

中泰中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.12 投资组合报告附注.....	67
§8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68

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.....	69
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	69
§9 开放式基金份额变动.....	70
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	71
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.....	71
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	72
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中泰中证A500指增发起	
基金主代码	022781	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	19,134,214.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰中证A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C
下属分级基金的交易代码	022781	022782
报告期末下属分级基金的份额总额	15,310,368.48份	3,823,846.28份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，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	本基金为股票增强型指数基金，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。 指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整。此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳

	的个股，将采用合理方法进行适当的替代。由于受到各项投资比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时基金将会采用合理方法进行适当的替代。 本基金通过构建多因子量化增强模型来实现量化增强策略。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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。同时本基金为股票指数增强型基金，通过跟踪标的指数表现，理论上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。 本基金投资于港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	方圆
	联系电话	021-20521199	95559
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-821-0808	95559
传真		021-50933716	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号24楼05室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		姜天坊	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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)	
	中泰中证A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C
本期已实现收益	2,219,404.94	587,607.47
本期利润	2,462,481.91	628,050.03
加权平均基金份额本期利润	0.1446	0.1393
本期加权平均净值利润率	11.30%	10.94%
本期基金份额净值增长率	10.88%	10.65%
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	4,543,977.89	1,109,262.93
期末可供分配基金份额利润	0.2968	0.2901
期末基金资产净值	20,861,996.42	5,184,144.39
期末基金份额净值	1.3626	1.3557

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	36.26%	35.57%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

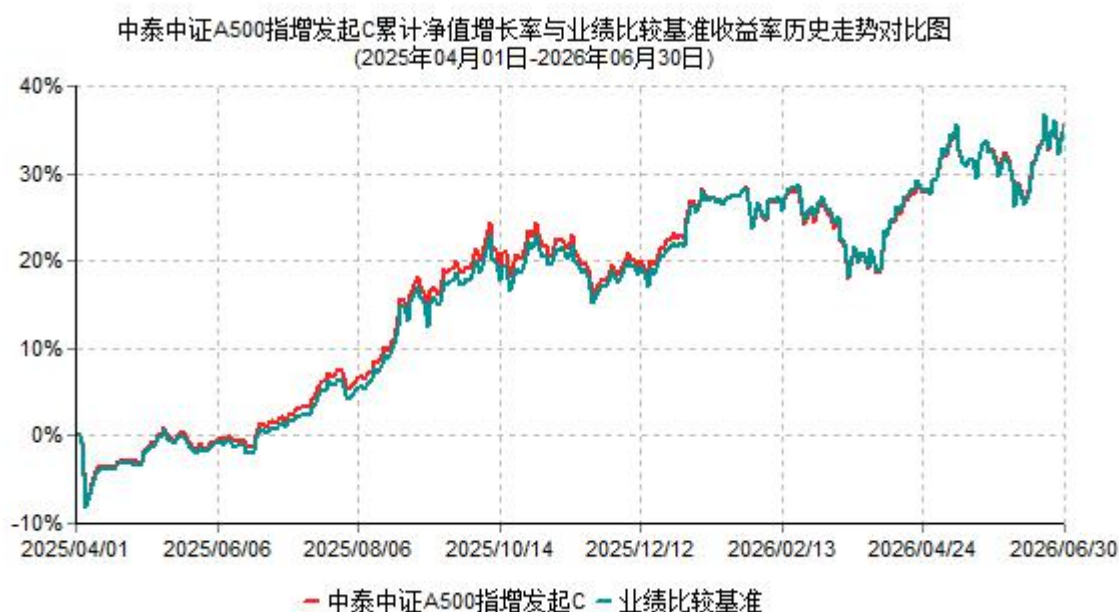
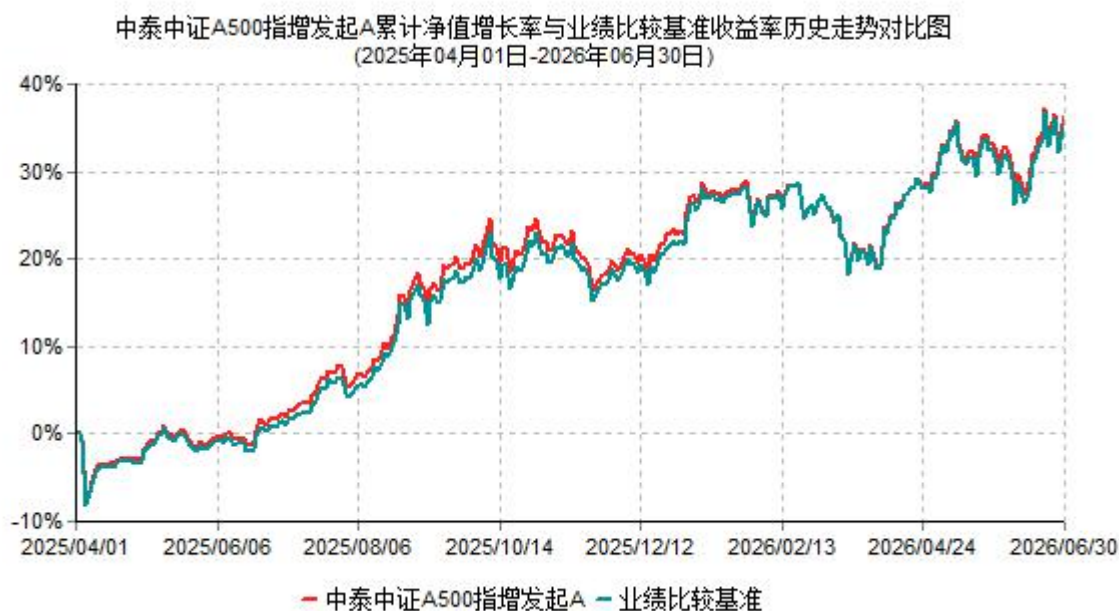
中泰中证A500指增发起A

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	13.85%	1.28%	13.54%	1.34%	0.31%	-0.06%
过去六个月	10.88%	1.18%	11.34%	1.22%	-0.46%	-0.04%
过去一年	33.92%	1.06%	34.41%	1.09%	-0.49%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	36.26%	1.07%	35.52%	1.10%	0.74%	-0.03%

