

泰康产业升级混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	76
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康产业升级混合型证券投资基金	
基金简称	泰康产业升级混合	
基金主代码	006904	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 17 日	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	309,252,671.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C
下属分级基金的交 易代码	006904	006905
报告期末下属分级 基金的份额总额	176,486,997.83 份	132,765,673.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于产业升级主题相关行业和企业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金将利用基金管理人多年来在宏观经济分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人构建的权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望。在此基础上判断未来市场投资环境的变化以及市场发展的主要推动因素与变量，运用泰康量化资产配置模型，根据股票、债券、货币市场工具三种最主要大类资产的预期收益和风险，确定三者的最优配置比例并适时调整。 股票投资方面，本基金以产业升级为主线，采用“自上而下”与“自下而上”相结合方式筛选优质股票构建投资组合。一方面，基金管理人基于国内外宏观经济与产业政策研究，选取制造业与消费服务业作为重点投资方向，并在其各细分行业间进行相对均衡的配置；另一方面，基金管理人通过综合考察行业景气度、企业的技术或产品实力、品牌竞争力、盈利能力、估值水平、公司治理等多方面因素，精选能够充分把握产业升级机遇、具备良好发展潜力的企业个股。 债券投资方面，根据基金流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略等，在严格控制风险的前提下，通过配置不同类别和期限的债券品种，提高基金非股票资产的收益率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*25%+中债综合全价指数

	收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

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		泰康基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	王小飞
	联系电话	010-89620366	021-60637103
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4001895522	021-60637228
传真		010-89620100	010-60635778
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		金志刚	张金良

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	泰康基金管理有限公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C
本期已实现收益	20,963,312.14	15,326,167.25	-26,729,905.49	-20,254,908.20	-76,090,159.97	-61,832,429.67
本期利润	23,861,107.48	17,631,360.34	-29,257,930.43	-21,036,737.67	-107,227,381.98	-83,641,523.98
加权平均基金份额本期利润	0.1403	0.1340	-0.1530	-0.1430	-0.5889	-0.5621
本期加权平均净值利润率	9.21%	9.06%	-9.34%	-8.95%	-33.62%	-32.81%
本期基金份额净值增长率	10.48%	9.92%	-8.74%	-9.20%	-25.42%	-25.79%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	108,833,419.91	74,496,616.70	92,092,385.41	62,308,530.14	111,553,349.56	89,735,002.26
期末可供分配基金份额利润	0.6167	0.5611	0.4917	0.4501	0.6344	0.5943
期末基金资产净值	290,854,199.33	211,633,843.04	279,394,536.70	200,742,186.41	287,427,187.24	241,140,019.91
期末基金份额净值	1.6480	1.5940	1.4917	1.4501	1.6346	1.5970
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	80.12%	74.23%	63.04%	58.50%	78.66%	74.56%

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）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。

(3) 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

泰康产业升级混合 A

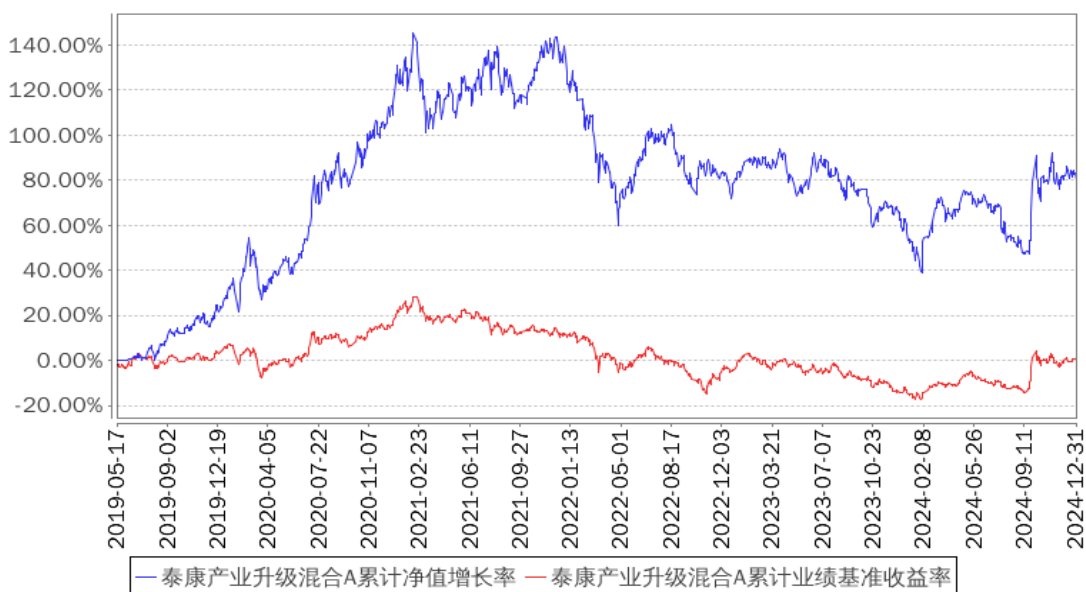
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.62%	1.79%	-1.54%	1.08%	2.16%	0.71%
过去六个月	6.49%	1.77%	11.16%	1.06%	-4.67%	0.71%
过去一年	10.48%	1.56%	13.69%	0.91%	-3.21%	0.65%
过去三年	-24.80%	1.35%	-10.79%	0.91%	-14.01%	0.44%
过去五年	43.06%	1.47%	-4.89%	0.91%	47.95%	0.56%
自基金合同生效 起至今	80.12%	1.42%	-0.04%	0.88%	80.16%	0.54%

泰康产业升级混合 C

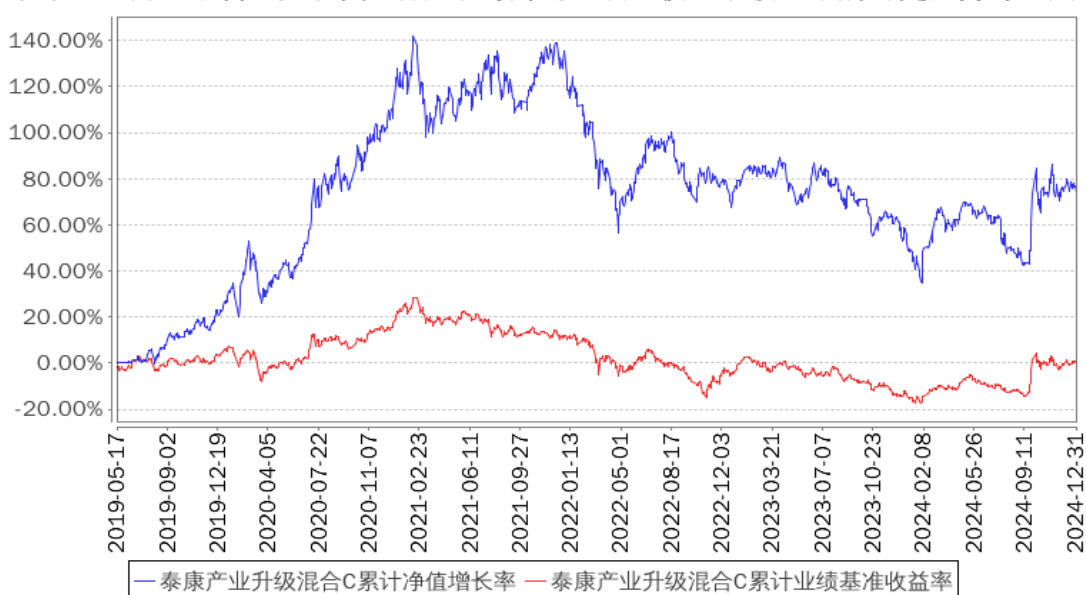
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.49%	1.79%	-1.54%	1.08%	2.03%	0.71%
过去六个月	6.22%	1.77%	11.16%	1.06%	-4.94%	0.71%
过去一年	9.92%	1.56%	13.69%	0.91%	-3.77%	0.65%
过去三年	-25.93%	1.35%	-10.79%	0.91%	-15.14%	0.44%
过去五年	39.53%	1.47%	-4.89%	0.91%	44.42%	0.56%
自基金合同生效 起至今	74.23%	1.42%	-0.04%	0.88%	74.27%	0.54%

