

中泰中证 500 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:兴业银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024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.....	5
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.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§ 4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	15
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.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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	净资产变动表.....	19
6.4	报表附注.....	21
§ 7	投资组合报告.....	44
7.1	期末基金资产组合情况.....	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
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
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	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.....	69
11.1	备查文件目录.....	69
11.2	存放地点.....	70
11.3	查阅方式.....	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	中泰中证500指数增强	
基金主代码	008112	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月11日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,527,686.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰中证500指数增强 A	中泰中证500指数增强 C
下属分级基金的交易代码	008112	008113
报告期末下属分级基金的份额总额	13,013,432.89份	35,514,253.98份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中泰证券（上海）资产管理有	兴业银行股份有限公司

		限公司	
信息披露 负责人	姓名	王洪懿	龚小武
	联系电话	021-20521199	021-52629999-212056
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-821-0808	95561
传真		021-50933716	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	福建省福州市台江区江滨中 大道398号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路167号 4楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		黄文卿	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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
	(2024年01月01日-2024年06月30日)

	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C
本期已实现收益	-556,689.64	-1,572,512.53
本期利润	-964,915.82	-2,753,024.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0744	-0.0766
本期加权平均净值利润率	-6.39%	-6.70%
本期基金份额净值增长率	-6.24%	-6.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	1,571,644.37	3,570,012.70
期末可供分配基金份额利润	0.1208	0.1005
期末基金资产净值	14,585,077.26	39,084,266.68
期末基金份额净值	1.1208	1.1005
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	12.08%	10.05%

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

中泰中证500指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.51%	0.87%	-6.55%	0.91%	1.04%	-0.04%

过去三个月	-4.23%	1.03%	-6.16%	1.09%	1.93%	-0.06%
过去六个月	-6.24%	1.41%	-8.46%	1.53%	2.22%	-0.12%
过去一年	-15.96%	1.12%	-16.71%	1.21%	0.75%	-0.09%
过去三年	-23.13%	1.07%	-26.00%	1.14%	2.87%	-0.07%
自基金合同生效起至今	12.08%	1.16%	-1.49%	1.22%	13.57%	-0.06%

中泰中证500指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.54%	0.87%	-6.55%	0.91%	1.01%	-0.04%
过去三个月	-4.33%	1.03%	-6.16%	1.09%	1.83%	-0.06%
过去六个月	-6.44%	1.42%	-8.46%	1.53%	2.02%	-0.11%
过去一年	-16.30%	1.12%	-16.71%	1.21%	0.41%	-0.09%
过去三年	-24.05%	1.07%	-26.00%	1.14%	1.95%	-0.07%
自基金合同生效起至今	10.05%	1.16%	-1.49%	1.22%	11.54%	-0.06%

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

中泰中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月11日-2024年06月30日)



中泰中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月11日-2024年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资

设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2024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、中泰星汇优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、中泰双利债券型证券投资基金、中泰安悦6个月定期开放债券型证券投资基金、中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金、中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金、中泰元和价值精选混合型证券投资基金、中泰天择稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）、中泰星锐景气成长混合型证券投资基金、中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中泰福瑞稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中泰ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金和中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金共三十只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹巍	本基金基金经理；中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基	2019-12-11	-	20	国籍：中国。学历：华东师范大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司财务部IT运维工程师，上海国泰君安证券资

	<p>金经理；中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理；中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理；量化公募投资部副总经理。</p>				<p>产管理有限公司运营部副总经理、量化投资部首席研究员。2014年10月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司，历任对冲基金部副总经理、基金业务部副总经理，现任量化公募投资部副总经理。2019年12月11日至今担任中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理。2020年4月1日至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2021年7月5日至今担任中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。2023年2月7日至今担任中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2024年6月4日至今担任中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。</p>
<p>李玉刚</p>	<p>本基金基金经理；中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理；中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金基金经理；中泰ESG主题6个月持有期混合</p>	<p>2022-01-04</p>	<p>-</p>	<p>23</p>	<p>国籍：中国。学历：北京大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所、新产品部和衍生产品部研究员、资产管理总部研究员，上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理。2014年11月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司，历任对冲</p>

	<p>型发起式证券投资基金基金经理；研究部总经理兼量化公募投资部总经理。</p>			<p>基金部总经理、研究部总经理，现任研究部总经理兼量化公募投资部总经理。2022年1月4日至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金和沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。2022年11月11日至今担任中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金基金经理。2024年1月23日至今担任中泰ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

异常交易，是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理产品买卖法规、产品管理合同、交易制度等限制投资对象的交易均认定为交易对象异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在收盘前15分钟的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过15%，则认定为交易时间异常型异常交易。产品在连续竞价阶段委托价格超过最新价格的3%，则作为交易价格异常

型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在交易当日的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过30%，即作为交易数量异常型异常交易。内幕交易，频繁申报与撤单，不能列示有充分投资研究成果支持的交易，以及投资管理人员受他人干预，未能就投资、交易等事项做出客观、公正的独立判断与决策的交易，均作为交易理由异常型异常交易。

风险管理部通过系统或人工手段，监控各产品的异常交易，如果发现某笔交易符合异常交易界定标准，将其列为异常交易，并建立异常交易档案，系统记录异常交易发生的时间、具体交易情况及认定人和认定依据，对于风险管理部识别出的异常交易，要求投资经理进行合理解释，并提交书面说明至风险管理部备案。

本报告期内，未发生异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，中证500指数经历了一段显著的市场波动。在二月的强劲反弹之后，市场迅速转入震荡模式，直至五月，指数转而步入缓慢下行轨道。年初时，指数位于5429.23点，而半年结束时已回落至4942.78点，显示出一定的回调压力。总体年化波动率虽较前期有所上升，达24.4%，但主要归因于一季度的大幅波动，而进入二季度后波动率明显收窄。

从行业表现来看，上半年唯公用事业板块小幅上扬，其余行业均遭遇不同程度的下跌，尤以医药、消费及房地产行业跌幅最为显著。

本基金上半年坚持既定的投资策略，采取相对保守且严谨的投资方法论。我们运用统计模型，依托历史数据，对股票进行科学分类，确保投资组合在各类风险因子上的配置与指数保持高度一致，从而有效控制跟踪误差。同时，我们不忘追求超越指数的主动收益，坚持价值投资理念，深入挖掘市场机会。

