

中泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 26 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月25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2026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.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
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.....	17
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62
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.....	64

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.....65

§10 重大事件揭示.....65

10.1 基金份额持有人大会决议..... 65

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..... 65

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....66

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况..... 66

10.8 其他重大事件.....67

§11 备查文件目录.....67

11.1 备查文件目录.....67

11.2 存放地点.....68

11.3 查阅方式.....68

§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	184,162,058.65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	136,673,189.77份	47,488,868.88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		姜天坊	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金中期报告置备地点	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 (2026年01月01日-2026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	17,483,719.49	5,392,790.58
本期利润	22,270,765.54	6,868,085.72
加权平均基金份额本期利润	0.1370	0.1182
本期加权平均净值利润率	7.90%	6.99%
本期基金份额净值增长率	9.01%	8.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	103,713,952.69	34,056,231.56
期末可供分配基金份额利润	0.7588	0.7171
期末基金资产净值	252,739,372.05	85,646,642.32
期末基金份额净值	1.8492	1.8035
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	84.92%	80.35%

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 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	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

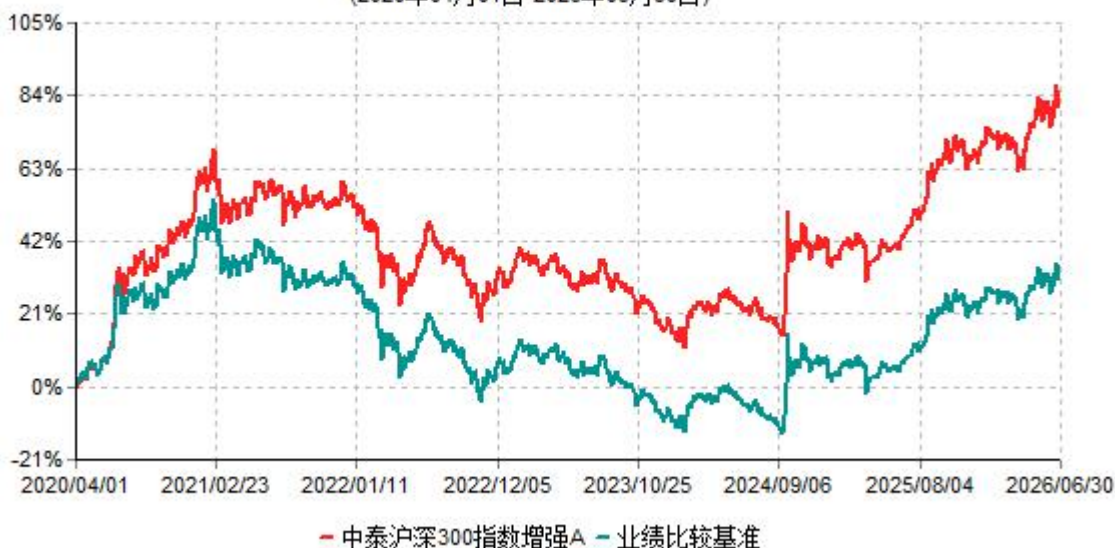
				④		
过去三个月	13.16%	1.16%	11.30%	1.19%	1.86%	-0.03%
过去六个月	9.01%	1.05%	7.20%	1.07%	1.81%	-0.02%
过去一年	28.89%	0.95%	25.13%	0.97%	3.76%	-0.02%
过去三年	41.83%	1.03%	28.26%	1.06%	13.57%	-0.03%
过去五年	16.16%	1.03%	-4.02%	1.06%	20.18%	-0.03%
自基金合同生效起至今	84.92%	1.07%	33.85%	1.09%	51.07%	-0.02%

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
过去三个月	13.05%	1.16%	11.30%	1.19%	1.75%	-0.03%
过去六个月	8.80%	1.05%	7.20%	1.07%	1.60%	-0.02%
过去一年	28.37%	0.95%	25.13%	0.97%	3.24%	-0.02%
过去三年	40.14%	1.03%	28.26%	1.06%	11.88%	-0.03%
过去五年	13.86%	1.03%	-4.02%	1.06%	17.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	80.35%	1.07%	33.85%	1.09%	46.50%	-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-2026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-2026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2026年6月30日，公司作为基金管理人共管理三十三只证券投资基金：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、中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金、中泰双益债券型证券投资基金、中泰稳固90天持有期债券型证券投资基金。

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；权益公募投资部副总经理。	2020-04-01	-	22	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。
李玉刚	本基金基金经理；权益公募投资部首席基金经理。	2022-01-04	-	25	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、研究部总经理兼量化公募投资部总经理，现任权益公募投资部首席基金经理。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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

本报告期内，未发生异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，国内经济总体平稳，出口高增与高技术产业景气对增长形成支撑，但房地产投资下行与消费修复偏弱对修复斜率形成制约。A股市场呈现显著结构性分化，算力硬件（CPO、半导体等）等科技成长方向在AI资本开支扩张与国产替代驱动下持续领涨，消费、地产及部分传统权重受需求疲弱与盈利下修压制，整体表现相对落后。

