

中泰沪深 300 指数量化优选增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3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。

本报告期自2025年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告.....	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	83
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	83
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	83
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	83
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	83

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	83
8.12 投资组合报告附注.....	83
§9 基金份额持有人信息.....	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	85
§10 开放式基金份额变动.....	86
§11 重大事件揭示.....	86
11.1 基金份额持有人大会决议.....	86
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
11.4 基金投资策略的改变.....	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	87
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	87
11.8 其他重大事件.....	88
§12 备查文件目录.....	89
12.1 备查文件目录.....	89
12.2 存放地点.....	89
12.3 查阅方式.....	89

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金	
基金简称	中泰沪深300量化优选增强	
基金主代码	012206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年07月05日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	58,467,391.23份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C
下属分级基金的交易代码	012206	012207
报告期末下属分级基金的份额总额	32,943,622.05份	25,523,769.18份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为沪深300指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场组合相似

	的风险收益特征。
--	----------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	张姗
	联系电话	021-20521199	400-61-95555
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-821-0808	400-61-95555
传真		021-50933716	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号24楼05室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		黄文卿	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
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

	限公司	金融大厦1002-1003室
--	-----	----------------

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年		2024年		2023年	
	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C
本期已实现收益	3,962,282.57	2,714,764.21	1,924,904.68	784,665.68	-4,527,639.80	-3,951,214.04
本期利润	5,393,601.90	3,556,667.53	4,895,469.52	2,974,338.15	-3,510,538.64	-3,243,903.65
加权平均基金份额本期利润	0.1405	0.1356	0.1166	0.1011	-0.0705	-0.0791
本期加权平均净值利润率	16.04%	15.61%	15.17%	13.40%	-8.67%	-9.84%
本期基金份额净值增长率	16.53%	16.06%	14.60%	14.14%	-9.97%	-10.34%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末		2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	-3,901,760.25	-3,432,749.25	-9,511,360.50	-6,106,343.69	-11,163,182.25	-10,626,137.80
期末可供分配基金份额利润	-0.1184	-0.1345	-0.2224	-0.2332	-0.2658	-0.2730
期末基金资产净值	32,303,321.98	24,581,804.20	35,994,983.26	21,726,444.81	30,847,065.16	28,303,041.81
期末基金份额净值	0.9806	0.9631	0.8415	0.8298	0.7343	0.7270
3.1.3 累计期末指标	2025年末		2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	-1.94%	-3.69%	-15.85%	-17.02%	-26.57%	-27.30%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

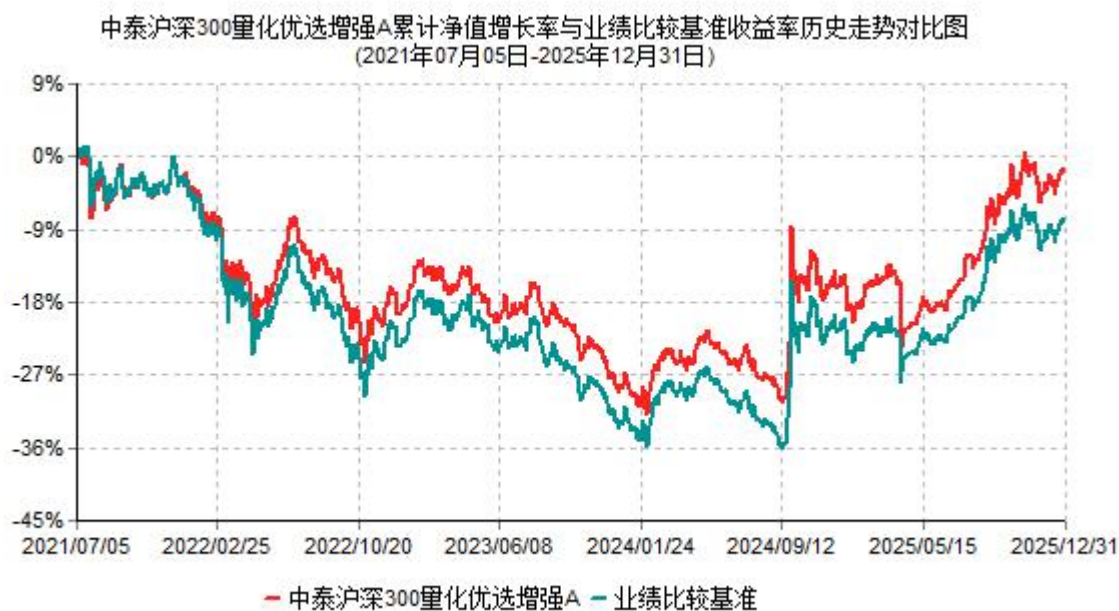
中泰沪深300量化优选增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.66%	0.96%	-0.20%	0.90%	0.86%	0.06%
过去六个月	17.93%	0.89%	16.72%	0.86%	1.21%	0.03%
过去一年	16.53%	0.98%	16.79%	0.91%	-0.26%	0.07%
过去三年	20.23%	1.01%	18.82%	1.02%	1.41%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-1.94%	1.04%	-8.09%	1.06%	6.15%	-0.02%

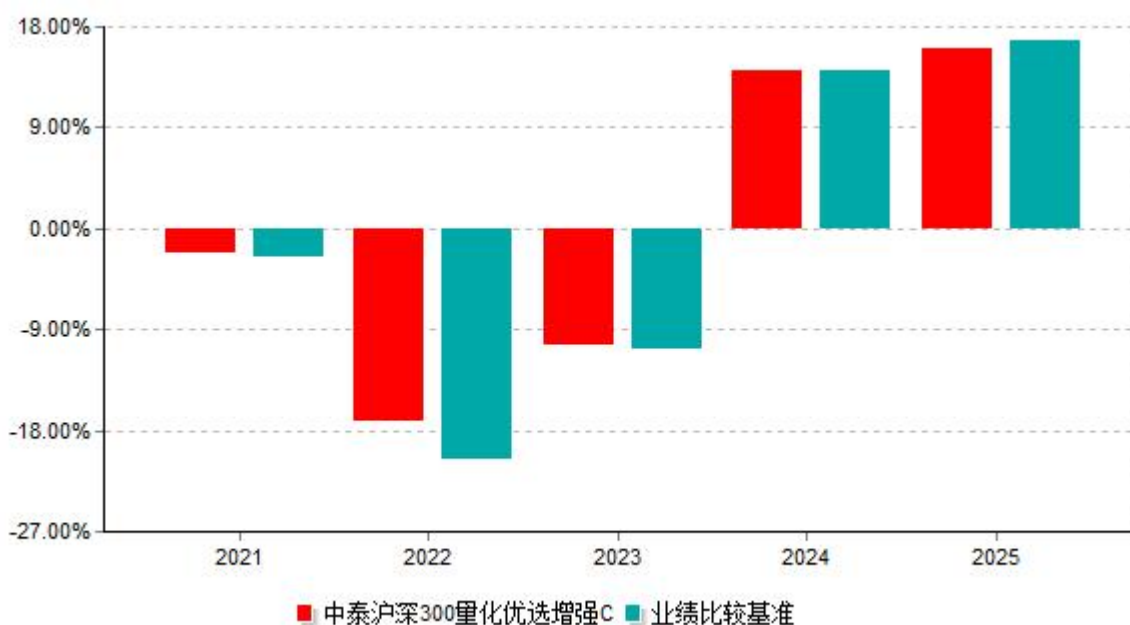
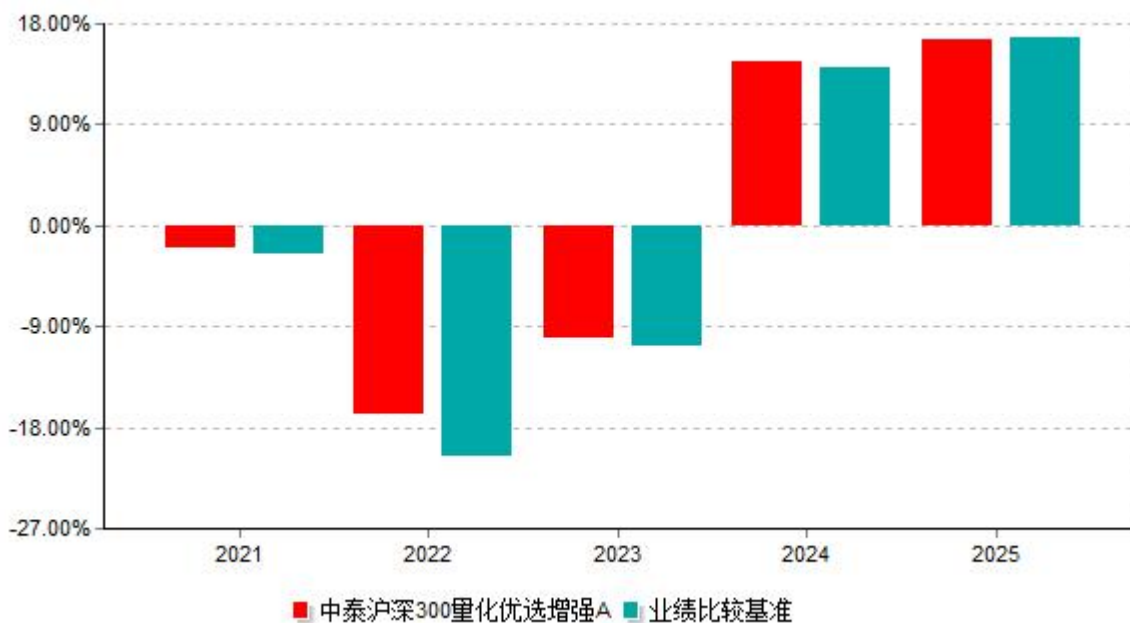
中泰沪深300量化优选增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.55%	0.96%	-0.20%	0.90%	0.75%	0.06%
过去六个月	17.70%	0.89%	16.72%	0.86%	0.98%	0.03%
过去一年	16.06%	0.98%	16.79%	0.91%	-0.73%	0.07%
过去三年	18.78%	1.01%	18.82%	1.02%	-0.04%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-3.69%	1.04%	-8.09%	1.06%	4.40%	-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