报告期内，本基金不仅成功地将跟踪误差控制在合理范围内，还实现了一定的超额收益，这充分验证了我们投资策略的有效性和稳健性。作为指数型基金，我们始终认为，精准跟踪指数是基金运作的核心任务，而在此基础上，通过主动管理增强收益则是我们不断努力的方向。我们将继续深化对优质企业的识别能力，提升对价格安全边际的判断能力，力求在控制风险的同时，为投资者创造更加稳定且可持续的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰中证500指数增强A基金份额净值为1.1208元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.24%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；截至报告期末中泰中证500指数增强C基金份额净值为1.1005元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.44%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年，特别是二季度，经济数据揭示了环比增长动力显著不及普遍预期，多数经济活动指标如房地产销售、整车货运流量、汽车销量及地铁客流量等，同比增速均现放缓迹象，凸显出当前经济环境下供给相对充裕而需求持续疲软的挑战。这一现状标志着我国在经济增长模式新旧动能转换的关键阶段，仍面临着艰巨的任务与长远的征程。

鉴于上述实际情况，我们审慎预测下半年政府将在财政与货币政策两端持续采取宽松措施，以刺激经济增长并平衡供需关系。与此同时，A股市场因其整体估值已回落至历史低位，为投资者提供了相对具有吸引力的入场点。我们预期，在未来一段时间内，市场将不乏结构性投资机会，这些机会将主要聚焦于那些展现出稳健业绩、良好股东回报的价值型企业，以及以AI技术为核心驱动力的科技创新企业。

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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,463,977.02	3,622,680.56
结算备付金		382,118.24	379,599.25
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,010,892.30	55,195,693.10
其中：股票投资		49,994,891.11	55,193,392.93
基金投资		-	-
债券投资		16,001.19	2,300.17

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		52,563.45	139,422.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		53,909,551.01	59,337,395.33
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		92,172.53	140,316.72
应付管理人报酬		22,779.88	25,090.04
应付托管费		2,278.01	2,509.00
应付销售服务费		13,302.90	14,699.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	109,673.75	270,011.87
负债合计		240,207.07	452,627.03

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	48,527,686.87	49,846,963.95
未分配利润	6.4.7.8	5,141,657.07	9,037,804.35
净资产合计		53,669,343.94	58,884,768.30
负债和净资产总计		53,909,551.01	59,337,395.33

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额48,527,686.87份，其中A类份额13,013,432.89份，C类份额35,514,253.98份。A类份额净值1.1208元，C类份额净值1.1005元。

6.2 利润表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-3,321,872.94	2,680,878.13
1.利息收入		13,102.32	16,984.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,102.32	16,984.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-1,758,889.29	-208,714.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,498,678.27	-864,149.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	336.89	445.83
资产支持证券投资 收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	739,452.09	654,989.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	-1,588,737.81	2,869,293.99
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.15	12,651.84	3,313.95
减：二、营业总支出		396,067.04	439,263.98
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	139,822.04	162,122.63
2.托管费	6.4.10.2.2	13,982.23	16,212.26
3.销售服务费	6.4.10.2.3	81,800.43	95,727.32
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.16	160,462.34	165,201.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,717,939.98	2,241,614.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,717,939.98	2,241,614.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,717,939.98	2,241,614.15

6.3 净资产变动表

会计主体：中泰中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,846,963.95	9,037,804.35	58,884,768.30
二、本期期初净资产	49,846,963.95	9,037,804.35	58,884,768.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,319,277.08	-3,896,147.28	-5,215,424.36
（一）、综合收益总额	-	-3,717,939.98	-3,717,939.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,319,277.08	-178,207.30	-1,497,484.38
其中：1.基金申购款	6,198,381.47	922,170.97	7,120,552.44
2.基金赎回款	-7,517,658.55	-1,100,378.27	-8,618,036.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	48,527,686.87	5,141,657.07	53,669,343.94
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	49,488,928.17	13,699,573.12	63,188,501.29
二、本期期初净资产	49,488,928.17	13,699,573.12	63,188,501.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-670,448.99	1,906,167.90	1,235,718.91
（一）、综合收益总额	-	2,241,614.15	2,241,614.15
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-670,448.99	-335,446.25	-1,005,895.24
其中：1.基金申购款	6,947,889.87	2,383,184.83	9,331,074.70
2.基金赎回款	-7,618,338.86	-2,718,631.08	-10,336,969.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	48,818,479.18	15,605,741.02	64,424,220.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券以及中国证监会允许投资的其他债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金和应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行相应程序后,以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{中证500指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2024年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、2024年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
----	--------------------

活期存款	1,704,136.99
等于：本金	1,703,975.61
加：应计利息	161.38
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	1,759,840.03
等于：本金	1,759,505.66
加：应计利息	334.37
减：坏账准备	-
合计	3,463,977.02

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 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	53,395,591.41	-	49,994,891.11	-3,400,700.30	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	16,000.00	1.19	16,001.19	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,000.00	1.19	16,001.19	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	53,411,591.41	1.19	50,010,892.30	-3,400,700.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.41
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	19,890.78
预提费用-信息披露费	39,781.56
其他应付	50,000.00
合计	109,673.75

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中泰中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,269,037.79	13,269,037.79
本期申购	1,923,876.84	1,923,876.84
本期赎回（以“-”号填列）	-2,179,481.74	-2,179,481.74
本期末	13,013,432.89	13,013,432.89

6.4.7.7.2 中泰中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,577,926.16	36,577,926.16
本期申购	4,274,504.63	4,274,504.63
本期赎回（以“-”号填列）	-5,338,176.81	-5,338,176.81
本期末	35,514,253.98	35,514,253.98

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中泰中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,780,204.57	-1,186,888.14	2,593,316.43
本期期初	3,780,204.57	-1,186,888.14	2,593,316.43
本期利润	-556,689.64	-408,226.18	-964,915.82
本期基金份额交易产生的变动数	-58,513.46	1,757.22	-56,756.24
其中：基金申购款	477,398.26	-174,975.60	302,422.66
基金赎回款	-535,911.72	176,732.82	-359,178.90

本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,165,001.47	-1,593,357.10	1,571,644.37