本基金是指数增强型产品，控制跟踪误差，在绝大多数情况下都不会落后指数太多，是我们的第一要务。

本基金的策略是选择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，替代相同类型的成份股。这些优秀公司可能是成份股，也可能是非成份股。有一些成份股可能找不到我们认可的、相同类型的优秀公司，则不进行替代，保持它在指数里的权重。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。

从长期回报的角度看，股票的收益来源来自于公司长期经营的积累。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，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。

本基金不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。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1.8492元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.01%，同期业绩比较基准收益率为7.20%；截至报告期末中泰沪深300指数增强C基金份额净值为1.8035元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.80%，同期业绩比较基准收益率为7.20%。

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，都有可能导致完全不同的结果。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数量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、利润分配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，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§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：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,325,456.72	25,791,553.33
结算备付金		2,103,322.63	991,071.26
存出保证金		-	330,710.40
交易性金融资产	6.4.7.2	316,246,668.51	330,236,610.99
其中：股票投资		316,138,662.36	330,236,610.99
基金投资		-	-
债券投资		108,006.15	-
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		633,248.42	872,537.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		339,308,696.28	358,222,483.21
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		567,978.87	844,922.06
应付管理人报酬		215,103.80	240,100.87
应付托管费		26,887.96	30,012.64
应付销售服务费		26,854.97	33,852.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	85,856.17	162,850.27
负债合计		922,681.91	1,311,738.07
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	184,162,058.65	211,752,916.28
未分配利润	6.4.7.8	154,223,955.72	145,157,828.86
净资产合计		338,386,014.37	356,910,745.14
负债和净资产总计		339,308,696.28	358,222,483.21

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额184,162,058.65份，其中A类份额136,673,189.77份，C类份额47,488,868.88份。A类份额净值1.8492元，C类份额净值1.8035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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		31,101,954.00	10,376,869.94
1.利息收入		102,428.80	101,010.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	102,428.80	101,010.26
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）		24,348,198.22	10,945,926.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	22,970,351.85	6,670,911.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6.02	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	-1,748,925.01	-82,714.66
股利收益	6.4.7.13	3,126,765.36	4,352,996.23
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.14	6,262,341.19	-822,241.47

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	388,985.79	152,174.33
减：二、营业总支出		1,963,102.74	2,231,030.25
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,502,774.97	1,547,316.92
2.托管费	6.4.10.2.2	187,846.78	193,414.55
3.销售服务费	6.4.10.2.3	192,896.72	394,248.23
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		38.61	-
8.其他费用	6.4.7.16	79,545.66	96,050.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		29,138,851.26	8,145,839.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		29,138,851.26	8,145,839.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,138,851.26	8,145,839.69

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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026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	211,752,916.28	145,157,828.86	356,910,745.14
二、本期期初净资产	211,752,916.28	145,157,828.86	356,910,745.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,590,857.63	9,066,126.86	-18,524,730.77
（一）、综合收益总额	-	29,138,851.26	29,138,851.26
（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）	-27,590,857.63	-20,072,724.40	-47,663,582.03
其中：1.基金申购款	128,436,541.35	92,839,149.73	221,275,691.08
2.基金赎回款	-156,027,398.98	-112,911,874.13	-268,939,273.11
（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	184,162,058.65	154,223,955.72	338,386,014.37
项 目	上年度可比期间		
	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	-38,318,959.88	-8,390,418.81	-46,709,378.69

填列)			
(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

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:

姜天坊

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2026年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投

资基金信息披露XBRL模板第3号--年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026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2026年6月30日的财务状况以及2026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》、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。

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 2026年06月30日
活期存款	8,624,295.94
等于：本金	8,623,716.75
加：应计利息	579.19
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	11,701,160.78
等于：本金	11,697,487.07
加：应计利息	3,673.71
减：坏账准备	-
合计	20,325,456.72

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 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		273,625,431.77	-	316,138,662.36	42,513,230.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	108,000.00	6.15	108,006.15	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	108,000.00	6.15	108,006.15	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		273,733,431.77	6.15	316,246,668.51	42,513,230.59

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 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	622.71
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
其他应付	5,890.30
合计	85,856.17

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 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,650,084.77	152,650,084.77
本期申购	84,788,227.53	84,788,227.53

本期赎回（以“-”号填列）	-100,765,122.53	-100,765,122.53
本期末	136,673,189.77	136,673,189.77

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 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,102,831.51	59,102,831.51
本期申购	43,648,313.82	43,648,313.82
本期赎回（以“-”号填列）	-55,262,276.45	-55,262,276.45
本期末	47,488,868.88	47,488,868.88

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	98,678,245.88	7,611,226.72	106,289,472.60
本期期初	98,678,245.88	7,611,226.72	106,289,472.60
本期利润	17,483,719.49	4,787,046.05	22,270,765.54
本期基金份额交易产生的变动数	-12,448,012.68	-46,043.18	-12,494,055.86
其中：基金申购款	57,461,866.76	5,136,014.53	62,597,881.29
基金赎回款	-69,909,879.44	-5,182,057.71	-75,091,937.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	103,713,952.69	12,352,229.59	116,066,182.28