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

泰康产业升级混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康产业升级混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

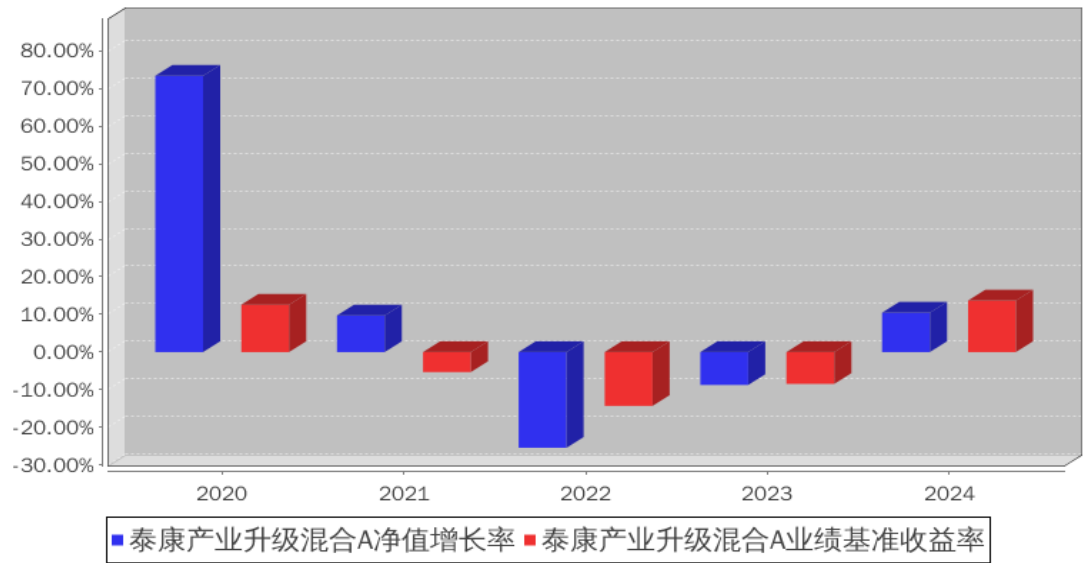


注：1、本基金基金合同于 2019 年 05 月 17 日生效。

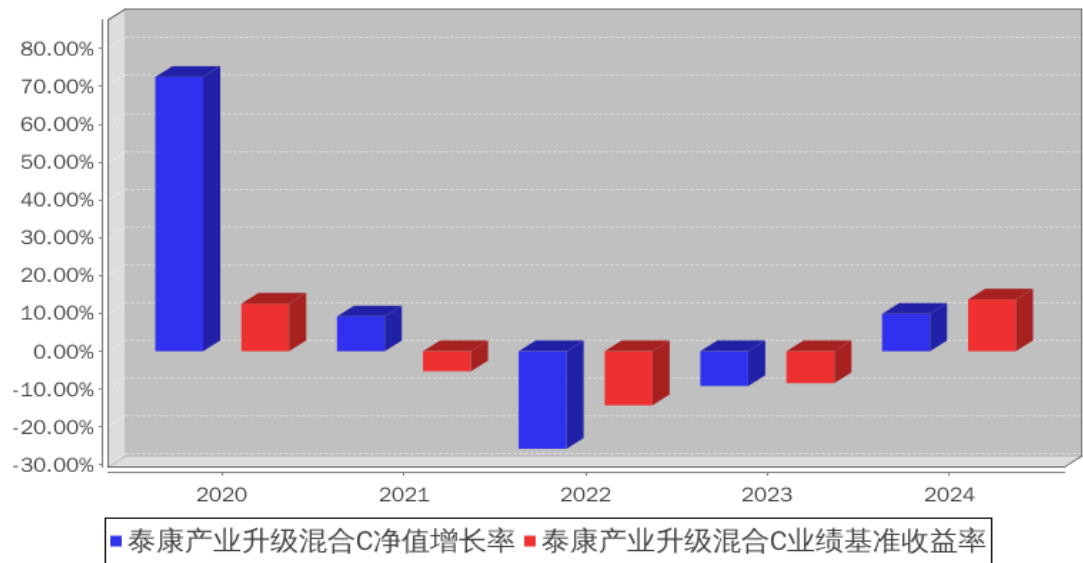
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康产业升级混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



泰康产业升级混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021 年 9 月 1 日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021 年 10 月 12 日，泰康基金完成工商注册。2022 年 11 月 18 日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为 1.2 亿元人民币。截至 2024 年 12 月 31 日，泰康基金共管理 82 只证券投资基金。产品已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF 基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列。泰康基金主动与被动业务双轮发展，旗下基金覆盖沪深 300、中证 500、中证 A500 等重要宽基指数，及半导体、智能电车、碳中和、医疗健康、大消费等细分行业，为投资者提供了丰富多元的投资选择。

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		
薛小波	本基金基金经理	2019 年 5 月 17 日	—	19 年	薛小波，硕士研究生。2018 年 6 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任中信证券机械行业和军工行业首席分析师、高级副总裁，前海开源基金管理有限公司执行投资总监、事业部负责人、投资决策委员会成员和基金经理等职务。2019 年 5 月 17 日至今担任泰康产业升级混合型证券投资基金基金经理。2020 年 1 月 10 日至 2023 年 3 月 15 日担任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 7 日至今担任泰康创新成长混合型证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 31 日至今担任泰康优势精选三年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合

法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易制度和流程，并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

宏观经济方面，2024 年的宏观经济继续是量价分化、结构分化的一年。实际 GDP 目标顺利完成，物价指数处于低位，从购买力角度是一件好事，从盈利和收入预期的角度则有所承压。从结构来看，出口继续延续了较强的竞争力，地产继续在转型的过程中，而消费则先抑后稳，下半年在以旧换新政策的支持下边际改善。政策在 9 月底的转向给宏观经济注入了强心针，政策的落实

