

# 中泰沪深300指数增强型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09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

报告送出日期:2021年10月27日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	9
4.5 报告期内基金的业绩表现	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	9
§5 投资组合报告	9
5.1 报告期末基金资产组合情况	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	10
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	12
5.5 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债券投资明细	13
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	13
5.7 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	13
5.8 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权证投资明细	13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	14
5.11 投资组合报告附注	14
§6 开放式基金份额变动	17
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	17
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	18
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	18
§8 影响投资者决策的其他重要信息	18
8.1 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	18
§9 备查文件目录	18
9.1 备查文件目录	18
9.2 存放地点	19
9.3 查阅方式	19

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	162,236,601.74份
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。

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	
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	39,921,833.57份	122,314,768.17份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	中泰沪深300指数增强A	中泰沪深300指数增强C
1. 本期已实现收益	1,589,431.00	4,976,575.87
2. 本期利润	-2,643,923.65	-8,362,990.01
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0628	-0.0618
4. 期末基金资产净值	61,065,255.91	185,977,335.20
5. 期末基金份额净值	1.5296	1.5205

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。

#### 3.2 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净值表现

阶段	净值增长率①	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	-3.91%	1.20%	-6.49%	1.14%	2.58%	0.06%
过去六个月	1.49%	1.07%	-3.38%	1.04%	4.87%	0.03%
过去一年	14.06%	1.15%	5.88%	1.15%	8.18%	0.00%

自基金合同生效起至今	52.96%	1.18%	30.41%	1.19%	22.55%	-0.01%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

中泰沪深300指数增强C净值表现

阶段	净值增长率①	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	-4.01%	1.19%	-6.49%	1.14%	2.48%	0.05%
过去六个月	1.29%	1.07%	-3.38%	1.04%	4.67%	0.03%
过去一年	13.60%	1.15%	5.88%	1.15%	7.72%	0.00%
自基金合同生效起至今	52.05%	1.18%	30.41%	1.19%	21.64%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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-2021年09月30日)



注：根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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-2021年09月30日)



注：根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹巍	本基金基金经理；中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理；中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理	2020-04-01	-	8	国籍：中国。学历：华东师范大学统计系硕士研究生。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) 资产管理有限公司任对冲基金部副总经理、现任基金业务部副总经理。2019年12月11日起至今担任中泰中证500指数增强型证券投资基金基金经理。2020年4月1日起至今担任中泰沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2021年7月5日起至今担任中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《证券业从业人员资格管理规定》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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公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。

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

#### 4.3.2 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。公司管理的同一产品或不同产品之间在同一交易日内进行的反向交易，关联交易，以及买卖法规、产品管理合同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。产品收盘前15 分钟的密集交易达到当日市场交易量的10%，则认定为交易时间异常型异常交易。不同产品临近交易日的同向交易价格差达到5%以上，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品单独或共同在单个交易日的交易量占市场交易量比例达到30%以上，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，要求基金经理（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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年三季度，沪深300指数震荡中有所下跌，由季度初的5229点下跌到季度末的4866点，指数波动率整体上也维持较低水平。从本季度沪深300指数的不同行业表现来看，公用事业、材料、能源等行业取得较大正收益，而媒体、保险、制药等行业则出现明显的下跌。

本季度，本基金通过对指数的组合优化，同时利用持仓参与新股申购，取得一定的超额收益。同时，依旧严格依照量化模型约束跟踪误差，跟踪误差控制在一个适当的水平。我们将进一步加强对指数成份股公司的比较研究，力争在指数优化方面做得更好一些。

#### 4.5 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1.5296元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.91%，同期业绩比较基准收益率为-6.49%；截至报告期末中泰沪深300指数增强C基金份额净值为1.5205元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.01%，同期业绩比较基准收益率为-6.49%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	227,521,145.19	91.86
	其中：股票	227,521,145.19	91.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,300.00	0.00
	其中：债券	8,300.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	19,973,573.70	8.06
8	其他资产	174,571.48	0.07
9	合计	247,677,590.37	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	2,862,996.00	1.16
B	采矿业	7,081,397.00	2.87
C	制造业	108,466,664.05	43.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,336,806.00	1.76
E	建筑业	4,673,240.00	1.89
F	批发和零售业	1,255,702.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	4,112,939.80	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,258,890.00	1.72
J	金融业	53,600,816.63	21.70
K	房地产业	4,832,000.00	1.96
L	租赁和商务服务业	4,039,212.00	1.64
M	科学研究和技术服务业	5,004,402.40	2.03
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	290,512.00	0.12
Q	卫生和社会工作	1,751,480.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	64,665.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	206,631,722.88	83.64