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



注：本基金的基金合同于2021年7月5日生效。基金合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为"中泰证券股份有限公司"）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2025年12月31日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、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、中泰双利债券型证券投资基金、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、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放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、中泰安睿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、中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金、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ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金、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、中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金和中泰双益债券型证券投资基金共34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	离任		

		日期	日期		
邹巍	本基金基金经理；权益公募投资部副总经理。	2021-07-05	-	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、量化公募投资部副总经理，现任权益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2025年12月21日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。

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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

异常交易，是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理产品买卖法规、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，股票市场除第一季度在冲突、关税战等因素的干扰下一波三折外，随后三个季度整体表现非常乐观，尤其是第三季度，走出一波可谓波澜壮阔的大涨行情。从沪深300指数的表现来看，去年年末收盘点位为3934.91点，今年年终收盘于4629.94点，全年指数上涨17.66%，具备典型的牛市特征。虽然指数大涨，但年化波动率只有14.87%，相较于上一年度反而有所下降，这可能说明市场参与者对市场的看法分歧有所降低；年换手率为410%，较上一年度有所上升。从中证指数细分行业的全年表现来看，沪深300成分股中，电信、材料以及信息技术行业涨幅较大，而地产行业今年依旧大幅下跌。

在本基金全年运作过程中，我们在一季度末为加强超额收益的获取，在策略上进行了较大调整，采用因子模型主动暴露部分因子，期望通过因子模型带来更好的超额收益。实际运行下来，从全年基金表现来看，因子模型的表现并不十分稳定，特别是在极端事件冲击下，若风格因子暴露过高，跟踪误差风险较难控制。我们通过量化方法对不同因子模型进行约束优化，保持对指数的有效跟踪。全年基金跟踪误差基本达到设定目标，但未能创造超额收益。这表明我们仍需在投资方法和策略上继续努力，开展更深入、细致的研究，力争为客户创造价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰沪深300量化优选增强A基金份额净值为0.9806元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为16.53%，同期业绩比较基准收益率为16.79%；截至报告期末中泰沪深300量化优选增强C基金份额净值为0.9631元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为16.06%，同期业绩比较基准收益率为16.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年，我国宏观经济在巨大挑战面前展现出超预期的强大韧性，主要表现在以下几个方面：一是在全球贸易保护主义抬头的环境下，出口仍保持较好增长，增速显著高于年初预期；二是内需尤其是消费成为经济增长的另一核心动力，最终消费支出对经济增长的贡献率达到53.5%，尽管财政补贴退坡后的持续性仍有待观察；三是以人工智能为引领的高技术制造业实现突破，自年初DeepSeek发布以来，我国人工智能技术追赶步伐明显加快，迭代速度超出预期。这些新兴行业的崛起，标志着政府推动的产业转型升级政策已取得初步成效。

在此基础上展望2026年，我们认为，基于2025年的经验，国家决策层在财政政策上将采取“更加积极”的取向：赤字率可能继续保持较高水平，超长期特别国债发行规模有望进一步扩大，资金将精准用于促进消费、扩大投资和培育新动能。货币政策预计趋向“适度宽松”，为配合财政政策发力及降低社会融资成本，市场普遍预期2026年存在降息、降准的空间。扩内需与产业升级的政策路径预计将持续，产业政策将更聚焦于培

育新质生产力，集中资源支持科技创新与制造业升级，加快推进北京、上海、粤港澳大湾区三大国际科技创新中心建设。

回归股市，我们虽无法预判整体走势，但认为结构性机会较为明确：一方面，以AI应用为代表的科技创新领域具备爆发潜力；另一方面，我们持续看好中国制造业的全球竞争力，其出口比较优势有望继续保持。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：

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

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

3、加强内部监察稽核力度。公司每季度针对投资、研究、交易、风控、基金运营等内部控制各方面开展定期核查，并针对发现的问题采取有效措施完善制度、改进流程；在此基础上，报告期内公司针对投资者适当性管理、员工行为管理、关联交易、债券交易、临时授权管理等业务开展了专项稽核，对专项稽核中发现的问题明确要求相关部门整改到位，不断提升内部控制和风险管理水平。

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

5、积极开展合规培训。报告期内，公司合规管理部门及时向公司管理层和员工传达最新的监管要求和违规案例通报，积极保持与各个业务部门的沟通与联络，根据各板块业务的开展情况适时开展合规督导，及时提示合规风险，妥善解答业务人员在展业过程中遇到的法律、合规问题；并根据法律法规变化和最新监管动态，统筹协调外部律师

事务所和内部合规力量，有针对性地开展合规培训项目，不断提升员工的风险、合规意识，营造合规经营氛围。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z0097号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金（以下简称"中泰沪深300量化优选增强"）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）、中国证券投资基金业协会（以下简称"中国基金业协会"）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中泰沪深300量化优选增强2025年12月31日的财务状况以及2025年

	度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于中泰沪深300量化优选增强，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中泰沪深300量化优选增强的基金管理人中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称"基金管理人"）管理层对其他信息负责。其他信息包括中泰沪深300量化优选增强2025年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中泰沪深300量化优选增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中泰沪深300量化优选增强、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中泰沪深300量化优选增强的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中泰沪深300量化优选增强持续经

	营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中泰沪深300量化优选增强不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	罗佳
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2026-03-24	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	4,506,891.21	3,691,514.08
结算备付金		708,960.17	575,206.16
存出保证金		166,262.40	-
交易性金融资产	7.4.7.2	51,596,181.10	53,526,154.85

其中：股票投资		51,596,181.10	53,526,154.85
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,479.65	32,655.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		56,992,774.53	57,825,530.50
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		29,319.75	29,845.99
应付管理人报酬		50,114.98	49,450.10
应付托管费		7,517.23	7,417.52
应付销售服务费		8,999.40	7,386.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,420.99	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.6	10,276.00	10,002.44
负债合计		107,648.35	104,102.43
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	58,467,391.23	68,956,457.59
未分配利润	7.4.7.8	-1,582,265.05	-11,235,029.52
净资产合计		56,885,126.18	57,721,428.07
负债和净资产总计		56,992,774.53	57,825,530.50

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额总额58,467,391.23份，其中A类份额32,943,622.05份，C类份额25,523,769.18份。A类份额净值0.9806元，C类份额净值0.9631元。

7.2 利润表

会计主体：中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2 025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2 024年12月31日
一、营业总收入		9,782,705.72	8,679,161.45
1.利息收入		31,148.76	27,657.88
其中：存款利息收入	7.4.7.9	31,148.76	27,657.88
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）		7,463,424.35	3,485,975.33
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,948,978.81	1,856,376.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	959.71	39.98

资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	270,542.82	255,686.93
股利收益	7.4.7.13	1,242,943.01	1,373,872.39
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	2,273,222.65	5,160,237.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	14,909.96	5,290.93
减：二、营业总支出		832,436.29	809,353.78
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	564,066.16	545,768.53
2.托管费	7.4.10.2.2	84,609.90	81,865.46
3.销售服务费	7.4.10.2.3	90,985.41	89,067.10
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		975.93	921.25
8.其他费用	7.4.7.16	91,798.89	91,731.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,950,269.43	7,869,807.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,950,269.43	7,869,807.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,950,269.43	7,869,807.67