6.4.7.8.2 中泰中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (中泰中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,691,248.64	-3,246,760.72	6,444,487.92
本期期初	9,691,248.64	-3,246,760.72	6,444,487.92
本期利润	-1,572,512.53	-1,180,511.63	-2,753,024.16
本期基金份额交易产生的变动数	-246,321.90	124,870.84	-121,451.06
其中：基金申购款	974,017.47	-354,269.16	619,748.31
基金赎回款	-1,220,339.37	479,140.00	-741,199.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,872,414.21	-4,302,401.51	3,570,012.70

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	2,801.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,782.08
结算备付金利息收入	2,518.99
其他	-
合计	13,102.32

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	114,037,115.43
减：卖出股票成本总额	116,412,727.27
减：交易费用	123,066.43
买卖股票差价收入	-2,498,678.27

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	1.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	335.42
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	336.89

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,636.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,300.00
减：应计利息总额	0.45
减：交易费用	0.16
买卖债券差价收入	335.42

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	739,452.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	739,452.09

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-1,588,737.81
——股票投资	-1,588,737.81
——债券投资	-
——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	-1,588,737.81

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	12,647.70
基金转换费收入	4.14
合计	12,651.84

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
汇划手续费	790.00
指数使用费	100,000.00
合计	160,462.34

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	226,840,078.69	100.00%	184,075,429.48	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中泰证券	2,636.03	100.00%	2,446.00	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024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	51,488.44	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

		总量的比例		金总额的比例
中泰证券	41,739.64	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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	139,822.04	162,122.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	56,338.16	64,694.50
应支付基金管理人的净管理费	83,483.88	97,428.13

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,982.23	16,212.26

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.05%/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 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	合计
兴业银行	0.00	1,217.04	1,217.04
中泰证券	0.00	72,049.52	72,049.52
中泰资管	0.00	75.71	75.71
合计	0.00	73,342.27	73,342.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C	合计
兴业银行	0.00	1,443.89	1,443.89
中泰证券	0.00	88,393.51	88,393.51
中泰资管	0.00	72.53	72.53
合计	0.00	89,909.93	89,909.93

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，按月支付给中泰资管，再由中泰资管计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

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

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

中泰中证500指数增强A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至 2023年06月30日

基金合同生效日（2019年12月11日）持有的基金份额	1,999,560.32	1,999,560.32
报告期初持有的基金份额	999,560.32	999,560.32
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	999,560.32	999,560.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.68%	7.98%

中泰中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至 2023年06月30日
基金合同生效日（2019年12月11日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

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		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

兴业银行	1,704,136.99	2,801.25	2,777,545.81	3,833.50
中泰证券	1,759,840.03	7,782.08	1,533,511.35	9,118.37

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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：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
113685	升24转债	2024-06-14	18个交易日	新债未上市	100.00	100.01	160	16,000.00	16,001.19	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023-05-19	重大事项	0.40	-	-	37,500	64,085.52	15,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

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

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

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

工作；第四层次为各业务部门的一线风险管理。各业务部门承担一线的风控职能，执行具体的风险管理制度，并承担风险管理有效性的直接责任。公司建立了完善的内部控制制度，交易部门、投资管理部门以及风险管理部门互相独立、互相制约。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	16,001.19	2,300.17
未评级	-	-
合计	16,001.19	2,300.17

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无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,463,977.02	-	-	-	-	-	3,463,977.02
结算备付金	382,118.24	-	-	-	-	-	382,118.24
交易性金融资产	-	-	-	-	16,001.19	49,994,891.11	50,010,892.30
应收申购款	-	-	-	-	-	52,563.45	52,563.45
资产总计	3,846,095.26	-	-	-	16,001.19	50,047,454.56	53,909,551.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	92,172.53	92,172.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,779.88	22,779.88
应付托管费	-	-	-	-	-	2,278.01	2,278.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,302.90	13,302.90
其他负债	-	-	-	-	-	109,673.75	109,673.75

负债总计	-	-	-	-	-	240,207.07	240,207.07
利率敏感度缺口	3,846,095.26	-	-	-	16,001.19	49,807,247.49	53,669,343.94
上年度末 2023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							
货币资金	3,622,680.56	-	-	-	-	-	3,622,680.56
结算备付金	379,599.25	-	-	-	-	-	379,599.25
交易性金融资产	-	-	-	-	2,300.17	55,193,392.93	55,195,693.10
应收申购款	-	-	-	-	-	139,422.42	139,422.42
资产总计	4,002,279.81	-	-	-	2,300.17	55,332,815.35	59,337,395.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	140,316.72	140,316.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,090.04	25,090.04
应付托管费	-	-	-	-	-	2,509.00	2,509.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,699.40	14,699.40
其他负债	-	-	-	-	-	270,011.87	270,011.87
负债总计	-	-	-	-	-	452,627.03	452,627.03
利率敏感度缺口	4,002,279.81	-	-	-	2,300.17	54,880,188.32	58,884,768.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

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

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 2024年06月30日		上年度末 2023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	49,994,891.11	93.15	55,193,392.93	93.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	16,001.19	0.03	2,300.17	-
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	50,010,892.30	93.18	55,195,693.10	93.74

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	比较基准上升5%	3,647,229.79	2,346,706.31
	比较基准下降5%	-3,647,229.79	-2,346,706.31

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	49,979,891.11	55,163,128.93
第二层次	31,001.19	32,564.17
第三层次	-	-
合计	50,010,892.30	55,195,693.10

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，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，确定相关股票的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2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2023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工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,994,891.11	92.74
	其中：股票	49,994,891.11	92.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,001.19	0.03
	其中：债券	16,001.19	0.03
	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	3,846,095.26	7.13
8	其他各项资产	52,563.45	0.10
9	合计	53,909,551.01	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	312,170.00	0.58
B	采矿业	2,051,414.00	3.82
C	制造业	26,972,630.65	50.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,170,882.90	2.18
E	建筑业	61,418.00	0.11
F	批发和零售业	851,529.80	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	575,987.00	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,355,579.30	6.25
J	金融业	3,058,028.90	5.70
K	房地产业	418,933.00	0.78
L	租赁和商务服务业	332,120.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	563,214.36	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	187,531.80	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	94,868.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	784,752.00	1.46

S	综合	-	-
	合计	40,791,059.71	76.00

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	134,489.00	0.25
C	制造业	5,104,118.00	9.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	227,437.40	0.42
E	建筑业	618,084.00	1.15
F	批发和零售业	315,127.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	380,504.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,755.00	0.22
J	金融业	1,657,303.00	3.09
K	房地产业	273,730.00	0.51
L	租赁和商务服务业	138,156.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	236,128.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,203,831.40	17.15