6.4.7.8.2 中泰沪深300指数增强C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(中泰沪深300指数增强C)			
上年度末	36,098,013.57	2,770,342.69	38,868,356.26
本期期初	36,098,013.57	2,770,342.69	38,868,356.26
本期利润	5,392,790.58	1,475,295.14	6,868,085.72
本期基金份额交易产生的变动数	-7,434,572.59	-144,095.95	-7,578,668.54
其中：基金申购款	28,360,410.56	1,880,857.88	30,241,268.44
基金赎回款	-35,794,983.15	-2,024,953.83	-37,819,936.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,056,231.56	4,101,541.88	38,157,773.44

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	14,384.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	76,498.96
结算备付金利息收入	11,545.64
其他	-
合计	102,428.80

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	558,402,546.79
减：卖出股票成本总额	534,867,453.75
减：交易费用	564,741.19
买卖股票差价收入	22,970,351.85

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 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	6.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	6.02

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 2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	-1,748,925.01

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,126,765.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,126,765.36

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	6,243,861.19

——股票投资	6,243,861.19
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	18,480.00
——权证投资	-
——期货投资	18,480.00
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	6,262,341.19

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	386,569.15
其他	118.65
基金转换费收入	2,297.99
合计	388,985.79

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026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	202.50
合计	79,545.66

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、关联关系

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 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,502,774.97	1,547,316.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	585,140.13	670,240.57
应支付基金管理人的净管理费	917,634.84	877,076.35

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 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	187,846.78	193,414.55

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 2026年01月01日至2026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
中泰资管	0.00	2,306.06	2,306.06
中泰证券	0.00	15,186.53	15,186.53
光大银行	0.00	12,383.74	12,383.74
合计	0.00	29,876.33	29,876.33

获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	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

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×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 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025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	-	-
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	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
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	3.74%	3.57%

中泰沪深300指数增强C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025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	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	8,624,295.94	14,384.20	3,381,454.07	17,187.94

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（2026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
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	680	31,334.40	315,064.40	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	105	8,597.40	166,354.65	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股锁定	10.11	10.11	10,048	101,585.28	101,585.28	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	615	12,103.20	87,016.35	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	创业板打新限售	69.66	160.06	375	26,122.50	60,022.50	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个交易日	新股未上市	10.11	10.11	4,305	43,523.55	43,523.55	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	88	8,111.84	40,757.20	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月	科创板打新限售	22.68	47.61	798	18,098.64	37,992.78	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,582	12,371.24	32,810.68	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股锁定	17.70	84.32	286	5,062.20	24,115.52	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	创业板打新限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	创业板打新限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	创业板打新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股锁定	27.19	31.31	379	10,305.01	11,866.49	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打新限售	78.38	121.77	94	7,367.72	11,446.38	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股锁定	53.26	58.74	155	8,255.30	9,104.70	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打新限售	55.95	57.10	152	8,504.40	8,679.20	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股锁定	11.18	17.59	351	3,924.18	6,174.09	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
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
118070	南芯转债	2026-06-18	15个交易日	新债未上市	100.00	100.01	1,080	108,000.00	108,006.15	-

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

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	832.00	2026-07-13	890.99	1,067	702,185.26	887,744.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。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。

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，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。

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	108,006.15	-
合计	108,006.15	-

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%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的，A股和港股通标的股票合并计算）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、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 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	20,325,456.72	-	-	-	-	-	20,325,456.72
结算备付金	2,103,322.63	-	-	-	-	-	2,103,322.63
交易性金融资产	-	-	-	-	108,006.15	316,138,662.36	316,246,668.51
应收申	-	-	-	-	-	633,248.42	633,248.42

购款							
资产总计	22,428,779.35	-	-	-	108,006.15	316,771,910.78	339,308,696.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	567,978.87	567,978.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	215,103.80	215,103.80
应付托管费	-	-	-	-	-	26,887.96	26,887.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,854.97	26,854.97
应交税费	-	-	-	-	-	0.14	0.14
其他负债	-	-	-	-	-	85,856.17	85,856.17
负债总计	-	-	-	-	-	922,681.91	922,681.91
利率敏感度缺口	22,428,779.35	-	-	-	108,006.15	315,849,228.87	338,386,014.37
上年度末 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	25,791,553.33	-	-	-	-	-	25,791,553.33
结算备付金	991,071.26	-	-	-	-	-	991,071.26
存出保证金	-	-	-	-	-	330,710.40	330,710.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	330,236,610.99	330,236,610.99
应收申购款	-	-	-	-	-	872,537.23	872,537.23
资产总计	26,782,624.59	-	-	-	-	331,439,858.62	358,222,483.21

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	844,922.06	844,922.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	240,100.87	240,100.87
应付托管费	-	-	-	-	-	30,012.64	30,012.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	33,852.23	33,852.23
其他负债	-	-	-	-	-	162,850.27	162,850.27
负债总计	-	-	-	-	-	1,311,738.07	1,311,738.07
利率敏感度缺口	26,782,624.59	-	-	-	-	330,128,120.55	356,910,745.14