7.3 净资产变动表

会计主体：中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	68,956,457.59	-11,235,029.52	57,721,428.07
二、本期期初净资产	68,956,457.59	-11,235,029.52	57,721,428.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,489,066.36	9,652,764.47	-836,301.89
（一）、综合收益总额	-	8,950,269.43	8,950,269.43
（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）	-10,489,066.36	702,495.04	-9,786,571.32
其中：1.基金申购款	22,927,092.03	-3,106,809.61	19,820,282.42
2.基金赎回款	-33,416,158.39	3,809,304.65	-29,606,853.74
（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	58,467,391.23	-1,582,265.05	56,885,126.18
项 目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	80,935,457.54	-21,785,350.57	59,150,106.97
二、本期期初净资产	80,935,457.54	-21,785,350.57	59,150,106.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,978,999.95	10,550,321.05	-1,428,678.90
（一）、综合收益总额	-	7,869,807.67	7,869,807.67
（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）	-11,978,999.95	2,680,513.38	-9,298,486.57
其中：1.基金申购款	12,276,172.08	-2,904,916.18	9,371,255.90
2.基金赎回款	-24,255,172.03	5,585,429.56	-18,669,742.47
（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	68,956,457.59	-11,235,029.52	57,721,428.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2021]1210号《关于准予中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金注册的批复》注册,由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币269,924,175.01元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0635号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》于2021年7月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为269,953,304.05份,其中认购资金利息折合29,129.04份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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

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

行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深300指数收益率 $+5\% \times$ 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2026年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《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指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025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12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，

那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为

基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	1,414,928.27	1,400,831.98
等于：本金	1,414,755.74	1,400,701.43
加：应计利息	172.53	130.55
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	3,091,962.94	2,290,682.10
等于：本金	3,091,290.21	2,290,141.18
加：应计利息	672.73	540.92
减：坏账准备	-	-
合计	4,506,891.21	3,691,514.08

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		48,010,197.45	-	51,596,181.10	3,585,983.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		48,010,197.45	-	51,596,181.10	3,585,983.65
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		52,197,141.89	-	53,526,154.85	1,329,012.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	52,197,141.89	-	53,526,154.85	1,329,012.96	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,368,720.00	-	-	-
--股指期货	1,368,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,368,720.00	-	-	-
项目	上年度末 2024年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2601	IF2601	1.00	1,385,520.00	16,800.00
合计				16,800.00
减：可抵销 期货暂收 款				16,800.00
净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	2.44
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	10,000.00	10,000.00
其他应付	276.00	-
合计	10,276.00	10,002.44

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 中泰沪深300量化优选增强A

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强A)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,774,394.78	42,774,394.78
本期申购	5,461,809.59	5,461,809.59
本期赎回（以“-”号填列）	-15,292,582.32	-15,292,582.32
本期末	32,943,622.05	32,943,622.05

7.4.7.7.2 中泰沪深300量化优选增强C

金额单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强C)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,182,062.81	26,182,062.81
本期申购	17,465,282.44	17,465,282.44
本期赎回（以“-”号填列）	-18,123,576.07	-18,123,576.07
本期末	25,523,769.18	25,523,769.18

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 中泰沪深300量化优选增强A

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,511,360.50	2,731,948.98	-6,779,411.52
本期期初	-9,511,360.50	2,731,948.98	-6,779,411.52
本期利润	3,962,282.57	1,431,319.33	5,393,601.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,647,317.68	-901,808.13	745,509.55

其中：基金申购款	-1,260,201.85	280,580.94	-979,620.91
基金赎回款	2,907,519.53	-1,182,389.07	1,725,130.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,901,760.25	3,261,460.18	-640,300.07

7.4.7.8.2 中泰沪深300量化优选增强C

单位：人民币元

项目 (中泰沪深300量化优选增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,106,343.69	1,650,725.69	-4,455,618.00
本期期初	-6,106,343.69	1,650,725.69	-4,455,618.00
本期利润	2,714,764.21	841,903.32	3,556,667.53
本期基金份额交易产生的变动数	-41,169.77	-1,844.74	-43,014.51
其中：基金申购款	-3,499,837.99	1,372,649.29	-2,127,188.70
基金赎回款	3,458,668.22	-1,374,494.03	2,084,174.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,432,749.25	2,490,784.27	-941,964.98

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	5,444.30	4,697.00
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	21,178.87	18,209.33
结算备付金利息收入	4,525.59	4,751.55
其他	-	-
合计	31,148.76	27,657.88

7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	477,564,243.90	190,826,363.91
减：卖出股票成本总额	471,124,987.09	188,771,007.21
减：交易费用	490,278.00	198,980.67
买卖股票差价收入	5,948,978.81	1,856,376.03

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
债券投资收益——利息收入	0.24	0.02
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	959.47	39.96
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	959.71	39.98

7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股）	4,160.00	240.00

及债券到期兑付) 成交总额		
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	3,200.00	200.00
减：应计利息总额	0.24	0.02
减：交易费用	0.29	0.02
买卖债券差价收入	959.47	39.96

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
期货投资	270,542.82	255,686.93

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
股票投资产生的股利收益	1,242,943.01	1,373,872.39
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,242,943.01	1,373,872.39

7.4.7.14 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12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	2,256,970.69	5,160,237.31

——股票投资	2,256,970.69	5,160,237.31
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	16,800.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	16,800.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	548.04	-
合计	2,273,222.65	5,160,237.31

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
基金赎回费收入	14,894.64	5,283.98
其他	15.32	6.93
基金转换费收入	-	0.02
合计	14,909.96	5,290.93

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
审计费用	10,000.00	10,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
汇划手续费	1,798.89	1,731.44

合计	91,798.89	91,731.44
----	-----------	-----------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年12月31日		2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	943,922,908.97	100.00%	372,569,823.73	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年12月31日		2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中泰证券	4,160.00	100.00%	240.00	100.00%

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年01月01日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	191,101.95	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	79,667.48	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.根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	564,066.16	545,768.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	215,376.60	207,408.96
应支付基金管理人的净管理费	348,689.56	338,359.57

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值X1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	84,609.90	81,865.46

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C	合计
招商银行	0.00	6,360.44	6,360.44
中泰证券	0.00	66,805.65	66,805.65

中泰资管	0.00	782.80	782.80
合计	0.00	73,948.89	73,948.89
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰沪深300量化优选增强A	中泰沪深300量化优选增强C	合计
招商银行	0.00	5,536.28	5,536.28
中泰证券	0.00	73,352.00	73,352.00
中泰资管	0.00	7,073.79	7,073.79
合计	0.00	85,962.07	85,962.07

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值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。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值 X 0.40%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,414,928.27	5,444.30	1,400,831.98	4,697.00

中泰证券	3,091,962.94	21,178.87	2,290,682.10	18,209.33
------	--------------	-----------	--------------	-----------

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金因指数投资而被动持有招商银行的股票25,200股，估值金额
为人民币1,060,920.00元，占基金净资产的比例为1.87%（上年度末：本基金因指数投资
而被动持有招商银行的股票23,500股，估值金额为人民币923,550.00元，占基金净资产的
比例为1.60%）。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票名称	停牌日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量 （股）	期末成本总 额	期末估值总 额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大 事项	78.81	2026-01-15	86.69	1,400	102,635.32	110,334.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大 事项	272.72	2026-01-05	278.00	984	207,836.98	268,356.48	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。审计风险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审计风险委员会和专业投资委员会及投资决策委员会。风险管理部应根据市场环境的变化对投资组合的风险进行情景分析或模拟分析，在估计可能产生重大风险隐患时，及时通报专业投资委员会和投资决策委员会，并提出降低风险的建议。当市场环境的变化导致风险控制模型的适用性降低时，风险管理部应及时对所使用的风险控制模型进行重新检验和修正，包括但不限于压力测试、敏感性分析等。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金无债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流

动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中

浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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	4,506,891.21	-	-	-	-	-	4,506,891.21
结算备付金	708,960.17	-	-	-	-	-	708,960.17
存出保证金	-	-	-	-	-	166,262.40	166,262.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	51,596,181.10	51,596,181.10
应收申购款	-	-	-	-	-	14,479.65	14,479.65
资产总计	5,215,851.38	-	-	-	-	51,776,923.15	56,992,774.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,319.75	29,319.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,114.98	50,114.98
应付托管费	-	-	-	-	-	7,517.23	7,517.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,999.40	8,999.40
应交税	-	-	-	-	-	1,420.99	1,420.99

费							
其他负债	-	-	-	-	-	10,276.00	10,276.00
负债总计	-	-	-	-	-	107,648.35	107,648.35
利率敏感度缺口	5,215,851.38	-	-	-	-	51,669,274.80	56,885,126.18
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	3,691,514.08	-	-	-	-	-	3,691,514.08
结算备付金	575,206.16	-	-	-	-	-	575,206.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	53,526,154.85	53,526,154.85
应收申购款	-	-	-	-	-	32,655.41	32,655.41
资产总计	4,266,720.24	-	-	-	-	53,558,810.26	57,825,530.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,845.99	29,845.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,450.10	49,450.10
应付托管费	-	-	-	-	-	7,417.52	7,417.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,386.38	7,386.38
其他负债	-	-	-	-	-	10,002.44	10,002.44
负债总计	-	-	-	-	-	104,102.43	104,102.43
利率敏感度缺	4,266,720.24	-	-	-	-	53,454,707.83	57,721,428.07