中泰中证A500指增发起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	13.73%	1.28%	13.54%	1.34%	0.19%	-0.06%
过去六个月	10.65%	1.18%	11.34%	1.22%	-0.69%	-0.04%
过去一年	33.37%	1.06%	34.41%	1.09%	-1.04%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	35.57%	1.07%	35.52%	1.10%	0.05%	-0.03%

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



§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	2025-04-01	-	22	国籍：中国。学历：华东师范大学硕士研究生。具备证

	经理。				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。	2025-04-01	-	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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

本报告期内，未发生异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，且成分股按照市值加权，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

截至报告期末中泰中证A500指增发起A基金份额净值为1.3626元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.88%，同期业绩比较基准收益率为11.34%；截至报告期末中泰中证A500指增发起C基金份额净值为1.3557元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.65%，同期业绩比较基准收益率为11.34%。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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，基金托管人在中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，中泰证券（上海）资产管理有限公司在中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中泰证券（上海）资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、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：中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金

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	2,533,267.33	3,773,753.84
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,687,187.62	32,206,462.31
其中：股票投资		23,676,187.08	32,206,462.31
基金投资		-	-
债券投资		11,000.54	-
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		5,710.98	19,287.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		26,226,165.93	35,999,503.76
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		121,584.72	1,243,930.82
应付管理人报酬		16,973.29	24,392.27
应付托管费		2,121.67	3,049.03
应付销售服务费		1,779.45	3,061.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	37,565.99	115,180.94
负债合计		180,025.12	1,389,615.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	19,134,214.76	28,182,357.80
未分配利润	6.4.7.8	6,911,926.05	6,427,530.92
净资产合计		26,046,140.81	34,609,888.72
负债和净资产总计		26,226,165.93	35,999,503.76

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额19,134,214.76份，其中A类份额15,310,368.48份，C类份额3,823,846.28份。A类份额净值1.3626元，C类份额净值1.3557元。

6.2 利润表

会计主体：中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金

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04月01日（基金 合同生效日）至2025年 06月30日
一、营业总收入		3,261,994.95	1,480,301.62
1.利息收入		5,076.77	19,011.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,076.77	19,011.34
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）		2,960,527.62	95,112.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,742,826.11	-837,065.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.54	2,180.11
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	217,700.97	929,997.76
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	283,519.53	1,302,484.03
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	12,871.03	63,693.75
减：二、营业总支出		171,463.01	459,129.49
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	109,146.26	286,777.66
2.托管费	6.4.10.2.2	13,643.23	35,847.21
3.销售服务费	6.4.10.2.3	11,481.64	92,424.62
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.16	37,191.88	44,080.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,090,531.94	1,021,172.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,090,531.94	1,021,172.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,090,531.94	1,021,172.13

6.3 净资产变动表

会计主体：中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金

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	28,182,357.80	6,427,530.92	34,609,888.72
二、本期期初净资产	28,182,357.80	6,427,530.92	34,609,888.72

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,048,143.04	484,395.13	-8,563,747.91
（一）、综合收益总额	-	3,090,531.94	3,090,531.94
（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）	-9,048,143.04	-2,606,136.81	-11,654,279.85
其中：1.基金申购款	5,472,299.58	1,548,778.96	7,021,078.54
2.基金赎回款	-14,520,442.62	-4,154,915.77	-18,675,358.39
（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	19,134,214.76	6,911,926.05	26,046,140.81
项 目	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	217,877,365.26	-	217,877,365.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-151,779,013.43	1,125,389.71	-150,653,623.72
（一）、综合收益总额	-	1,021,172.13	1,021,172.13

（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）	-151,779,013.43	104,217.58	-151,674,795.85
其中：1.基金申购款	1,846,876.68	5,565.87	1,852,442.55
2.基金赎回款	-153,625,890.11	98,651.71	-153,527,238.40
（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	66,098,351.83	1,125,389.71	67,223,741.54

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

中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金(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[2024]1674号《关于准予中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰中证A500指数增强型发起式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217,828,036.29元。经向中国证监会备案,《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2025年4月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为217,877,365.26份，其中认购资金利息折合49,328.97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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于其他依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、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）、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（但须符合中国证监会的相关规定）。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。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。本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的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%，其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证A500指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、2026年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部 税务总局 证监会公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部 税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部 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》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部 税务总局公告2025第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续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。

(b)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联交所”）上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司

（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

(d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与香港联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	1,150,763.25
等于：本金	1,150,749.08
加：应计利息	14.17
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	1,382,504.08
等于：本金	1,382,184.33

加：应计利息	319.75
减：坏账准备	-
合计	2,533,267.33

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		19,914,803.91	-	23,676,187.08	3,761,383.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,000.00	0.54	11,000.54	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,000.00	0.54	11,000.54	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		19,925,803.91	0.54	23,687,187.62	3,761,383.17

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	76.11
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	12,396.69
预提费用-信息披露费	24,795.19
其他应付	298.00
合计	37,565.99

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中泰中证A500指增发起A

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起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	21,852,428.25	21,852,428.25
本期申购	2,689,687.10	2,689,687.10
本期赎回（以“-”号填列）	-9,231,746.87	-9,231,746.87
本期末	15,310,368.48	15,310,368.48

6.4.7.7.2 中泰中证A500指增发起C

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起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	6,329,929.55	6,329,929.55
本期申购	2,782,612.48	2,782,612.48
本期赎回（以“-”号填列）	-5,288,695.75	-5,288,695.75
本期末	3,823,846.28	3,823,846.28

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中泰中证A500指增发起A

单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,736,141.72	1,266,144.89	5,002,286.61
本期期初	3,736,141.72	1,266,144.89	5,002,286.61
本期利润	2,219,404.94	243,076.97	2,462,481.91
本期基金份额交易产生的变动数	-1,411,568.77	-501,571.81	-1,913,140.58
其中：基金申购款	666,341.08	100,807.34	767,148.42
基金赎回款	-2,077,909.85	-602,379.15	-2,680,289.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,543,977.89	1,007,650.05	5,551,627.94