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 2026年06月30日		上年度末 2025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	316,138,662.36	93.43	330,236,610.99	92.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	108,006.15	0.03	-	-
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	316,246,668.51	93.46	330,236,610.99	92.53

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	比较基准上升5%	17,778,459.00	17,955,487.27
	比较基准下降5%	-17,778,459.00	-17,955,487.27

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	314,016,434.32	328,127,407.52
第二层次	1,140,858.98	1,543,158.76
第三层次	1,089,375.21	566,044.71
合计	316,246,668.51	330,236,610.99

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2026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（2025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	316,138,662.36	93.17
	其中：股票	316,138,662.36	93.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	108,006.15	0.03
	其中：债券	108,006.15	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,428,779.35	6.61
8	其他各项资产	633,248.42	0.19

9	合计	339,308,696.28	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,147,416.10	0.34
B	采矿业	14,104,964.00	4.17
C	制造业	198,942,098.38	58.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,804,680.00	2.31
E	建筑业	4,067,615.00	1.20
F	批发和零售业	101,372.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	7,008,044.00	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,151,874.54	4.77
J	金融业	55,062,460.73	16.27
K	房地产业	803,879.00	0.24
L	租赁和商务服务业	1,063,043.79	0.31
M	科学研究和技术服务业	3,587,755.65	1.06
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	387,394.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	180,767.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	310,413,364.19	91.73

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	32,810.68	0.01
C	制造业	3,961,761.07	1.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,108.83	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,539.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,482,128.13	0.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	94,367.00	0.03
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	5,725,298.17	1.69

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	300308	中际旭创	12,340	15,671,800.00	4.63
2	300750	宁德时代	29,360	11,538,773.60	3.41
3	600519	贵州茅台	8,553	10,139,495.97	3.00
4	300502	新易盛	15,504	9,410,928.00	2.78
5	600036	招商银行	242,846	8,621,033.00	2.55
6	601318	中国平安	161,400	7,705,236.00	2.28
7	603986	兆易创新	7,500	6,112,500.00	1.81
8	000333	美的集团	80,600	6,087,718.00	1.80
9	601899	紫金矿业	239,200	6,013,488.00	1.78
10	688012	中微公司	12,314	5,769,109.00	1.70
11	002371	北方华创	6,265	5,541,768.40	1.64
12	688256	寒武纪	3,408	5,437,634.40	1.61
13	600030	中信证券	173,135	4,974,168.55	1.47
14	601398	工商银行	615,200	4,349,464.00	1.29
15	601939	建设银行	437,500	4,213,125.00	1.25
16	688008	澜起科技	12,912	4,001,428.80	1.18
17	002475	立讯精密	56,600	3,984,640.00	1.18
18	688041	海光信息	10,292	3,811,127.60	1.13
19	002384	东山精密	14,200	3,725,370.00	1.10
20	600276	恒瑞医药	70,092	3,647,587.68	1.08
21	600900	长江电力	135,800	3,594,626.00	1.06
22	603259	药明康德	28,815	3,587,755.65	1.06
23	000725	京东方 A	405,500	3,519,740.00	1.04
24	601138	工业富联	44,100	3,181,815.00	0.94
25	688981	中芯国际	18,986	3,015,356.52	0.89
26	000776	广发证券	124,480	2,912,832.00	0.86
27	600183	生益科技	16,200	2,809,080.00	0.83

28	601995	中金公司	75,600	2,732,940.00	0.81
29	300059	东方财富	128,200	2,612,716.00	0.77
30	601668	中国建筑	600,500	2,606,170.00	0.77
31	300274	阳光电源	16,100	2,560,222.00	0.76
32	601166	兴业银行	151,700	2,512,152.00	0.74
33	300408	三环集团	14,900	2,486,810.00	0.73
34	002594	比亚迪	30,200	2,406,940.00	0.71
35	300476	胜宏科技	6,800	2,355,724.00	0.70
36	002463	沪电股份	14,900	2,276,720.00	0.67
37	300394	天孚通信	7,248	2,193,824.64	0.65
38	000988	华工科技	11,200	2,067,632.00	0.61
39	301308	江波龙	2,900	2,041,020.00	0.60
40	601288	农业银行	329,800	2,001,886.00	0.59
41	600660	福耀玻璃	38,650	1,949,506.00	0.58
42	600176	中国巨石	26,659	1,942,907.92	0.57
43	600309	万华化学	27,300	1,867,593.00	0.55
44	600522	中天科技	30,300	1,838,604.00	0.54
45	603019	中科曙光	16,300	1,747,849.00	0.52
46	600585	海螺水泥	102,500	1,737,375.00	0.51
47	688521	芯原股份	4,676	1,735,450.64	0.51
48	600150	中国船舶	50,100	1,692,879.00	0.50
49	000338	潍柴动力	59,600	1,624,100.00	0.48
50	000858	五粮液	21,500	1,591,000.00	0.47
51	002311	海大集团	34,400	1,534,584.00	0.45
52	601816	京沪高铁	325,800	1,475,874.00	0.44
53	000568	泸州老窖	18,918	1,466,523.36	0.43
54	002916	深南电路	3,050	1,396,595.00	0.41
55	002415	海康威视	40,700	1,391,940.00	0.41
56	600919	江苏银行	126,900	1,367,982.00	0.40
57	600111	北方稀土	28,200	1,355,010.00	0.40
58	601688	华泰证券	64,000	1,319,680.00	0.39

