泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 50

7.1 期末基金资产组合情况 50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
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 52
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 67
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 67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 67
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 69

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 69
8.2 期末上市基金前十名持有人 69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 70
8.4 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 70

§9 开放式基金份额变动 71

§10 重大事件揭示 72

10.1 基金份额持有人大会决议 72
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 72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 72
10.4 基金投资策略的改变 72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 72
10.8 其他重大事件 76

§11 影响投资者决策的其他重要信息 78

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 78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 78

§12 备查文件目录 79

12.1 备查文件目录 79
12.2 存放地点 79
12.3 查阅方式 79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 A500
场内简称	中证 A500ETF
基金主代码	560510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 27 日
基金管理人	泰康基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,452,026,938.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资策略	1、股票（含存托凭证）投资策略：本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份券构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。但是，如因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他股票或证券组合对标的指数中的股票加以替换。这些特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 2、参与股指期货交易策略：本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货交易。投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。 3、债券与资产支持证券投资策略：本基金基于流动性管理的需要，可以投资于债券等固定收益类工具。 4、可转换债券和可交换债券投资策略：可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，是本基金的重要投资对象之一。 5、证券公司短期公司债券投资策略：对于证券公司短期公司债券，本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、债券收益率等要素，并适当控制债券投资组合整体的久期，防范流动性风险。 6、融资及转融通证券出借业务投资策略：本基金在参与融资业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回

	情况等因素的研究和判断，决定融资规模。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标及本基金风险收益特征的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	张姗
	联系电话	010-89620366	400-61-95555
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	400-61-95555
传真		010-89620100	0755-83195201
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		金志刚	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-28,184,869.34
本期利润	129,203,381.22
加权平均基金份额本期利润	0.0168
本期加权平均净值利润率	1.79%
本期基金份额净值增长率	1.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-218,266,199.09
期末可供分配基金份额利润	-0.0338
期末基金资产净值	6,233,760,738.91
期末基金份额净值	0.9662
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.23%

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。

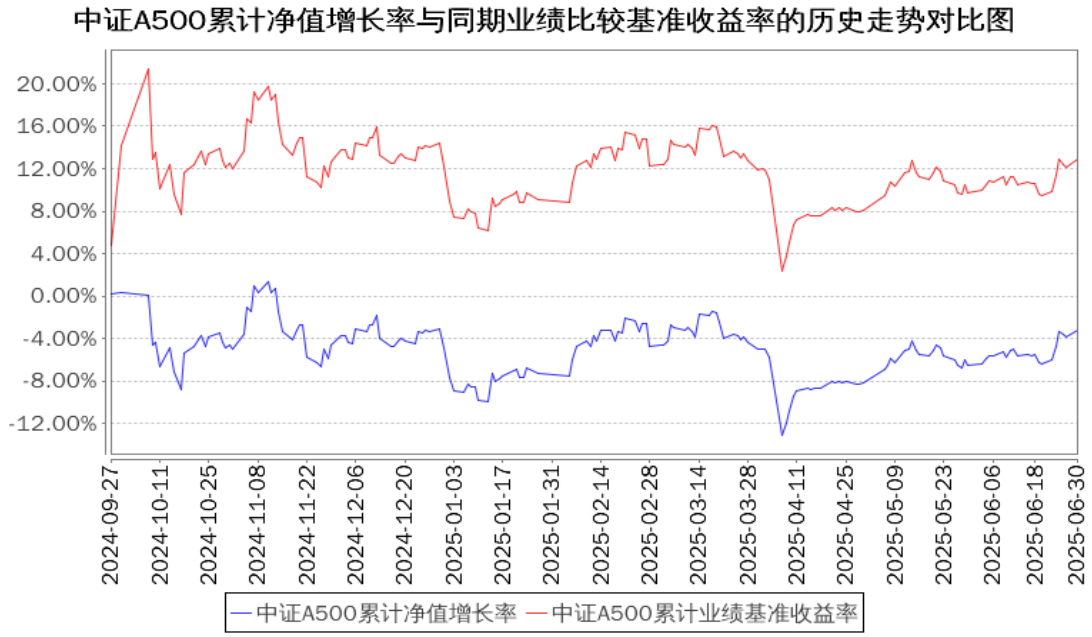
（4）本基金合同生效日为 2024 年 9 月 27 日，截止报告期末本基金未满一年。

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

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
过去一个月	3.58%	0.60%	2.82%	0.60%	0.76%	0.00%
过去三个月	1.92%	1.20%	0.84%	1.20%	1.08%	0.00%
过去六个月	1.67%	1.10%	0.47%	1.10%	1.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	-3.23%	1.21%	12.83%	1.56%	-16.06%	-0.35%

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



注：1、本基金基金合同于 2024 年 09 月 27 日生效，截止报告期末本基金未满一年。

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。

3.3 其他指标

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 2025 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 85 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 及养老目标基金等不同类型、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		
魏军	本基金基金经理、量化投资部负责人	2024 年 9 月 27 日	-	17 年	魏军，博士研究生。2019 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人、量化基金经理。曾历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理等职务。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 27 日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 6 日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金基金