6.4.7.8.2 中泰中证A500指增发起C

单位：人民币元

项目 (中泰中证A500指增发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,058,815.65	366,428.66	1,425,244.31
本期期初	1,058,815.65	366,428.66	1,425,244.31
本期利润	587,607.47	40,442.56	628,050.03
本期基金份额交易产生的变动数	-537,160.19	-155,836.04	-692,996.23
其中：基金申购款	660,497.91	121,132.63	781,630.54

基金赎回款	-1,197,658.10	-276,968.67	-1,474,626.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,109,262.93	251,035.18	1,360,298.11

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	190.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,885.90
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,076.77

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	44,448,785.55
减：卖出股票成本总额	41,663,168.43
减：交易费用	42,791.01
买卖股票差价收入	2,742,826.11

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	0.54
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	0.54

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	217,700.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	217,700.97

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	283,519.53
——股票投资	283,519.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	283,519.53

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	12,852.40
基金转换费收入	18.63
合计	12,871.03

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	12,396.69
信息披露费	24,795.19
合计	37,191.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方、关联关系

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
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	77,298,159.22	100.00%	459,966,864.76	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中泰证券	-	-	8,180.58	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	15,604.85	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	92,818.48	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。

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2026年06月30日	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	109,146.26	286,777.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,494.11	104,685.02
应支付基金管理人的净管理费	82,652.15	182,092.64

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X0.80%/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04月01日（基金合同生 效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,643.23	35,847.21

注：支付基金托管人交通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X0.10%/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		
	中泰中证A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C	合计
中泰资管	0.00	0.95	0.95
中泰证券	0.00	9,659.57	9,659.57
交通银行	0.00	304.86	304.86
合计	0.00	9,965.38	9,965.38
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰中证A500指增发起A	中泰中证A500指增发起C	合计
交通银行	0.00	789.81	789.81
中泰证券	0.00	91,351.82	91,351.82
中泰资管	0.00	0.05	0.05

合计	0.00	92,141.68	92,141.68
----	------	-----------	-----------

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰资管，再由中泰资管计算并支付给各基金销售机构。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

中泰中证A500指增发起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04月01日（基金 合同生效日）至2025年0 6月30日
基金合同生效日（2025年04月01日）持有的基金份额	10,001,333.47	10,001,333.47
报告期初持有的基金份额	10,001,333.47	10,001,333.47
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	10,001,333.47	10,001,333.47
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	65.32%	27.81%

中泰中证A500指增发起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04月01日（基金 合同生效日）至2025年0 6月30日
基金合同生效日（2025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04月01日（基金合同生效日） 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
交通银行	1,150,763.25	190.87	5,425,111.16	1,762.74
中泰证券	1,382,504.08	4,885.90	4,972,814.09	17,248.60

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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：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	90	9,000.00	9,000.51	-
111025	圣泉转债	2026-06-25	18个交易日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.03	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。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	11,000.54	-
合计	11,000.54	-

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上市公司发行的证券（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	2,533,267.33	-	-	-	-	-	2,533,267.33
交易性金融资产	-	-	-	-	11,000.54	23,676,187.08	23,687,187.62
应收申购款	-	-	-	-	-	5,710.98	5,710.98
资产总计	2,533,267.33	-	-	-	11,000.54	23,681,898.06	26,226,165.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	121,584.72	121,584.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,973.29	16,973.29
应付托管费	-	-	-	-	-	2,121.67	2,121.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,779.45	1,779.45
其他负债	-	-	-	-	-	37,565.99	37,565.99
负债总计	-	-	-	-	-	180,025.12	180,025.12
利率敏感度缺口	2,533,267.33	-	-	-	11,000.54	23,501,872.94	26,046,140.81
上年度末	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

2025年 12月31 日							
资产							
货币资金	3,773,753.84	-	-	-	-	-	3,773,753.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	32,206,462.31	32,206,462.31
应收申购款	-	-	-	-	-	19,287.61	19,287.61
资产总计	3,773,753.84	-	-	-	-	32,225,749.92	35,999,503.76
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,243,930.82	1,243,930.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,392.27	24,392.27
应付托管费	-	-	-	-	-	3,049.03	3,049.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,061.98	3,061.98
其他负债	-	-	-	-	-	115,180.94	115,180.94
负债总计	-	-	-	-	-	1,389,615.04	1,389,615.04
利率敏感度缺口	3,773,753.84	-	-	-	-	30,836,134.88	34,609,888.72

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。

本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；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	23,676,187.08	90.90	32,206,462.31	93.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	11,000.54	0.04	-	-

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	23,687,187.62	90.94	32,206,462.31	93.06

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%	1,446,677.84	1,863,051.38
	比较基准下降5%	-1,446,677.84	-1,863,051.38

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	23,676,187.08	32,077,961.51
第二层次	11,000.54	128,500.80
第三层次	-	-
合计	23,687,187.62	32,206,462.31

6.4.14.2 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等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,676,187.08	90.28
	其中：股票	23,676,187.08	90.28

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,000.54	0.04
	其中：债券	11,000.54	0.04
	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	2,533,267.33	9.66
8	其他各项资产	5,710.98	0.02
9	合计	26,226,165.93	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	-	-
B	采矿业	1,070,840.00	4.11
C	制造业	16,299,048.09	62.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	493,280.00	1.89
E	建筑业	244,972.00	0.94
F	批发和零售业	136,629.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	499,217.00	1.92
H	住宿和餐饮业	9,765.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,404,037.86	5.39
J	金融业	2,126,716.00	8.17
K	房地产业	98,514.00	0.38
L	租赁和商务服务业	140,149.00	0.54

M	科学研究和技术服务业	422,076.00	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	41,212.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,429.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	18,009.00	0.07
S	综合	41,622.00	0.16
	合计	23,092,515.95	88.66

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	291,207.40	1.12
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	117,329.73	0.45
J	金融业	175,134.00	0.67
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	583,671.13	2.24