在有条不紊推进，预计 2025 年继续是政策占据主导的一年。

权益市场方面，2024 年国内宏观经济整体偏弱，从宏观数据看供给端强于需求端，制造业的投资增速高于社会消费品总额增速。股票市场先是震荡回落，后来随着货币政策宽松明确和财政政策也会进一步宽松的预期下，市场快速回升，全年正收益。股票市场内部各行业呈现震荡分化走势，价值方向的高股息行业如银行、家电、交通运输、公用事业和石油石化等表现较好，科技成长方向的人工智能和自主可控相关的通信和电子表现也比较好，其他行业表现则相对落后。

权益投资方面，由于整体市场估值水平处于历史偏低位置，所以本基金全年整体持仓变化不大，主要还是围绕着产业升级方向进行配置，综合考虑宏观环境、市场环境、细分行业的基本面和估值水平进行动态调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.6480 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 10.48%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.5940 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为 9.92%；同期业绩比较基准增长率为 13.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，展望 2025 年，海内外政策成为宏观经济的核心变量。特朗普 2.0 时期，美国处于高通胀高赤字高利率的阶段，关税政策更可能是渐进的、交易性的，此时对中国的出口存在一定的负面影响，但总体可控。在国内稳增长政策对冲、扩内需的导向下，预计宏观经济有望筑底，不过考虑到政策可能是相机抉择的、经济的转轨也不可逆，预计经济向上弹性仍然缺失。

权益整体方面，对于 2025 年的市场，我们认为中性偏乐观。从影响资本市场的几个维度来看：1) 宏观基本面方面，在制造业产能相对过剩和出口存在贸易战的背景下，预计 2025 年实际 GDP 增速在 4.8% 左右，市场对中国经济的关注点会放在国内需求上。2024 年 CPI 和 PPI 还都是负增长，2025 年能否转正仍存在不确定性，这也会影响到上市公司的盈利水平，预期 2025 年上市公司的盈利增速相比 2024 年略有增长。对股票投资而言，寻找结构性机会比总量更为重要。2) 政策方面，面对股市是偏正面，货币政策和财政政策明确转向宽松，货币政策要关注后续的降息节奏和力度，财政政策则要关注后续的力度和发力的方向。政策对 2025 年的市场影响会比较大，一方面经济的增长需要政策发力，另一方面估值的提升也要靠政策发力。当前市场 PE 估值处于历史均值水平附近，PB 处于历史偏低估水平，无风险利率下降、科技发展和部分行业的困境反转，有望带动市场整体估值水平的提升。科技发展、内需消费和困境反转等方向都有值得期待的地方，我们将怀着偏乐观的心态去积极挖掘投资机会。3) 过去三年我们经历了经济过热期和衰退期，所以风格上有利于上游资源板块和高股息的大盘价值板块。预计 2025 年市场风格方面并非一种风格贯穿全年。

在货币宽松的背景下，预计 2025 年风格会更有利于自身景气度高的科技成长方向；如果未来内需刺激政策持续发力，则也会有利于消费为主的大盘成长风格；而在市场对未来悲观预期的时候高股息大盘价值风格占优。4) 2025 年主要看好四个方向：科技成长、内需消费、非美出口和高股息。2025 年贸易战力度、刺激政策强度、刺激政策节奏、刺激政策方向和宏观景气度等因素都会对市场走势和方向产生影响，在预判的同时更要做好应对。我们将在不同的情境下，围绕看好的方向，在市场波动中进一步优化投资组合，优选潜在投资回报率更高的标的。5) 风险方面需要持续跟踪国内经济景气度、国内外宏观政策、海外市场和地缘风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、产品、市场销售、信息技术等方面进行监督检查。

同时，公司在产品开发、销售募集、投资交易、运营管理等业务环节，进行事前合规性审核，以有效防范业务风险；公司通过投资交易系统控制和人工审核控制相结合的方式，对基金投资交易情况进行监督，以确保基金投资满足监管法规、基金合同和公司制度的规定；公司设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；公司监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期向风险控制委员会报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管人复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或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合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]100Z1318 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰康产业升级混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了泰康产业升级混合型证券投资基金（以下简称“泰康产业升级混合”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰康产业升级混合 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰康产业升级混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	泰康产业升级混合的基金管理人泰康基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括泰康产业升级混合 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要

	的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰康产业升级混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泰康产业升级混合、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督泰康产业升级混合的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰康产业升级混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰康产业升级混合不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蔡晓慧	陈玉珊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2025年3月27日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰康产业升级混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	20,389,330.63	7,634,479.99
结算备付金		2,751,918.99	2,548,512.63
存出保证金		211,565.08	195,603.41
交易性金融资产	7.4.7.2	485,605,944.65	464,071,632.24
其中：股票投资		462,700,542.32	440,077,564.21
基金投资		-	-
债券投资		22,905,402.33	23,994,068.03
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	7,998,737.39
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		187,399.61	1,351,719.31
应收股利		49.74	-
应收申购款		130,726.10	206,040.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		509,276,934.80	484,006,725.65
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,539,622.68	2.94
应付赎回款		1,610,319.50	2,155,876.10

应付管理人报酬		513,670.24	497,615.27
应付托管费		85,611.72	82,935.85
应付销售服务费		91,493.99	86,928.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	8.59
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	948,174.30	1,046,635.49
负债合计		6,788,892.43	3,870,002.54
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	309,252,671.82	325,735,807.56
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	193,235,370.55	154,400,915.55
净资产合计		502,488,042.37	480,136,723.11
负债和净资产总计		509,276,934.80	484,006,725.65

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日,基金份额总额 309,252,671.82 份，其中泰康产业升级混合 A 基金份额总额 176,486,997.83 份，基金份额净值 1.6480 元;泰康产业升级混合 C 基金份额总额 132,765,673.99 份，基金份额净值 1.5940 元。

7.2 利润表

会计主体：泰康产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		49,009,247.65	-39,984,728.06
1. 利息收入		151,914.46	277,033.78
其中：存款利息收入	7.4.7.13	103,578.50	90,837.73
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		48,335.96	186,196.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,600,483.08	-37,003,317.87
其中：股票投资收益	7.4.7.14	38,053,095.05	-44,306,884.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	610,532.55	701,841.01
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	4,936,855.48	6,601,726.09
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	5,202,988.43	-3,309,854.41
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	53,861.68	51,410.44
减：二、营业总支出		7,516,779.83	10,309,940.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,437,741.75	7,671,868.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	906,290.36	1,278,644.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	971,573.70	1,177,135.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,632.74	399.57
其中：卖出回购金融资产 支出		3,632.74	399.57
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9.45	4.12
8. 其他费用	7.4.7.23	197,531.83	181,887.65
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		41,492,467.82	-50,294,668.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		41,492,467.82	-50,294,668.10
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		41,492,467.82	-50,294,668.10

7.3 净资产变动表

会计主体：泰康产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	325,735,807.56	-	154,400,915.55	480,136,723.11

