.58	23,538.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	149,404.47	120,399.57
负债合计		342,045.51	6,599,590.07
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.6	115,528,282.07	133,161,152.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-8,819,973.64	-2,807,963.13
净资产合计		106,708,308.43	130,353,189.24
负债和净资产总计		107,050,353.94	136,952,779.31

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额115,528,282.07份，其中A类份额69,704,552.27份，C类份额45,823,729.80份。A类份额净值0.9251元，C类份额净值0.9215元。

## 6.2 利润表

会计主体：中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-7,756,448.64
1. 利息收入		30,467.09
其中：存款利息收入	6.4.7.8	29,413.40
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,053.69
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,128,259.64
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-12,116,272.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	70,443.78
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.11	-
股利收益	6.4.7.12	917,569.24
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	3,338,105.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	3,238.48
<b>减：二、营业总支出</b>		806,953.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	542,213.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,332.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	91,372.34
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		3.81
8. 其他费用	6.4.7.15	92,032.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,563,402.17
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,563,402.17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-8,563,402.17

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	133,161,152.37	-	-2,807,963.13	130,353,189.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	133,161,152.37	-	-2,807,963.13	130,353,189.24
三、本期增减变动额	-17,632,870.30	-	-6,012,010.51	-23,644,880.81

(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-8,563,402.17	-8,563,402.17
(二)、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)	-17,632,870.30	-	2,551,391.66	-15,081,478.64
其中: 1. 基金申购款	4,509,829.62	-	-527,164.21	3,982,665.41
2. 基金赎回款	-22,142,699.92	-	3,078,555.87	-19,064,144.05
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	115,528,282.07	-	-8,819,973.64	106,708,308.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中泰沪深300指数量化优选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[2021]1210号《关于准予中泰沪深300指数量化优选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指数量化优选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269,924,175.01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(2021)第0635号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》于2021年7月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为269,953,304.05份,其中认购资金利息折合29,129.04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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》和《中泰沪深300指数量化优选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指数量化优选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）、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权（含股指期货）等）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票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、国债期货、股票期权（含股指期货）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、存出保证金和应收申购款等。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8月29日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年上半年度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2022年6月30日的财务状况以及2022年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或资产支持证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。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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和资产支持证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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息和应收申购款，金额分别为14,897,374.49元、982,354.16元、4,439.44元和15,135.92元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、其他资产

-应收利息和应收申购款，金额分别为14,900,478.52元、983,681.18元、0.00元和15,135.92元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为121,053,475.30元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为121,053,483.69元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为6,283,580.92元、149,627.36元、22,444.11元、23,538.11元和399.57元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为6,283,580.92元、149,627.36元、22,444.11元、23,538.11元和399.57元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机

构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	1,367,758.75
等于：本金	1,367,579.70
加：应计利息	179.05
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	6,346,533.35
等于：本金	6,345,061.99
加：应计利息	1,471.36
减：坏账准备	-
合计	7,714,292.10

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	96,144,785.90	-	98,314,025.20	2,169,239.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	0.60	8,000.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,000.00	0.60	8,000.60
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	96,152,785.90	0.60	98,322,025.80	2,169,239.30

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债****6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	144.32
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	149,404.47

**6.4.7.6 实收基金****6.4.7.6.1 中泰沪深300量化优选增强A**

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	73,246,825.79	73,246,825.79
本期申购	3,162,178.54	3,162,178.54

本期赎回（以“-”号填列）	-6,704,452.06	-6,704,452.06
本期末	69,704,552.27	69,704,552.27

## 6.4.7.6.2 中泰沪深300量化优选增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,914,326.58	59,914,326.58
本期申购	1,347,651.08	1,347,651.08
本期赎回（以“-”号填列）	-15,438,247.86	-15,438,247.86
本期末	45,823,729.80	45,823,729.80

## 6.4.7.7 未分配利润

## 6.4.7.7.1 中泰沪深300量化优选增强A

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-2,220,638.77	739,381.64	-1,481,257.13
本期利润	-6,938,665.36	2,795,359.31	-4,143,306.05
本期基金份额交易产生的变动数	320,366.09	83,612.26	403,978.35
其中：基金申购款	-225,662.90	-145,109.75	-370,772.65
基金赎回款	546,028.99	228,722.01	774,751.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,838,938.04	3,618,353.21	-5,220,584.83

## 6.4.7.7.2 中泰沪深300量化优选增强C

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-------------------	-------	-------	---------

选增强C)			
本期期初	-1,929,149.66	602,443.66	-1,326,706.00
本期利润	-4,962,842.24	542,746.12	-4,420,096.12
本期基金份额交易产生的变动数	927,831.96	1,219,581.35	2,147,413.31
其中：基金申购款	-88,306.06	-68,085.50	-156,391.56
基金赎回款	1,016,138.02	1,287,666.85	2,303,804.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,964,159.94	2,364,771.13	-3,599,388.81

