

中泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2025 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2025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.....	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.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人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.....	16
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.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65

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..... 65

§9 开放式基金份额变动.....66

§10 重大事件揭示.....66

10.1 基金份额持有人大会决议..... 66

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..... 66

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....66

10.4 基金投资策略的改变..... 66

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....66

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.....66

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....67

10.8 其他重大事件.....67

§11 备查文件目录.....68

11.1 备查文件目录.....68

11.2 存放地点.....69

11.3 查阅方式.....69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	中泰沪深300指数增强	
基金主代码	008238	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年04月01日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	262,134,019.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	008238	008239
报告期末下属分级基金的份额总额	143,113,277.54份	119,020,741.49份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深300指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场组合相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	王茵
	联系电话	021-20521199	010-63639180
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-821-0808	95595
传真		021-50933716	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号24楼05室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄文卿	吴利军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
本期已实现收益	4,565,139.14	4,402,942.02
本期利润	4,898,924.81	3,246,914.88
加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.0224
本期加权平均净值利润率	2.56%	1.64%
本期基金份额净值增长率	1.73%	1.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	62,212,905.08	48,185,946.26
期末可供分配基金份额利润	0.4347	0.4049
期末基金资产净值	205,326,182.62	167,206,687.75
期末基金份额净值	1.4347	1.4049
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	43.47%	40.49%

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指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

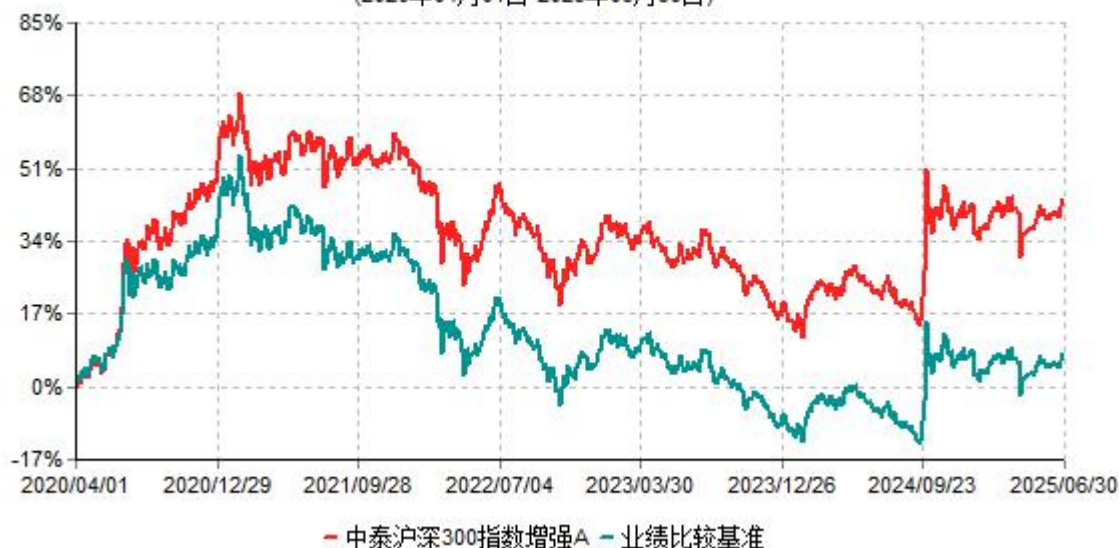
		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	3.19%	0.54%	2.37%	0.55%	0.82%	-0.01%
过去三个月	2.19%	1.01%	1.21%	1.04%	0.98%	-0.03%
过去六个月	1.73%	0.95%	0.07%	0.97%	1.66%	-0.02%
过去一年	17.39%	1.28%	13.12%	1.32%	4.27%	-0.04%
过去三年	-2.61%	1.01%	-11.43%	1.05%	8.82%	-0.04%
自基金合同生效起至今	43.47%	1.09%	6.97%	1.11%	36.50%	-0.02%

中泰沪深300指数增强C

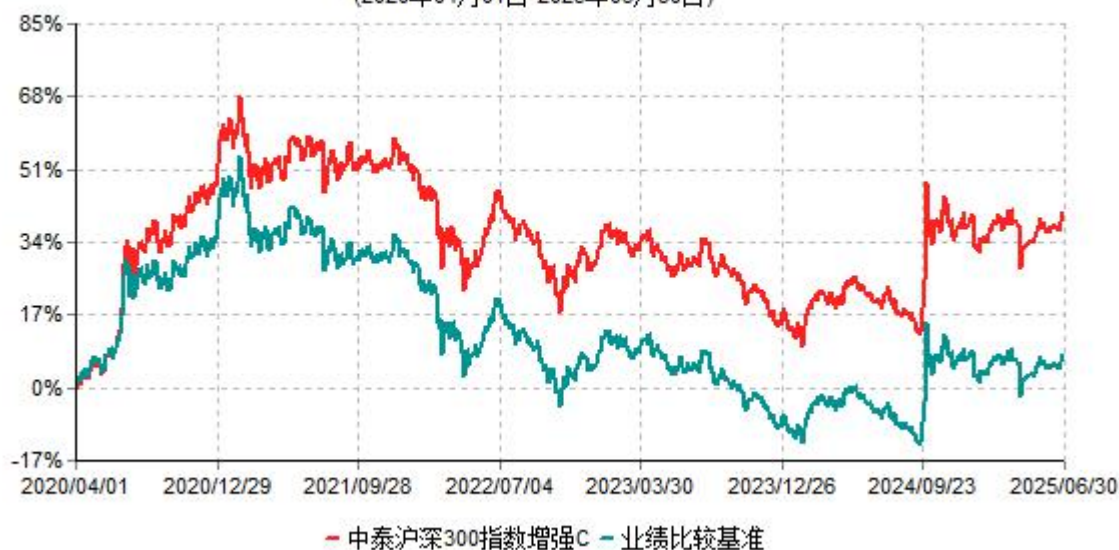
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.16%	0.54%	2.37%	0.55%	0.79%	-0.01%
过去三个月	2.09%	1.01%	1.21%	1.04%	0.88%	-0.03%
过去六个月	1.53%	0.95%	0.07%	0.97%	1.46%	-0.02%
过去一年	16.92%	1.28%	13.12%	1.32%	3.80%	-0.04%
过去三年	-3.77%	1.01%	-11.43%	1.05%	7.66%	-0.04%
自基金合同生效起至今	40.49%	1.09%	6.97%	1.11%	33.52%	-0.02%