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	325,735,807.56	-	154,400,915.55	480,136,723.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,483,135.74	-	38,834,455.00	22,351,319.26
(一)、综合收益总额	-	-	41,492,467.82	41,492,467.82
(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)	-16,483,135.74	-	-2,658,012.82	-19,141,148.56
其中：1. 基金申购款	68,238,109.48	-	40,623,812.42	108,861,921.90
2. 基金赎回款	-84,721,245.22	-	-43,281,825.24	-128,003,070.46
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	309,252,671.82	-	193,235,370.55	502,488,042.37
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	326,843,860.57	-	201,723,346.58	528,567,207.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	326,843,860.57	-	201,723,346.58	528,567,207.15

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,108,053.01	-	-47,322,431.03	-48,430,484.04
(一)、综合收益总额	-	-	-50,294,668.10	-50,294,668.10
(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)	-1,108,053.01	-	2,972,237.07	1,864,184.06
其中：1. 基金申购款	66,185,891.57	-	44,079,525.36	110,265,416.93
2. 基金赎回款	-67,293,944.58	-	-41,107,288.29	-108,401,232.87
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	325,735,807.56	-	154,400,915.55	480,136,723.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>金志刚</u>	<u>金志刚</u>	<u>李俊佑</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康产业升级混合型证券投资基金(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[2018]2228 号《关于准予泰康产业升级混合型证券投资基金注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康产业升级混合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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 311,522,116.88 元，业经毕马威华振会计师事务所

所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1900271 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康产业升级混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 311,730,740.37 份基金份额,其中认购资金利息折合 208,623.49 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《泰康产业升级混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康产业升级混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(“港股通标的股票”)、权证、股指期货、国债期货、债券资产(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产比例为 50%-95%,其中投资于产业升级主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*25%+中债综合全价指数收益率*25%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告

》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康产业升级混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具,以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

以摊余成本计量的金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1. 估值方法及关键假设

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

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

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

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

2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 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。基金通过沪港通/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。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	20,389,330.63	7,634,479.99
等于：本金	20,387,424.00	7,633,562.94
加：应计利息	1,906.63	917.05
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-

合计	20,389,330.63	7,634,479.99
----	---------------	--------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		448,402,658.54	-	462,700,542.32	14,297,883.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,710,191.00	29,589.04	2,742,279.04	2,499.00
	银行间市场	19,962,300.00	127,123.29	20,163,123.29	73,700.00
	合计	22,672,491.00	156,712.33	22,905,402.33	76,199.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		471,075,149.54	156,712.33	485,605,944.65	14,374,082.78
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		431,062,332.16	-	440,077,564.21	9,015,232.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,122,855.00	24,160.87	3,405,498.17	258,482.30
	银行间市场	20,106,620.00	584,569.86	20,588,569.86	-102,620.00
	合计	23,229,475.00	608,730.73	23,994,068.03	155,862.30
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		454,291,807.16	608,730.73	464,071,632.24	9,171,094.35

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,998,737.39	-
银行间市场	-	-
合计	7,998,737.39	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	364.43	90.73
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	900,809.87	1,002,044.76
其中：交易所市场	900,487.37	1,002,044.76
银行间市场	322.50	-
应付利息	-	-
预提费用	47,000.00	44,500.00
合计	948,174.30	1,046,635.49

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康产业升级混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,302,151.29	187,302,151.29
本期申购	32,165,415.25	32,165,415.25
本期赎回（以“-”号填列）	-42,980,568.71	-42,980,568.71
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	176,486,997.83	176,486,997.83

泰康产业升级混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	138,433,656.27	138,433,656.27
本期申购	36,072,694.23	36,072,694.23
本期赎回（以“-”号填列）	-41,740,676.51	-41,740,676.51
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	132,765,673.99	132,765,673.99

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

泰康产业升级混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	92,648,394.27	-556,008.86	92,092,385.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	92,648,394.27	-556,008.86	92,092,385.41
本期利润	20,963,312.14	2,897,795.34	23,861,107.48
本期基金份额交易产生的变动数	-4,778,286.50	3,191,995.11	-1,586,291.39
其中：基金申购款	16,613,667.52	4,448,890.26	21,062,557.78
基金赎回款	-21,391,954.02	-1,256,895.15	-22,648,849.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,833,419.91	5,533,781.59	114,367,201.50

泰康产业升级混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,363,872.66	-55,342.52	62,308,530.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	62,363,872.66	-55,342.52	62,308,530.14
本期利润	15,326,167.25	2,305,193.09	17,631,360.34
本期基金份额交易产生的变动数	-3,193,423.21	2,121,701.78	-1,071,721.43
其中：基金申购款	15,380,584.36	4,180,670.28	19,561,254.64
基金赎回款	-18,574,007.57	-2,058,968.50	-20,632,976.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,496,616.70	4,371,552.35	78,868,169.05

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	47,976.62	44,181.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	50,738.53	42,958.88
其他	4,863.35	3,697.17

合计	103,578.50	90,837.73
----	------------	-----------

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	38,053,095.05	-44,306,884.97
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	38,053,095.05	-44,306,884.97

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	2,648,286,076.92	2,456,845,418.24
减：卖出股票成本总额	2,605,066,451.97	2,494,705,552.47
减：交易费用	5,166,529.90	6,446,750.74
买卖股票差价收入	38,053,095.05	-44,306,884.97

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	411,340.03	582,254.40

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	199,192.52	119,586.61
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	610,532.55	701,841.01

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	44,449,611.92	21,520,384.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	43,204,975.00	21,030,650.00
减：应计利息总额	1,044,956.46	369,921.31
减：交易费用	487.94	226.50
买卖债券差价收入	199,192.52	119,586.61

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,936,855.48	6,601,726.09
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,936,855.48	6,601,726.09

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,202,988.43	-3,309,854.41
股票投资	5,282,651.73	-3,362,767.96
债券投资	-79,663.30	52,913.55
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	5,202,988.43	-3,309,854.41

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	38,207.99	39,200.26
基金转换费收入	15,653.69	12,210.18
合计	53,861.68	51,410.44

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	38,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,231.83	3,887.65
债券帐户维护费	34,500.00	18,000.00
其他	800.00	-
合计	197,531.83	181,887.65

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
泰康人寿保险有限责任公司（“泰康人寿”）	与基金管理人同受最终控股母公司控制、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,437,741.75	7,671,868.65

其中：应支付销售机构的客户维护费	1,265,389.06	1,908,125.31
应支付基金管理人的净管理费	4,172,352.69	5,763,743.34

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 20 日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

根据《关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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 X 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	906,290.36	1,278,644.74

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 20 日，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/当年天数。

根据《关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C	合计
建设银行	—	28,131.03	28,131.03
泰康基金管理有限公司	—	791,037.97	791,037.97
合计	—	819,169.00	819,169.00
获得销售服务费的各关联	上年度可比期间		

方名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C	合计
建设银行	-	32,497.82	32,497.82
泰康基金管理有限公司	-	936,060.42	936,060.42
合计	-	968,558.24	968,558.24