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	3,497.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	19,423.23
结算备付金利息收入	6,492.42
其他	-
合计	29,413.40

#### 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	167,317,006.93
减：卖出股票成本总额	179,162,719.86
减：交易费用	270,559.73
买卖股票差价收入	-12,116,272.66

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	35.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	70,408.76
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	70,443.78

## 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	466,465.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	396,000.00
减：应计利息总额	43.04
减：交易费用	13.90
买卖债券差价收入	70,408.76

## 6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	917,569.24

基金投资产生的股利收益	-
合计	917,569.24

## 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	3,338,105.43
——股票投资	3,345,897.63
——债券投资	-7,792.20
——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	3,338,105.43

## 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	3,238.48
合计	3,238.48

## 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日

审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	2,771.92
合计	92,032.07

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“中泰资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例

中泰证券	318,889,788.36	100.00%
------	----------------	---------

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
中泰证券	466,465.70	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中泰证券	1,500,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	71,852.35	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。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	542,213.31
其中：支付销售机构的客户维护费	157,745.60

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1.00%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X1.00%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,332.00

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.15%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	2,857.40	2,857.40
中泰证券股份有限公司	0.00	62,125.92	62,125.92

中泰证券 (上海)资 产管理有 限公司	0.00	24,815.23	24,815.23
合计	0.00	89,798.55	89,798.55

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%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰证券（上海）资产管理有限公司，再由中泰证券（上海）资产管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,367,758.75	3,497.75
中泰证券	6,346,533.35	19,423.23

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	创业板打新限售	15.64	20.38	284	4,441.76	5,787.92	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	创业板打新限售	55.57	30.03	98	5,445.86	2,942.94	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板打新限售	37.23	25.39	102	3,797.46	2,589.78	-
301196	唯科技	2022-01-04	6个月	创业板打新限售	64.08	37.52	52	3,332.16	1,951.04	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙22转债	2022-06-14	18个交易日	新债未上市	100.00	100.01	80	8,000.00	8,000.60	-

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

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

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

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

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

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

事后控制流程包括：在风险处理措施实施以后，风险管理部实时监控处理效果并提出阶段性总结报告，进一步提出改善整体和局部风险管理的建议。此外，对本基金资产的投资组合风险状况进行定期或不定期分析和总结，定期或不定期编写风险管理报告提交风险控制委员会和专业投资委员会及投资决策委员会。风险管理部应根据市场环境的变化对投资组合的风险进行情景分析或模拟分析，在估计可能产生重大风险隐患时，及时通报专业投资委员会和投资决策委员会，并提出降低风险的建议。当市场环境的变化

导致风险控制模型的适用性降低时，风险管理部应及时对所使用的风险控制模型进行重新检验和修正，包括但不限于压力测试、敏感性分析等。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

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

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

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

## 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	8,000.60	245,000.00
AAA以下	-	27,792.20
未评级	-	-
合计	8,000.60	272,792.20

## 6.4.13.3 流动性风险

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

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

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

## 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年06月3	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

0 日							
资产							
银行存款	7,714,292.10	-	-	-	-	-	7,714,292.10
结算备付金	990,173.60	-	-	-	-	-	990,173.60
交易性金融资产	-	-	-	-	8,000.60	98,314,025.20	98,322,025.80
应收申购款	-	-	-	-	-	23,862.44	23,862.44
资产总计	8,704,465.70	-	-	-	8,000.60	98,337,887.64	107,050,353.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	82,730.30	82,730.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	84,034.91	84,034.91
应付托管费	-	-	-	-	-	12,605.25	12,605.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,270.58	13,270.58
其他负债	-	-	-	-	-	149,404.47	149,404.47
负债总计	-	-	-	-	-	342,045.51	342,045.51
利率敏感度缺口	8,704,465.70	-	-	-	8,000.60	97,995,842.13	106,708,308.43
上年度末 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	14,897,374.49	-	-	-	-	-	14,897,374.49
结算备付金	982,354.16	-	-	-	-	-	982,354.16
交易性金融资产	-	-	-	-	272,792.20	120,780,683.10	121,053,475.30
应收利息	-	-	-	-	-	4,439.44	4,439.44
应收申购款	-	-	-	-	-	15,135.92	15,135.92
资产总计	15,879,728.65	-	-	-	272,792.20	120,800,258.46	136,952,779.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,283,580.92	6,283,580.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	149,627.36	149,627.36
应付托管费	-	-	-	-	-	22,444.11	22,444.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,538.11	23,538.11
其他负债	-	-	-	-	-	120,399.57	120,399.57
负债总计	-	-	-	-	-	6,599,590.07	6,599,590.07
利率敏感度缺口	15,879,728.65	-	-	-	272,792.20	114,200,668.39	130,353,189.24