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

中泰沪深300指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年04月01日-2025年06月30日)



中泰沪深300指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年04月01日-2025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2025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、中泰青月中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、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、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、中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金、中泰安弘债券型证券投资基金、中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金和中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金共三十三只证券投资基金。

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；量化公募投资部副总经理。	2020-04-01	-	21	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。2025年4月1日至今担任中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
李玉刚	本基金基金经理；研究部总经理兼量化公募投资部总经理。	2022-01-04	-	24	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基金经理。2022年1月4日至2024年12月25日期间担任沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。2022年1月4日至2025年4月16日期间担任中泰中证500指数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2025年5月11日期间担任中泰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。2025年4月1日至今担任中泰中证A500指数增强型发起式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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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

2025年上半年，虽然外部有美国“对等关税”冲击影响，但宏观政策持续发力支撑基本面，财政端专项债扩容，货币政策维持宽松，提振基建投资与流动性。消费专项行动推动社会消费品零售总额同比增长，新能源汽车和家电等耐用品消费韧性凸显。市场主题轮动明显，AI算力应用、人形机器人、创新药领涨，中小盘成长股显著占优。

判断市场风格，并根据市场的风格偏好调整组合，既不符合我们遵循的固有安全性原则，也超出我们的能力范围。本基金策略是选择那些能够持续创造价值并且估值合理的优秀公司，在控制跟踪误差的前提下，用它们来替代相同类型的成分股。

本基金仅利用多因子模型来解释波动和控制跟踪误差，而不是用它来预测收益和选股。从长期回报的角度来说，股票的收益来源只能来自于公司长期经营的积累。那些能够持续创造价值的优秀公司，它们的平均回报要高过市场的平均回报。所谓优秀公司，指的是从生意和商业逻辑的角度，通过深度研究筛选出来的能够持续创造超额价值的公

司。这个筛选过程是基于个案的深度研究驱动，而不是量化指标驱动。量化指标仅是历史结果，我们希望通过深度研究理解造就优秀的原因，以及是否可以持续。

在控制跟踪误差方面，我们基于聚类分析和因子分析，对股票进行重新分类，并约束“类中性”，而不是因子中性和行业中性。最终合意的增强组合，是求解一个数学规划问题，目标是最大化预期的超额回报，同时最小化跟踪误差。

本基金的超额收益来源主要体现在两方面：

一是用处于合理估值范围的优秀公司替代平庸的、并且是同类型的成份股公司。从长期来看，以合理价格持有优秀公司获得的回报要高于平庸公司的回报。

二是指数编制决定了成交越活跃、市值越大的股票越容易进入指数，但并没有考虑成份股公司是否有持续创造价值的能力，且成份股按照市值加权，成份股涨幅越大、市值越大权重就越大，所以我们会改变投资组合权重的决定方式，综合考虑预期回报和跟踪误差的约束，而不是按照市值加权。

本基金并不会去判断接下来市场会偏好哪些风格，或者哪些因子会表现好。我们的策略始终是用低估或合理估值的优秀公司替代同类型的成份股。当市场风格比较极端时，我们可能会落后市场。但因为严格地控制了跟踪误差，即便在不利的市场环境下，我们也不会落后指数太多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰沪深300指数增强A基金份额净值为1.4347元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.73%，同期业绩比较基准收益率为0.07%；截至报告期末中泰沪深300指数增强C基金份额净值为1.4049元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.53%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

居民财富和经济增长来源于个体间自由交换的不断拓展。一个保护个体产权、社会分工持续深化的经济体，其经济增长和居民财富是持续向上的。这是权益投资的最终收益来源。本基金希望通过“以合理的价格、分散化的持有能持续创造价值的优秀公司”，来分享国家经济增长的成果，并实现基金资产的增值。

但是，宏观变量并非本基金投资决策的依赖变量。大部分的宏观经济事件是一个很长的因果链条，反映的是一系列的事件和可能性，任何一个环节的微小变动，都有可能导向完全不同的结果。基于宏观变量进行的判断，往往是不可靠的。

对具体公司和具体生意的研究，更有客观性和科学性，由此得出的判断更有决策价值。相比于担忧经济接下去会怎样，我们更关心在逆境中哪些公司会变得更强大。

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

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

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露

等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中泰沪深300指数增强型证券投资基金2025年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 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指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	21,733,624.41	29,895,043.24
结算备付金		5,135,886.08	3,544,426.07
存出保证金		-	140,810.40
交易性金融资产	6.4.7.2	346,859,193.58	389,453,157.57
其中：股票投资		346,858,793.55	389,453,157.57
基金投资		-	-
债券投资		400.03	-
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		614,660.11	3,909,895.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		374,343,364.18	426,943,332.53
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		1,393,580.67	7,081,602.27
应付管理人报酬		249,229.36	292,261.30
应付托管费		31,153.64	36,532.70
应付销售服务费		56,947.09	80,104.83
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	79,583.05	210,582.37
负债合计		1,810,493.81	7,701,083.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	262,134,019.03	300,452,978.91
未分配利润	6.4.7.8	110,398,851.34	118,789,270.15
净资产合计		372,532,870.37	419,242,249.06
负债和净资产总计		374,343,364.18	426,943,332.53

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额总额262,134,019.03份，其中A类份额143,113,277.54份，C类份额119,020,741.49份。A类份额净值1.4347元，C类份额净值1.4049元。