注：本基金 A 类基金份额不计提销售服务费，C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额日销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	20,389,330.63	47,976.62	7,634,479.99	44,181.68

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股锁定期流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定期流通受限	2.30	6.80	4,054	9,324.20	27,567.20	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定期流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁定期流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普	2024 年 10	6 个月	新股锁定	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-

	云农	月 10 日		期流通受限						
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁定期流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定期流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股锁定期流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁定期流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁定期流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股锁定期流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定期流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定期流通受限	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新	2024	6 个月	新股	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-

	铝时代	年 10 月 18 日		锁定期流通受限						
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股锁定期流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定期流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期流通受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内(含)	网下新股流通受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定期流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫股份	2024 年 9 月 10 日	6 个月	新股锁定期流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定期流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定期流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小	2024	6 个月	新股	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-

	方制药	年8月19日		锁定期流通受限						
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定期流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024年8月7日	6个月	新股锁定期流通受限	17.39	17.95	252	4,382.28	4,523.40	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定期流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024年7月24日	6个月	新股锁定期流通受限	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024年11月19日	6个月	新股锁定期流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024年11月20日	6个月	新股锁定期流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688615	合合信息	2024年9月19日	6个月	新股锁定期流通受限	55.18	165.78	268	14,788.24	44,429.04	-
688708	佳驰科技	2024年11月27日	6个月	新股锁定期流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-

688710	益 诺 思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股 锁定 期流 通受 限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙 图 光 罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股 锁定 期流 通受 限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688750	金 天 钛 业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期流 通受 限	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

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、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、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。

5、截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，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信用风险管理流程，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.4 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	2,182,183.32
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	2,182,183.32

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2024 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)

无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 12 月 31 日，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 2024 年 12 月 31 日，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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,389,330.63	-	-	-	20,389,330.63
结算备付金	2,751,918.99	-	-	-	2,751,918.99
存出保证金	211,565.08	-	-	-	211,565.08
交易性金融资产	22,905,402.33	-	-	-462,700,542.32	485,605,944.65
应收股利	-	-	-	49.74	49.74
应收申购款	-	-	-	130,726.10	130,726.10
应收清算款	-	-	-	187,399.61	187,399.61
资产总计	46,258,217.03	-	-	-463,018,717.77	509,276,934.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,610,319.50	1,610,319.50
应付管理人报酬	-	-	-	513,670.24	513,670.24
应付托管费	-	-	-	85,611.72	85,611.72
应付清算款	-	-	-	3,539,622.68	3,539,622.68
应付销售服务费	-	-	-	91,493.99	91,493.99
其他负债	-	-	-	948,174.30	948,174.30
负债总计	-	-	-	6,788,892.43	6,788,892.43
利率敏感度缺口	46,258,217.03	-	-	-456,229,825.34	502,488,042.37
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,634,479.99	-	-	-	7,634,479.99
结算备付金	2,548,512.63	-	-	-	2,548,512.63
存出保证金	195,603.41	-	-	-	195,603.41
交易性金融资产	21,811,884.71	-	2,182,183.32	440,077,564.21	464,071,632.24
买入返售金融资产	7,998,737.39	-	-	-	7,998,737.39
应收申购款	-	-	-	206,040.68	206,040.68

应收清算款	-	-	-	1,351,719.31	1,351,719.31
资产总计	40,189,218.13	-	2,182,183.32	441,635,324.20	484,006,725.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,155,876.10	2,155,876.10
应付管理人报酬	-	-	-	497,615.27	497,615.27
应付托管费	-	-	-	82,935.85	82,935.85
应付清算款	-	-	-	2.94	2.94
应付销售服务费	-	-	-	86,928.30	86,928.30
应交税费	-	-	-	8.59	8.59
其他负债	-	-	-	1,046,635.49	1,046,635.49
负债总计	-	-	-	3,870,002.54	3,870,002.54
利率敏感度缺口	40,189,218.13	-	2,182,183.32	437,765,321.66	480,136,723.11

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	-31,348.96	-1,252.84
	市场利率下调 0.25%	31,435.35	1,253.00

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 33,534,896.64 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 33,534,896.64 元（于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 13,357,665.31 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 13,357,665.31 元）。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值

的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 335,348.97 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-335,348.97 元（于 2023 年 12 月 31 日，若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 133,576.65 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-133,576.65 元）。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	33,534,896.64	-	33,534,896.64
资产合计	-	33,534,896.64	-	33,534,896.64
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	33,534,896.64	-	33,534,896.64
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,357,665.31	-	13,357,665.31
资产合计	-	13,357,665.31	-	13,357,665.31
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,357,665.31	-	13,357,665.31

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场汇率上升 1%	335,348.97	133,576.65
	市场汇率下降 1%	-335,348.97	-133,576.65

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产比例为 50%-95%，其中投资于产业升级主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	462,700,542.32	92.08	440,077,564.21	91.66

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	462,700,542.32	92.08	440,077,564.21	91.66

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	26,655,919.36	17,759,673.75
	业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-26,655,919.36	-17,759,673.75

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	462,122,704.02	440,116,723.07
第二层次	22,933,138.83	22,778,954.65

第三层次	550,101.80	1,175,954.52
合计	485,605,944.65	464,071,632.24

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,175,954.52	1,175,954.52
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	389,909.01	389,909.01
转出第三层次	-	1,226,727.98	1,226,727.98
当期利得或损失总额	-	210,966.25	210,966.25
其中：计入损益的利得或损失	-	210,966.25	210,966.25
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	550,101.80	550,101.80
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	324,480.61	324,480.61
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	773,990.70	773,990.70
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,024,222.92	3,024,222.92
转出第三层次	-	2,422,222.76	2,422,222.76
当期利得或损失总额	-	-200,036.34	-200,036.34
其中：计入损益的利得或损失	-	-200,036.34	-200,036.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,175,954.52	1,175,954.52
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	151,539.93	151,539.93

注：本基金持有的第三层次的交易性金融资产（若有）均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。本基金从第三层次转出的交易性金融资产（若有）均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	550,101.80	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	26.65%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	1,175,954.52	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%-219.88%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	462,700,542.32	90.85
	其中：股票	462,700,542.32	90.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,905,402.33	4.50
	其中：债券	22,905,402.33	4.50
	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	23,141,249.62	4.54
8	其他各项资产	529,740.53	0.10
9	合计	509,276,934.80	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 33,534,896.64 元，占期末资产净值比例为 6.67%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	389,179,140.93	77.45
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	27,567.20	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,878,719.99	5.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,069,069.00	2.00
M	科学研究和技术服务业	11,148.56	0.00

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	429,165,645.68	85.41

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	8.24	0.00
E 金融	-	-
F 医疗保健	4,397,671.36	0.88
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	29,137,217.04	5.80
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	33,534,896.64	6.67