59	601088	中国神华	33,500	1,307,840.00	0.39
60	000063	中兴通讯	35,800	1,295,602.00	0.38
61	000100	TCL科技	222,060	1,292,389.20	0.38
62	600089	特变电工	56,900	1,280,250.00	0.38
63	300124	汇川技术	19,200	1,273,536.00	0.38
64	601857	中国石油	146,600	1,272,488.00	0.38
65	603993	洛阳钼业	68,200	1,196,910.00	0.35
66	002028	思源电气	6,900	1,193,700.00	0.35
67	300433	蓝思科技	22,200	1,191,252.00	0.35
68	600584	长电科技	11,500	1,190,825.00	0.35
69	600031	三一重工	65,802	1,137,058.56	0.34
70	600000	浦发银行	130,600	1,124,466.00	0.33
71	300014	亿纬锂能	16,900	1,099,007.00	0.32
72	601601	中国太保	38,500	1,098,020.00	0.32
73	000792	盐湖股份	35,200	1,062,688.00	0.31
74	600549	厦门钨业	12,400	1,056,480.00	0.31
75	002353	杰瑞股份	6,800	1,037,000.00	0.31
76	601225	陕西煤业	50,200	1,021,570.00	0.30
77	601211	国泰海通	55,962	1,018,508.40	0.30
78	002714	牧原股份	28,990	1,014,360.10	0.30
79	002050	三花智控	23,100	1,012,473.00	0.30
80	000657	中钨高新	10,100	966,772.00	0.29
81	601919	中远海控	71,200	944,112.00	0.28
82	002602	世纪华通	65,400	922,140.00	0.27
83	600887	伊利股份	38,339	918,602.44	0.27
84	600016	民生银行	278,900	898,058.00	0.27
85	601728	中国电信	172,300	894,237.00	0.26
86	688072	拓荆科技	1,067	887,744.00	0.26
87	002230	科大讯飞	21,300	869,892.00	0.26
88	600941	中国移动	10,000	861,300.00	0.25
89	300661	圣邦股份	5,909	847,823.32	0.25

90	601985	中国核电	91,300	824,439.00	0.24
91	002460	赣锋锂业	12,500	817,500.00	0.24
92	300033	同花顺	3,380	814,580.00	0.24
93	002709	天赐材料	15,800	812,594.00	0.24
94	002938	鹏鼎控股	7,700	811,426.00	0.24
95	603799	华友钴业	16,810	811,250.60	0.24
96	603501	豪威集团	8,500	806,225.00	0.24
97	000977	浪潮信息	11,500	805,000.00	0.24
98	300442	润泽科技	9,100	755,937.00	0.22
99	002202	金风科技	31,600	755,240.00	0.22
100	600160	巨化股份	13,900	736,839.00	0.22
101	000425	徐工机械	91,000	736,190.00	0.22
102	000938	紫光股份	25,400	733,044.00	0.22
103	600926	杭州银行	50,400	728,280.00	0.22
104	000651	格力电器	19,400	727,500.00	0.21
105	601600	中国铝业	88,000	723,360.00	0.21
106	600028	中国石化	162,100	722,966.00	0.21
107	601012	隆基绿能	55,000	721,600.00	0.21
108	600938	中国海油	26,500	719,475.00	0.21
109	601328	交通银行	111,300	715,659.00	0.21
110	002600	领益智造	40,800	707,472.00	0.21
111	002466	天齐锂业	11,500	705,180.00	0.21
112	600050	中国联通	175,000	700,000.00	0.21
113	300760	迈瑞医疗	5,000	679,150.00	0.20
114	002837	英维克	8,500	676,260.00	0.20
115	002142	宁波银行	22,162	657,989.78	0.19
116	002179	中航光电	14,126	652,621.20	0.19
117	601872	招商轮船	35,800	629,006.00	0.19
118	002241	歌尔股份	27,700	624,081.00	0.18
119	601006	大秦铁路	132,300	609,903.00	0.18
120	600406	国电南瑞	26,388	602,965.80	0.18