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金和应收申购款等。

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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	98,314,025.20	92.13	120,780,683.10	92.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产	8,000.60	0.01	272,792.20	0.21

产—债券投资				
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	98,322,025.80	92.14	121,053,475.30	92.87

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假设基金的市场价格风险主要源于系统性风险，公司采用beta系数来衡量股票投资的系统性风险，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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	比较基准上升5%	5,052,117.50	6,310,275.34
	比较基准下降5%	-5,052,117.50	-6,310,275.34

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	98,300,753.52	119,955,022.05
第二层次	8,000.60	374,052.97
第三层次	13,271.68	724,400.28
合计	98,322,025.80	121,053,475.30

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021年12月31日：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	98,314,025.20	91.84
	其中：股票	98,314,025.20	91.84

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,000.60	0.01
	其中：债券	8,000.60	0.01
	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	8,704,465.70	8.13
8	其他各项资产	23,862.44	0.02
9	合计	107,050,353.94	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,323,135.00	1.24
B	采矿业	3,052,329.00	2.86
C	制造业	54,799,613.57	51.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,407,658.00	2.26
E	建筑业	2,021,467.00	1.89
F	批发和零售业	32,632.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,165,706.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,558,803.00	2.40
J	金融业	19,773,559.02	18.53
K	房地产业	1,126,051.00	1.06
L	租赁和商务服务业	946,901.00	0.89

M	科学研究和技术服务业	1,051,562.80	0.99
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	10,422.00	0.01
Q	卫生和社会工作	934,969.00	0.88
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,204,808.39	86.41

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,928,298.81	3.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,436.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	758,060.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	83,349.24	0.08
H	住宿和餐饮业	201,280.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	160,072.00	0.15
J	金融业	511,299.36	0.48
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	70,698.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	37,208.40	0.03
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	351,515.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	6,109,216.81	5.73

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,300	6,748,500.00	6.32
2	300750	宁德时代	6,700	3,577,800.00	3.35
3	601318	中国平安	54,000	2,521,260.00	2.36
4	002142	宁波银行	62,500	2,238,125.00	2.10
5	601012	隆基绿能	28,580	1,904,285.40	1.78
6	002594	比亚迪	4,800	1,600,752.00	1.50
7	300059	东方财富	62,031	1,575,587.40	1.48
8	600809	山西汾酒	4,700	1,526,560.00	1.43
9	600030	中信证券	70,455	1,526,055.30	1.43
10	601166	兴业银行	72,500	1,442,750.00	1.35
11	000001	平安银行	94,000	1,408,120.00	1.32
12	600900	长江电力	60,300	1,394,136.00	1.31
13	000333	美的集团	22,200	1,340,658.00	1.26
14	601398	工商银行	258,500	1,233,045.00	1.16
15	000568	泸州老窖	4,900	1,208,046.00	1.13

16	601668	中国建筑	222,500	1,183,700.00	1.11
17	600887	伊利股份	29,600	1,152,920.00	1.08
18	601899	紫金矿业	113,900	1,062,687.00	1.00
19	002415	海康威视	28,200	1,020,840.00	0.96
20	002714	牧原股份	18,200	1,005,914.00	0.94
21	601088	中国神华	28,100	935,730.00	0.88
22	603259	药明康德	8,920	927,590.80	0.87
23	600690	海尔智家	33,000	906,180.00	0.85
24	002475	立讯精密	25,700	868,403.00	0.81
25	600438	通威股份	14,114	844,864.04	0.79
26	601888	中国中免	3,600	838,548.00	0.79
27	002129	TCL中环	14,200	836,238.00	0.78
28	601995	中金公司	18,300	814,167.00	0.76
29	000625	长安汽车	45,970	796,200.40	0.75
30	600276	恒瑞医药	21,120	783,340.80	0.73
31	601985	中国核电	112,800	773,808.00	0.73
32	300760	迈瑞医疗	2,400	751,680.00	0.70
33	002352	顺丰控股	13,100	731,111.00	0.69
34	600309	万华化学	7,500	727,425.00	0.68
35	002460	赣锋锂业	4,600	684,020.00	0.64
36	600031	三一重工	35,700	680,442.00	0.64
37	300015	爱尔眼科	14,900	667,073.00	0.63
38	002812	恩捷股份	2,600	651,170.00	0.61
39	600919	江苏银行	89,400	636,528.00	0.60
40	601658	邮储银行	117,500	633,325.00	0.59
41	603986	兆易创新	4,300	611,503.00	0.57
42	603799	华友钴业	6,350	607,187.00	0.57
43	002271	东方雨虹	11,400	586,758.00	0.55
44	300124	汇川技术	8,900	586,243.00	0.55
45	688981	中芯国际	12,749	575,872.33	0.54
46	600048	保利发展	31,600	551,736.00	0.52