6.2 利润表

会计主体：中泰沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		10,376,869.94	3,254,284.17
1.利息收入		101,010.26	65,270.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	101,010.26	65,270.84
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）		10,945,926.82	142,535.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,670,911.44	-2,754,526.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,733.81	-
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	-82,714.66	154,250.35
股利收益	6.4.7.13	4,352,996.23	2,742,811.17
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.14	-822,241.47	2,944,138.35

以“-”号填列)			
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	152,174.33	102,339.92
减：二、营业总支出		2,231,030.25	1,254,204.45
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,547,316.92	800,010.37
2.托管费	6.4.10.2.2	193,414.55	100,001.24
3.销售服务费	6.4.10.2.3	394,248.23	172,453.19
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		-	834.43
8.其他费用	6.4.7.16	96,050.55	180,905.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		8,145,839.69	2,000,079.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		8,145,839.69	2,000,079.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,145,839.69	2,000,079.72

6.3 净资产变动表

会计主体：中泰沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2025年01月01日至2025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	300,452,978.91	118,789,270.15	419,242,249.06
二、本期期初净资产	300,452,978.91	118,789,270.15	419,242,249.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,318,959.88	-8,390,418.81	-46,709,378.69
（一）、综合收益总额	-	8,145,839.69	8,145,839.69
（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）	-38,318,959.88	-16,536,258.50	-54,855,218.38
其中：1.基金申购款	121,048,927.33	44,244,309.03	165,293,236.36
2.基金赎回款	-159,367,887.21	-60,780,567.53	-220,148,454.74
（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	262,134,019.03	110,398,851.34	372,532,870.37
项 目	上年度可比期间		
	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	146,006,751.13	28,307,779.34	174,314,530.47
二、本期期初净资产	146,006,751.13	28,307,779.34	174,314,530.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号	79,081,007.22	19,286,229.03	98,367,236.25

填列)			
(一)、综合收益总额	-	2,000,079.72	2,000,079.72
(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)	79,081,007.22	17,286,149.31	96,367,156.53
其中: 1.基金申购款	134,524,984.52	28,996,141.55	163,521,126.07
2.基金赎回款	-55,443,977.30	-11,709,992.24	-67,153,969.54
(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	225,087,758.35	47,594,008.37	272,681,766.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中泰沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2019]2115号《关于准予中泰沪深300指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币555,940,813.06元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0248号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》于2020年4月1日正式生效,基金合同生效日的

基金份额总额为556,129,042.30份，其中认购资金利息折合188,229.24份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和《中泰沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券以及中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金和应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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2025年8月27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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)

颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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2025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2025年6月30日的财务状况以及2025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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	3,381,454.07
等于：本金	3,380,981.30
加：应计利息	472.77
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	18,352,170.34
等于：本金	18,348,484.24
加：应计利息	3,686.10
减：坏账准备	-
合计	21,733,624.41

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 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		328,357,880.29	-	346,858,793.55	18,500,913.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	400.00	0.03	400.03	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	400.00	0.03	400.03	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		328,358,280.29	0.03	346,859,193.58	18,500,913.26

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	239.89
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	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	79,583.05

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中泰沪深300指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300指数增强A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,295,584.78	132,295,584.78
本期申购	56,688,034.37	56,688,034.37
本期赎回（以“-”号填列）	-45,870,341.61	-45,870,341.61
本期末	143,113,277.54	143,113,277.54

6.4.7.7.2 中泰沪深300指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300指数增强C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	168,157,394.13	168,157,394.13
本期申购	64,360,892.96	64,360,892.96
本期赎回（以“-”号填列）	-113,497,545.60	-113,497,545.60
本期末	119,020,741.49	119,020,741.49

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中泰沪深300指数增强A

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,209,998.09	-1,935,241.06	54,274,757.03
本期期初	56,209,998.09	-1,935,241.06	54,274,757.03
本期利润	4,565,139.14	333,785.67	4,898,924.81
本期基金份额交易产生的变动数	4,920,522.99	-1,881,299.75	3,039,223.24
其中：基金申购款	25,093,390.22	-3,932,036.74	21,161,353.48
基金赎回款	-20,172,867.23	2,050,736.99	-18,122,130.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,695,660.22	-3,482,755.14	62,212,905.08

6.4.7.8.2 中泰沪深300指数增强C

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	67,245,336.04	-2,730,822.92	64,514,513.12
本期期初	67,245,336.04	-2,730,822.92	64,514,513.12
本期利润	4,402,942.02	-1,156,027.14	3,246,914.88
本期基金份额交易产生的变动数	-20,390,656.94	815,175.20	-19,575,481.74
其中：基金申购款	26,583,491.93	-3,500,536.38	23,082,955.55
基金赎回款	-46,974,148.87	4,315,711.58	-42,658,437.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,257,621.12	-3,071,674.86	48,185,946.26

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	17,187.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	66,612.37
结算备付金利息收入	17,209.95
其他	-
合计	101,010.26

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	410,818,015.20
减：卖出股票成本总额	403,736,534.51
减：交易费用	410,569.25
买卖股票差价收入	6,670,911.44

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 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	3.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,729.98
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,733.81

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	43,836.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,100.00
减：应计利息总额	3.80
减：交易费用	2.99
买卖债券差价收入	4,729.98

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
期货投资	-82,714.66

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,352,996.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,352,996.23

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-838,021.47
——股票投资	-838,021.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	15,780.00
——权证投资	-
——期货投资	15,780.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-822,241.47

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	151,412.58
其他	374.32

基金转换费收入	387.43
合计	152,174.33

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	2,754.11
指数使用费	13,953.28
合计	96,050.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,547,316.92	800,010.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	670,240.57	326,450.48
应支付基金管理人的净管理费	877,076.35	473,559.89