121	000630	铜陵有色	93,400	594,024.00	0.18
122	600905	三峡能源	158,700	588,777.00	0.17
123	001979	招商蛇口	90,900	584,487.00	0.17
124	600489	中金黄金	32,300	583,015.00	0.17
125	601888	中国中免	10,849	582,699.79	0.17
126	002625	光启技术	19,100	579,112.00	0.17
127	605117	德业股份	5,380	571,248.40	0.17
128	600893	航发动力	14,800	567,432.00	0.17
129	600010	包钢股份	253,200	564,636.00	0.17
130	002049	紫光国微	6,200	550,250.00	0.16
131	601100	恒立液压	5,100	548,556.00	0.16
132	688111	金山办公	2,550	543,277.50	0.16
133	600118	中国卫星	6,600	541,530.00	0.16
134	688126	沪硅产业	13,518	539,233.02	0.16
135	600019	宝钢股份	98,600	535,398.00	0.16
136	600760	中航沈飞	12,620	518,682.00	0.15
137	000807	云铝股份	23,100	511,434.00	0.15
138	600426	华鲁恒升	21,200	507,104.00	0.15
139	601127	赛力斯	8,200	502,250.00	0.15
140	688183	生益电子	3,772	499,412.80	0.15
141	300450	先导智能	12,200	496,784.00	0.15
142	601689	拓普集团	8,700	490,854.00	0.15
143	603288	海天味业	14,800	490,768.00	0.15
144	600875	东方电气	16,900	486,213.00	0.14
145	300316	晶盛机电	7,700	465,080.00	0.14
146	601916	浙商银行	176,200	463,406.00	0.14
147	600795	国电电力	98,900	461,863.00	0.14
148	600547	山东黄金	20,000	461,800.00	0.14
149	603893	瑞芯微	2,300	433,228.00	0.13
150	601868	中国能建	161,400	430,938.00	0.13
151	601727	上海电气	61,300	429,100.00	0.13

152	601698	中国卫通	14,100	426,525.00	0.13
153	600460	士兰微	7,800	426,348.00	0.13
154	601669	中国电建	90,700	426,290.00	0.13
155	600482	中国动力	12,600	413,280.00	0.12
156	002558	巨人网络	14,700	405,132.00	0.12
157	300418	昆仑万维	10,000	403,600.00	0.12
158	603296	华勤技术	5,400	401,058.00	0.12
159	300015	爱尔眼科	46,900	387,394.00	0.11
160	600438	通威股份	31,879	386,054.69	0.11
161	600221	海航控股	285,400	385,290.00	0.11
162	002532	天山铝业	35,900	385,207.00	0.11
163	000157	中联重科	55,100	384,047.00	0.11
164	300803	指南针	4,100	375,847.00	0.11
165	688036	传音控股	6,371	375,570.45	0.11
166	600011	华能国际	48,800	370,392.00	0.11
167	601898	中煤能源	29,900	364,182.00	0.11
168	600115	中国东航	94,500	360,045.00	0.11
169	002236	大华股份	21,800	359,482.00	0.11
170	600066	宇通客车	13,300	356,573.00	0.11
171	600570	恒生电子	16,780	355,568.20	0.11
172	000625	长安汽车	49,570	355,416.90	0.11
173	600886	国投电力	26,700	355,377.00	0.11
174	600015	华夏银行	54,200	346,338.00	0.10
175	003816	中国广核	87,200	340,952.00	0.10
176	688396	华润微	3,475	338,986.25	0.10
177	601360	三六零	38,800	337,172.00	0.10
178	600026	中远海能	18,500	331,890.00	0.10
179	002074	国轩高科	12,000	330,120.00	0.10
180	600009	上海机场	13,800	318,780.00	0.09
181	000768	中航西飞	15,500	317,440.00	0.09
182	601877	正泰电器	12,600	315,882.00	0.09

183	000975	山金国际	18,500	314,500.00	0.09
184	601111	中国国航	51,700	312,785.00	0.09
185	600415	小商品城	30,700	311,912.00	0.09
186	600029	南方航空	59,900	310,282.00	0.09
187	600674	川投能源	21,700	307,489.00	0.09
188	600219	南山铝业	76,500	305,235.00	0.09
189	601117	中国化学	41,400	304,290.00	0.09
190	601838	成都银行	17,100	302,670.00	0.09
191	301236	软通动力	6,900	292,905.00	0.09
192	600372	中航机载	26,900	291,865.00	0.09
193	688047	龙芯中科	1,852	286,448.84	0.08
194	000538	云南白药	6,000	284,220.00	0.08
195	601058	赛轮轮胎	23,400	269,802.00	0.08
196	605499	东鹏饮料	2,140	264,140.20	0.08
197	600362	江西铜业	6,100	264,130.00	0.08
198	600233	圆通速递	16,700	263,025.00	0.08
199	600989	宝丰能源	12,500	254,125.00	0.08
200	002352	顺丰控股	8,100	253,206.00	0.07
201	300866	安克创新	2,400	250,800.00	0.07
202	601021	春秋航空	5,400	246,132.00	0.07
203	002920	德赛西威	3,000	244,500.00	0.07
204	002001	新 和 成	8,500	241,570.00	0.07
205	688223	晶科能源	50,556	240,141.00	0.07
206	600023	浙能电力	44,600	234,596.00	0.07
207	600039	四川路桥	29,000	226,780.00	0.07
208	603260	合盛硅业	4,400	212,344.00	0.06
209	600588	用友网络	22,800	209,304.00	0.06
210	001965	招商公路	22,600	207,016.00	0.06
211	601169	北京银行	40,700	199,430.00	0.06
212	600027	华电国际	44,800	199,360.00	0.06
213	688472	阿特斯	18,424	199,347.68	0.06