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	800	1,016,000.00	3.90
2	300750	宁德时代	1,900	746,719.00	2.87
3	300502	新易盛	1,036	628,852.00	2.41
4	600519	贵州茅台	500	592,745.00	2.28
5	600036	招商银行	16,300	578,650.00	2.22
6	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.83
7	601318	中国平安	9,400	448,756.00	1.72
8	000333	美的集团	5,900	445,627.00	1.71
9	601899	紫金矿业	17,000	427,380.00	1.64
10	688012	中微公司	894	418,839.00	1.61
11	603986	兆易创新	500	407,500.00	1.56
12	603259	药明康德	3,200	398,432.00	1.53
13	002371	北方华创	415	367,092.40	1.41
14	002475	立讯精密	3,700	260,480.00	1.00
15	688041	海光信息	682	252,544.60	0.97
16	600030	中信证券	8,400	241,332.00	0.93

17	688008	澜起科技	762	236,143.80	0.91
18	002384	东山精密	900	236,115.00	0.91
19	600900	长江电力	8,900	235,583.00	0.90
20	600276	恒瑞医药	4,500	234,180.00	0.90
21	600660	福耀玻璃	4,600	232,024.00	0.89
22	000725	京东方 A	26,500	230,020.00	0.88
23	601398	工商银行	30,300	214,221.00	0.82
24	688981	中芯国际	1,291	205,036.62	0.79
25	600183	生益科技	1,100	190,740.00	0.73
26	300059	东方财富	9,200	187,496.00	0.72
27	600585	海螺水泥	10,400	176,280.00	0.68
28	300274	阳光电源	1,100	174,922.00	0.67
29	600309	万华化学	2,500	171,025.00	0.66
30	300408	三环集团	1,000	166,900.00	0.64
31	600487	亨通光电	1,400	153,076.00	0.59
32	002463	沪电股份	1,000	152,800.00	0.59
33	301308	江波龙	200	140,760.00	0.54
34	300394	天孚通信	460	139,232.80	0.53
35	300476	胜宏科技	400	138,572.00	0.53
36	601668	中国建筑	29,900	129,766.00	0.50
37	000988	华工科技	700	129,227.00	0.50
38	002594	比亚迪	1,600	127,520.00	0.49
39	601288	农业银行	20,900	126,863.00	0.49
40	600176	中国巨石	1,700	123,896.00	0.48
41	600522	中天科技	2,000	121,360.00	0.47
42	688525	佰维存储	245	121,208.85	0.47
43	601166	兴业银行	6,900	114,264.00	0.44
44	600150	中国船舶	3,300	111,507.00	0.43
45	002595	豪迈科技	2,380	110,908.00	0.43
46	603993	洛阳钼业	6,300	110,565.00	0.42
47	603019	中科曙光	1,000	107,230.00	0.41

48	000858	五 粮 液	1,400	103,600.00	0.40
49	600584	长电科技	1,000	103,550.00	0.40
50	002281	光迅科技	400	102,776.00	0.39
51	688347	华虹宏力	305	102,571.50	0.39
52	300604	长川科技	300	102,426.00	0.39
53	601816	京沪高铁	21,300	96,489.00	0.37
54	000338	潍柴动力	3,500	95,375.00	0.37
55	300124	汇川技术	1,400	92,862.00	0.36
56	002415	海康威视	2,700	92,340.00	0.35
57	002916	深南电路	200	91,580.00	0.35
58	600486	扬农化工	1,800	91,260.00	0.35
59	002008	大族激光	600	90,066.00	0.35
60	000063	中兴通讯	2,400	86,856.00	0.33
61	600111	北方稀土	1,800	86,490.00	0.33
62	300136	信维通信	700	83,475.00	0.32
63	601857	中国石油	9,600	83,328.00	0.32
64	600089	特变电工	3,700	83,250.00	0.32
65	300661	圣邦股份	580	83,218.40	0.32
66	000100	TCL科技	13,900	80,898.00	0.31
67	300433	蓝思科技	1,500	80,490.00	0.31
68	688521	芯原股份	214	79,423.96	0.30
69	601088	中国神华	2,000	78,080.00	0.30
70	001979	招商蛇口	11,800	75,874.00	0.29
71	300223	北京君正	300	74,670.00	0.29
72	300014	亿纬锂能	1,100	71,533.00	0.27
73	601601	中国太保	2,500	71,300.00	0.27
74	002050	三花智控	1,600	70,128.00	0.27
75	000792	盐湖股份	2,300	69,437.00	0.27
76	002156	通富微电	900	68,283.00	0.26
77	600549	厦门钨业	800	68,160.00	0.26
78	300857	协创数据	200	67,980.00	0.26

79	000657	中钨高新	700	67,004.00	0.26
80	600426	华鲁恒升	2,800	66,976.00	0.26
81	601919	中远海控	4,700	62,322.00	0.24
82	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.24
83	002436	兴森科技	1,200	61,140.00	0.23
84	002353	杰瑞股份	400	61,000.00	0.23
85	002602	世纪华通	4,300	60,630.00	0.23
86	600941	中国移动	700	60,291.00	0.23
87	300475	香农芯创	200	60,000.00	0.23
88	601225	陕西煤业	2,900	59,015.00	0.23
89	600031	三一重工	3,400	58,752.00	0.23
90	601728	中国电信	11,300	58,647.00	0.23
91	601012	隆基绿能	4,400	57,728.00	0.22
92	002230	科大讯飞	1,400	57,176.00	0.22
93	600406	国电南瑞	2,500	57,125.00	0.22
94	603501	豪威集团	600	56,910.00	0.22
95	601211	国泰海通	3,100	56,420.00	0.22
96	688777	中控技术	478	56,165.00	0.22
97	000977	浪潮信息	800	56,000.00	0.22
98	300760	迈瑞医疗	400	54,332.00	0.21
99	601985	中国核电	6,000	54,180.00	0.21
100	603799	华友钴业	1,100	53,086.00	0.20
101	300054	鼎龙股份	500	52,985.00	0.20
102	002938	鹏鼎控股	500	52,690.00	0.20
103	002460	赣锋锂业	800	52,320.00	0.20
104	002028	思源电气	300	51,900.00	0.20
105	002709	天赐材料	1,000	51,430.00	0.20
106	002851	麦格米特	300	50,154.00	0.19
107	300442	润泽科技	600	49,842.00	0.19
108	002466	天齐锂业	800	49,056.00	0.19
109	002202	金风科技	2,000	47,800.00	0.18