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	51,596,181.10	90.70	53,526,154.85	92.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,596,181.10	90.70	53,526,154.85	92.73

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2024年12月31日
	比较基准上升5%	2,823,056.29	2,722,103.75
	比较基准下降5%	-2,823,056.29	-2,722,103.75

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	51,217,490.62	53,444,568.85
第二层次	378,690.48	81,586.00
第三层次	-	-
合计	51,596,181.10	53,526,154.85

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31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）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	51,596,181.10	90.53
	其中：股票	51,596,181.10	90.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,215,851.38	9.15
8	其他各项资产	180,742.05	0.32
9	合计	56,992,774.53	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	467,240.00	0.82
B	采矿业	3,037,094.00	5.34
C	制造业	28,636,416.28	50.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,475,339.00	2.59
E	建筑业	766,108.00	1.35
F	批发和零售业	112,088.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,518,480.00	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	2,362,488.30	4.15

	术服务业		
J	金融业	11,774,417.20	20.70
K	房地产业	279,459.00	0.49
L	租赁和商务服务业	430,262.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	577,085.80	1.01
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	104,310.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	49,140.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	51,589,927.58	90.69

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,253.52	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,253.52	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	5,420	1,990,549.20	3.50
2	600519	贵州茅台	1,300	1,790,334.00	3.15
3	601318	中国平安	21,700	1,484,280.00	2.61
4	300308	中际旭创	2,280	1,390,800.00	2.44
5	601899	紫金矿业	33,600	1,158,192.00	2.04
6	600036	招商银行	25,200	1,060,920.00	1.87
7	300502	新易盛	2,020	870,377.60	1.53
8	000333	美的集团	10,000	781,500.00	1.37
9	601166	兴业银行	34,500	726,570.00	1.28
10	600900	长江电力	25,000	679,750.00	1.19
11	002594	比亚迪	6,930	677,199.60	1.19
12	688256	寒武纪	454	615,419.70	1.08

13	300059	东方财富	25,800	598,044.00	1.05
14	002475	立讯精密	10,400	589,784.00	1.04
15	600030	中信证券	19,900	571,329.00	1.00
16	600276	恒瑞医药	9,060	539,704.20	0.95
17	601398	工商银行	66,000	523,380.00	0.92
18	601211	国泰海通	25,144	516,709.20	0.91
19	300274	阳光电源	2,940	502,857.60	0.88
20	601138	工业富联	8,100	502,605.00	0.88
21	688981	中芯国际	4,072	500,163.76	0.88
22	603259	药明康德	5,020	455,012.80	0.80
23	601288	农业银行	58,600	450,048.00	0.79
24	688041	海光信息	1,892	424,583.72	0.75
25	000858	五 粮 液	4,000	423,760.00	0.74
26	002371	北方华创	905	415,467.40	0.73
27	601328	交通银行	54,400	394,400.00	0.69
28	600887	伊利股份	12,900	368,940.00	0.65
29	000651	格力电器	9,100	366,002.00	0.64
30	603993	洛阳钼业	17,800	356,000.00	0.63
31	300476	胜宏科技	1,200	345,096.00	0.61
32	600000	浦发银行	27,200	338,368.00	0.59
33	000725	京东方 A	74,800	314,908.00	0.55
34	600919	江苏银行	29,900	310,960.00	0.55
35	601816	京沪高铁	59,800	307,970.00	0.54
36	600150	中国船舶	9,219	306,623.94	0.54
37	603986	兆易创新	1,400	299,950.00	0.53
38	300124	汇川技术	3,900	293,787.00	0.52
39	601601	中国太保	7,000	293,370.00	0.52
40	600309	万华化学	3,800	291,384.00	0.51
41	002714	牧原股份	5,600	283,248.00	0.50
42	601688	华泰证券	11,900	280,721.00	0.49
43	688008	澜起科技	2,373	279,539.40	0.49

44	601088	中国神华	6,700	271,350.00	0.48
45	688012	中微公司	984	268,356.48	0.47
46	603019	中科曙光	3,000	256,920.00	0.45
47	600031	三一重工	12,100	255,673.00	0.45
48	002050	三花智控	4,600	254,426.00	0.45
49	000063	中兴通讯	6,600	249,744.00	0.44
50	601668	中国建筑	47,900	245,727.00	0.43
51	601857	中国石油	23,100	240,471.00	0.42
52	600111	北方稀土	5,200	239,824.00	0.42
53	002230	科大讯飞	4,700	236,363.00	0.42
54	600089	特变电工	10,300	228,866.00	0.40
55	300760	迈瑞医疗	1,200	228,540.00	0.40
56	000001	平安银行	19,800	225,918.00	0.40
57	601012	隆基绿能	12,400	225,680.00	0.40
58	002415	海康威视	7,500	223,800.00	0.39
59	000425	徐工机械	19,200	222,336.00	0.39
60	002384	东山精密	2,600	220,090.00	0.39
61	603501	豪威集团	1,700	214,030.00	0.38
62	600660	福耀玻璃	3,300	213,741.00	0.38
63	603799	华友钴业	3,100	211,606.00	0.37
64	601127	赛力斯	1,700	205,632.00	0.36
65	601229	上海银行	20,300	205,030.00	0.36
66	002463	沪电股份	2,761	201,746.27	0.35
67	002028	思源电气	1,300	200,967.00	0.35
68	600690	海尔智家	7,700	200,893.00	0.35
69	601728	中国电信	31,600	199,080.00	0.35
70	601600	中国铝业	16,200	197,964.00	0.35
71	601919	中远海控	12,900	195,822.00	0.34
72	600016	民生银行	50,600	193,798.00	0.34
73	000100	TCL科技	42,400	192,496.00	0.34
74	000338	潍柴动力	11,000	189,200.00	0.33

75	601888	中国中免	2,000	189,120.00	0.33
76	002142	宁波银行	6,700	188,203.00	0.33
77	002352	顺丰控股	4,900	187,768.00	0.33
78	300394	天孚通信	920	186,787.60	0.33
79	600406	国电南瑞	8,240	185,235.20	0.33
80	300498	温氏股份	10,900	183,992.00	0.32
81	600028	中国石化	29,700	183,546.00	0.32
82	000792	盐湖股份	6,500	183,040.00	0.32
83	600941	中国移动	1,800	181,890.00	0.32
84	600183	生益科技	2,500	178,525.00	0.31
85	000568	泸州老窖	1,500	174,330.00	0.31
86	600809	山西汾酒	1,000	171,700.00	0.30
87	601766	中国中车	24,800	169,136.00	0.30
88	601225	陕西煤业	7,900	168,428.00	0.30
89	601988	中国银行	29,200	167,316.00	0.29
90	601169	北京银行	30,200	165,496.00	0.29
91	300014	亿纬锂能	2,500	164,400.00	0.29
92	600050	中国联通	31,900	163,009.00	0.29
93	601939	建设银行	17,300	160,544.00	0.28
94	600926	杭州银行	10,400	158,912.00	0.28
95	601628	中国人寿	3,400	154,700.00	0.27
96	002027	分众传媒	20,600	151,822.00	0.27
97	002625	光启技术	3,100	151,156.00	0.27
98	600938	中国海油	4,900	147,882.00	0.26
99	002460	赣锋锂业	2,340	147,162.60	0.26
100	002241	歌尔股份	5,100	146,523.00	0.26
101	601985	中国核电	16,800	145,320.00	0.26
102	688111	金山办公	470	144,322.90	0.25
103	601009	南京银行	12,600	144,018.00	0.25
104	600547	山东黄金	3,700	143,227.00	0.25
105	000977	浪潮信息	2,100	139,860.00	0.25