47	002466	天齐锂业	4,300	536,640.00	0.50
48	002410	广联达	9,200	500,848.00	0.47
49	002241	歌尔股份	14,900	500,640.00	0.47
50	600426	华鲁恒升	17,000	496,400.00	0.47
51	603019	中科曙光	17,000	493,340.00	0.46
52	300122	智飞生物	4,400	488,444.00	0.46
53	601328	交通银行	97,600	486,048.00	0.46
54	600111	北方稀土	13,700	481,692.00	0.45
55	002049	紫光国微	2,500	474,300.00	0.44
56	600406	国电南瑞	17,300	467,100.00	0.44
57	601288	农业银行	154,400	466,288.00	0.44
58	600050	中国联通	132,100	457,066.00	0.43
59	000725	京东方 A	114,700	451,918.00	0.42
60	603501	韦尔股份	2,600	449,878.00	0.42
61	601601	中国太保	18,800	442,364.00	0.41
62	600585	海螺水泥	12,000	423,360.00	0.40
63	300450	先导智能	6,700	423,306.00	0.40
64	688599	天合光能	6,200	404,550.00	0.38
65	002304	洋河股份	2,200	402,930.00	0.38
66	000651	格力电器	11,900	401,268.00	0.38
67	603288	海天味业	4,381	395,867.16	0.37
68	002459	晶澳科技	4,880	385,032.00	0.36
69	000858	五粮液	1,900	383,667.00	0.36
70	601688	华泰证券	27,000	383,400.00	0.36
71	300896	爱美客	600	360,006.00	0.34
72	600015	华夏银行	68,800	358,448.00	0.34
73	002001	新和成	15,660	357,204.60	0.33
74	002920	德赛西威	2,400	355,200.00	0.33
75	002821	凯莱英	1,200	346,800.00	0.32
76	600089	特变电工	12,600	345,114.00	0.32
77	603392	万泰生物	2,205	342,436.50	0.32

78	600926	杭州银行	22,800	341,544.00	0.32
79	601857	中国石油	64,000	339,200.00	0.32
80	002008	大族激光	10,100	334,613.00	0.31
81	600009	上海机场	5,800	328,860.00	0.31
82	300661	圣邦股份	1,800	327,636.00	0.31
83	601117	中国化学	34,400	323,704.00	0.30
84	600436	片仔癀	900	321,057.00	0.30
85	600660	福耀玻璃	7,600	317,756.00	0.30
86	300498	温氏股份	14,900	317,221.00	0.30
87	300274	阳光电源	3,100	304,575.00	0.29
88	601919	中远海控	21,630	300,657.00	0.28
89	601669	中国电建	37,900	298,273.00	0.28
90	688005	容百科技	2,200	284,768.00	0.27
91	002555	三七互娱	13,400	284,482.00	0.27
92	300014	亿纬锂能	2,900	282,750.00	0.26
93	601021	春秋航空	4,800	280,080.00	0.26
94	002709	天赐材料	4,500	279,270.00	0.26
95	601988	中国银行	84,800	276,448.00	0.26
96	601225	陕西煤业	13,000	275,340.00	0.26
97	300529	健帆生物	5,400	274,806.00	0.26
98	601916	浙商银行	82,500	273,900.00	0.26
99	601989	中国重工	72,600	269,346.00	0.25
100	600132	重庆啤酒	1,800	263,880.00	0.25
101	600600	青岛啤酒	2,500	259,800.00	0.24
102	600741	华域汽车	11,200	257,600.00	0.24
103	002371	北方华创	900	249,408.00	0.23
104	601838	成都银行	14,900	247,042.00	0.23
105	002311	海大集团	4,000	240,040.00	0.22
106	300316	晶盛机电	3,500	236,565.00	0.22
107	603659	璞泰来	2,800	236,320.00	0.22
108	000661	长春高新	1,000	233,420.00	0.22