110	601600	中国铝业	5,800	47,676.00	0.18
111	600028	中国石化	10,600	47,276.00	0.18
112	002600	领益智造	2,700	46,818.00	0.18
113	000938	紫光股份	1,600	46,176.00	0.18
114	600938	中国海油	1,700	46,155.00	0.18
115	600050	中国联通	11,500	46,000.00	0.18
116	688002	睿创微纳	295	45,633.55	0.18
117	002407	多氟多	900	45,207.00	0.17
118	002080	中材科技	500	45,000.00	0.17
119	605117	德业股份	420	44,595.60	0.17
120	300033	同花顺	180	43,380.00	0.17
121	601100	恒立液压	400	43,024.00	0.17
122	688111	金山办公	200	42,610.00	0.16
123	002179	中航光电	900	41,580.00	0.16
124	002837	英维克	520	41,371.20	0.16
125	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.16
126	002241	歌尔股份	1,800	40,554.00	0.16
127	688271	联影医疗	400	40,492.00	0.16
128	600879	航天电子	1,900	40,451.00	0.16
129	601872	招商轮船	2,300	40,411.00	0.16
130	300395	菲利华	300	40,119.00	0.15
131	601006	大秦铁路	8,700	40,107.00	0.15
132	603288	海天味业	1,200	39,792.00	0.15
133	002625	光启技术	1,300	39,416.00	0.15
134	688396	华润微	400	39,020.00	0.15
135	000568	泸州老窖	500	38,760.00	0.15
136	600905	三峡能源	10,400	38,584.00	0.15
137	600893	航发动力	1,000	38,340.00	0.15
138	600489	中金黄金	2,100	37,905.00	0.15
139	601888	中国中免	700	37,597.00	0.14
140	300390	天华新能	400	37,404.00	0.14

141	300037	新宙邦	400	37,140.00	0.14
142	600160	巨化股份	700	37,107.00	0.14
143	600673	东阳光	1,100	36,938.00	0.14
144	600010	包钢股份	16,500	36,795.00	0.14
145	600887	伊利股份	1,500	35,940.00	0.14
146	300058	蓝色光标	2,600	35,776.00	0.14
147	002049	紫光国微	400	35,500.00	0.14
148	002273	水晶光电	1,000	35,480.00	0.14
149	600019	宝钢股份	6,500	35,295.00	0.14
150	000960	锡业股份	800	34,152.00	0.13
151	601689	拓普集团	600	33,852.00	0.13
152	000807	云铝股份	1,500	33,210.00	0.13
153	000426	兴业银锡	1,000	32,960.00	0.13
154	601727	上海电气	4,700	32,900.00	0.13
155	600760	中航沈飞	800	32,880.00	0.13
156	300782	卓胜微	300	32,874.00	0.13
157	600118	中国卫星	400	32,820.00	0.13
158	600460	士兰微	600	32,796.00	0.13
159	300450	先导智能	800	32,576.00	0.13
160	605589	圣泉集团	500	31,785.00	0.12
161	600988	赤峰黄金	1,200	31,584.00	0.12
162	002078	太阳纸业	2,500	31,225.00	0.12
163	000630	铜陵有色	4,900	31,164.00	0.12
164	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.12
165	600795	国电电力	6,500	30,355.00	0.12
166	301358	湖南裕能	400	30,348.00	0.12
167	300316	晶盛机电	500	30,200.00	0.12
168	600547	山东黄金	1,300	30,017.00	0.12
169	002126	银轮股份	600	29,880.00	0.11
170	600392	盛和资源	1,000	29,770.00	0.11
171	601669	中国电建	6,300	29,610.00	0.11

172	002738	中矿资源	500	29,495.00	0.11
173	002138	顺络电子	400	29,240.00	0.11
174	000425	徐工机械	3,600	29,124.00	0.11
175	600497	驰宏锌锗	2,400	29,064.00	0.11
176	002129	TCL中环	2,400	28,848.00	0.11
177	600153	建发股份	3,600	28,548.00	0.11
178	601179	中国西电	1,900	28,348.00	0.11
179	300418	昆仑万维	700	28,252.00	0.11
180	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.11
181	600141	兴发集团	600	28,182.00	0.11
182	002352	顺丰控股	900	28,134.00	0.11
183	300015	爱尔眼科	3,400	28,084.00	0.11
184	300346	南大光电	300	27,795.00	0.11
185	000831	中国稀土	500	27,745.00	0.11
186	002558	巨人网络	1,000	27,560.00	0.11
187	300803	指南针	300	27,501.00	0.11
188	601868	中国能建	10,200	27,234.00	0.10
189	600066	宇通客车	1,000	26,810.00	0.10
190	002185	华天科技	1,200	26,772.00	0.10
191	002812	恩捷股份	400	26,764.00	0.10
192	000066	中国长城	1,400	26,670.00	0.10
193	600580	卧龙电驱	800	26,480.00	0.10
194	000651	格力电器	700	26,250.00	0.10
195	600362	江西铜业	600	25,980.00	0.10
196	002532	天山铝业	2,400	25,752.00	0.10
197	600221	海航控股	18,700	25,245.00	0.10
198	688036	传音控股	424	24,994.80	0.10
199	300438	鹏辉能源	300	24,855.00	0.10
200	600143	金发科技	1,600	24,720.00	0.09
201	002340	格林美	3,700	24,457.00	0.09
202	600011	华能国际	3,200	24,288.00	0.09