106	601689	拓普集团	1,800	138,924.00	0.24
107	000807	云铝股份	4,200	137,928.00	0.24
108	600489	中金黄金	5,900	137,824.00	0.24
109	000408	藏格矿业	1,600	135,040.00	0.24
110	002709	天赐材料	2,900	134,357.00	0.24
111	600019	宝钢股份	17,800	132,610.00	0.23
112	601818	光大银行	37,900	132,271.00	0.23
113	000776	广发证券	6,000	132,120.00	0.23
114	300033	同花顺	400	128,872.00	0.23
115	601006	大秦铁路	24,700	127,452.00	0.22
116	600999	招商证券	7,600	126,464.00	0.22
117	603288	海天味业	3,400	125,868.00	0.22
118	300433	蓝思科技	4,100	124,107.00	0.22
119	300408	三环集团	2,700	123,525.00	0.22
120	601658	邮储银行	22,400	122,080.00	0.21
121	601100	恒立液压	1,100	120,901.00	0.21
122	000625	长安汽车	10,100	119,786.00	0.21
123	600905	三峡能源	29,100	119,019.00	0.21
124	601336	新华保险	1,700	118,490.00	0.21
125	600958	东方证券	10,700	116,630.00	0.21
126	002466	天齐锂业	2,100	116,298.00	0.20
127	002916	深南电路	500	116,145.00	0.20
128	600362	江西铜业	2,100	115,332.00	0.20
129	002600	领益智造	7,400	114,996.00	0.20
130	688271	联影医疗	911	114,330.50	0.20
131	601390	中国中铁	20,900	113,069.00	0.20
132	600438	通威股份	5,500	112,860.00	0.20
133	002049	紫光国微	1,400	110,334.00	0.19
134	600010	包钢股份	46,300	110,194.00	0.19
135	601825	沪农商行	11,800	109,622.00	0.19
136	600893	航发动力	2,700	108,081.00	0.19

137	600160	巨化股份	2,800	107,576.00	0.19
138	600585	海螺水泥	4,900	107,114.00	0.19
139	605499	东鹏饮料	400	106,956.00	0.19
140	600584	长电科技	2,900	106,662.00	0.19
141	601377	兴业证券	14,100	104,622.00	0.18
142	600115	中国东航	17,400	104,400.00	0.18
143	300015	爱尔眼科	9,500	104,310.00	0.18
144	000538	云南白药	1,800	102,168.00	0.18
145	600522	中天科技	5,600	101,472.00	0.18
146	600436	片仔癀	600	101,268.00	0.18
147	000938	紫光股份	4,100	100,860.00	0.18
148	000630	铜陵有色	16,400	98,564.00	0.17
149	000166	申万宏源	18,400	96,968.00	0.17
150	600346	恒力石化	4,300	96,879.00	0.17
151	600760	中航沈飞	1,700	95,455.00	0.17
152	600426	华鲁恒升	3,000	94,290.00	0.17
153	002311	海大集团	1,700	94,146.00	0.17
154	600570	恒生电子	3,110	93,766.50	0.16
155	601916	浙商银行	30,800	93,632.00	0.16
156	002179	中航光电	2,600	92,144.00	0.16
157	600795	国电电力	18,200	91,728.00	0.16
158	300803	指南针	700	91,609.00	0.16
159	601669	中国电建	17,500	91,000.00	0.16
160	300442	润泽科技	1,700	89,760.00	0.16
161	600415	小商品城	5,600	89,320.00	0.16
162	600015	华夏银行	13,000	89,310.00	0.16
163	600048	保利发展	14,600	89,060.00	0.16
164	600989	宝丰能源	4,500	88,335.00	0.16
165	600066	宇通客车	2,700	88,290.00	0.16
166	600029	南方航空	11,000	88,110.00	0.15
167	601058	赛轮轮胎	5,400	87,372.00	0.15

168	000157	中联重科	10,100	87,163.00	0.15
169	002074	国轩高科	2,200	86,042.00	0.15
170	601117	中国化学	11,400	85,842.00	0.15
171	688126	沪硅产业	3,887	84,114.68	0.15
172	601995	中金公司	2,400	84,000.00	0.15
173	601838	成都银行	5,200	83,824.00	0.15
174	600176	中国巨石	4,900	83,790.00	0.15
175	601998	中信银行	10,800	83,160.00	0.15
176	688036	传音控股	1,256	83,096.96	0.15
177	000975	山金国际	3,400	82,722.00	0.15
178	002736	国信证券	6,300	82,656.00	0.15
179	600009	上海机场	2,500	81,900.00	0.14
180	601360	三六零	7,100	79,307.00	0.14
181	002001	新 和 成	3,100	78,089.00	0.14
182	600219	南山铝业	14,200	76,396.00	0.13
183	002236	大华股份	4,000	75,760.00	0.13
184	300418	昆仑万维	1,800	75,060.00	0.13
185	688169	石头科技	480	72,988.80	0.13
186	002304	洋河股份	1,200	72,888.00	0.13
187	603296	华勤技术	800	72,592.00	0.13
188	002920	德赛西威	600	72,180.00	0.13
189	601186	中国铁建	9,400	72,098.00	0.13
190	002493	荣盛石化	6,100	71,431.00	0.13
191	603893	瑞芯微	400	71,312.00	0.13
192	601111	中国国航	7,600	71,212.00	0.13
193	000768	中航西飞	2,800	71,064.00	0.12
194	000963	华东医药	1,800	71,010.00	0.12
195	002938	鹏鼎控股	1,400	70,812.00	0.12
196	601788	光大证券	4,000	70,200.00	0.12
197	601077	渝农商行	10,800	69,768.00	0.12
198	601066	中信建投	2,600	69,602.00	0.12

199	601881	中国银河	4,400	69,168.00	0.12
200	600196	复星医药	2,600	68,874.00	0.12
201	002252	上海莱士	10,800	68,472.00	0.12
202	600460	士兰微	2,400	68,184.00	0.12
203	002422	科伦药业	2,300	67,505.00	0.12
204	600011	华能国际	9,000	67,140.00	0.12
205	002601	龙佰集团	3,400	66,572.00	0.12
206	301236	软通动力	1,400	66,402.00	0.12
207	600372	中航机载	4,900	65,758.00	0.12
208	601901	方正证券	8,400	65,520.00	0.12
209	300782	卓胜微	800	65,184.00	0.11
210	000661	长春高新	700	64,785.00	0.11
211	000002	万科A	13,900	64,635.00	0.11
212	688506	百利天恒	200	64,620.00	0.11
213	600886	国投电力	4,900	64,288.00	0.11
214	600741	华域汽车	3,200	64,000.00	0.11
215	001979	招商蛇口	7,400	63,936.00	0.11
216	300347	泰格医药	1,100	62,370.00	0.11
217	601868	中国能建	26,500	62,275.00	0.11
218	605117	德业股份	720	62,064.00	0.11
219	600515	海南机场	11,600	61,828.00	0.11
220	601877	正泰电器	2,200	61,358.00	0.11
221	601698	中国卫通	1,700	60,741.00	0.11
222	600875	东方电气	2,500	60,700.00	0.11
223	601878	浙商证券	5,600	60,536.00	0.11
223	003816	中国广核	16,100	60,536.00	0.11
225	300661	圣邦股份	880	60,403.20	0.11
226	002648	卫星化学	3,400	60,112.00	0.11
227	300759	康龙化成	2,100	59,703.00	0.10
228	601021	春秋航空	1,000	59,500.00	0.10
229	601872	招商轮船	6,600	59,268.00	0.10

230	000301	东方盛虹	5,400	58,806.00	0.10
231	601319	中国人保	6,500	58,175.00	0.10
232	600233	圆通速递	3,500	57,470.00	0.10
233	601633	长城汽车	2,500	56,575.00	0.10
234	600588	用友网络	4,200	55,692.00	0.10
235	600674	川投能源	4,000	55,600.00	0.10
236	000895	双汇发展	2,100	55,587.00	0.10
237	688047	龙芯中科	400	52,844.00	0.09
238	600039	四川路桥	5,300	52,735.00	0.09
239	000786	北新建材	2,100	52,437.00	0.09
240	688396	华润微	991	52,384.26	0.09
241	603369	今世缘	1,500	52,170.00	0.09
242	000617	中油资本	5,200	49,920.00	0.09
243	688082	盛美上海	282	49,646.10	0.09
244	300251	光线传媒	3,000	49,140.00	0.09
245	300316	晶盛机电	1,300	47,775.00	0.08
246	600482	中国动力	2,300	47,610.00	0.08
247	302132	中航成飞	600	47,400.00	0.08
248	600188	兖矿能源	3,600	47,340.00	0.08
249	688223	晶科能源	8,176	46,112.64	0.08
250	601898	中煤能源	3,700	46,028.00	0.08
251	002459	晶澳科技	4,000	45,800.00	0.08
252	300866	安克创新	400	45,756.00	0.08
253	300122	智飞生物	2,400	45,288.00	0.08
254	600085	同仁堂	1,400	45,164.00	0.08
255	300832	新产业	800	45,000.00	0.08
256	688472	阿特斯	2,929	43,671.39	0.08
257	601618	中国中冶	14,600	43,362.00	0.08
258	600600	青岛啤酒	700	42,840.00	0.08
259	301269	华大九天	400	42,532.00	0.07
260	300896	爱美客	300	42,516.00	0.07