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	193,414.55	100,001.24

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C	合计
光大银行	0.00	20,094.84	20,094.84
中泰证券	0.00	23,457.39	23,457.39
中泰资管	0.00	3,674.76	3,674.76
合计	0.00	47,226.99	47,226.99
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	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		
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C	合计
光大银行	0.00	19,731.52	19,731.52
中泰证券	0.00	25,759.99	25,759.99
中泰资管	0.00	15,705.17	15,705.17
合计	0.00	61,196.68	61,196.68

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰资管，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：
日销售服务费＝前一日C类基金资产净值×0.40%÷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

中泰沪深300指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年06月30日
基金合同生效日（2020年04月01日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	5,110,518.20	5,110,518.20
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	5,110,518.20	5,110,518.20
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.57%	4.74%

中泰沪深300指数增强C

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年06月30日
基金合同生效日（2020年04月01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%	0.00%

注：1、关联方投资本基金适用的费率按照公告的费率条款执行，符合本基金法律文件约定。

2、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。

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	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	3,381,454.07	17,187.94	16,418,173.80	23,463.86

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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（2025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
301458	钧威电子	2025-01-02	6个月	创业板打新限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6个月	创业板打新限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6个月	科创板打新限售	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025-06-19	18个交易日	科创板打新限售送股	-	79.68	52	-	4,143.36	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月	创业板打新限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6个月	创业板打新限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6个月	创业板打新限售	39.92	45.22	224	8,942.08	10,129.28	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	4个月	创业板打新限售送股	-	45.22	101	-	4,567.22	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6个月	创业板打新限售	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-

301479	弘景光电	2025-05-28	4个月	创业板打新限售 送股	-	77.87	52	-	4,049.24	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6个月	创业板打新限售	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
001388	信通电子	2025-06-24	5个交易日	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6个月	科创板打新限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	新股锁定	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6个月	创业板打新限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6个月	新股锁定	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6个月	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航新能	2025-03-26	6个月	创业板打新限售	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6个月	创业板打新限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6个月	创业板打新限售	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6个月	新股锁定	26.50	32.68	199	5,273.50	6,503.32	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6个月	创业板打新限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6个月	创业板打新限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6个月	创业板打新限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6个月	新股锁定	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6个月	新股锁定	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

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
123257	安克转债	2025-06-16	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	4	400.00	400.03	-

注：1、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中需要限售的部分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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不

得转让。

3、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	400.03	-
未评级	-	-
合计	400.03	-

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约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公司的证券不得超过该证券的10%。本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、5%以内债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2025年 06月30	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

日							
资产							
货币资金	21,733,624.41	-	-	-	-	-	21,733,624.41
结算备付金	5,135,886.08	-	-	-	-	-	5,135,886.08
交易性金融资产	-	-	-	-	400.03	346,858,793.55	346,859,193.58
应收申购款	-	-	-	-	-	614,660.11	614,660.11
资产总计	26,869,510.49	-	-	-	400.03	347,473,453.66	374,343,364.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,393,580.67	1,393,580.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,229.36	249,229.36
应付托管费	-	-	-	-	-	31,153.64	31,153.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	56,947.09	56,947.09
其他负债	-	-	-	-	-	79,583.05	79,583.05
负债总计	-	-	-	-	-	1,810,493.81	1,810,493.81
利率敏感度缺口	26,869,510.49	-	-	-	400.03	345,662,959.85	372,532,870.37
上年度末 2024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	29,895,043.24	-	-	-	-	-	29,895,043.24
结算备付金	3,544,426.07	-	-	-	-	-	3,544,426.07

存出保证金	-	-	-	-	-	140,810.40	140,810.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	389,453,157.57	389,453,157.57
应收申购款	-	-	-	-	-	3,909,895.25	3,909,895.25
资产总计	33,439,469.31	-	-	-	-	393,503,863.22	426,943,332.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,081,602.27	7,081,602.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	292,261.30	292,261.30
应付托管费	-	-	-	-	-	36,532.70	36,532.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	80,104.83	80,104.83
其他负债	-	-	-	-	-	210,582.37	210,582.37
负债总计	-	-	-	-	-	7,701,083.47	7,701,083.47
利率敏感度缺口	33,439,469.31	-	-	-	-	385,802,779.75	419,242,249.06

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	346,858,793.55	93.11	389,453,157.57	92.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	400.03	-	-	-
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	346,859,193.58	93.11	389,453,157.57	92.89

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系数来衡量股票及基金投资的系统性风险，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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	比较基准上升5%	17,349,702.46	19,682,551.36
	比较基准下降5%	-17,349,702.46	-19,682,551.36

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	346,556,995.60	388,868,460.62
第二层次	15,785.57	66,002.50
第三层次	286,412.41	518,694.45
合计	346,859,193.58	389,453,157.57

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2025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（2024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	346,858,793.55	92.66
	其中：股票	346,858,793.55	92.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	400.03	0.00
	其中：债券	400.03	0.00
	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	26,869,510.49	7.18
8	其他各项资产	614,660.11	0.16
9	合计	374,343,364.18	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	4,943,822.90	1.33
B	采矿业	17,419,750.00	4.68
C	制造业	159,262,813.26	42.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,226,991.00	3.28
E	建筑业	7,299,904.00	1.96
F	批发和零售业	634,356.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	10,488,492.60	2.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,830,828.23	4.25
J	金融业	94,077,603.64	25.25
K	房地产业	2,257,470.00	0.61
L	租赁和商务服务业	1,497,255.53	0.40
M	科学研究和技术服务业	3,587,324.25	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,480,128.00	0.40

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	331,006,739.41	88.85

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	24,233.00	0.01
C	制造业	13,963,382.00	3.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,720.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,292,209.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	386,833.78	0.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	28,812.00	0.01
L	租赁和商务服务业	54,961.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	14,499.36	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	83,160.00	0.02
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	15,852,054.14	4.26