203	600438	通威股份	2,000	24,220.00	0.09
204	600115	中国东航	6,200	23,622.00	0.09
205	300017	网宿科技	1,800	23,418.00	0.09
206	000933	神火股份	1,100	23,320.00	0.09
207	600570	恒生电子	1,100	23,309.00	0.09
208	603659	璞泰来	800	23,144.00	0.09
209	300339	润和软件	600	23,106.00	0.09
210	002236	大华股份	1,400	23,086.00	0.09
211	600482	中国动力	700	22,960.00	0.09
212	002456	欧菲光	2,400	22,704.00	0.09
213	600886	国投电力	1,700	22,627.00	0.09
214	003816	中国广核	5,700	22,287.00	0.09
215	002074	国轩高科	800	22,008.00	0.08
216	601360	三六零	2,500	21,725.00	0.08
217	688390	固德威	200	21,702.00	0.08
218	600026	中远海能	1,200	21,528.00	0.08
219	688213	思特威	200	21,414.00	0.08
220	301236	软通动力	500	21,225.00	0.08
221	300866	安克创新	200	20,900.00	0.08
222	300207	欣旺达	1,100	20,889.00	0.08
223	600711	盛屯矿业	1,900	20,843.00	0.08
224	002128	电投能源	900	20,808.00	0.08
225	600009	上海机场	900	20,790.00	0.08
226	002555	三七互娱	1,100	20,757.00	0.08
227	002472	双环传动	500	20,755.00	0.08
228	601111	中国国航	3,400	20,570.00	0.08
229	000768	中航西飞	1,000	20,480.00	0.08
230	000975	山金国际	1,200	20,400.00	0.08
231	600989	宝丰能源	1,000	20,330.00	0.08
232	600415	小商品城	2,000	20,320.00	0.08
233	600029	南方航空	3,900	20,202.00	0.08

234	601877	正泰电器	800	20,056.00	0.08
235	600219	南山铝业	5,000	19,950.00	0.08
236	601117	中国化学	2,700	19,845.00	0.08
237	600674	川投能源	1,400	19,838.00	0.08
238	300458	全志科技	500	19,730.00	0.08
239	300115	长盈精密	700	19,558.00	0.08
240	600372	中航机载	1,800	19,530.00	0.07
241	002517	恺英网络	1,200	19,500.00	0.07
242	688469	芯联集成	1,827	19,384.47	0.07
243	300454	深信服	200	19,240.00	0.07
244	002155	湖南黄金	800	19,096.00	0.07
245	000878	云南铜业	1,200	19,056.00	0.07
246	688169	石头科技	200	18,994.00	0.07
247	600839	四川长虹	2,700	18,846.00	0.07
248	300568	星源材质	1,000	18,720.00	0.07
249	600885	宏发股份	540	18,624.60	0.07
250	300496	中科创达	300	18,537.00	0.07
251	688122	西部超导	293	18,403.33	0.07
252	601021	春秋航空	400	18,232.00	0.07
253	600418	江淮汽车	700	18,081.00	0.07
254	300763	锦浪科技	200	18,070.00	0.07
255	002027	分众传媒	3,700	17,908.00	0.07
256	002465	海格通信	1,400	17,878.00	0.07
257	688676	金盘科技	208	17,605.12	0.07
258	300024	机器人	900	17,397.00	0.07
259	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.07
260	600875	东方电气	600	17,262.00	0.07
261	000547	航天发展	900	17,235.00	0.07
262	002130	沃尔核材	900	17,064.00	0.07
263	002756	永兴材料	300	16,992.00	0.07
263	000733	振华科技	300	16,992.00	0.07

264	300012	华测检测	1,200	16,632.00	0.06
265	300083	创世纪	1,200	16,344.00	0.06
266	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.06
267	002497	雅化集团	800	16,296.00	0.06
268	601615	明阳智能	1,400	16,198.00	0.06
269	002414	高德红外	1,200	15,912.00	0.06
270	688126	沪硅产业	397	15,836.33	0.06
271	300142	沃森生物	1,200	15,588.00	0.06
272	002444	巨星科技	500	15,550.00	0.06
273	000034	神州数码	560	15,540.00	0.06
274	300748	金力永磁	500	15,425.00	0.06
275	002025	航天电器	200	15,244.00	0.06
276	600096	云天化	500	15,200.00	0.06
277	600699	均胜电子	700	15,127.00	0.06
278	601677	明泰铝业	900	14,940.00	0.06
279	002252	上海莱士	3,400	14,756.00	0.06
280	603260	合盛硅业	300	14,478.00	0.06
281	300073	当升科技	300	14,412.00	0.06
282	688223	晶科能源	3,031	14,397.25	0.06
283	002831	裕同科技	400	14,224.00	0.05
284	600233	圆通速递	900	14,175.00	0.05
285	002432	九安医疗	200	14,136.00	0.05
286	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.05
287	300432	富临精工	700	14,063.00	0.05
288	600588	用友网络	1,500	13,770.00	0.05
289	001965	招商公路	1,500	13,740.00	0.05
290	688005	容百科技	446	13,647.60	0.05
291	603806	福斯特	800	13,432.00	0.05
292	000661	长春高新	200	13,320.00	0.05
293	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.05
294	688599	天合光能	925	13,061.00	0.05

295	002223	鱼跃医疗	500	12,830.00	0.05
296	000519	中兵红箭	600	12,642.00	0.05
297	605499	东鹏饮料	100	12,343.00	0.05
298	601127	赛力斯	200	12,250.00	0.05
299	300251	光线传媒	1,100	12,199.00	0.05
299	002085	万丰奥威	1,100	12,199.00	0.05
300	300474	景嘉微	200	12,096.00	0.05
301	002176	江特电机	1,200	12,012.00	0.05
302	300409	道氏技术	600	11,958.00	0.05
303	002318	久立特材	500	11,950.00	0.05
304	000617	中油资本	1,800	11,862.00	0.05
305	300003	乐普医疗	1,000	11,850.00	0.05
306	300677	英科医疗	300	11,751.00	0.05
307	688472	阿特斯	1,079	11,674.78	0.04
308	600667	太极实业	400	11,672.00	0.04
309	302132	中航成飞	200	11,664.00	0.04
310	002266	浙富控股	2,300	11,638.00	0.04
311	002044	美年健康	2,300	11,569.00	0.04
312	300699	光威复材	400	11,460.00	0.04
313	002065	东华软件	1,600	11,424.00	0.04
314	002001	新 和 成	400	11,368.00	0.04
315	002459	晶澳科技	1,400	11,340.00	0.04
316	600515	海南机场	4,100	11,234.00	0.04
317	600895	张江高科	300	11,175.00	0.04
318	605090	九丰能源	300	11,151.00	0.04
319	600516	方大炭素	1,800	11,106.00	0.04
320	600803	新奥股份	700	11,060.00	0.04
321	600499	科达制造	800	11,040.00	0.04
322	603596	伯特利	444	11,028.96	0.04
323	002405	四维图新	1,700	10,999.00	0.04
324	600323	瀚蓝环境	400	10,984.00	0.04