注：以上行业分类标准来源于财汇。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	00700	腾讯控股	75,454	29,137,217.04	5.80
2	002138	顺络电子	806,158	25,377,853.84	5.05
3	600285	羚锐制药	1,120,400	24,828,064.00	4.94
4	002179	中航光电	593,000	23,304,900.00	4.64
5	601567	三星医疗	739,000	22,731,640.00	4.52
6	002517	恺英网络	1,630,500	22,191,105.00	4.42
7	002371	北方华创	51,900	20,292,900.00	4.04
8	002475	立讯精密	496,500	20,237,340.00	4.03
9	002409	雅克科技	336,100	19,476,995.00	3.88
10	688019	安集科技	131,791	18,366,393.76	3.66
11	688789	宏华数科	255,157	16,937,321.66	3.37
12	000680	山推股份	1,655,200	16,055,440.00	3.20
13	002223	鱼跃医疗	418,600	15,274,714.00	3.04
14	000423	东阿阿胶	238,700	14,971,264.00	2.98
15	300679	电连技术	223,800	13,360,860.00	2.66
16	600480	凌云股份	1,227,200	13,266,032.00	2.64

17	002241	歌尔股份	507,900	13,108,899.00	2.61
18	600862	中航高科	508,200	12,837,132.00	2.55
19	300408	三环集团	326,600	12,577,366.00	2.50
20	600765	中航重机	583,600	11,946,292.00	2.38
21	688768	容知日新	292,543	10,631,012.62	2.12
22	002027	分众传媒	1,432,300	10,069,069.00	2.00
23	000999	华润三九	221,230	9,809,338.20	1.95
24	688017	绿的谐波	86,079	9,301,696.74	1.85
25	000425	徐工机械	1,012,600	8,029,918.00	1.60
26	601126	四方股份	450,600	7,642,176.00	1.52
27	002315	焦点科技	179,800	7,494,064.00	1.49
28	002920	德赛西威	67,100	7,388,381.00	1.47
29	002078	太阳纸业	427,700	6,359,899.00	1.27
30	000333	美的集团	67,200	5,054,784.00	1.01
31	603296	华勤技术	69,100	4,902,645.00	0.98
32	603596	伯特利	104,680	4,667,681.20	0.93
33	02273	固生堂	140,500	4,397,671.36	0.88
34	688692	达梦数据	175	63,777.00	0.01
35	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
36	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
37	688615	合合信息	268	44,429.04	0.01
38	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.01
39	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
40	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.01
41	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
42	001391	国货航	4,054	27,567.20	0.01
43	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.01
44	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
45	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
46	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
47	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
48	301565	中仑新材	711	15,215.40	0.00
49	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
50	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
51	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
52	301580	爱迪特	202	11,736.20	0.00
53	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
54	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
55	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
56	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
57	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
58	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
59	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00

60	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
61	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
62	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
63	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
64	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
65	603310	巍华新材	252	4,523.40	0.00
66	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
67	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
68	603381	永臻股份	178	3,901.76	0.00
69	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
70	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
71	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
72	00386	中国石油化工 股份	2	8.24	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	75,199,429.00	15.66
2	002142	宁波银行	60,555,850.00	12.61
3	00700	腾讯控股	52,900,443.73	11.02
4	002371	北方华创	48,390,446.28	10.08
5	300760	迈瑞医疗	43,405,727.00	9.04
6	300679	电连技术	42,638,355.94	8.88
7	603596	伯特利	42,097,593.99	8.77
8	000975	山金国际	42,066,397.40	8.76
9	002463	沪电股份	42,022,611.10	8.75
10	02367	巨子生物	40,666,680.05	8.47
11	300408	三环集团	39,807,703.54	8.29
12	002138	顺络电子	39,687,094.62	8.27
13	600916	中国黄金	38,956,543.32	8.11
14	002179	中航光电	38,024,959.67	7.92
15	601899	紫金矿业	31,010,304.96	6.46
15	02899	紫金矿业	6,672,975.30	1.39
16	600989	宝丰能源	36,774,298.31	7.66
17	002351	漫步者	34,128,647.94	7.11
18	002409	雅克科技	32,106,213.00	6.69
19	300476	胜宏科技	30,592,615.02	6.37
20	300285	国瓷材料	29,197,984.00	6.08
21	601689	拓普集团	28,862,114.35	6.01

22	688789	宏华数科	28,791,576.97	6.00
23	600988	赤峰黄金	27,599,077.00	5.75
24	000680	山推股份	27,488,962.87	5.73
25	688639	华恒生物	27,303,152.01	5.69
26	000999	华润三九	26,914,786.88	5.61
27	002557	洽洽食品	25,003,446.61	5.21
28	600285	羚锐制药	24,982,903.94	5.20
29	600482	中国动力	24,913,935.80	5.19
30	600426	华鲁恒升	24,615,955.00	5.13
31	600489	中金黄金	24,399,751.00	5.08
32	00941	中国移动	16,617,889.45	3.46
32	600941	中国移动	7,592,650.00	1.58
33	688120	华海清科	23,555,352.79	4.91
34	688019	安集科技	23,337,976.75	4.86
35	002223	鱼跃医疗	23,022,801.50	4.80
36	002517	恺英网络	23,000,041.00	4.79
37	603809	豪能股份	22,656,549.58	4.72
38	00386	中国石油化工 股份	22,168,595.99	4.62
39	600582	天地科技	22,139,312.00	4.61
40	000333	美的集团	20,671,175.00	4.31
41	600309	万华化学	20,650,145.00	4.30
42	688187	时代电气	20,561,192.26	4.28
43	300308	中际旭创	20,224,265.60	4.21
44	601567	三星医疗	19,381,224.00	4.04
45	300661	圣邦股份	19,058,353.90	3.97
46	002078	太阳纸业	18,555,672.00	3.86
47	600519	贵州茅台	18,467,275.00	3.85
48	600079	人福医药	18,184,867.00	3.79
49	002648	卫星化学	18,154,235.22	3.78
50	688548	广钢气体	18,089,766.13	3.77
51	603993	洛阳钼业	18,049,933.00	3.76
52	600993	马应龙	17,945,201.00	3.74
53	002241	歌尔股份	17,807,390.20	3.71
54	688596	正帆科技	17,606,800.85	3.67
55	601717	郑煤机	16,452,287.00	3.43
56	605098	行动教育	16,215,902.00	3.38
57	002180	纳思达	15,749,897.66	3.28
58	000425	徐工机械	15,644,700.00	3.26
59	300442	润泽科技	15,571,187.00	3.24
60	601669	中国电建	15,487,449.00	3.23
61	000568	泸州老窖	15,460,843.00	3.22
62	603368	柳药集团	15,146,069.16	3.15
63	000786	北新建材	14,980,102.72	3.12