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601555	东吴证券	168,200	992,380.00	1.85
2	601128	常熟银行	80,930	612,640.10	1.14
3	300502	新易盛	5,300	559,415.00	1.04
4	600988	赤峰黄金	25,600	418,304.00	0.78
5	600885	宏发股份	14,100	390,288.00	0.73
6	002966	苏州银行	50,300	377,250.00	0.70
7	600497	驰宏锌锗	69,200	369,528.00	0.69
8	300144	宋城演艺	45,900	368,577.00	0.69
9	002409	雅克科技	5,800	364,878.00	0.68
10	002028	思源电气	5,300	354,570.00	0.66
11	000738	航发控制	17,500	351,225.00	0.65
12	600862	中航高科	18,000	338,040.00	0.63
13	600863	内蒙华电	72,800	337,792.00	0.63
14	688536	思瑞浦	3,400	332,554.00	0.62
15	600418	江淮汽车	20,900	331,056.00	0.62
16	000932	华菱钢铁	73,800	326,934.00	0.61
17	002138	顺络电子	11,900	326,774.00	0.61
18	000683	远兴能源	46,800	323,388.00	0.60
19	002152	广电运通	30,700	321,122.00	0.60
20	002738	中矿资源	11,960	320,528.00	0.60
21	002372	伟星新材	20,700	319,194.00	0.59
22	601058	赛轮轮胎	22,400	313,600.00	0.58
23	002078	太阳纸业	22,300	311,085.00	0.58
24	000630	铜陵有色	85,200	307,572.00	0.57

25	002444	巨星科技	12,200	301,340.00	0.56
26	002472	双环传动	13,600	299,472.00	0.56
27	600096	云天化	15,400	299,068.00	0.56
28	601233	桐昆股份	18,300	292,068.00	0.54
29	600566	济川药业	9,000	285,390.00	0.53
30	300054	鼎龙股份	12,500	283,500.00	0.53
31	002850	科达利	3,700	282,606.00	0.53
32	603927	中科软	15,420	278,947.80	0.52
33	000400	许继电气	8,100	278,721.00	0.52
34	600582	天地科技	39,400	271,466.00	0.51
35	002128	电投能源	12,800	270,080.00	0.50
36	601231	环旭电子	16,800	269,640.00	0.50
37	002080	中材科技	20,800	268,320.00	0.50
38	002595	豪迈科技	7,000	267,190.00	0.50
39	000933	神火股份	13,100	265,013.00	0.49
40	002353	杰瑞股份	7,500	263,100.00	0.49
41	000988	华工科技	8,600	257,398.00	0.48
42	600131	国网信通	15,000	253,050.00	0.47
43	002465	海格通信	23,900	247,604.00	0.46
44	600879	航天电子	31,700	246,309.00	0.46
45	600348	华阳股份	24,700	246,012.00	0.46
46	300146	汤臣倍健	17,900	242,545.00	0.45
47	002517	恺英网络	25,300	241,615.00	0.45
48	600325	华发股份	36,800	239,200.00	0.45
49	601636	旗滨集团	36,900	238,005.00	0.44
50	002625	光启技术	13,500	234,225.00	0.44
51	000783	长江证券	48,400	233,772.00	0.44
52	603444	吉比特	1,300	231,413.00	0.43
53	688120	华海清科	1,200	227,496.00	0.42
54	000513	丽珠集团	6,100	226,981.00	0.42
55	600486	扬农化工	4,010	226,364.50	0.42

56	002156	通富微电	10,100	226,139.00	0.42
57	002690	美亚光电	13,600	224,400.00	0.42
58	600737	中粮糖业	23,100	221,529.00	0.41
59	600867	通化东宝	26,400	220,968.00	0.41
60	600079	人福医药	12,700	218,059.00	0.41
61	600583	海油工程	36,800	217,488.00	0.41
62	600511	国药股份	7,000	215,530.00	0.40
63	002436	兴森科技	20,700	213,624.00	0.40
64	603589	口子窖	5,400	211,626.00	0.39
65	600398	海澜之家	22,800	210,672.00	0.39
66	002223	鱼跃医疗	5,600	210,560.00	0.39
67	000960	锡业股份	13,300	206,017.00	0.38
68	601965	中国汽研	12,000	202,680.00	0.38
69	000998	隆平高科	20,300	199,549.00	0.37
70	002340	格林美	31,100	198,107.00	0.37
71	300383	光环新网	23,400	197,730.00	0.37
72	300748	金力永磁	15,120	195,955.20	0.37
73	002439	启明星辰	11,300	195,038.00	0.36
74	300474	景嘉微	3,050	192,851.50	0.36
75	688180	君实生物	6,600	191,730.00	0.36
76	301236	软通动力	5,300	186,613.00	0.35
77	000591	太阳能	39,400	185,574.00	0.35
78	689009	九号公司	4,880	179,632.80	0.33
79	002203	海亮股份	22,300	177,954.00	0.33
80	000636	风华高科	13,500	176,310.00	0.33
81	600060	海信视像	7,000	173,180.00	0.32
82	600066	宇通客车	6,700	172,860.00	0.32
83	000060	中金岭南	40,600	172,144.00	0.32
84	300088	长信科技	36,600	172,020.00	0.32
85	600739	辽宁成大	20,400	170,748.00	0.32
86	000066	中国长城	19,500	170,625.00	0.32