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	600519	贵州茅台	11,353	16,002,280.56	4.30
2	300750	宁德时代	46,660	11,768,585.20	3.16
3	600036	招商银行	250,346	11,503,398.70	3.09
4	601318	中国平安	207,100	11,489,908.00	3.08
5	601398	工商银行	1,126,500	8,550,135.00	2.30
6	601899	紫金矿业	371,500	7,244,250.00	1.94
7	600900	长江电力	215,200	6,486,128.00	1.74
8	601166	兴业银行	273,700	6,388,158.00	1.71
9	000333	美的集团	84,600	6,108,120.00	1.64
10	300059	东方财富	253,400	5,861,142.00	1.57
11	002594	比亚迪	17,500	5,808,425.00	1.56
12	000858	五粮液	45,600	5,421,840.00	1.46
13	600030	中信证券	183,335	5,063,712.70	1.36
14	600938	中国海油	183,100	4,780,741.00	1.28
15	601668	中国建筑	790,600	4,561,762.00	1.22
16	688981	中芯国际	47,707	4,206,326.19	1.13
17	600276	恒瑞医药	75,592	3,923,224.80	1.05
18	601288	农业银行	651,600	3,831,408.00	1.03
19	601328	交通银行	474,800	3,798,400.00	1.02
20	600919	江苏银行	291,900	3,485,286.00	0.94
21	300760	迈瑞医疗	15,500	3,483,625.00	0.94
22	601211	国泰海通	175,962	3,371,431.92	0.91

23	000651	格力电器	74,600	3,351,032.00	0.90
24	601601	中国太保	88,300	3,312,133.00	0.89
25	603259	药明康德	47,115	3,276,848.25	0.88
26	600000	浦发银行	234,900	3,260,412.00	0.88
27	601816	京沪高铁	559,800	3,218,850.00	0.86
28	002230	科大讯飞	63,700	3,049,956.00	0.82
29	000100	TCL科技	663,760	2,874,080.80	0.77
30	002371	北方华创	5,900	2,609,039.00	0.70
31	300498	温氏股份	151,000	2,579,080.00	0.69
32	300308	中际旭创	16,640	2,427,110.40	0.65
33	002475	立讯精密	69,900	2,424,831.00	0.65
34	688041	海光信息	16,989	2,400,375.81	0.64
35	601688	华泰证券	134,300	2,391,883.00	0.64
36	002714	牧原股份	56,290	2,364,742.90	0.63
37	601390	中国中铁	421,200	2,362,932.00	0.63
38	601838	成都银行	115,800	2,327,580.00	0.62
39	601766	中国中车	327,400	2,304,896.00	0.62
40	603501	豪威集团	18,000	2,297,700.00	0.62
41	603019	中科曙光	32,300	2,273,920.00	0.61
42	600048	保利发展	278,700	2,257,470.00	0.61
43	002736	国信证券	194,700	2,242,944.00	0.60
44	600795	国电电力	461,000	2,231,240.00	0.60
45	601088	中国神华	55,000	2,229,700.00	0.60
46	000568	泸州老窖	19,446	2,205,176.40	0.59
47	601728	中国电信	280,300	2,172,325.00	0.58
48	002142	宁波银行	79,362	2,171,344.32	0.58
49	601919	中远海控	144,290	2,170,121.60	0.58
50	600941	中国移动	19,000	2,138,450.00	0.57
51	002352	顺丰控股	42,800	2,086,928.00	0.56
52	601012	隆基绿能	136,500	2,050,230.00	0.55
53	601939	建设银行	211,800	1,999,392.00	0.54

54	300274	阳光电源	29,000	1,965,330.00	0.53
55	601021	春秋航空	35,300	1,964,445.00	0.53
56	603986	兆易创新	15,500	1,961,215.00	0.53
57	600426	华鲁恒升	89,800	1,945,966.00	0.52
58	300502	新易盛	15,160	1,925,623.20	0.52
59	600025	华能水电	199,300	1,903,315.00	0.51
60	600031	三一重工	105,202	1,888,375.90	0.51
61	601881	中国银河	109,100	1,871,065.00	0.50
62	002179	中航光电	45,326	1,829,357.36	0.49
63	000001	平安银行	149,400	1,803,258.00	0.48
64	600016	民生银行	366,200	1,739,450.00	0.47
65	601127	赛力斯	12,800	1,719,296.00	0.46
66	600309	万华化学	31,600	1,714,616.00	0.46
67	601138	工业富联	79,500	1,699,710.00	0.46
68	688256	寒武纪	2,815	1,693,222.50	0.45
69	600570	恒生电子	49,680	1,666,267.20	0.45
70	688012	中微公司	8,972	1,635,595.60	0.44
71	600585	海螺水泥	75,500	1,620,985.00	0.44
72	600760	中航沈飞	27,420	1,607,360.40	0.43
73	600660	福耀玻璃	27,000	1,539,270.00	0.41
74	600111	北方稀土	60,800	1,513,920.00	0.41
75	300015	爱尔眼科	118,600	1,480,128.00	0.40
76	600690	海尔智家	59,600	1,476,888.00	0.40
77	600150	中国船舶	45,000	1,464,300.00	0.39
78	000338	潍柴动力	94,000	1,445,720.00	0.39
79	600547	山东黄金	44,300	1,414,499.00	0.38
80	002050	三花智控	53,400	1,408,692.00	0.38
81	600887	伊利股份	50,439	1,406,239.32	0.38
82	601225	陕西煤业	72,100	1,387,204.00	0.37
83	600999	招商证券	78,500	1,380,815.00	0.37
84	688111	金山办公	4,909	1,374,765.45	0.37