### 5.2.2 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	18,116.82	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,389,687.33	6.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	350,830.24	0.14
E	建筑业	20,183.39	0.01
F	批发和零售业	69,707.74	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	386,638.00	0.16
H	住宿和餐饮业	358,513.44	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,666,809.55	1.08
J	金融业	973,083.00	0.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,966.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	254,572.04	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	218,514.14	0.09
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	151,800.62	0.06
S	综合	-	-
	合计	20,889,422.31	8.46

### 5.2.3 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	---------	---------------

1	600519	贵州茅台	7,353	13,455,990.00	5.45
2	600036	招商银行	197,746	9,976,285.70	4.04
3	300059	东方财富	157,716	5,420,698.92	2.19
4	600887	伊利股份	140,397	5,292,966.90	2.14
5	603259	药明康德	30,928	4,725,798.40	1.91
6	600438	通威股份	91,079	4,639,564.26	1.88
7	000858	五粮液	21,095	4,628,032.05	1.87
8	600809	山西汾酒	12,500	3,943,750.00	1.60
9	000001	平安银行	219,600	3,937,428.00	1.59
10	600900	长江电力	151,639	3,336,058.00	1.35

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,100	1,104,033.00	0.45
2	601128	常熟银行	151,100	968,551.00	0.39
3	603444	吉比特	2,200	860,816.00	0.35
4	601233	桐昆股份	37,450	821,653.00	0.33
5	603486	科沃斯	4,745	720,765.50	0.29

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	8,300.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	8,300.00	0.00
----	----	----------	------

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127046	百润转债	83	8,300.00	0.00

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					202,560.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。股指期货投资本期收益已扣除金融商品转让产生的增值税。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

#### 1、招商银行 代码：600036.SH

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021-08-23依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会安徽监管局于2021-08-23依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国人民银行西宁市中心支行于2021-08-12依据相关法规给予：公开处罚，公开批评处分决定

因未依法履行其他职责，中国人民银行武汉分行于2021-08-09依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021-07-19依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局于2021-06-08依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会北京监管局于2021-06-07依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会于2021-05-17依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国人民银行贵阳中心支行于2021-05-07依据相关法规给予：公开批评，公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会青海监管局于2021-04-22依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国人民银行沈阳分行于2021-02-03依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会南通监管分局于2021-01-22依据相关法规给予:公开处罚, 公开批评处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局于2021-01-19依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2020-12-24依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因信息披露虚假或严重误导性陈述，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局于2020-12-31依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会徐州监管分局于2020-12-31依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会聊城监管分局于2020-12-22依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会盐城监管分局于2020-12-21依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会东营监管分局于2020-10-19依据相关法规给予:公开处罚处分决定

## 2 平安银行 代码: 000001.SZ

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021-08-23依据相关法规给予:公开处罚, 责令改正处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会佛山监管分局于2021-07-22依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会三亚监管分局于2021-07-12依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会湖南监管局于2021-07-13依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局于2021-06-30依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会襄阳监管分局于2021-06-01依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会云南监管局于2021-05-28依据相关法规给予:公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会佛山监管分局于2021-05-27依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会深圳监管局于2021-05-18依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会云南监管局于2021-05-12依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021-05-10依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局于2021-05-06依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国人民银行天津分行于2021-04-07依据相关法规给予：公开处罚，公开批评，责令改正处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会山东监管局于2021-03-19依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会厦门监管局于2021-03-12依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会台州监管分局于2021-02-22依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局于2020-12-31依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会安徽监管局于2020-12-23依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会泰州监管分局于2020-12-21依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会盐城监管分局于2020-12-21依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会扬州监管分局于2020-11-23依据相关法规给予：公开处罚处分决定

因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于2020-10-16依据相关法规给予：公开处罚处分决定

关于投资决策的说明：

以上证券都是沪深300指数成份股，本基金为指数型基金，为保持对指数的有效跟踪而投资以上股票。

5.11.2 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。



## 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,922.78
5	应收申购款	168,648.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	174,571.48

## 5.11.4 报告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。

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 5.11.5.1 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。

## 5.11.5.2 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。

## 5.11.6 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。

## § 6 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
报告期期初基金份额总额	45,594,390.54	160,302,042.10
报告期期间基金总申购份额	5,794,766.42	14,463,914.35
减：报告期期间基金总赎回份额	11,467,323.39	52,451,188.28
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	39,921,833.57	122,314,768.17

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金份额。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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	2021年7月1日至2021年9月30日	45,004,500.45	0.00	0.00	45,004,500.45	27.74%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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，可能导致在其赎回后本基金资产净值连续五十个工作日低于5000万元，本基金可能面临基金合同提前终止等情形。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>							

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 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、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内中泰沪深300指数增强型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 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。

## 9.3 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

2021年10月27日