214	302132	中航成飞	3,300	192,456.00	0.06
215	300628	亿联网络	5,600	189,392.00	0.06
216	600025	华能水电	21,100	187,579.00	0.06
217	000617	中油资本	28,100	185,179.00	0.05
218	300122	智飞生物	15,600	182,364.00	0.05
219	300251	光线传媒	16,300	180,767.00	0.05
220	000001	平安银行	17,600	176,880.00	0.05
221	600930	华电新能	37,000	176,490.00	0.05
222	600515	海南机场	63,500	173,990.00	0.05
223	002027	分众传媒	34,800	168,432.00	0.05
224	600803	新奥股份	10,300	162,740.00	0.05
225	600018	上港集团	33,600	158,592.00	0.05
226	600845	宝信软件	9,500	157,985.00	0.05
227	601009	南京银行	14,700	145,383.00	0.04
228	000708	中信特钢	11,200	141,344.00	0.04
229	688271	联影医疗	1,380	139,697.40	0.04
230	002648	卫星化学	5,800	136,242.00	0.04
231	601018	宁波港	43,100	135,765.00	0.04
232	300498	温氏股份	10,800	133,056.00	0.04
233	600436	片仔癀	1,200	131,136.00	0.04
234	300896	爱美客	1,500	130,800.00	0.04
235	001280	中国铀业	1,900	126,730.00	0.04
236	300413	芒果超媒	8,300	121,429.00	0.04
237	301165	锐捷网络	1,500	120,675.00	0.04
238	301269	华大九天	1,000	119,420.00	0.04
239	601238	广汽集团	22,400	113,792.00	0.03
240	000999	华润三九	4,500	101,205.00	0.03
241	601607	上海医药	6,400	98,560.00	0.03
242	600104	上汽集团	9,700	94,672.00	0.03
243	000408	藏格矿业	1,200	83,184.00	0.02
244	603392	万泰生物	3,000	80,910.00	0.02

245	002493	荣盛石化	7,400	79,550.00	0.02
246	601901	方正证券	10,400	74,880.00	0.02
247	600085	同仁堂	3,200	73,952.00	0.02
248	600346	恒力石化	3,900	69,069.00	0.02
249	001391	国货航	16,300	66,341.00	0.02
250	600196	复星医药	2,900	65,163.00	0.02
251	600600	青岛啤酒	1,160	60,586.80	0.02
252	300999	金龙鱼	2,500	58,150.00	0.02
253	600958	东方证券	6,000	56,640.00	0.02
254	601390	中国中铁	11,800	49,206.00	0.01
255	601825	沪农商行	6,500	48,685.00	0.01
256	601377	兴业证券	7,900	47,716.00	0.01
257	000166	申万宏源	10,600	46,640.00	0.01
258	688303	大全能源	2,566	44,725.38	0.01
259	000002	万 科 A	14,400	42,624.00	0.01
260	300832	新产业	900	37,800.00	0.01
261	601077	渝农商行	6,100	37,271.00	0.01
262	600690	海尔智家	1,700	34,697.00	0.01
263	000301	东方盛虹	3,000	34,350.00	0.01
264	601456	国联民生	3,700	32,708.00	0.01
265	601881	中国银河	2,600	32,682.00	0.01
266	601878	浙商证券	3,300	31,350.00	0.01
267	600741	华域汽车	1,800	27,936.00	0.01
268	600999	招商证券	1,300	27,430.00	0.01
269	000895	双汇发展	1,200	26,880.00	0.01
270	002736	国信证券	2,600	25,974.00	0.01
271	601618	中国中冶	9,100	22,204.00	0.01
272	601633	长城汽车	1,400	21,126.00	0.01
273	600061	国投资本	3,000	19,650.00	0.01
274	688009	中国通号	2,926	13,927.76	0.00
275	000963	华东医药	100	2,812.00	0.00

276	600048	保利发展	600	2,778.00	0.00
277	601229	上海银行	300	2,604.00	0.00
278	601136	首创证券	100	1,395.00	0.00
279	601800	中国交建	200	1,142.00	0.00
280	601658	邮储银行	200	986.00	0.00
281	601998	中信银行	100	693.00	0.00
282	601319	中国人保	100	676.00	0.00
283	601186	中国铁建	100	595.00	0.00
284	601988	中国银行	100	572.00	0.00
285	601766	中国中车	100	520.00	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	688484	南芯科技	26,237	1,482,128.13	0.44
2	002078	太阳纸业	67,000	836,830.00	0.25
3	300470	中密控股	27,500	797,775.00	0.24
4	600486	扬农化工	14,520	736,164.00	0.22
5	600566	济川药业	14,300	317,317.00	0.09
6	301666	大普微	680	315,064.40	0.09
7	002032	苏泊尔	4,700	186,120.00	0.06
8	688808	联讯仪器	105	166,354.65	0.05
9	001248	华润新能源	14,353	145,108.83	0.04
10	600153	建发股份	11,900	94,367.00	0.03
11	688820	盛合晶微	615	87,016.35	0.03
12	301682	宏明电子	375	60,022.50	0.02
13	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.02
14	688785	恒运昌	88	40,757.20	0.01
15	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01