85	000938	紫光股份	56,600	1,357,834.00	0.36
86	000425	徐工机械	174,500	1,355,865.00	0.36
87	002311	海大集团	22,000	1,288,980.00	0.35
88	688008	澜起科技	15,645	1,282,890.00	0.34
89	600406	国电南瑞	57,088	1,279,342.08	0.34
90	600183	生益科技	39,800	1,199,970.00	0.32
91	300394	天孚通信	14,920	1,191,212.80	0.32
92	600015	华夏银行	149,200	1,180,172.00	0.32
93	300408	三环集团	35,300	1,179,020.00	0.32
94	002027	分众传媒	159,300	1,162,890.00	0.31
95	688036	传音控股	13,870	1,105,439.00	0.30
96	000063	中兴通讯	33,100	1,075,419.00	0.29
97	601901	方正证券	133,100	1,052,821.00	0.28
98	600600	青岛啤酒	13,900	965,494.00	0.26
99	002709	天赐材料	52,600	953,112.00	0.26
100	002241	歌尔股份	40,800	951,456.00	0.26
101	601169	北京银行	135,600	926,148.00	0.25
102	600436	片仔癀	4,600	920,046.00	0.25
103	002460	赣锋锂业	26,500	894,905.00	0.24
104	600161	天坛生物	46,420	890,799.80	0.24
105	003816	中国广核	242,800	883,792.00	0.24
106	601989	中国重工	185,700	861,648.00	0.23
107	002415	海康威视	30,600	848,538.00	0.23
108	002466	天齐锂业	25,900	829,836.00	0.22
109	002129	TCL中环	104,625	803,520.00	0.22
110	601100	恒立液压	10,800	777,600.00	0.21
111	601633	长城汽车	36,100	775,428.00	0.21
112	600176	中国巨石	67,859	773,592.60	0.21
113	601877	正泰电器	33,400	757,178.00	0.20
114	300433	蓝思科技	33,900	755,970.00	0.20
115	601872	招商轮船	117,000	732,420.00	0.20

116	300124	汇川技术	11,300	729,641.00	0.20
117	002600	领益智造	84,100	722,419.00	0.19
118	000786	北新建材	27,100	717,608.00	0.19
119	002001	新 和 成	32,100	682,767.00	0.18
120	000895	双汇发展	27,100	661,511.00	0.18
121	601995	中金公司	18,500	654,160.00	0.18
122	000725	京东方 A	160,000	638,400.00	0.17
123	688271	联影医疗	4,928	629,502.72	0.17
124	600438	通威股份	35,979	602,648.25	0.16
125	301236	软通动力	10,900	595,576.00	0.16
126	300316	晶盛机电	21,700	589,155.00	0.16
127	002028	思源电气	7,700	561,407.00	0.15
128	600893	航发动力	14,100	543,414.00	0.15
129	000625	长安汽车	42,570	543,193.20	0.15
130	300896	爱美客	3,100	541,911.00	0.15
131	600741	华域汽车	30,300	534,795.00	0.14
132	300661	圣邦股份	7,309	531,875.93	0.14
133	300782	卓胜微	7,300	521,001.00	0.14
134	688047	龙芯中科	3,573	476,602.47	0.13
135	000807	云铝股份	28,900	461,822.00	0.12
136	002236	大华股份	27,800	441,464.00	0.12
137	000963	华东医药	10,800	435,888.00	0.12
138	688599	天合光能	29,433	427,661.49	0.11
139	600346	恒力石化	29,900	426,374.00	0.11
140	603260	合盛硅业	8,500	402,900.00	0.11
141	601009	南京银行	34,000	395,080.00	0.11
142	300418	昆仑万维	11,500	386,745.00	0.10
143	300442	润泽科技	7,800	386,334.00	0.10
144	600039	四川路桥	37,900	375,210.00	0.10
145	601985	中国核电	39,900	371,868.00	0.10
146	603392	万泰生物	6,000	366,000.00	0.10

147	601058	赛轮轮胎	27,600	362,112.00	0.10
148	000977	浪潮信息	7,000	356,160.00	0.10
149	002459	晶澳科技	35,384	353,132.32	0.09
150	300122	智飞生物	17,800	348,702.00	0.09
151	600104	上汽集团	20,800	333,840.00	0.09
152	601878	浙商证券	27,700	302,207.00	0.08
153	000157	中联重科	41,000	296,430.00	0.08
154	300759	康龙化成	12,000	294,480.00	0.08
155	605499	东鹏饮料	900	282,645.00	0.08
156	601077	渝农商行	38,600	275,604.00	0.07
157	601698	中国卫通	12,600	257,922.00	0.07
158	002049	紫光国微	3,900	256,854.00	0.07
159	601066	中信建投	10,500	252,525.00	0.07
160	600332	白云山	9,500	250,420.00	0.07
161	002422	科伦药业	6,900	247,848.00	0.07
162	002916	深南电路	2,150	231,791.50	0.06
163	600926	杭州银行	13,600	228,752.00	0.06
164	601136	首创证券	11,200	222,656.00	0.06
165	600584	长电科技	6,500	218,985.00	0.06
166	300033	同花顺	800	218,408.00	0.06
167	603799	华友钴业	5,810	215,086.20	0.06
168	601888	中国中免	3,449	210,285.53	0.06
169	601607	上海医药	11,100	198,468.00	0.05
170	301269	华大九天	1,600	198,208.00	0.05
171	600050	中国联通	37,000	197,580.00	0.05
172	603288	海天味业	5,000	194,550.00	0.05
173	601916	浙商银行	53,700	182,043.00	0.05
174	600588	用友网络	13,500	180,495.00	0.05
175	002252	上海莱士	26,200	179,994.00	0.05
176	603296	华勤技术	2,200	177,496.00	0.05
177	300999	金龙鱼	5,800	171,274.00	0.05