261	000876	新希望	4,600	42,412.00	0.07
262	001965	招商公路	4,200	42,336.00	0.07
263	601607	上海医药	2,300	41,078.00	0.07
264	600023	浙能电力	8,200	40,590.00	0.07
265	600061	国投资本	5,200	39,780.00	0.07
265	000596	古井贡酒	300	39,780.00	0.07
267	600026	中远海能	3,400	39,712.00	0.07
268	600027	华电国际	8,000	39,680.00	0.07
269	600803	新奥股份	1,900	39,444.00	0.07
270	600930	华电新能	6,000	37,740.00	0.07
271	000999	华润三九	1,320	37,567.20	0.07
272	600845	宝信软件	1,800	37,278.00	0.07
273	000983	山西焦煤	5,800	37,236.00	0.07
274	603260	合盛硅业	700	36,890.00	0.06
275	601238	广汽集团	4,500	36,720.00	0.06
276	300413	芒果超媒	1,500	36,630.00	0.06
277	603392	万泰生物	800	35,952.00	0.06
278	300628	亿联网络	1,000	35,650.00	0.06
279	601059	信达证券	2,000	35,420.00	0.06
280	600025	华能水电	3,800	34,504.00	0.06
281	300999	金龙鱼	1,200	34,488.00	0.06
282	688303	大全能源	1,246	33,417.72	0.06
283	000708	中信特钢	2,000	32,740.00	0.06
284	600161	天坛生物	2,000	32,680.00	0.06
285	601456	国联民生	3,200	32,544.00	0.06
286	600018	上港集团	5,700	30,894.00	0.05
287	688187	时代电气	582	29,850.78	0.05
288	601018	宁波港	8,000	29,040.00	0.05
289	688009	中国通号	5,224	28,575.28	0.05
290	601236	红塔证券	2,900	23,751.00	0.04
291	603195	公牛集团	580	23,681.40	0.04

292	601136	首创证券	1,100	20,669.00	0.04
293	300979	华利集团	400	20,084.00	0.04
294	601808	中海油服	1,200	16,848.00	0.03
295	600377	宁沪高速	1,000	12,110.00	0.02
296	001391	国货航	2,000	11,840.00	0.02
297	601298	青岛港	1,400	11,676.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688190	云路股份	33	3,214.20	0.01
2	688408	中信博	62	2,610.82	0.00
3	002129	TCL中环	50	428.50	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	6,108,539.00	10.58
2	300308	中际旭创	5,438,841.00	9.42
3	300750	宁德时代	4,736,734.00	8.21
4	600276	恒瑞医药	4,374,956.60	7.58
5	300394	天孚通信	4,307,563.00	7.46
6	002463	沪电股份	4,253,855.00	7.37
7	002594	比亚迪	3,839,159.00	6.65
8	601899	紫金矿业	3,796,894.00	6.58
9	601865	福莱特	3,656,740.00	6.34
10	300502	新易盛	3,639,626.61	6.31

11	600036	招商银行	3,583,007.01	6.21
12	601318	中国平安	3,582,629.00	6.21
13	000333	美的集团	3,541,161.00	6.13
14	300059	东方财富	3,314,837.00	5.74
15	688256	寒武纪	3,041,246.81	5.27
16	600745	闻泰科技	2,814,226.00	4.88
17	300274	阳光电源	2,787,072.00	4.83
18	601808	中海油服	2,768,494.00	4.80
19	002459	晶澳科技	2,759,798.00	4.78
20	601688	华泰证券	2,753,196.00	4.77
21	000975	山金国际	2,745,328.00	4.76
22	601628	中国人寿	2,675,085.00	4.63
23	603259	药明康德	2,673,990.00	4.63
24	688008	澜起科技	2,669,704.15	4.63
25	601166	兴业银行	2,654,066.00	4.60
26	601138	工业富联	2,632,983.00	4.56
27	603993	洛阳钼业	2,600,842.00	4.51
28	600958	东方证券	2,577,145.00	4.46
29	601985	中国核电	2,547,728.00	4.41
30	002916	深南电路	2,495,650.00	4.32
31	600438	通威股份	2,491,166.00	4.32
32	601211	国泰海通	2,483,857.72	4.30
33	688981	中芯国际	2,474,814.02	4.29
34	601117	中国化学	2,457,689.00	4.26
35	688472	阿特斯	2,431,548.35	4.21
36	601919	中远海控	2,416,130.00	4.19
37	000858	五粮液	2,414,800.00	4.18
38	601901	方正证券	2,407,931.00	4.17
39	601766	中国中车	2,405,260.00	4.17
40	002129	TCL中环	2,390,394.00	4.14
41	600436	片仔癀	2,378,818.00	4.12

42	600941	中国移动	2,355,112.00	4.08
43	600900	长江电力	2,352,003.00	4.07
44	600025	华能水电	2,351,743.00	4.07
45	000651	格力电器	2,331,210.00	4.04
46	601186	中国铁建	2,324,225.00	4.03
47	600795	国电电力	2,205,390.00	3.82
48	002475	立讯精密	2,204,431.00	3.82
49	002236	大华股份	2,202,914.00	3.82
50	603659	璞泰来	2,173,097.00	3.76
51	300760	迈瑞医疗	2,140,002.00	3.71
52	688303	大全能源	2,131,501.56	3.69
53	688599	天合光能	2,122,934.56	3.68
54	601818	光大银行	2,097,062.00	3.63
55	000596	古井贡酒	2,096,822.00	3.63
56	600111	北方稀土	2,092,818.74	3.63
57	688187	时代电气	2,074,424.86	3.59
58	600585	海螺水泥	2,072,812.00	3.59
59	600415	小商品城	2,070,803.00	3.59
60	600030	中信证券	2,067,233.00	3.58
61	002938	鹏鼎控股	2,043,801.00	3.54
62	000776	广发证券	2,028,885.00	3.51
63	601328	交通银行	2,022,695.00	3.50
64	688506	百利天恒	2,017,677.39	3.50
65	601006	大秦铁路	1,998,281.00	3.46
66	600905	三峡能源	1,997,601.00	3.46
67	601857	中国石油	1,993,954.00	3.45
68	000999	华润三九	1,973,955.00	3.42
69	601398	工商银行	1,960,996.00	3.40
70	600183	生益科技	1,955,879.00	3.39
71	601336	新华保险	1,954,590.00	3.39
72	603296	华勤技术	1,946,518.00	3.37

73	600547	山东黄金	1,942,560.00	3.37
74	600150	中国船舶	1,940,520.07	3.36
75	688223	晶科能源	1,938,469.98	3.36
76	601668	中国建筑	1,912,426.00	3.31
77	603019	中科曙光	1,910,458.00	3.31
78	601699	潞安环能	1,876,574.00	3.25
79	601618	中国中冶	1,875,465.00	3.25
80	600011	华能国际	1,875,452.00	3.25
81	600674	川投能源	1,874,873.00	3.25
82	000630	铜陵有色	1,871,809.00	3.24
83	300832	新产业	1,865,173.00	3.23
84	601728	中国电信	1,859,578.00	3.22
85	600886	国投电力	1,856,792.00	3.22
86	600028	中国石化	1,849,093.00	3.20
87	601816	京沪高铁	1,839,580.00	3.19
88	600372	中航机载	1,834,601.00	3.18
89	002252	上海莱士	1,821,279.00	3.16
90	000063	中兴通讯	1,814,210.00	3.14
91	600938	中国海油	1,805,363.00	3.13
92	000625	长安汽车	1,796,662.00	3.11
93	601066	中信建投	1,786,480.00	3.10
94	000725	京东方 A	1,775,753.00	3.08
95	601319	中国人保	1,765,016.00	3.06
96	601995	中金公司	1,747,426.00	3.03
97	300442	润泽科技	1,742,051.00	3.02
98	688036	传音控股	1,738,432.19	3.01
99	000800	一汽解放	1,724,942.00	2.99
100	300999	金龙鱼	1,722,335.00	2.98
101	603288	海天味业	1,720,181.00	2.98
102	601229	上海银行	1,710,349.00	2.96
103	601009	南京银行	1,702,629.00	2.95

104	601669	中国电建	1,697,294.00	2.94
105	601088	中国神华	1,691,752.00	2.93
106	002230	科大讯飞	1,688,553.00	2.93
107	600160	巨化股份	1,667,996.00	2.89
108	301269	华大九天	1,663,559.00	2.88
109	601127	赛力斯	1,661,139.00	2.88
110	603799	华友钴业	1,648,205.00	2.86
111	600027	华电国际	1,640,292.00	2.84
112	601601	中国太保	1,624,654.00	2.81
113	601012	隆基绿能	1,624,376.00	2.81
114	601799	星宇股份	1,618,712.00	2.80
115	601689	拓普集团	1,600,645.00	2.77
116	002049	紫光国微	1,593,460.20	2.76
117	688009	中国通号	1,590,858.25	2.76
118	600309	万华化学	1,582,607.00	2.74
119	002601	龙佰集团	1,575,387.00	2.73
120	601390	中国中铁	1,571,941.00	2.72
121	002180	纳思达	1,570,019.00	2.72
122	600741	华域汽车	1,567,840.00	2.72
123	600690	海尔智家	1,566,133.00	2.71
124	601136	首创证券	1,554,897.00	2.69
125	688012	中微公司	1,551,676.65	2.69
126	600196	复星医药	1,527,432.00	2.65
127	000100	TCL科技	1,525,718.00	2.64
128	000807	云铝股份	1,525,590.00	2.64
129	600085	同仁堂	1,523,812.00	2.64
130	600050	中国联通	1,516,075.00	2.63
131	600989	宝丰能源	1,511,180.00	2.62
132	601939	建设银行	1,510,205.00	2.62
133	601916	浙商银行	1,509,649.00	2.62
134	601169	北京银行	1,487,478.00	2.58