87	300136	信维通信	8,700	170,346.00	0.32
88	002384	东山精密	8,200	169,740.00	0.32
89	002268	电科网安	11,900	169,337.00	0.32
90	603568	伟明环保	7,960	163,816.80	0.31
91	600517	国网英大	37,200	161,076.00	0.30
92	000987	越秀资本	32,380	160,604.80	0.30
93	300037	新宙邦	5,500	157,080.00	0.29
94	688169	石头科技	400	157,040.00	0.29
95	002281	光迅科技	4,200	156,954.00	0.29
96	002407	多氟多	12,820	156,788.60	0.29
97	000818	航锦科技	7,100	156,768.00	0.29
98	603883	老百姓	8,530	156,610.80	0.29
99	601019	山东出版	13,200	156,024.00	0.29
100	600416	湘电股份	15,600	155,064.00	0.29
101	002064	华峰化学	21,500	154,155.00	0.29
102	601000	唐山港	32,500	152,750.00	0.28
103	600536	中国软件	4,989	149,270.88	0.28
104	601717	郑煤机	9,700	143,560.00	0.27
105	600516	方大炭素	33,200	143,092.00	0.27
106	300487	蓝晓科技	3,400	141,984.00	0.26
107	600500	中化国际	39,700	138,553.00	0.26
108	002185	华天科技	17,000	138,550.00	0.26
109	300207	欣旺达	9,100	138,047.00	0.26
110	600062	华润双鹤	7,000	137,060.00	0.26
111	300803	指南针	3,700	134,717.00	0.25
112	300601	康泰生物	8,600	134,246.00	0.25
113	603345	安井食品	1,800	133,758.00	0.25
114	600895	张江高科	7,200	133,056.00	0.25
115	300676	华大基因	3,800	133,038.00	0.25
116	600529	山东药玻	5,100	129,234.00	0.24
117	003022	联泓新科	9,400	128,874.00	0.24

118	300357	我武生物	6,300	127,386.00	0.24
119	300394	天孚通信	1,440	127,324.80	0.24
120	003035	南网能源	28,900	127,160.00	0.24
121	002430	杭氧股份	5,700	126,825.00	0.24
122	002373	千方科技	13,700	124,259.00	0.23
123	601098	中南传媒	10,000	124,200.00	0.23
124	002518	科士达	6,900	122,130.00	0.23
125	600765	中航重机	5,900	120,360.00	0.22
126	300595	欧普康视	7,600	119,168.00	0.22
127	300285	国瓷材料	6,500	116,025.00	0.22
128	300682	朗新集团	13,500	114,885.00	0.21
129	300058	蓝色光标	21,100	114,784.00	0.21
130	600153	建发股份	12,800	114,304.00	0.21
131	688385	复旦微电	3,600	112,968.00	0.21
132	688778	厦钨新能	3,582	111,901.68	0.21
133	002497	雅化集团	12,500	111,500.00	0.21
134	002414	高德红外	18,900	111,321.00	0.21
135	300861	美畅股份	5,700	110,295.00	0.21
136	603179	新泉股份	2,800	109,872.00	0.20
137	601991	大唐发电	36,500	109,865.00	0.20
138	600390	五矿资本	27,100	109,755.00	0.20
139	600177	雅戈尔	15,400	109,648.00	0.20
140	600435	北方导航	12,600	108,612.00	0.20
141	002368	太极股份	4,800	108,240.00	0.20
142	000893	亚钾国际	6,600	106,656.00	0.20
143	300390	天华新能	6,200	106,516.00	0.20
144	688006	杭可科技	6,000	104,700.00	0.20
145	000785	居然之家	42,400	103,032.00	0.19
146	000021	深科技	6,800	102,816.00	0.19
147	600827	百联股份	13,900	102,582.00	0.19
148	003031	中瓷电子	2,200	101,728.00	0.19

149	600839	四川长虹	22,400	100,576.00	0.19
150	002558	巨人网络	10,600	100,064.00	0.19
151	688063	派能科技	2,473	98,202.83	0.18
152	002025	航天电器	2,100	97,398.00	0.18
153	002500	山西证券	20,700	97,290.00	0.18
154	000887	中鼎股份	7,900	96,696.00	0.18
155	000739	普洛药业	7,100	96,347.00	0.18
156	601298	青岛港	10,000	95,600.00	0.18
157	688772	珠海冠宇	6,400	95,360.00	0.18
158	300529	健帆生物	3,500	95,235.00	0.18
159	002065	东华软件	20,700	93,564.00	0.17
160	605358	立昂微	4,000	92,560.00	0.17
161	603228	景旺电子	2,900	92,220.00	0.17
162	002984	森麒麟	3,800	91,542.00	0.17
163	002299	圣农发展	6,700	91,388.00	0.17
164	688032	禾迈股份	796	91,364.88	0.17
165	600380	健康元	8,100	90,477.00	0.17
166	600299	安迪苏	9,300	90,210.00	0.17
167	603486	科沃斯	1,900	89,642.00	0.17
168	688567	孚能科技	9,278	89,068.80	0.17
169	603127	昭衍新药	6,668	88,484.36	0.16
170	601666	平煤股份	7,900	88,480.00	0.16
171	002273	水晶光电	5,200	88,296.00	0.16
172	603885	吉祥航空	8,000	87,920.00	0.16
173	300558	贝达药业	2,700	87,885.00	0.16
174	300212	易华录	5,200	87,516.00	0.16
175	000921	海信家电	2,700	87,048.00	0.16
176	002867	周大生	6,600	86,196.00	0.16
177	000629	钒钛股份	34,300	85,750.00	0.16
178	603650	彤程新材	2,900	85,695.00	0.16
179	601598	中国外运	15,200	85,576.00	0.16

180	688520	神州细胞	2,139	84,169.65	0.16
181	600580	卧龙电驱	6,900	83,835.00	0.16
182	000831	中国稀土	3,300	83,655.00	0.16
183	300395	菲利华	2,700	83,025.00	0.15
184	688052	纳芯微	800	82,224.00	0.15
185	601016	节能风电	27,410	81,955.90	0.15
186	301358	湖南裕能	2,600	81,796.00	0.15
187	600483	福能股份	7,000	81,620.00	0.15
188	688390	固德威	1,453	81,542.36	0.15
189	688331	荣昌生物	1,800	77,760.00	0.14
190	600392	盛和资源	9,000	77,580.00	0.14
191	601567	三星医疗	2,200	77,000.00	0.14
192	688525	佰维存储	1,200	76,980.00	0.14
193	603816	顾家家居	2,300	74,267.00	0.14
194	603658	安图生物	1,600	73,712.00	0.14
195	688297	中无人机	2,220	73,326.60	0.14
196	600801	华新水泥	5,300	72,875.00	0.14
197	603000	人民网	3,600	71,964.00	0.13
198	601228	广州港	23,300	71,065.00	0.13
199	688348	昱能科技	1,200	70,800.00	0.13
200	600141	兴发集团	3,700	70,596.00	0.13
201	600546	山煤国际	4,800	70,176.00	0.13
202	603087	甘李药业	1,500	69,480.00	0.13
203	002262	恩华药业	2,900	68,846.00	0.13
204	002487	大金重工	3,000	68,640.00	0.13
205	688220	翱捷科技	1,800	67,428.00	0.13
206	600642	申能股份	7,600	67,108.00	0.13
207	601179	中国西电	8,300	66,732.00	0.12
208	688779	长远锂科	14,246	65,958.98	0.12
209	002945	华林证券	6,600	65,868.00	0.12
210	300024	机器人	6,700	65,258.00	0.12