109	601881	中国银河	24,000	232,080.00	0.22
110	600845	宝信软件	4,200	229,320.00	0.21
111	002230	科大讯飞	5,500	226,710.00	0.21
112	600176	中国巨石	13,000	226,330.00	0.21
113	601211	国泰君安	14,800	224,960.00	0.21
114	000063	中兴通讯	8,700	222,111.00	0.21
115	600383	金地集团	16,500	221,760.00	0.21
116	000100	TCL科技	46,200	221,298.00	0.21
117	000708	中信特钢	10,300	207,545.00	0.19
118	300628	亿联网络	2,700	205,605.00	0.19
119	002120	韵达股份	12,000	204,720.00	0.19
120	600745	闻泰科技	2,400	204,264.00	0.19
121	600547	山东黄金	11,000	204,160.00	0.19
122	601816	京沪高铁	40,100	201,302.00	0.19
123	600085	同仁堂	3,800	200,944.00	0.19
124	600196	复星医药	4,500	198,405.00	0.19
125	603882	金域医学	2,400	198,120.00	0.19
126	601066	中信建投	6,800	196,588.00	0.18
127	300751	迈为股份	400	196,360.00	0.18
128	600958	东方证券	18,892	192,887.32	0.18
129	300142	沃森生物	3,900	188,721.00	0.18
130	002916	深南电路	2,000	187,420.00	0.18
131	601877	正泰电器	5,200	186,056.00	0.17
132	600460	士兰微	3,500	182,000.00	0.17
133	002179	中航光电	2,860	181,095.20	0.17
134	603806	福斯特	2,640	172,972.80	0.16
135	300763	锦浪科技	800	170,400.00	0.16
136	600104	上汽集团	9,500	169,195.00	0.16
137	300408	三环集团	5,600	168,560.00	0.16
138	601100	恒立液压	2,700	166,644.00	0.16
139	000895	双汇发展	5,600	164,080.00	0.15

140	601998	中信银行	33,700	160,075.00	0.15
141	603486	科沃斯	1,300	158,457.00	0.15
142	601009	南京银行	15,200	158,384.00	0.15
143	688008	澜起科技	2,600	157,508.00	0.15
144	001979	招商蛇口	11,700	157,131.00	0.15
145	688561	奇安信	2,800	156,240.00	0.15
146	002648	卫星化学	6,000	155,100.00	0.15
147	000776	广发证券	8,100	151,470.00	0.14
148	000002	万科A	7,300	149,650.00	0.14
149	000876	新希望	9,600	146,880.00	0.14
150	003816	中国广核	51,700	144,760.00	0.14
151	603369	今世缘	2,800	142,800.00	0.13
152	603260	合盛硅业	1,200	141,552.00	0.13
153	601939	建设银行	22,800	138,168.00	0.13
154	002493	荣盛石化	8,900	136,971.00	0.13
155	601390	中国中铁	22,000	135,080.00	0.13
156	600161	天坛生物	5,500	133,540.00	0.13
157	002074	国轩高科	2,900	132,240.00	0.12
158	600219	南山铝业	35,300	130,257.00	0.12
159	002050	三花智控	4,700	129,156.00	0.12
160	000425	徐工机械	23,700	127,743.00	0.12
161	002736	国信证券	13,300	127,281.00	0.12
162	000338	潍柴动力	10,200	127,194.00	0.12
163	600332	白云山	4,000	126,360.00	0.12
164	600346	恒力石化	5,600	124,544.00	0.12
165	300919	中伟股份	1,000	123,900.00	0.12
166	601628	中国人寿	3,800	118,104.00	0.11
167	600028	中国石化	28,600	116,688.00	0.11
168	300347	泰格医药	1,000	114,450.00	0.11
169	601138	工业富联	11,100	109,224.00	0.10
170	002027	分众传媒	16,100	108,353.00	0.10

171	300033	同花顺	1,100	105,765.00	0.10
172	688012	中微公司	891	104,024.25	0.10
173	601229	上海银行	15,200	99,560.00	0.09
174	601878	浙商证券	8,700	99,006.00	0.09
175	000166	申万宏源	23,000	98,670.00	0.09
176	000977	浪潮信息	3,700	97,976.00	0.09
177	002841	视源股份	1,300	97,916.00	0.09
178	601238	广汽集团	6,300	96,012.00	0.09
179	600018	上港集团	16,000	93,280.00	0.09
180	601377	兴业证券	13,000	91,650.00	0.09
181	600760	中航沈飞	1,500	90,675.00	0.08
182	300957	贝泰妮	400	87,012.00	0.08
183	688363	华熙生物	600	85,308.00	0.08
184	600989	宝丰能源	5,700	83,505.00	0.08
185	002938	鹏鼎控股	2,700	81,567.00	0.08
186	688111	金山办公	400	78,848.00	0.07
187	000538	云南白药	1,300	78,507.00	0.07
188	603290	斯达半导	200	77,180.00	0.07
189	600584	长电科技	2,800	75,600.00	0.07
190	601319	中国人保	14,600	73,876.00	0.07
191	600763	通策医疗	400	69,776.00	0.07
192	300207	欣旺达	2,200	69,520.00	0.07
193	600011	华能国际	9,600	67,584.00	0.06
194	601186	中国铁建	8,400	66,360.00	0.06
195	300496	中科创达	500	65,240.00	0.06
196	300782	卓胜微	480	64,800.00	0.06
197	600019	宝钢股份	10,700	64,414.00	0.06
198	603185	上机数控	400	62,396.00	0.06
199	603993	洛阳钼业	10,100	57,873.00	0.05
200	600999	招商证券	4,000	57,640.00	0.05
201	000938	紫光股份	2,900	56,260.00	0.05