64	002130	沃尔核材	14,933,659.00	3.11
65	603283	赛腾股份	14,812,435.00	3.09
66	002315	焦点科技	14,787,188.00	3.08
67	000423	东阿阿胶	14,544,599.00	3.03
68	600480	凌云股份	14,339,779.40	2.99
69	603197	保隆科技	14,339,652.00	2.99
70	002472	双环传动	14,274,125.00	2.97
71	002993	奥海科技	14,245,234.00	2.97
72	603605	珀莱雅	14,180,840.00	2.95
73	300770	新媒股份	14,081,206.00	2.93
74	300541	先进数通	14,017,557.40	2.92
75	601900	南方传媒	14,004,759.40	2.92
76	00388	香港交易所	13,837,301.61	2.88
77	600741	华域汽车	13,829,981.00	2.88
78	605090	九丰能源	13,531,095.00	2.82
79	688372	伟测科技	13,480,436.05	2.81
80	002867	周大生	13,414,197.50	2.79
81	601168	西部矿业	13,076,398.71	2.72
82	300680	隆盛科技	12,953,536.64	2.70
83	002938	鹏鼎控股	12,945,094.43	2.70
84	00981	中芯国际	12,851,364.87	2.68
85	688017	绿的谐波	12,805,270.76	2.67
86	603712	七一二	12,725,045.20	2.65
87	000034	神州数码	12,714,319.00	2.65
88	600862	中航高科	12,675,323.00	2.64
89	002027	分众传媒	12,531,655.00	2.61
90	300750	宁德时代	12,317,811.12	2.57
91	600576	祥源文旅	12,296,164.00	2.56
92	000338	潍柴动力	10,282,456.00	2.14
92	02338	潍柴动力	1,828,096.39	0.38
93	601126	四方股份	12,012,714.00	2.50
94	600765	中航重机	11,760,977.00	2.45
95	688601	力芯微	11,354,332.57	2.36
96	600761	安徽合力	11,131,158.96	2.32
97	002600	领益智造	11,099,807.00	2.31
98	832982	锦波生物	11,029,148.56	2.30
99	688016	心脉医疗	10,959,918.41	2.28
100	688768	容知日新	10,552,074.22	2.20
101	002050	三花智控	10,504,588.00	2.19
102	688018	乐鑫科技	10,112,419.84	2.11
103	688630	芯碁微装	10,065,953.05	2.10
104	300567	精测电子	9,928,732.76	2.07
105	002859	洁美科技	9,626,051.00	2.00

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

（2）“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	002475	立讯精密	78,334,456.90	16.32
2	002142	宁波银行	64,490,440.88	13.43
3	300760	迈瑞医疗	59,595,978.00	12.41
4	601689	拓普集团	52,405,989.45	10.91
5	002463	沪电股份	49,285,021.40	10.26
6	603596	伯特利	48,627,504.96	10.13
7	02367	巨子生物	45,528,538.18	9.48
8	000975	山金国际	44,727,042.15	9.32
9	002371	北方华创	42,484,768.47	8.85
10	601899	紫金矿业	35,068,017.00	7.30
10	02899	紫金矿业	6,335,918.90	1.32
11	600519	贵州茅台	39,629,305.99	8.25
12	002351	漫步者	38,906,655.77	8.10
13	00700	腾讯控股	38,817,372.30	8.08
14	600916	中国黄金	38,561,427.54	8.03
15	601567	三星医疗	37,220,672.90	7.75
16	002179	中航光电	37,109,450.97	7.73
17	600989	宝丰能源	36,035,380.00	7.51
18	300476	胜宏科技	33,471,682.00	6.97
19	300679	电连技术	32,938,624.00	6.86
20	605098	行动教育	32,672,938.80	6.80
21	300285	国瓷材料	32,510,536.50	6.77
22	688639	华恒生物	30,745,231.60	6.40
23	601717	郑煤机	30,488,010.00	6.35
24	000034	神州数码	30,193,468.00	6.29
25	600489	中金黄金	29,643,957.80	6.17
26	688120	华海清科	29,566,871.78	6.16
27	300408	三环集团	27,937,045.00	5.82
28	688019	安集科技	26,464,708.58	5.51
29	600482	中国动力	26,076,596.26	5.43
30	600988	赤峰黄金	25,908,289.16	5.40
31	300308	中际旭创	25,763,507.60	5.37
32	002270	华明装备	24,687,450.14	5.14
33	603809	豪能股份	24,340,879.30	5.07
34	688187	时代电气	23,957,370.40	4.99
35	00386	中国石油化工	23,887,511.10	4.98

		股份		
36	00941	中国移动	15,343,530.84	3.20
36	600941	中国移动	8,009,768.00	1.67
37	600582	天地科技	22,970,959.00	4.78
38	002315	焦点科技	22,640,625.80	4.72
39	002557	洽洽食品	22,369,740.00	4.66
40	603179	新泉股份	21,099,428.40	4.39
41	600309	万华化学	20,728,209.00	4.32
42	600079	人福医药	19,802,300.00	4.12
43	603993	洛阳钼业	18,450,122.00	3.84
44	300661	圣邦股份	18,404,802.00	3.83
45	002517	恺英网络	18,233,577.00	3.80
46	600426	华鲁恒升	18,125,664.20	3.78
47	002648	卫星化学	18,099,072.00	3.77
48	688596	正帆科技	17,638,701.86	3.67
49	603368	柳药集团	17,167,598.59	3.58
50	600993	马应龙	17,068,757.00	3.55
51	603605	珀莱雅	16,862,460.75	3.51
52	600285	羚锐制药	16,489,426.00	3.43
53	600976	健民集团	16,400,965.00	3.42
54	601138	工业富联	16,325,501.00	3.40
55	002138	顺络电子	16,301,747.00	3.40
56	603859	能科科技	16,284,928.00	3.39
57	000999	华润三九	16,276,200.10	3.39
58	601669	中国电建	16,104,693.00	3.35
59	688018	乐鑫科技	15,529,519.95	3.23
60	603283	赛腾股份	15,495,091.00	3.23
61	000333	美的集团	15,371,618.00	3.20
62	002180	纳思达	15,312,349.24	3.19
63	002130	沃尔核材	14,699,230.00	3.06
64	002993	奥海科技	14,600,708.00	3.04
65	688548	广钢气体	14,590,400.67	3.04
66	000786	北新建材	14,340,350.00	2.99
67	000568	泸州老窖	14,245,952.00	2.97
68	002867	周大生	14,220,859.54	2.96
69	300406	九强生物	14,199,415.00	2.96
70	300442	润泽科技	14,169,433.20	2.95
71	600584	长电科技	13,779,529.00	2.87
72	605090	九丰能源	13,765,362.80	2.87
73	688372	伟测科技	13,726,401.36	2.86
74	000680	山推股份	13,316,145.00	2.77
75	002938	鹏鼎控股	13,255,705.00	2.76
76	603712	七一二	13,222,189.28	2.75