211	300724	捷佳伟创	1,200	64,812.00	0.12
212	688005	容百科技	2,712	63,135.36	0.12
213	601615	明阳智能	6,600	62,304.00	0.12
214	000032	深桑达 A	4,100	61,418.00	0.11
215	600399	抚顺特钢	10,700	60,241.00	0.11
216	300251	光线传媒	7,100	59,711.00	0.11
217	300002	神州泰岳	7,300	59,276.00	0.11
218	688114	华大智造	1,201	56,939.41	0.11
219	600549	厦门钨业	3,200	55,200.00	0.10
220	000937	冀中能源	8,200	54,940.00	0.10
221	300604	长川科技	2,000	54,340.00	0.10
222	600118	中国卫星	2,400	53,352.00	0.10
223	000723	美锦能源	11,200	53,312.00	0.10
224	601958	金钼股份	5,100	53,091.00	0.10
225	001286	陕西能源	4,600	53,038.00	0.10
226	300888	稳健医疗	2,080	52,624.00	0.10
227	300073	当升科技	1,500	51,465.00	0.10
228	002155	湖南黄金	2,800	50,680.00	0.09
229	002429	兆驰股份	10,200	49,062.00	0.09
230	600704	物产中大	11,300	49,042.00	0.09
231	002261	拓维信息	4,400	48,708.00	0.09
232	600763	通策医疗	900	48,645.00	0.09
233	600707	彩虹股份	6,800	46,308.00	0.09
234	603882	金域医学	1,700	46,223.00	0.09
235	600956	新天绿能	5,600	45,752.00	0.09
236	600985	淮北矿业	2,700	45,198.00	0.08
237	001203	大中矿业	4,700	45,167.00	0.08
238	600498	烽火通信	2,800	44,520.00	0.08
239	601866	中远海发	17,200	44,376.00	0.08
240	603606	东方电缆	900	43,929.00	0.08
241	600578	京能电力	13,400	43,416.00	0.08

242	600316	洪都航空	2,600	43,238.00	0.08
243	002532	天山铝业	5,300	42,983.00	0.08
244	000537	中绿电	4,400	41,932.00	0.08
245	002432	九安医疗	1,000	40,540.00	0.08
246	600977	中国电影	3,700	39,812.00	0.07
247	002008	大族激光	1,900	39,520.00	0.07
248	300568	星源材质	4,800	39,360.00	0.07
249	600143	金发科技	5,900	38,999.00	0.07
250	688213	思特威	800	38,800.00	0.07
251	002608	江苏国信	5,000	38,750.00	0.07
252	002120	韵达股份	5,000	38,700.00	0.07
253	002244	滨江集团	5,300	38,478.00	0.07
254	002624	完美世界	5,000	38,000.00	0.07
255	688234	天岳先进	800	37,536.00	0.07
256	688516	奥特维	880	36,792.80	0.07
257	300438	鹏辉能源	2,000	36,680.00	0.07
258	603529	爱玛科技	1,300	35,529.00	0.07
259	603893	瑞芯微	600	35,502.00	0.07
260	002153	石基信息	6,194	35,491.62	0.07
261	300677	英科医疗	1,300	34,853.00	0.06
262	000997	新大陆	2,500	34,775.00	0.06
263	603160	汇顶科技	500	34,375.00	0.06
264	002673	西部证券	5,500	34,045.00	0.06
265	002531	天顺风能	3,800	33,972.00	0.06
266	002831	裕同科技	1,300	33,267.00	0.06
267	300776	帝尔激光	720	33,091.20	0.06
268	688387	信科移动	6,550	33,012.00	0.06
269	600352	浙江龙盛	3,600	30,924.00	0.06
270	300765	新诺威	1,200	30,276.00	0.06
271	603338	浙江鼎力	500	30,210.00	0.06
272	603939	益丰药房	1,200	29,460.00	0.05

273	601399	国机重装	11,400	29,412.00	0.05
274	600378	昊华科技	1,000	28,900.00	0.05
275	000050	深天马 A	3,900	28,392.00	0.05
276	600271	航天信息	3,800	27,968.00	0.05
277	603233	大参林	1,920	27,456.00	0.05
278	600315	上海家化	1,500	26,670.00	0.05
279	000967	盈峰环境	6,200	26,226.00	0.05
280	601212	白银有色	9,300	25,854.00	0.05
281	600032	浙江新能	3,400	24,752.00	0.05
282	688029	南微医学	400	24,624.00	0.05
283	600499	科达制造	2,900	24,447.00	0.05
284	300118	东方日升	2,000	24,200.00	0.05
285	002266	浙富控股	8,500	23,715.00	0.04
286	603218	日月股份	2,300	23,621.00	0.04
287	688301	奕瑞科技	200	23,046.00	0.04
288	688122	西部超导	600	22,992.00	0.04
289	600481	双良节能	4,900	22,883.00	0.04
290	688777	中控技术	600	22,620.00	0.04
291	300567	精测电子	400	22,604.00	0.04
292	601928	凤凰传媒	2,000	21,920.00	0.04
293	600598	北大荒	1,700	21,233.00	0.04
294	002056	横店东磁	1,700	21,199.00	0.04
295	600098	广州发展	3,300	21,120.00	0.04
296	301165	锐捷网络	700	20,888.00	0.04
297	002408	齐翔腾达	3,700	20,720.00	0.04
298	601158	重庆水务	4,300	20,640.00	0.04
299	600282	南钢股份	4,100	20,418.00	0.04
300	603728	鸣志电器	500	20,115.00	0.04
301	002572	索菲亚	1,300	19,929.00	0.04
302	601077	渝农商行	3,900	19,578.00	0.04
303	603868	飞科电器	500	19,200.00	0.04