202	000786	北新建材	1,600	55,392.00	0.05
203	002236	大华股份	3,300	54,186.00	0.05
204	600016	民生银行	14,400	53,568.00	0.05
205	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.05
206	002252	上海莱士	8,200	48,626.00	0.05
207	002007	华兰生物	2,100	47,880.00	0.04
208	601155	新城控股	1,800	45,774.00	0.04
209	000157	中联重科	7,400	45,584.00	0.04
210	601600	中国铝业	9,500	45,125.00	0.04
211	603899	晨光股份	800	44,864.00	0.04
212	002600	领益智造	8,700	43,674.00	0.04
213	688396	华润微	737	43,534.59	0.04
214	300223	北京君正	400	42,500.00	0.04
215	002202	金风科技	2,700	39,960.00	0.04
216	601633	长城汽车	1,000	37,040.00	0.03
217	002601	龙佰集团	1,800	36,090.00	0.03
218	601898	中煤能源	3,400	35,292.00	0.03
219	300595	欧普康视	600	34,314.00	0.03
220	601169	北京银行	7,400	33,596.00	0.03
221	300601	康泰生物	725	32,755.50	0.03
222	601336	新华保险	1,000	32,190.00	0.03
223	601865	福莱特	800	30,480.00	0.03
224	600570	恒生电子	700	30,478.00	0.03
225	603087	甘李药业	600	28,782.00	0.03
226	600795	国电电力	7,000	27,370.00	0.03
227	600010	宝钢股份	11,000	25,850.00	0.02
228	600588	用友网络	1,100	23,881.00	0.02
229	600655	豫园股份	2,500	23,600.00	0.02
230	002414	高德红外	1,800	23,166.00	0.02
231	601216	君正集团	4,700	22,936.00	0.02
232	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.02

233	002602	世纪华通	4,500	21,690.00	0.02
234	601808	中海油服	1,500	20,925.00	0.02
235	300866	安克创新	300	19,896.00	0.02
236	300003	乐普医疗	1,000	18,570.00	0.02
237	688036	传音控股	200	17,846.00	0.02
238	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.02
239	000301	东方盛虹	1,000	16,910.00	0.02
240	002032	苏泊尔	300	16,902.00	0.02
241	601111	中国国航	1,400	16,254.00	0.02
242	600183	生益科技	900	15,291.00	0.01
243	601766	中国中车	2,800	14,560.00	0.01
244	601618	中国中冶	4,100	14,350.00	0.01
245	601901	方正证券	2,000	13,420.00	0.01
246	000877	天山股份	900	11,070.00	0.01
247	002607	中公教育	1,800	10,422.00	0.01
248	300454	深信服	100	10,378.00	0.01
249	600352	浙江龙盛	1,000	10,180.00	0.01
250	600061	国投资本	1,600	10,176.00	0.01
251	300759	康龙化成	100	9,522.00	0.01
252	000963	华东医药	200	9,032.00	0.01
253	000066	中国长城	700	7,574.00	0.01
254	601006	大秦铁路	1,100	7,249.00	0.01
255	603160	汇顶科技	100	6,193.00	0.01
256	000768	中航西飞	200	6,058.00	0.01
257	300999	金龙鱼	100	5,402.00	0.01
258	600893	航发动力	100	4,551.00	0.00
259	600489	中金黄金	600	4,434.00	0.00
260	601360	三六零	500	4,260.00	0.00
261	002064	华峰化学	400	3,376.00	0.00
262	000408	藏格矿业	100	3,294.00	0.00
263	601698	中国卫通	200	2,262.00	0.00