135	600377	宁沪高速	1,474,770.00	2.55
136	001965	招商公路	1,467,795.00	2.54
137	001289	龙源电力	1,464,940.00	2.54
138	600919	江苏银行	1,461,295.00	2.53
139	000166	申万宏源	1,460,631.00	2.53
140	600893	航发动力	1,452,519.00	2.52
141	600584	长电科技	1,448,121.00	2.51
142	600588	用友网络	1,438,613.00	2.49
143	002074	国轩高科	1,438,007.00	2.49
144	603501	豪威集团	1,433,308.00	2.48
145	600482	中国动力	1,422,010.00	2.46
146	003816	中国广核	1,419,806.00	2.46
147	600887	伊利股份	1,417,665.00	2.46
148	688111	金山办公	1,411,167.82	2.44
149	002415	海康威视	1,409,001.00	2.44
150	600233	圆通速递	1,402,204.00	2.43
151	000617	中油资本	1,397,039.00	2.42
152	600406	国电南瑞	1,386,757.00	2.40
153	600023	浙能电力	1,386,455.00	2.40
154	000983	山西焦煤	1,376,077.00	2.38
155	300433	蓝思科技	1,374,032.00	2.38
156	600015	华夏银行	1,369,086.00	2.37
157	601868	中国能建	1,368,742.00	2.37
158	600066	宇通客车	1,349,786.73	2.34
159	002555	三七互娱	1,333,168.00	2.31
160	001979	招商蛇口	1,329,893.00	2.30
161	601878	浙商证券	1,328,735.00	2.30
162	603806	福斯特	1,322,997.00	2.29
163	605499	东鹏饮料	1,322,898.00	2.29
164	600660	福耀玻璃	1,319,485.00	2.29
165	600061	国投资本	1,316,180.00	2.28

166	600018	上港集团	1,311,797.00	2.27
167	600219	南山铝业	1,307,864.00	2.27
168	600489	中金黄金	1,303,527.00	2.26
169	601377	兴业证券	1,302,105.00	2.26
170	605117	德业股份	1,289,743.00	2.23
171	600000	浦发银行	1,289,633.00	2.23
172	601988	中国银行	1,285,953.00	2.23
173	601872	招商轮船	1,277,145.00	2.21
174	300347	泰格医药	1,264,490.00	2.19
175	688041	海光信息	1,263,345.66	2.19
176	600460	士兰微	1,261,637.00	2.19
177	600600	青岛啤酒	1,249,779.00	2.17
178	601288	农业银行	1,244,344.00	2.16
179	002304	洋河股份	1,225,945.00	2.12
180	000002	万 科 A	1,220,273.00	2.11
181	601998	中信银行	1,218,475.00	2.11
182	300033	同花顺	1,216,806.00	2.11
183	002648	卫星化学	1,212,222.00	2.10
184	601788	光大证券	1,210,596.00	2.10
185	002714	牧原股份	1,209,287.00	2.10
186	000876	新 希 望	1,208,924.00	2.09
187	601607	上海医药	1,204,094.00	2.09
188	600346	恒力石化	1,197,337.00	2.07
189	000301	东方盛虹	1,196,945.00	2.07
190	000408	藏格矿业	1,194,624.00	2.07
191	000425	徐工机械	1,182,650.00	2.05
192	600999	招商证券	1,180,017.00	2.04
193	601225	陕西煤业	1,177,250.00	2.04
194	601989	中国重工	1,176,749.00	2.04
195	000001	平安银行	1,161,593.00	2.01
196	601881	中国银河	1,158,913.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,420,645.00	9.39
2	300308	中际旭创	4,956,144.00	8.59
3	600276	恒瑞医药	4,469,850.80	7.74
4	300394	天孚通信	4,335,022.00	7.51
5	002463	沪电股份	4,248,690.00	7.36
6	300750	宁德时代	4,040,517.00	7.00
7	601865	福莱特	3,993,029.00	6.92
8	300502	新易盛	3,963,673.25	6.87
9	601899	紫金矿业	3,752,162.00	6.50
10	002459	晶澳科技	3,565,451.00	6.18
11	002594	比亚迪	3,533,826.90	6.12
12	600036	招商银行	3,515,942.00	6.09
13	000333	美的集团	3,345,927.00	5.80
14	601318	中国平安	3,311,455.00	5.74
15	300059	东方财富	3,168,184.00	5.49
16	000975	山金国际	3,138,752.00	5.44
17	300274	阳光电源	3,071,690.00	5.32
18	600745	闻泰科技	3,054,123.00	5.29
19	601138	工业富联	3,052,097.00	5.29
20	603993	洛阳钼业	2,904,955.00	5.03
21	600958	东方证券	2,875,884.00	4.98
22	002129	TCL中环	2,870,605.00	4.97
23	601808	中海油服	2,810,325.00	4.87
24	601688	华泰证券	2,810,151.00	4.87

25	603259	药明康德	2,805,004.00	4.86
26	688008	澜起科技	2,802,165.68	4.85
27	002916	深南电路	2,781,219.00	4.82
28	688256	寒武纪	2,718,922.83	4.71
29	601985	中国核电	2,622,679.00	4.54
30	600941	中国移动	2,584,269.00	4.48
31	601766	中国中车	2,578,648.00	4.47
32	601117	中国化学	2,544,845.00	4.41
33	601628	中国人寿	2,538,687.00	4.40
34	688303	大全能源	2,474,435.96	4.29
35	600436	片仔癀	2,471,004.00	4.28
36	601901	方正证券	2,456,284.00	4.26
37	601186	中国铁建	2,415,643.00	4.19
38	601211	国泰海通	2,406,813.04	4.17
39	600025	华能水电	2,404,469.00	4.17
40	601166	兴业银行	2,398,874.00	4.16
41	600183	生益科技	2,388,183.00	4.14
42	601919	中远海控	2,372,931.00	4.11
43	600372	中航机载	2,338,815.00	4.05
44	000858	五 粮 液	2,333,526.00	4.04
45	600795	国电电力	2,319,511.00	4.02
46	688599	天合光能	2,315,858.30	4.01
47	600900	长江电力	2,311,373.00	4.00
48	000651	格力电器	2,305,494.00	3.99
49	601668	中国建筑	2,302,252.00	3.99
50	688223	晶科能源	2,295,327.49	3.98
51	688472	阿特斯	2,274,361.19	3.94
52	601398	工商银行	2,225,971.00	3.86
53	600111	北方稀土	2,218,717.00	3.84
54	000776	广发证券	2,215,979.00	3.84
55	601319	中国人保	2,204,627.00	3.82

56	600438	通威股份	2,178,283.00	3.77
57	688981	中芯国际	2,172,627.00	3.76
58	002236	大华股份	2,157,954.00	3.74
59	603659	璞泰来	2,153,032.00	3.73
60	688187	时代电气	2,129,681.25	3.69
61	002475	立讯精密	2,122,367.00	3.68
62	600938	中国海油	2,120,054.00	3.67
63	600585	海螺水泥	2,107,596.00	3.65
64	600905	三峡能源	2,099,753.00	3.64
65	601006	大秦铁路	2,094,178.00	3.63
66	600011	华能国际	2,087,644.00	3.62
67	601336	新华保险	2,087,349.00	3.62
68	688506	百利天恒	2,082,200.46	3.61
69	601618	中国中冶	2,080,552.00	3.60
70	601818	光大银行	2,068,619.00	3.58
71	600030	中信证券	2,036,431.40	3.53
72	300760	迈瑞医疗	2,010,336.00	3.48
73	000596	古井贡酒	2,009,470.00	3.48
74	600415	小商品城	1,995,631.00	3.46
75	600547	山东黄金	1,973,238.00	3.42
76	601699	潞安环能	1,943,829.00	3.37
77	000999	华润三九	1,938,180.54	3.36
78	000630	铜陵有色	1,930,406.00	3.34
79	601669	中国电建	1,923,631.00	3.33
80	601012	隆基绿能	1,905,839.20	3.30
81	601995	中金公司	1,900,994.00	3.29
82	601857	中国石油	1,869,408.00	3.24
83	600028	中国石化	1,853,370.00	3.21
84	603019	中科曙光	1,842,932.00	3.19
85	300999	金龙鱼	1,830,711.00	3.17
86	603296	华勤技术	1,825,247.00	3.16