304	002865	钧达股份	500	19,190.00	0.04
305	688819	天能股份	800	19,088.00	0.04
306	600126	杭钢股份	4,300	17,673.00	0.03
307	000958	电投产融	4,800	17,568.00	0.03
308	603290	斯达半导	200	17,222.00	0.03
309	600884	杉杉股份	2,000	16,240.00	0.03
310	603305	旭升集团	1,500	15,840.00	0.03
311	600369	西南证券	4,300	15,394.00	0.03
312	300009	安科生物	1,780	15,201.20	0.03
313	603456	九洲药业	1,100	15,092.00	0.03
314	002739	万达电影	1,200	14,508.00	0.03
315	002756	永兴材料	400	14,312.00	0.03
316	600155	华创云信	2,400	14,184.00	0.03
317	688375	国博电子	200	14,128.00	0.03
318	600655	豫园股份	2,700	13,905.00	0.03
319	000878	云南铜业	1,100	13,706.00	0.03
320	601216	君正集团	3,700	13,653.00	0.03
321	603688	石英股份	450	13,324.50	0.02
322	000039	中集集团	1,300	12,038.00	0.02
323	688248	南网科技	400	11,852.00	0.02
324	688276	百克生物	400	11,348.00	0.02
325	002423	中粮资本	1,500	11,235.00	0.02
326	600361	创新新材	2,700	10,881.00	0.02
327	601168	西部矿业	600	10,770.00	0.02
328	688521	芯原股份	400	10,700.00	0.02
329	300253	卫宁健康	1,800	10,620.00	0.02
330	600637	东方明珠	1,700	10,336.00	0.02
331	002019	亿帆医药	800	9,888.00	0.02
332	601456	国联证券	1,000	9,640.00	0.02
333	000009	中国宝安	1,000	8,600.00	0.02
334	603185	弘元绿能	500	8,545.00	0.02

335	300763	锦浪科技	200	8,328.00	0.02
336	600848	上海临港	900	8,199.00	0.02
337	688172	燕东微	500	8,090.00	0.02
338	002240	盛新锂能	600	8,052.00	0.02
339	600528	中铁工业	1,000	7,320.00	0.01
340	601608	中信重工	1,900	7,239.00	0.01
341	000825	太钢不锈	1,800	6,084.00	0.01
342	300003	乐普医疗	400	5,936.00	0.01
343	002557	洽洽食品	200	5,638.00	0.01
344	688002	睿创微纳	200	5,594.00	0.01

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	600030	中信证券	45,700	833,111.00	1.55
2	601668	中国建筑	116,400	618,084.00	1.15
3	600519	贵州茅台	300	440,217.00	0.82
4	603588	高能环境	37,600	236,128.00	0.44
5	000858	五粮液	1,800	230,472.00	0.43
6	002422	科伦药业	7,000	212,310.00	0.40
7	600019	宝钢股份	31,900	212,135.00	0.40
8	601881	中国银河	18,100	196,566.00	0.37
9	002318	久立特材	8,200	191,306.00	0.36
10	002332	仙琚制药	16,700	190,547.00	0.36
11	688085	三友医疗	10,800	182,520.00	0.34
12	600522	中天科技	10,900	172,765.00	0.32
13	600584	长电科技	4,600	145,866.00	0.27
14	601688	华泰证券	11,600	143,724.00	0.27
15	601816	京沪高铁	26,600	142,842.00	0.27
16	002541	鸿路钢构	8,300	140,851.00	0.26

17	603308	应流股份	10,800	134,136.00	0.25
18	000501	武商集团	20,100	134,067.00	0.25
19	603997	继峰股份	13,100	134,013.00	0.25
20	600761	安徽合力	6,000	129,840.00	0.24
21	601658	邮储银行	25,600	129,792.00	0.24
22	001914	招商积余	12,700	127,254.00	0.24
23	600710	苏美达	15,400	125,510.00	0.23
24	601838	成都银行	8,200	124,558.00	0.23
25	002736	国信证券	14,300	124,267.00	0.23
26	600461	洪城环境	10,700	123,906.00	0.23
27	600048	保利发展	13,900	121,764.00	0.23
28	002304	洋河股份	1,500	121,110.00	0.23
29	002555	三七互娱	9,100	118,755.00	0.22
30	600750	江中药业	5,000	115,550.00	0.22
31	688300	联瑞新材	2,400	115,440.00	0.22
32	000708	中信特钢	8,300	112,631.00	0.21
33	002737	葵花药业	4,700	109,886.00	0.20
34	603203	快克智能	4,600	108,468.00	0.20
35	600150	中国船舶	2,600	105,846.00	0.20
36	002027	分众传媒	15,500	93,930.00	0.18
37	600919	江苏银行	12,500	92,875.00	0.17
38	600233	圆通速递	5,700	89,205.00	0.17
39	002014	永新股份	9,100	86,268.00	0.16
40	600760	中航沈飞	2,000	80,200.00	0.15
41	600933	爱柯迪	5,100	75,429.00	0.14
42	300470	中密控股	2,200	74,382.00	0.14
43	600479	千金药业	7,300	74,241.00	0.14
44	002911	佛燃能源	8,110	74,125.40	0.14
45	300750	宁德时代	400	72,012.00	0.13
46	300627	华测导航	2,400	71,640.00	0.13
47	603129	春风动力	500	71,170.00	0.13

48	688100	威胜信息	1,860	70,959.00	0.13
49	601677	明泰铝业	6,000	69,360.00	0.13
50	600459	贵研铂业	5,100	68,901.00	0.13
51	603565	中谷物流	7,800	68,172.00	0.13
52	600161	天坛生物	2,500	61,000.00	0.11
53	600976	健民集团	1,100	55,550.00	0.10
54	603599	广信股份	4,400	53,372.00	0.10
55	301301	川宁生物	4,000	51,120.00	0.10
56	688019	安集科技	400	50,320.00	0.09
57	600273	嘉化能源	6,600	47,124.00	0.09
58	603300	华铁应急	8,100	44,226.00	0.08
59	002389	航天彩虹	2,900	40,281.00	0.08
60	002925	盈趣科技	3,100	39,277.00	0.07
61	603277	银都股份	1,300	39,052.00	0.07
62	002884	凌霄泵业	2,000	38,400.00	0.07
63	603283	赛腾股份	500	38,200.00	0.07
64	603699	纽威股份	2,200	37,664.00	0.07
65	603639	海利尔	3,000	36,510.00	0.07
66	001213	中铁特货	8,800	34,760.00	0.06
67	600309	万华化学	400	32,344.00	0.06
68	601001	晋控煤业	1,900	31,388.00	0.06
69	000983	山西焦煤	2,900	29,899.00	0.06
70	000923	河钢资源	1,700	29,274.00	0.05
71	300760	迈瑞医疗	100	29,091.00	0.05
72	600438	通威股份	1,500	28,665.00	0.05
73	600690	海尔智家	1,000	28,380.00	0.05
74	603279	景津装备	1,300	28,197.00	0.05
75	000807	云铝股份	2,000	27,020.00	0.05
76	601369	陕鼓动力	3,300	26,466.00	0.05
77	601872	招商轮船	3,000	25,350.00	0.05
78	600160	巨化股份	900	21,717.00	0.04