264	300433	蓝思科技	200	2,214.00	0.00
265	600029	南方航空	300	2,193.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600153	建发股份	58,000	758,060.00	0.71
2	601128	常熟银行	66,924	511,299.36	0.48
3	300144	宋城演艺	22,900	351,515.00	0.33
4	600765	中航重机	9,480	305,066.40	0.29
5	601615	明阳智能	8,400	283,920.00	0.27
6	600486	扬农化工	1,700	226,576.00	0.21
7	600754	锦江酒店	3,200	201,280.00	0.19
8	603816	顾家家居	3,460	195,939.80	0.18
9	002597	金禾实业	4,100	177,653.00	0.17
10	688777	中控技术	2,200	160,072.00	0.15
11	300363	博腾股份	2,000	155,980.00	0.15
12	002180	纳思达	2,700	136,674.00	0.13
13	300373	扬杰科技	1,900	135,375.00	0.13
14	603456	九洲药业	2,200	113,740.00	0.11
15	300037	新宙邦	2,000	105,120.00	0.10
16	601677	明泰铝业	4,200	99,960.00	0.09
17	000513	丽珠集团	2,700	97,767.00	0.09
18	300357	我武生物	1,800	93,654.00	0.09
19	002372	伟星新材	3,800	91,352.00	0.09
20	300285	国瓷材料	2,400	86,208.00	0.08
21	002240	盛新锂能	1,400	84,504.00	0.08
22	603565	中谷物流	5,252	83,349.24	0.08
23	603298	杭叉集团	5,400	83,322.00	0.08
24	000733	振华科技	600	81,582.00	0.08

25	688388	嘉元科技	946	80,287.02	0.08
26	002756	永兴材料	500	76,105.00	0.07
27	000683	远兴能源	6,700	70,417.00	0.07
28	300327	中颖电子	1,350	67,243.50	0.06
29	002507	涪陵榨菜	1,800	62,136.00	0.06
30	300083	创世纪	5,300	60,950.00	0.06
31	002332	仙琚制药	6,200	60,884.00	0.06
32	603043	广州酒家	2,300	58,006.00	0.05
33	600801	华新水泥	2,900	56,579.00	0.05
34	002003	伟星股份	5,500	52,250.00	0.05
35	600884	杉杉股份	1,700	50,524.00	0.05
36	300171	东富龙	1,300	44,083.00	0.04
37	600563	法拉电子	200	41,032.00	0.04
38	601965	中国汽研	2,500	40,525.00	0.04
39	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
40	601689	拓普集团	500	34,215.00	0.03
41	000902	新洋丰	2,000	33,780.00	0.03
42	603345	安井食品	200	33,574.00	0.03
43	300012	华测检测	1,300	30,173.00	0.03
44	605358	立昂微	436	29,377.68	0.03
45	002484	江海股份	1,100	25,674.00	0.02
46	300415	伊之密	1,300	23,699.00	0.02
47	603589	口子窖	400	23,444.00	0.02
48	600862	中航高科	800	22,480.00	0.02
49	300394	天孚通信	800	21,656.00	0.02
50	603588	高能环境	1,780	20,523.40	0.02
51	600329	中新药业	800	19,664.00	0.02
52	600378	昊华科技	500	19,260.00	0.02
53	600096	云天化	600	18,888.00	0.02
54	603520	司太立	660	18,559.20	0.02
55	300861	美畅股份	200	18,538.00	0.02

56	603995	甬金股份	500	16,830.00	0.02
57	600885	宏发股份	400	16,740.00	0.02
58	603568	伟明环保	500	16,685.00	0.02
59	688139	海尔生物	200	14,566.00	0.01
60	002340	格林美	1,500	13,650.00	0.01
61	603639	海利尔	600	12,510.00	0.01
62	000723	美锦能源	1,000	12,200.00	0.01
63	603279	景津装备	380	11,783.80	0.01
64	300699	光威复材	200	11,774.00	0.01
65	000519	中兵红箭	400	11,660.00	0.01
66	002557	洽洽食品	200	11,386.00	0.01
67	603129	春风动力	100	11,372.00	0.01
68	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
69	002318	久立特材	700	11,193.00	0.01
70	002690	美亚光电	510	11,056.80	0.01
71	600803	新奥股份	400	7,436.00	0.01
72	002430	杭氧股份	200	6,252.00	0.01
73	603179	新泉股份	200	5,800.00	0.01
74	301158	德石股份	284	5,787.92	0.01
75	300395	菲利华	100	4,500.00	0.00
76	601233	桐昆股份	200	3,176.00	0.00
77	300834	星辉环材	98	2,942.94	0.00
78	002138	顺络电子	100	2,725.00	0.00
79	301123	奕东电子	102	2,589.78	0.00
80	301196	唯科科技	52	1,951.04	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