178	600018	上港集团	29,200	166,732.00	0.04
179	000975	山金国际	8,800	166,672.00	0.04
180	600011	华能国际	22,800	162,792.00	0.04
181	300413	芒果超媒	7,400	161,468.00	0.04
182	600089	特变电工	13,500	161,055.00	0.04
183	601628	中国人寿	3,700	152,403.00	0.04
184	600085	同仁堂	4,100	147,846.00	0.04
185	300014	亿纬锂能	3,200	146,592.00	0.04
186	688169	石头科技	901	141,051.55	0.04
187	600415	小商品城	6,000	124,080.00	0.03
188	300628	亿联网络	3,500	121,660.00	0.03
189	601006	大秦铁路	18,400	121,440.00	0.03
190	000661	长春高新	1,200	119,016.00	0.03
191	600196	复星医药	4,700	117,923.00	0.03
192	603195	公牛集团	2,380	114,835.00	0.03
193	002180	纳思达	5,000	114,700.00	0.03
194	601799	星宇股份	900	112,500.00	0.03
195	600160	巨化股份	3,800	108,984.00	0.03
196	688396	华润微	2,219	104,648.04	0.03
197	002648	卫星化学	5,800	100,514.00	0.03
198	000538	云南白药	1,800	100,422.00	0.03
199	603833	欧派家居	1,600	90,320.00	0.02
200	601336	新华保险	1,500	87,750.00	0.02
201	600845	宝信软件	3,600	85,032.00	0.02
202	600066	宇通客车	3,300	82,038.00	0.02
203	600489	中金黄金	5,600	81,928.00	0.02
204	600023	浙能电力	13,100	69,430.00	0.02
205	000999	华润三九	2,180	68,190.40	0.02
206	601699	潞安环能	6,000	63,300.00	0.02
207	688223	晶科能源	11,611	60,261.09	0.02
208	000630	铜陵有色	17,600	58,784.00	0.02

209	600372	中航机载	4,300	51,858.00	0.01
210	002920	德赛西威	500	51,065.00	0.01
211	688126	沪硅产业	2,292	42,906.24	0.01
212	600905	三峡能源	9,500	40,470.00	0.01
213	600027	华电国际	7,200	39,384.00	0.01
214	603806	福斯特	3,000	38,880.00	0.01
215	002463	沪电股份	800	34,064.00	0.01
216	600362	江西铜业	1,300	30,459.00	0.01
217	601825	沪农商行	2,700	26,190.00	0.01
218	000983	山西焦煤	4,000	25,600.00	0.01
219	000800	一汽解放	3,500	24,010.00	0.01
220	600803	新奥股份	1,200	22,680.00	0.01
221	600061	国投资本	2,800	21,056.00	0.01
222	000768	中航西飞	700	19,138.00	0.01
223	302132	中航成飞	200	17,588.00	0.00
224	600460	士兰微	700	17,374.00	0.00
225	000408	藏格矿业	400	17,068.00	0.00
226	300347	泰格医药	300	15,996.00	0.00
227	601998	中信银行	1,800	15,300.00	0.00
228	600377	宁沪高速	900	13,806.00	0.00
229	603993	洛阳钼业	1,600	13,472.00	0.00
230	001289	龙源电力	800	12,944.00	0.00
231	600010	包钢股份	7,200	12,888.00	0.00
232	688009	中国通号	2,462	12,654.68	0.00
233	601808	中海油服	900	12,384.00	0.00
234	688303	大全能源	547	11,662.04	0.00
235	300832	新产业	200	11,344.00	0.00
236	601600	中国铝业	1,600	11,264.00	0.00
237	000708	中信特钢	800	9,408.00	0.00
238	601865	福莱特	600	9,126.00	0.00
239	601059	信达证券	500	8,550.00	0.00

240	600989	宝丰能源	500	8,070.00	0.00
241	601377	兴业证券	1,300	8,047.00	0.00
242	600219	南山铝业	1,900	7,277.00	0.00
243	601360	三六零	700	7,140.00	0.00
244	002074	国轩高科	200	6,492.00	0.00
245	600009	上海机场	200	6,354.00	0.00
246	601229	上海银行	500	5,305.00	0.00
247	600958	东方证券	500	4,840.00	0.00
248	600482	中国动力	200	4,614.00	0.00
249	000166	申万宏源	800	4,016.00	0.00
250	000617	中油资本	500	3,650.00	0.00
251	002938	鹏鼎控股	100	3,203.00	0.00
252	600886	国投电力	200	2,948.00	0.00
253	601658	邮储银行	500	2,735.00	0.00
254	600019	宝钢股份	400	2,636.00	0.00
255	600233	圆通速递	200	2,578.00	0.00
256	600115	中国东航	600	2,418.00	0.00
257	001965	招商公路	200	2,400.00	0.00
258	601988	中国银行	400	2,248.00	0.00
259	000776	广发证券	100	1,681.00	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	002472	双环传动	50,600	1,694,594.00	0.45
2	600298	安琪酵母	37,100	1,304,807.00	0.35
3	002223	鱼跃医疗	33,000	1,174,800.00	0.32
4	000933	神火股份	59,900	996,736.00	0.27
5	600862	中航高科	34,800	907,584.00	0.24

6	300470	中密控股	20,200	742,754.00	0.20
7	300373	扬杰科技	14,100	731,790.00	0.20
8	002318	久立特材	30,300	708,717.00	0.19
9	688235	百济神州	2,896	676,621.44	0.18
10	000683	博源化工	133,300	638,507.00	0.17
11	603100	川仪股份	27,000	557,010.00	0.15
12	000429	粤高速 A	40,500	539,865.00	0.14
13	002850	科达利	4,100	463,997.00	0.12
14	600282	南钢股份	103,700	435,540.00	0.12
15	603885	吉祥航空	32,000	431,040.00	0.12
16	002595	豪迈科技	6,500	384,930.00	0.10
17	600885	宏发股份	15,820	352,944.20	0.09
18	603444	吉比特	1,100	332,145.00	0.09
19	600522	中天科技	22,200	321,012.00	0.09
20	600486	扬农化工	3,900	226,200.00	0.06
21	603565	中谷物流	18,800	179,540.00	0.05
22	002003	伟星股份	15,700	171,287.00	0.05
23	600563	法拉电子	1,400	152,726.00	0.04
24	600285	羚锐制药	6,500	147,355.00	0.04
25	688085	三友医疗	7,279	139,975.17	0.04
26	688019	安集科技	777	117,948.60	0.03
27	600096	云天化	5,200	114,244.00	0.03
28	002064	华峰化学	15,600	103,116.00	0.03
29	601298	青岛港	10,600	92,114.00	0.02
30	601827	三峰环境	9,900	83,160.00	0.02
31	600352	浙江龙盛	6,600	67,056.00	0.02
32	601567	三星医疗	2,800	62,776.00	0.02
33	002332	仙琚制药	6,500	59,605.00	0.02
34	603699	纽威股份	1,800	56,106.00	0.02
35	600153	建发股份	5,300	54,961.00	0.01
36	002078	太阳纸业	3,800	51,148.00	0.01