77	601900	南方传媒	13,188,006.00	2.75
78	603197	保隆科技	13,184,078.00	2.75
79	002078	太阳纸业	13,037,109.92	2.72
80	601168	西部矿业	12,895,250.00	2.69
81	002472	双环传动	12,887,208.00	2.68
82	00388	香港交易所	12,766,511.36	2.66
83	600741	华域汽车	12,714,866.00	2.65
84	603707	健友股份	12,688,040.60	2.64
85	00981	中芯国际	12,474,943.12	2.60
86	300541	先进数通	12,200,409.00	2.54
87	300750	宁德时代	12,119,969.00	2.52
88	300770	新媒股份	12,053,711.00	2.51
89	300680	隆盛科技	11,835,885.00	2.47
90	002050	三花智控	11,803,514.23	2.46
91	002409	雅克科技	11,612,571.51	2.42
92	000338	潍柴动力	9,496,391.00	1.98
92	02338	潍柴动力	1,849,266.05	0.39
93	600576	祥源文旅	11,292,134.00	2.35
94	002600	领益智造	10,758,326.00	2.24
95	688601	力芯微	10,300,439.82	2.15
96	688630	芯碁微装	10,232,144.22	2.13
97	832982	锦波生物	10,208,993.20	2.13
98	300567	精测电子	10,163,788.74	2.12
99	002311	海大集团	10,132,310.20	2.11
100	688789	宏华数科	9,872,763.09	2.06
101	01347	华虹半导体	5,169,437.74	1.08
101	688347	华虹公司	4,652,973.09	0.97
102	600406	国电南瑞	9,745,817.37	2.03

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	2,622,406,778.35
卖出股票收入（成交）总额	2,648,286,076.92

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	2,742,279.04	0.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,163,123.29	4.01
	其中：政策性金融债	20,163,123.29	4.01
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,905,402.33	4.56

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	240421	24 农发 21	200,000	20,163,123.29	4.01
2	019706	23 国债 13	27,000	2,742,279.04	0.55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	211,565.08
2	应收清算款	187,399.61
3	应收股利	49.74
4	应收利息	-
5	应收申购款	130,726.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	529,740.53

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
泰康产业 升级混合 A	2,851	61,903.54	56,167,271.66	31.83	120,319,726.17	68.17
泰康产业 升级混合 C	5,411	24,536.25	5,582,600.53	4.20	127,183,073.46	95.80
合计	7,822	39,536.27	61,749,872.19	19.97	247,502,799.63	80.03

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰康产业升级混合 A	5,907,033.32	3.3470
	泰康产业升级混合 C	973,374.58	0.7332
	合计	6,880,407.90	2.2248

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰康产业升级混合 A	10~50
	泰康产业升级混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康产业升级混合 A	>100
	泰康产业升级混合 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康产业升级混合 A	泰康产业升级混合 C
基金合同生效日 (2019 年 5 月 17 日) 基金份额总额	296,855,519.38	14,875,220.99
本报告期期初基金份 额总额	187,302,151.29	138,433,656.27
本报告期基金总申购 份额	32,165,415.25	36,072,694.23
减：本报告期基金总 赎回份额	42,980,568.71	41,740,676.51
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	176,486,997.83	132,765,673.99

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 1 月 20 日发布公告，陈奕伦先生自 2024 年 1 月 18 日起担任公司董事长，段国圣先生自 2024 年 1 月 18 日起不再担任公司董事长。

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自 2025 年 1 月 17 日起，本基金改聘审计服务机构，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已履行相关程序。本报告期本基金应支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 38,000.00 元；截至本报告期末，该审计机构向本基金提供审计服务不满 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽核或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	2,705,529,65	51.37	1,611,409.23	51.18	-

		5.77				
华泰证券	2	1,595,371,661.85	30.29	1,113,002.88	35.35	-
广发证券	3	599,625,842.24	11.38	264,404.52	8.40	-
华金证券	2	366,380,357.88	6.96	159,520.88	5.07	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

- 2、交易单元的选择标准和程序
- 租用协议券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：
- （一）合规风控能力较强，经营行为规范，近一年内无重大违规行为及风险事件，未受监管机构重大处罚；
 - （二）财务状况和经营状况良好；
 - （三）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
 - （四）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据公司各类资产管理产品（以下简称“产品”）投资需求提供专门的研究报告；
 - （五）能及时提供准确的信息资讯服务；
 - （六）满足产品运作的保密要求；
 - （七）有较强的交易能力；
 - （八）符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力、服务质量、交易服务进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金增加租用 2 个交易单元，华金证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
光大证券	4,915,682.92	100.00	367,900,000.00	70.86	-	-

华泰证 券	-	-	149,000,000. 00	28.70	-	-
广发证 券	-	-	2,300,000.00	0.44	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年非港股通交易日不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 01 月 15 日
2	泰康产业升级混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 01 月 19 日
3	泰康基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 01 月 20 日
4	泰康基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在深圳前海微众银行股份有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 03 月 25 日
5	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年“香港耶稣受难节、复活节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 03 月 27 日
6	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 03 月 28 日
7	泰康产业升级混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 03 月 29 日
8	泰康产业升级混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 04 月 19 日
9	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年“香港佛诞日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 05 月 13 日
10	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中泰证券股份有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 05 月 23 日
11	泰康产业升级混合型证券投资基金	《中国证券报》；中国证	2024 年 06 月 26 日

	(泰康产业升级混合 C 份额) 基金产品资料概要更新	监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
12	泰康产业升级混合型证券投资基金 (泰康产业升级混合 A 份额) 基金产品资料概要更新	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 06 月 26 日
13	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年“香港特别行政区成立纪念日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 06 月 27 日
14	关于调整泰康产业升级混合型证券投资基金 C 类基金份额在部分销售机构最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 06 月 28 日
15	泰康产业升级混合型证券投资基金 2024 年第二季度报告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 18 日
16	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 07 月 24 日
17	泰康基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在交通银行股份有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 07 月 29 日
18	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 08 月 08 日
19	泰康产业升级混合型证券投资基金 2024 年中期报告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 29 日
20	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金因香港交易所休市暂停申购赎回等交易类业务的公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 09 月 07 日
21	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年“中秋节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 09 月 12 日
22	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年“香港重阳节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 09 日
23	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增泰康人寿保险有限责	《中国证券报》; 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 15 日

	任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	及基金管理人网站	
24	关于调整泰康产业升级混合型证券投资基金在部分销售机构最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 18 日
25	关于调整泰康产业升级混合型证券投资基金在部分销售机构最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 22 日
26	泰康产业升级混合型证券投资基金 2024 年第三季度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 24 日
27	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加招商银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 19 日
28	泰康基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 22 日
29	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加北京汇成基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 3 日
30	泰康产业升级混合型证券投资基金（泰康产业升级混合 A 份额）基金产品资料概要更新	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 6 日
31	泰康产业升级混合型证券投资基金（泰康产业升级混合 C 份额）基金产品资料概要更新	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 6 日
32	泰康产业升级混合型证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 1 次更新)	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 6 日
33	泰康基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在奕丰基金销售有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 19 日
34	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年“香港圣诞节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 20 日
35	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年“香港新年前夕”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 27 日

36	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年非港股通交易日不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 27 日
----	---	-------------------------------	------------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康产业升级混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康产业升级混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康产业升级混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康产业升级混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康产业升级混合型证券投资基金产品资料概要》。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日