79	603558	健盛集团	2,000	19,900.00	0.04
80	601952	苏垦农发	2,200	19,844.00	0.04
81	688408	中信博	200	18,416.00	0.03
82	600028	中国石化	2,800	17,696.00	0.03
83	601877	正泰电器	900	17,154.00	0.03
84	600987	航民股份	2,400	16,944.00	0.03
85	000651	格力电器	400	15,688.00	0.03
86	400174	中天3	37,500	15,000.00	0.03
87	688190	云路股份	200	14,942.00	0.03
88	600176	中国巨石	1,300	14,365.00	0.03
89	600938	中国海油	400	13,200.00	0.02
90	000975	银泰黄金	800	13,032.00	0.02
91	600875	东方电气	700	12,915.00	0.02
92	603053	成都燃气	1,300	12,558.00	0.02
93	603899	晨光股份	400	12,512.00	0.02
94	688146	中船特气	400	11,940.00	0.02
95	000338	潍柴动力	700	11,368.00	0.02
96	000063	中兴通讯	400	11,188.00	0.02
97	600026	中远海能	700	10,927.00	0.02
98	603730	岱美股份	1,000	9,940.00	0.02
99	600064	南京高科	1,600	9,712.00	0.02
100	300476	胜宏科技	300	9,678.00	0.02
101	002015	协鑫能科	1,200	9,552.00	0.02
102	600018	上港集团	1,600	9,248.00	0.02
103	600886	国投电力	400	7,296.00	0.01
104	600036	招商银行	200	6,838.00	0.01
105	603855	华荣股份	300	6,633.00	0.01
106	300127	银河磁体	400	6,020.00	0.01
107	601601	中国太保	200	5,572.00	0.01

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	601555	东吴证券	1,165,293.00	1.98
2	601668	中国建筑	1,080,149.00	1.83
3	600030	中信证券	882,787.00	1.50
4	600585	海螺水泥	793,275.00	1.35
5	601128	常熟银行	681,875.00	1.16
6	600519	贵州茅台	661,440.00	1.12
7	601077	渝农商行	631,368.00	1.07
8	000513	丽珠集团	596,987.00	1.01
9	600036	招商银行	530,699.00	0.90
10	002372	伟星新材	521,701.00	0.89
11	300146	汤臣倍健	519,630.00	0.88
12	600177	雅戈尔	501,425.00	0.85
13	000932	华菱钢铁	501,372.00	0.85
14	300748	金力永磁	498,401.00	0.85
15	002078	太阳纸业	494,120.00	0.84
16	600096	云天化	493,368.00	0.84
17	603589	口子窖	479,426.00	0.81
18	600380	健康元	473,417.50	0.80
19	002690	美亚光电	455,967.00	0.77
20	600820	隧道股份	452,336.00	0.77

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	600585	海螺水泥	866,825.00	1.47
2	002078	太阳纸业	862,855.00	1.47
3	601211	国泰君安	785,242.00	1.33
4	600036	招商银行	745,594.00	1.27
5	600820	隧道股份	706,508.00	1.20
6	600177	雅戈尔	672,954.00	1.14
7	601077	渝农商行	642,235.00	1.09
8	600352	浙江龙盛	578,628.00	0.98
9	600030	中信证券	570,512.00	0.97
10	600901	江苏金租	563,901.00	0.96
11	002463	沪电股份	557,693.00	0.95
12	000630	铜陵有色	555,355.00	0.94
13	600282	南钢股份	542,464.00	0.92
14	601088	中国神华	532,455.00	0.90
15	600161	天坛生物	528,894.00	0.90
16	600497	驰宏锌锗	524,490.00	0.89
17	002532	天山铝业	509,077.00	0.86
18	600642	申能股份	506,390.00	0.86
19	000975	银泰黄金	499,619.00	0.85
20	000513	丽珠集团	489,176.00	0.83

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	112,802,963.26
卖出股票收入（成交）总额	114,037,115.43

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)	16,001.19	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,001.19	0.03

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	113685	升24转债	160	16,001.19	0.03

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、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,563.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,563.45

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中泰中证500指数增强A	1,257	10,352.77	999,560.32	7.68%	12,013,872.57	92.32%
中泰中证500指数增强C	3,610	9,837.74	0.00	0.00%	35,514,253.98	100.00%
合计	4,867	9,970.76	999,560.32	2.06%	47,528,126.55	97.94%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中泰中证500指数增强A	180,205.98	1.38%
	中泰中证500指数增强C	4,955.91	0.01%

	合计	185,161.89	0.38%
--	----	------------	-------

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中泰中证500指数增强A	0~10
	中泰中证500指数增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中泰中证500指数增强A	0
	中泰中证500指数增强C	0
	合计	0

注：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

	中泰中证500指数增强A	中泰中证500指数增强C
基金合同生效日(2019年12月11日)基金份额总额	107,120,144.91	190,368,684.73
本报告期期初基金份额总额	13,269,037.79	36,577,926.16
本报告期基金总申购份额	1,923,876.84	4,274,504.63
减：本报告期基金总赎回份额	2,179,481.74	5,338,176.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,013,432.89	35,514,253.98

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人中泰证券（上海）资产管理有限公司于2024年4月8日聘任史少杰先生担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	3	226,840,078.69	100.00%	51,488.44	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	2,636.03	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定网站	2024-01-19
2	中泰中证500指数增强型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定网站	2024-03-26
3	中泰中证500指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定网站	2024-04-22
4	中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2024年第1号	中国证监会规定网站	2024-05-17
5	中泰中证500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	2024-05-17

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰中证500指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰中证500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

11.3 查阅方式

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

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
二〇二四年八月二十八日