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

1	601288	农业银行	2,384,328.00	1.83
2	601668	中国建筑	2,040,853.00	1.57
3	601398	工商银行	1,918,579.00	1.47
4	600030	中信证券	1,625,653.65	1.25
5	300059	东方财富	1,606,935.00	1.23
6	002714	牧原股份	1,555,100.36	1.19
7	600153	建发股份	1,553,133.00	1.19
8	601995	中金公司	1,505,448.00	1.15
9	601899	紫金矿业	1,372,146.00	1.05
10	300595	欧普康视	1,323,034.00	1.01
11	603259	药明康德	1,298,679.00	1.00
12	601318	中国平安	1,298,551.00	1.00
13	600352	浙江龙盛	1,289,317.00	0.99
14	601009	南京银行	1,244,209.00	0.95
15	600104	上汽集团	1,237,389.00	0.95
16	601658	邮储银行	1,213,924.00	0.93
17	300144	宋城演艺	1,212,489.00	0.93
18	688981	中芯国际	1,194,961.43	0.92
19	600809	山西汾酒	1,148,326.00	0.88
20	603799	华友钴业	1,136,132.00	0.87

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	3,265,973.20	2.51
2	601398	工商银行	3,014,953.00	2.31
3	601288	农业银行	1,902,883.00	1.46
4	300595	欧普康视	1,879,739.00	1.44
5	000858	五粮液	1,784,467.00	1.37

6	002460	赣锋锂业	1,718,694.00	1.32
7	000001	平安银行	1,676,209.00	1.29
8	603259	药明康德	1,635,301.00	1.25
9	600438	通威股份	1,617,003.00	1.24
10	601899	紫金矿业	1,552,538.00	1.19
11	603986	兆易创新	1,488,565.00	1.14
12	601225	陕西煤业	1,439,375.00	1.10
13	601658	邮储银行	1,396,322.00	1.07
14	603799	华友钴业	1,379,906.65	1.06
15	000725	京东方 A	1,323,062.00	1.01
16	601012	隆基绿能	1,275,384.00	0.98
17	601668	中国建筑	1,205,899.00	0.93
18	601009	南京银行	1,194,201.00	0.92
19	600352	浙江龙盛	1,165,432.00	0.89
20	601601	中国太保	1,162,608.00	0.89

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	153,350,164.33
卖出股票收入（成交）总额	167,317,006.93

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,000.60	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,000.60	0.01

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙22转债	80	8,000.60	0.01

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

1、宁波银行 代码：002142.SZ 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：

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,862.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,862.44

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中泰沪深300量化优选增强A	1,665	41,864.60	21,491,791.88	30.83%	48,212,760.39	69.17%
中泰沪深300量化优选增强C	809	56,642.43	10,101,228.00	22.04%	35,722,501.80	77.96%
合计	2,474	46,696.96	31,593,019.88	27.35%	83,935,262.19	72.65%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中泰沪深300量化优选增强A	53,159.60	0.076%
	中泰沪深300量化优选增强C	1,010.28	0.002%
	合计	54,169.88	0.047%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	中泰沪深300量化 优选增强A	0
	中泰沪深300量化 优选增强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量化 优选增强A	0
	中泰沪深300量化 优选增强C	0
	合计	0

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰沪深300量化优选 增强A	中泰沪深300量化优选 增强C
基金合同生效日(2021年07月05 日)基金份额总额	176,574,607.39	93,378,696.66
本报告期期初基金份额总额	73,246,825.79	59,914,326.58
本报告期基金总申购份额	3,162,178.54	1,347,651.08
减：本报告期基金总赎回份额	6,704,452.06	15,438,247.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	69,704,552.27	45,823,729.80

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	318,889,788.36	100.00%	71,852.35	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交	占当期权	成交金额	占当期基

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例	金额	证成交总 额的比例		金成交总 额的比例
中泰证 券	466,465.70	100.00%	1,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-01-06
2	中泰沪深300指数量化优选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	2022-01-07
3	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金招募说明书（更新）2022年第1号	中国证监会规定网站	2022-01-07
4	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销最低认/申购金额的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-01-10
5	关于中泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分证券投资基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-01-14
6	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定网站	2022-01-20
7	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富投资管理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	2022-02-24
8	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-03-11

	新增国金证券股份有限公司为销售机构公告		
9	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得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	2022-03-17
10	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定网站	2022-03-30
11	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理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	2022-04-19
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招商银行股份有限公司招赢通平台为销售渠道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	2022-04-19
13	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定网站	2022-04-21
14	中泰沪深300指数量化优选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	2022-05-18
15	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金招募说明书（更新）2022年第2号	中国证监会规定网站	2022-05-18
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国联证券股份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	2022-05-20

17	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富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	2022-05-20
18	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益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	2022-05-23
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华宝证券股份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	2022-06-13
20	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创金启富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	2022-06-17
21	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行股份有限公司为销售机构公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-17
22	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低认/申购金额、单笔最低赎回份额和最低持有份额数额限制的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-29

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金设立的文件；

- 2、《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰沪深300指数量化优选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指数量化优选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。

## 11.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

## 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

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  
二〇二二年八月三十日