16	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
17	688781	视涯科技	798	37,992.78	0.01
18	001257	盛龙股份	1,582	32,810.68	0.01
19	002080	中材科技	300	27,000.00	0.01
20	603459	红板科技	286	24,115.52	0.01
21	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
22	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
23	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
24	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
25	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
26	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
27	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
28	001365	天海电子	379	11,866.49	0.00
29	301683	慧谷新材	94	11,446.38	0.00
30	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
31	001237	惠康科技	155	9,104.70	0.00
32	688816	易思维	152	8,679.20	0.00
33	601061	中信金属	700	7,539.00	0.00
34	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
35	601112	振石股份	351	6,174.09	0.00
36	600060	海信视像	200	5,574.00	0.00
37	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
38	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
39	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
40	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
41	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
42	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	601939	建设银行	9,625,554.00	2.70
2	601398	工商银行	9,223,715.00	2.58
3	600519	贵州茅台	8,684,774.00	2.43
4	601995	中金公司	8,460,033.00	2.37
5	600036	招商银行	8,315,301.62	2.33
6	601668	中国建筑	7,500,988.00	2.10
7	601318	中国平安	7,377,704.30	2.07
8	601211	国泰海通	7,102,395.00	1.99
9	000333	美的集团	6,988,065.40	1.96
10	688012	中微公司	6,900,714.84	1.93
11	000776	广发证券	6,833,154.00	1.91
12	000858	五 粮 液	6,742,040.00	1.89
13	601688	华泰证券	6,223,333.00	1.74
14	002311	海大集团	5,930,887.00	1.66
15	600660	福耀玻璃	5,868,150.50	1.64
16	600585	海螺水泥	5,555,103.00	1.56
17	002371	北方华创	5,463,073.00	1.53
18	600000	浦发银行	5,454,954.00	1.53
19	600309	万华化学	5,424,506.00	1.52
20	601166	兴业银行	5,357,789.00	1.50

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	300750	宁德时代	10,813,945.00	3.03

2	601398	工商银行	10,262,189.00	2.88
3	600036	招商银行	9,899,961.00	2.77
4	600519	贵州茅台	9,791,921.29	2.74
5	601668	中国建筑	9,733,598.00	2.73
6	000333	美的集团	8,238,650.00	2.31
7	601688	华泰证券	8,213,532.00	2.30
8	601166	兴业银行	7,912,965.00	2.22
9	000858	五 粮 液	7,632,750.00	2.14
10	601318	中国平安	7,258,182.00	2.03
11	002371	北方华创	7,243,985.00	2.03
12	601995	中金公司	6,644,791.00	1.86
13	600887	伊利股份	6,575,841.00	1.84
14	601939	建设银行	6,524,404.00	1.83
15	000792	盐湖股份	6,334,769.00	1.77
16	600919	江苏银行	6,317,648.00	1.77
17	600900	长江电力	6,019,154.00	1.69
18	600309	万华化学	5,920,218.00	1.66
19	600660	福耀玻璃	5,769,846.00	1.62
20	603259	药明康德	5,648,938.00	1.58

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	514,525,643.93
卖出股票收入（成交）总额	558,402,546.79

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)	108,006.15	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	108,006.15	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118070	南芯转债	1,080	108,006.15	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，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约定的备选股票库。

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	633,248.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	633,248.42

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指数增强A	390,736	349.78	28,085,049.63	20.55%	108,588,140.14	79.45%
中泰沪深300指数增强C	7,587	6,259.24	1,412,035.23	2.97%	46,076,833.65	97.03%
合计	398,323	462.34	29,497,084.86	16.02%	154,664,973.79	83.98%

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	1,285,465.60	0.94%
	中泰沪深300指数增强C	1,839.99	0.00%
	合计	1,287,305.59	0.70%

注：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	152,650,084.77	59,102,831.51
本报告期基金总申购份额	84,788,227.53	43,648,313.82
减：本报告期基金总赎回份额	100,765,122.53	55,262,276.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	136,673,189.77	47,488,868.88

§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，姜天坊先生自2026年5月7日起担任中泰证券（上海）资产管理有限公司董事长职务。

本报告期内，姜诚先生自2026年5月7日起代任中泰证券（上海）资产管理有限公司总经理职务。

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。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
光大证券	2	1,071,244,620.65	100.00%	216,842.60	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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

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2025年第4季度报告	中国证监会规定网站	2026-01-22
2	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定网站	2026-03-30
3	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	2026-04-08
4	中泰沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）2026年第1号	中国证监会规定网站	2026-04-08
5	中泰沪深300指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定网站	2026-04-21
6	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金风险等级调整的公告	中国证券报、中国证监会规定网站	2026-04-30

§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
二〇二六年八月二十六日