37	001872	招商港口	2,500	49,650.00	0.01
38	603893	瑞芯微	300	45,558.00	0.01
39	688536	思瑞浦	276	38,286.72	0.01
40	600060	海信视像	1,600	36,832.00	0.01
41	600007	中国国贸	1,400	28,812.00	0.01
42	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.01
43	300866	安克创新	200	22,720.00	0.01
44	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.01
45	600985	淮北矿业	1,600	18,144.00	0.00
46	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
47	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
48	688052	纳芯微	94	16,402.06	0.00
49	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
50	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
51	301501	恒鑫生活	325	14,696.50	0.00
52	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
53	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
54	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
55	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
56	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
57	002384	东山精密	300	11,331.00	0.00
58	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
59	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
60	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
61	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
62	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
63	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
64	603014	威高血净	199	6,503.32	0.00
65	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
66	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
67	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00

68	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
69	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
70	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
71	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
72	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
73	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
74	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
75	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
76	600968	海油发展	600	2,448.00	0.00
77	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
78	002128	电投能源	100	1,978.00	0.00
79	600642	申能股份	200	1,720.00	0.00
80	601168	西部矿业	100	1,663.00	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	601328	交通银行	5,995,013.00	1.43
2	601166	兴业银行	5,221,575.00	1.25
3	601816	京沪高铁	4,705,796.00	1.12
4	600519	贵州茅台	4,691,956.00	1.12
5	002230	科大讯飞	4,382,026.00	1.05
6	688981	中芯国际	4,299,001.46	1.03
7	601728	中国电信	4,123,983.00	0.98
8	601318	中国平安	3,804,809.00	0.91
9	000100	TCL科技	3,196,399.00	0.76
10	601390	中国中铁	3,075,283.00	0.73
11	002714	牧原股份	2,968,140.00	0.71

12	601211	国泰海通	2,924,410.56	0.70
13	601919	中远海控	2,891,913.00	0.69
14	600938	中国海油	2,818,058.00	0.67
15	603501	豪威集团	2,813,403.00	0.67
16	000725	京东方 A	2,778,881.00	0.66
17	601600	中国铝业	2,740,510.00	0.65
18	300498	温氏股份	2,710,787.00	0.65
19	601995	中金公司	2,604,296.00	0.62
20	603986	兆易创新	2,594,946.00	0.62

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	600519	贵州茅台	6,217,820.00	1.48
2	600941	中国移动	6,055,281.00	1.44
3	600887	伊利股份	4,622,189.00	1.10
4	600900	长江电力	4,234,766.00	1.01
5	601668	中国建筑	3,861,281.00	0.92
6	601985	中国核电	3,701,947.00	0.88
7	601328	交通银行	3,625,752.00	0.86
8	002594	比亚迪	3,589,879.00	0.86
9	300661	圣邦股份	3,547,856.00	0.85
10	300750	宁德时代	3,527,580.00	0.84
11	601398	工商银行	3,488,726.00	0.83
12	000063	中兴通讯	3,424,930.00	0.82
13	600036	招商银行	3,385,713.00	0.81
14	002415	海康威视	3,314,894.00	0.79
15	000725	京东方 A	3,259,744.00	0.78

16	002475	立讯精密	3,222,436.00	0.77
17	601899	紫金矿业	3,203,356.00	0.76
18	600938	中国海油	3,035,504.00	0.72
19	601211	国泰海通	3,014,226.00	0.72
20	000100	TCL科技	2,931,826.00	0.70

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	361,980,191.96
卖出股票收入（成交）总额	410,818,015.20

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)	400.03	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	400.03	0.00

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	123257	安克转债	4	400.03	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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，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	614,660.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	614,660.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中泰沪深300指数	274,831	520.73	27,945,887.96	19.53%	115,167,389.58	80.47%

增强A						
中泰沪深300指数增强C	12,311	9,667.84	493,591.88	0.41%	118,527,149.61	99.59%
合计	287,142	912.91	28,439,479.84	10.85%	233,694,539.19	89.15%

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指数增强A	337,404.36	0.24%
	中泰沪深300指数增强C	1,839.99	0.00%
	合计	339,244.35	0.13%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中泰沪深300指数增强A	0~10
	中泰沪深300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	中泰沪深300指数增强A	0
	中泰沪深300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

	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
基金合同生效日(2020年04月01日)基金份额总额	225,312,271.77	330,816,770.53
本报告期期初基金份额总额	132,295,584.78	168,157,394.13
本报告期基金总申购份额	56,688,034.37	64,360,892.96
减：本报告期基金总赎回份额	45,870,341.61	113,497,545.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	143,113,277.54	119,020,741.49

§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2025年3月24日聘任姜诚先生担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

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

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	771,051,739.22	100.00%	155,860.00	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	43,836.77	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定网站	2025-01-21
2	中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定网站	2025-03-19
3	中泰沪深300指数增强型证	中国证监会规定网站	2025-03-19

	券投资基金托管协议		
4	关于中泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证券报、中国证监会规定网站	2025-03-19
5	中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2025-03-24
6	中泰沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2025年第1号	中国证监会规定网站	2025-03-24
7	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定网站	2025-03-26
8	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会规定网站	2025-04-21
9	中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2025-05-14
10	中泰沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2025年第2号	中国证监会规定网站	2025-05-14

§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沪深300指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 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

二〇二五年八月二十八日