325	600704	物产中大	2,300	10,856.00	0.04
326	000400	许继电气	500	10,850.00	0.04
327	600862	中航高科	600	10,818.00	0.04
328	603606	东方电缆	260	10,792.60	0.04
329	000887	中鼎股份	600	10,734.00	0.04
330	688063	派能科技	200	10,654.00	0.04
331	600312	平高电气	600	10,596.00	0.04
332	000039	中集集团	1,300	10,543.00	0.04
333	000967	盈峰环境	1,000	10,530.00	0.04
334	300122	智飞生物	900	10,521.00	0.04
335	600018	上港集团	2,200	10,384.00	0.04
336	600765	中航重机	800	10,336.00	0.04
337	688114	华大智造	200	10,216.00	0.04
338	603486	科沃斯	200	10,150.00	0.04
339	000032	深桑达 A	400	9,980.00	0.04
340	002410	广联达	1,200	9,792.00	0.04
341	600177	雅戈尔	1,300	9,789.00	0.04
342	000157	中联重科	1,400	9,758.00	0.04
343	002007	华兰生物	800	9,752.00	0.04
344	688303	大全能源	551	9,603.93	0.04
345	000538	云南白药	200	9,474.00	0.04
346	300342	天银机电	200	9,400.00	0.04
347	002648	卫星化学	400	9,396.00	0.04
348	600529	山东药玻	500	9,225.00	0.04
349	000738	航发控制	500	9,145.00	0.04
350	301550	斯菱智驱	100	9,143.00	0.04
351	601000	唐山港	2,200	9,130.00	0.04
352	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.03
353	000932	华菱钢铁	2,600	9,022.00	0.03
354	002389	航天彩虹	500	8,885.00	0.03
355	601018	宁波港	2,800	8,820.00	0.03

356	300896	爱美客	100	8,720.00	0.03
357	300118	东方日升	700	8,715.00	0.03
358	600008	首创环保	3,200	8,704.00	0.03
359	601233	桐昆股份	400	8,660.00	0.03
360	600226	亨通股份	900	8,631.00	0.03
361	300832	新产业	200	8,400.00	0.03
362	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.03
363	600398	海澜之家	1,600	8,368.00	0.03
364	002271	东方雨虹	700	8,309.00	0.03
365	002601	龙佰集团	500	8,240.00	0.03
366	603885	吉祥航空	800	8,232.00	0.03
367	300573	兴齐眼药	200	8,152.00	0.03
368	600161	天坛生物	700	8,106.00	0.03
369	603392	万泰生物	300	8,091.00	0.03
370	300049	福瑞医科	200	7,776.00	0.03
371	603568	伟明环保	500	7,690.00	0.03
372	688116	天奈科技	200	7,640.00	0.03
373	600038	中直股份	300	7,587.00	0.03
374	601567	三星电气	500	7,470.00	0.03
375	600521	华海药业	500	7,200.00	0.03
376	600039	四川路桥	900	7,038.00	0.03
377	300676	华大基因	200	7,012.00	0.03
378	688166	博瑞医药	200	7,002.00	0.03
379	600763	通策医疗	200	6,776.00	0.03
380	600166	福田汽车	2,300	6,693.00	0.03
381	300457	赢合科技	300	6,324.00	0.02
382	601390	中国中铁	1,500	6,255.00	0.02
383	601866	中远海发	2,800	6,188.00	0.02
384	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.02
384	600635	大众公用	1,400	5,992.00	0.02
385	300144	宋城演艺	1,000	5,810.00	0.02

386	600004	白云机场	800	5,808.00	0.02
387	000035	中国天楹	1,200	5,796.00	0.02
388	603087	甘李药业	100	5,676.00	0.02
389	300601	康泰生物	500	5,670.00	0.02
390	300100	双林股份	200	5,556.00	0.02
391	600859	王府井	600	5,508.00	0.02
392	002544	普天科技	300	5,466.00	0.02
393	601168	西部矿业	200	5,428.00	0.02
394	000786	北新建材	300	5,427.00	0.02
395	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.02
396	002493	荣盛石化	500	5,375.00	0.02
397	600655	豫园股份	1,300	5,343.00	0.02
398	300070	碧水源	1,600	5,104.00	0.02
399	002120	韵达股份	800	5,088.00	0.02
400	002091	江苏国泰	700	5,061.00	0.02
401	301078	孩子王	700	4,732.00	0.02
402	000833	粤桂股份	200	4,684.00	0.02
403	601766	中国中车	900	4,680.00	0.02
404	600864	哈投股份	900	4,671.00	0.02
405	000423	东阿阿胶	100	4,536.00	0.02
406	002603	以岭药业	300	4,500.00	0.02
407	000999	华润三九	200	4,498.00	0.02
408	603816	顾家家居	200	4,472.00	0.02
409	600258	首旅酒店	400	4,368.00	0.02
410	603899	晨光股份	200	4,126.00	0.02
411	600332	白云山	200	4,008.00	0.02
412	600998	九州通	800	3,752.00	0.01
413	600346	恒力石化	200	3,542.00	0.01
414	601607	上海医药	200	3,080.00	0.01
415	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.01
416	000625	长安汽车	400	2,868.00	0.01