87	002252	上海莱士	1,819,096.00	3.15
88	600160	巨化股份	1,815,268.00	3.14
89	600150	中国船舶	1,811,012.00	3.14
90	000800	一汽解放	1,810,688.00	3.14
91	600674	川投能源	1,800,758.00	3.12
92	601066	中信建投	1,797,255.00	3.11
93	601009	南京银行	1,795,165.00	3.11
94	002938	鹏鼎控股	1,793,776.00	3.11
95	000625	长安汽车	1,792,013.40	3.10
96	600886	国投电力	1,783,158.00	3.09
97	000725	京东方 A	1,781,227.00	3.09
98	688009	中国通号	1,780,463.82	3.08
99	601939	建设银行	1,769,439.00	3.07
100	603799	华友钴业	1,758,372.00	3.05
101	000063	中兴通讯	1,749,973.00	3.03
102	601328	交通银行	1,731,737.00	3.00
103	601728	中国电信	1,730,312.00	3.00
104	601390	中国中铁	1,729,031.00	3.00
105	601799	星宇股份	1,719,082.00	2.98
106	601916	浙商银行	1,718,069.00	2.98
107	600196	复星医药	1,707,539.00	2.96
108	688036	传音控股	1,702,393.39	2.95
109	300832	新产业	1,692,338.00	2.93
110	002180	纳思达	1,690,013.00	2.93
111	000807	云铝股份	1,684,292.00	2.92
112	603806	福斯特	1,680,660.00	2.91
113	301269	华大九天	1,678,416.00	2.91
114	605117	德业股份	1,677,091.00	2.91
115	600027	华电国际	1,676,102.00	2.90
116	601601	中国太保	1,672,503.00	2.90
117	603288	海天味业	1,669,054.00	2.89

118	300442	润泽科技	1,658,293.00	2.87
119	601868	中国能建	1,645,199.00	2.85
120	601229	上海银行	1,628,389.00	2.82
121	601816	京沪高铁	1,624,567.00	2.81
122	600741	华域汽车	1,598,976.00	2.77
123	000166	申万宏源	1,597,358.00	2.77
124	600489	中金黄金	1,585,421.00	2.75
125	601088	中国神华	1,583,440.00	2.74
126	600690	海尔智家	1,575,206.00	2.73
127	600233	圆通速递	1,573,608.00	2.73
128	600588	用友网络	1,564,281.00	2.71
129	601136	首创证券	1,558,295.00	2.70
130	600085	同仁堂	1,544,984.00	2.68
131	002049	紫光国微	1,542,886.00	2.67
132	600309	万华化学	1,540,024.00	2.67
133	601127	赛力斯	1,531,791.00	2.65
134	002601	龙佰集团	1,531,731.00	2.65
135	000100	TCL科技	1,521,328.00	2.64
136	000617	中油资本	1,511,564.00	2.62
137	002230	科大讯飞	1,508,931.00	2.61
138	001289	龙源电力	1,497,478.00	2.59
139	601169	北京银行	1,484,628.00	2.57
140	600919	江苏银行	1,483,402.00	2.57
141	600377	宁沪高速	1,477,812.00	2.56
142	000876	新希望	1,475,688.00	2.56
143	688012	中微公司	1,467,095.94	2.54
144	601377	兴业证券	1,466,875.00	2.54
145	601288	农业银行	1,463,631.00	2.54
146	600989	宝丰能源	1,463,081.00	2.53
147	688111	金山办公	1,461,283.21	2.53
148	600018	上港集团	1,458,239.00	2.53

149	600584	长电科技	1,455,822.00	2.52
150	601881	中国银河	1,441,238.00	2.50
151	600050	中国联通	1,437,487.00	2.49
152	600887	伊利股份	1,428,586.00	2.47
153	002555	三七互娱	1,421,087.00	2.46
154	000001	平安银行	1,414,177.00	2.45
155	001965	招商公路	1,408,435.00	2.44
156	600023	浙能电力	1,407,255.00	2.44
157	002415	海康威视	1,404,866.00	2.43
158	300347	泰格医药	1,402,784.00	2.43
159	601689	拓普集团	1,402,564.00	2.43
160	003816	中国广核	1,401,083.00	2.43
161	600219	南山铝业	1,399,935.00	2.43
162	600061	国投资本	1,396,140.00	2.42
163	601872	招商轮船	1,392,932.00	2.41
164	000983	山西焦煤	1,383,353.00	2.40
165	601989	中国重工	1,381,265.07	2.39
166	002648	卫星化学	1,376,421.00	2.38
167	605499	东鹏饮料	1,368,568.00	2.37
168	600406	国电南瑞	1,359,577.00	2.36
169	000408	藏格矿业	1,355,253.00	2.35
170	600482	中国动力	1,354,826.00	2.35
171	600066	宇通客车	1,353,062.00	2.34
172	600660	福耀玻璃	1,351,144.00	2.34
173	601988	中国银行	1,345,600.00	2.33
174	002304	洋河股份	1,325,844.00	2.30
175	600016	民生银行	1,319,901.00	2.29
176	600893	航发动力	1,319,226.00	2.29
177	600015	华夏银行	1,316,425.00	2.28
178	002074	国轩高科	1,315,147.00	2.28
179	002001	新 和 成	1,303,040.00	2.26

180	600600	青岛啤酒	1,292,552.00	2.24
181	600999	招商证券	1,285,848.00	2.23
182	601878	浙商证券	1,284,852.00	2.23
183	600332	白云山	1,283,957.00	2.22
184	001979	招商蛇口	1,283,183.00	2.22
185	000002	万科A	1,282,860.00	2.22
186	600176	中国巨石	1,268,221.00	2.20
187	601838	成都银行	1,259,078.00	2.18
188	688041	海光信息	1,255,869.41	2.18
189	002493	荣盛石化	1,252,377.00	2.17
190	603501	豪威集团	1,246,260.00	2.16
191	601998	中信银行	1,233,414.00	2.14
192	600048	保利发展	1,232,882.00	2.14
193	002179	中航光电	1,212,113.00	2.10
194	600346	恒力石化	1,204,049.00	2.09
195	300033	同花顺	1,199,411.00	2.08
196	000538	云南白药	1,197,171.00	2.07
197	600009	上海机场	1,194,814.00	2.07
198	600460	士兰微	1,185,381.00	2.05
199	000301	东方盛虹	1,181,454.00	2.05
200	600000	浦发银行	1,170,622.00	2.03
201	601658	邮储银行	1,169,853.00	2.03
202	601788	光大证券	1,156,291.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	466,938,042.65
卖出股票收入（成交）总额	477,564,243.90

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	166,262.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,479.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,742.05

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
中泰沪深300量化 优选增强A	842	39,125.44	9,916,571.21	30.10%	23,027,050.84	69.90%
中泰沪深300量化 优选增强C	3,127	8,162.38	0.00	0.00%	25,523,769.18	100.00%
合计	3,969	14,731.01	9,916,571.21	16.96%	48,550,820.02	83.04%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中泰沪深300量化优 选增强A	378,620.28	1.15%
	中泰沪深300量化优 选增强C	1,236.72	0.00%
	合计	379,857.00	0.65%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	中泰沪深300量化 优选增强A	10~50
	中泰沪深300量化 优选增强C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	中泰沪深300量化 优选增强A	0

	中泰沪深300量化 优选增强C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰沪深300量化优选 增强A	中泰沪深300量化优选 增强C
基金合同生效日(2021年07月05日)基金份额总额	176,574,607.39	93,378,696.66
本报告期期初基金份额总额	42,774,394.78	26,182,062.81
本报告期基金总申购份额	5,461,809.59	17,465,282.44
减：本报告期基金总赎回份额	15,292,582.32	18,123,576.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	32,943,622.05	25,523,769.18

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2025年3月24日增聘姜诚先生担任公司副总经理职务。
本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币10,000.00元。

目前容诚会计师事务所(特殊普通合伙)向本基金提供审计服务的连续年限：自2024年12月10日起至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	4	943,922,908.97	100.00%	191,101.95	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例		金成交总 额的比例
中泰证 券	4,160.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰沪深300指数量化优选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指数量化优选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
3	中泰沪深300指数量化优选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
4	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金招募说明书（更新）2025年第1号	中国证监会规定网站	2025-05-14
5	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2025-05-14
6	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金2025年第2季度报告	中国证监会规定网站	2025-07-18
7	中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金2025年中期报告	中国证监会规定网站	2025-08-28
8	中泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2025-09-25
9	中泰沪深300指数量化优选	中国证监会规定网站	2025-10-28

	增强型证券投资基金2025年 第3季度报告		
--	--------------------------	--	--

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 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。

12.2 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。

12.3 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
二〇二六年三月三十日