417	000963	华东医药	100	2,812.00	0.01
418	601618	中国中冶	1,100	2,684.00	0.01
419	002891	中宠股份	100	2,672.00	0.01
420	600535	天士力	200	2,646.00	0.01
421	600511	国药股份	100	2,604.00	0.01
422	600085	同仁堂	100	2,311.00	0.01
423	601058	赛轮轮胎	200	2,306.00	0.01
424	002572	索菲亚	200	1,460.00	0.01
425	601216	君正集团	300	1,338.00	0.01
426	000830	鲁西化工	100	1,200.00	0.00
427	603766	隆鑫通用	100	1,193.00	0.00
428	601238	广汽集团	200	1,016.00	0.00
429	688009	中国通号	200	952.00	0.00
430	600170	上海建工	400	888.00	0.00
431	600325	华发股份	100	231.00	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	300470	中密控股	4,100	118,941.00	0.46
2	688484	南芯科技	2,077	117,329.73	0.45
3	601995	中金公司	2,900	104,835.00	0.40
4	600566	济川药业	3,700	82,103.00	0.32
5	601939	建设银行	7,300	70,299.00	0.27
6	002311	海大集团	800	35,688.00	0.14
7	600060	海信视像	1,164	32,440.68	0.12
8	002032	苏泊尔	300	11,880.00	0.05
9	002003	伟星股份	1,000	8,420.00	0.03
10	300627	华测导航	40	1,136.00	0.00

11	002245	蔚蓝锂芯	32	598.72	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	600660	福耀玻璃	523,224.00	1.51
2	601995	中金公司	462,741.00	1.34
3	600585	海螺水泥	444,286.00	1.28
4	601668	中国建筑	414,803.00	1.20
5	600036	招商银行	411,765.00	1.19
6	000333	美的集团	407,273.00	1.18
7	600153	建发股份	395,660.00	1.14
8	300059	东方财富	370,360.00	1.07
9	600309	万华化学	362,800.00	1.05
10	601939	建设银行	352,786.00	1.02
11	603259	药明康德	347,511.00	1.00
12	002078	太阳纸业	346,927.00	1.00
13	688012	中微公司	345,428.00	1.00
14	600566	济川药业	340,616.00	0.98
15	600276	恒瑞医药	320,095.00	0.92
16	688536	思瑞浦	319,188.00	0.92
17	601398	工商银行	315,156.00	0.91
18	600887	伊利股份	308,011.00	0.89
19	000858	五粮液	299,777.00	0.87
20	688484	南芯科技	297,691.41	0.86

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	864,540.00	2.50
2	600036	招商银行	659,457.00	1.91
3	000333	美的集团	630,692.00	1.82
4	601899	紫金矿业	598,931.00	1.73
5	600900	长江电力	561,745.00	1.62
6	601166	兴业银行	551,702.00	1.59
7	600519	贵州茅台	546,174.00	1.58
8	601318	中国平安	531,547.00	1.54
9	601668	中国建筑	529,391.00	1.53
10	002371	北方华创	524,717.00	1.52
11	600276	恒瑞医药	513,232.00	1.48
12	600887	伊利股份	511,570.00	1.48
13	601398	工商银行	502,138.00	1.45
14	300059	东方财富	500,782.00	1.45
15	000792	盐湖股份	468,831.00	1.35
16	600660	福耀玻璃	455,421.00	1.32
17	600031	三一重工	433,505.00	1.25
18	600153	建发股份	430,846.60	1.24
19	600938	中国海油	424,033.00	1.23
20	600030	中信证券	423,229.00	1.22

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	32,849,373.67
卖出股票收入（成交）总额	44,448,785.55

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)	11,000.54	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,000.54	0.04

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	90	9,000.51	0.03
2	111025	圣泉转债	20	2,000.03	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,710.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,710.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中泰中证A500指增发起A	348	43,995.31	10,001,333.47	65.32%	5,309,035.01	34.68%
中泰中证A500指增发起C	271	14,110.13	0.00	0.00%	3,823,846.28	100.00%
合计	619	30,911.49	10,001,333.47	52.27%	9,132,881.29	47.73%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中泰中证A500指 增发起A	514,484.55	3.36%
	中泰中证A500指 增发起C	15,102.53	0.39%
	合计	529,587.08	2.77%

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	中泰中证A500指增发起A	10~50
	中泰中证A500指增发起C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中泰中证A500指增发起A	0
	中泰中证A500指增发起C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,333.47	52.27%	10,001,333.47	52.27%	不低于三年
基金管理人高级管理人员	440,078.00	2.30%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,441,411.47	54.57%	10,001,333.47	52.27%	不低于三年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰中证A500指增发起 A	中泰中证A500指增发起 C
基金合同生效日(2025年04月01日)基金份额总额	59,681,493.78	158,195,871.48
本报告期期初基金份额总额	21,852,428.25	6,329,929.55
本报告期基金总申购份额	2,689,687.10	2,782,612.48
减：本报告期基金总赎回份额	9,231,746.87	5,288,695.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,310,368.48	3,823,846.28

§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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	3	77,298,159.22	100.00%	15,604.85	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	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定网站	2026-01-22
2	中泰证券（上海）资产管理有限公司	证券时报、中国证监会	2026-03-03

	司关于旗下部分基金2026年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	规定网站	
3	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定网站	2026-03-30
4	中泰中证A500指数增强型发起式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	2026-04-03
5	中泰中证A500指数增强型发起式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	2026-04-03
6	中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定网站	2026-04-21
7	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	证券时报、中国证监会规定网站	2026-04-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026年1月1日至2026年6月30日	10,001,333.47	0.00	0.00	10,001,333.47	52.27%
产品特有风险							
当本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况时，可能会引发以下风险： （1）流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险。 （2）基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。 （3）基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动。 （4）基金合同提前终止的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金合同生效之日起三年后的对应日本基金资产净值低于2亿元；本基金基金合同生效满3年后继续存续的，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产净值连续50个工作日低于5000万元。上述情形均可能导致本基							

金基金合同提前终止。

（5）巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

（6）份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

本基金管理人将通过完善的风险管理机制，有效管理上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

§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中证A500指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰中证A500指数增强型发起式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。

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