					经理。2022年8月1日至今担任泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022年9月27日至2023年2月17日担任泰康中证新能源动力电池指数型证券投资基金基金经理。2023年6月14日至今担任泰康中证科创创业50指数型发起式证券投资基金基金经理。2023年8月17日至2025年2月7日担任泰康中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023年10月26日至2025年2月7日担任泰康中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023年11月3日至2024年10月12日担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2024年1月31日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2024年3月15日至今担任泰康中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024年5月7日至2025年5月29日担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。2024年9月27日至今担任泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024年10月29日至今担任泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025年1月17日至今担任泰康中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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。

4.3.2 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，2025 年上半年延续了此前结构分化的特征，但部分领域的韧性好于预期，宏观经济预期有所改善。结构分化体现在，出口和制造业继续支撑经济，但地产在年初的小阳春之后明显降温。消费在以旧换新的支撑下，表现较好。相对于现实层面的数据，预期的改善更为明显，科技领域突破、出口在关税冲击下仍然保持韧性等，增强了宏观信心。

权益市场方面，2025 年上半年整体先跌后涨。从大盘指数整体表现上来看，上半年上证指数上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%，恒生综合指数上涨 20.18%，恒生科技上涨 18.68%。申万一级行业表现来看，有色金属、银行、国防军工、传媒、通信等行业表现相对较好，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等行业表现相对落后。

具体投资上，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内跟踪误差主要来自基金份额的申购和赎回、指数成分股调整。报告期内，跟踪指数宽幅震荡，整体小幅上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9662 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.67%；同期业绩比较基准增长率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，“反内卷”政策如何推行，成为最大看点。宏观经济或能继续维持平稳运行的特征，出口存在一定的向下压力、但韧性犹存；财政力度或边际退坡，但如果反内卷政策能提振市场预期、有效平衡部分行业的供需格局，则有利于通缩预期的缓解。外部环境处于缓和期，为国内提供了良好的发展环境。

首先，基本面和政策为市场风险偏好托底。关税冲击后，国内经济呈现超预期韧性。并且，近期涉及地产、消费、资本市场等各领域政策仍在积极发力，持续提振市场风险偏好。产业亮点不断涌现，不仅带动不少细分板块的赚钱效应明显改善，更成为本轮中国资产重估的清晰主线。此外，低利率环境下，机构资金、居民财富向股市再配置的趋势不断强化，市场资金动力仍源源

不断。

因此，大势上，今年或是风险偏好系统性抬升的一年，需战略性保持多头思维。遇到行情拥挤、潜在风险扰动带来的短期战术性调整，恰是中期择机逢低布局的机会。另一方面，多个指数阶段性新高，短期估值过高，市场下半年或将震荡向上。且随着中报业绩预告陆续披露，三季度是全年最看业绩的月份之一，市场将更加注重交易现实，关注基本面的兑现，景气投资或更加有效。未来一段时间，业绩或将再度成为超额收益的胜负手，业绩更为稳健的中证 A500 指数或将有良好表现。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 11,374,040.17 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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遵规守信情况声明

托管人声明:

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	32,393,037.73	33,562,373.40
结算备付金		37,513,117.29	49,386,585.37
存出保证金		8,808,586.31	11,478,016.86
交易性金融资产	6.4.7.2	6,166,001,334.94	8,148,836,332.35
其中：股票投资		6,165,876,826.75	8,148,836,332.35
基金投资		-	-
债券投资		124,508.19	-
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		257,032.91	548,579.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,244,973,109.18	8,243,811,887.52
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,992,015.43	2,357,487.15
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		789,332.40	1,070,729.27
应付托管费		263,110.77	356,909.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,167,911.33	11,680,470.38
负债合计		11,212,370.27	15,465,596.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	6,452,026,938.00	8,645,026,938.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-218,266,199.09	-416,680,647.01
净资产合计		6,233,760,738.91	8,228,346,290.99
负债和净资产总计		6,244,973,109.18	8,243,811,887.52

注：(1)报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9662 元，基金份额总额 6,452,026,938.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.2 利润表

会计主体：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		136,518,242.83
1.利息收入		323,818.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	323,818.46
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）		-22,844,582.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-104,796,866.54
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	226,099.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-240,071.60
股利收益	6.4.7.19	81,966,255.56
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）	6.4.7.20	157,388,250.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,650,756.54
减：二、营业总支出		7,314,861.61
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	5,397,800.49
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	1,799,266.83
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	6.4.7.22	-
7．税金及附加		6,263.49
8．其他费用	6.4.7.23	111,530.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		129,203,381.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		129,203,381.22
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		129,203,381.22

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 27 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	8,645,026,938.00	-	-416,680,647.01	8,228,346,290.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	8,645,026,938.	-	-416,680,647.01	8,228,346,290.99

	00			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,193,000,000.00	-	198,414,447.92	-1,994,585,552.08
（一）、综合收益总额	-	-	129,203,381.22	129,203,381.22
（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）	-2,193,000,000.00	-	80,585,106.87	-2,112,414,893.13
其中：1.基金申购款	1,149,000,000.00	-	-87,570,711.59	1,061,429,288.41
2.基金赎回款	-3,342,000,000.00	-	168,155,818.46	-3,173,844,181.54
（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）	-	-	-11,374,040.17	-11,374,040.17
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,452,026,938.00	-	-218,266,199.09	6,233,760,738.91

注：本基金合同生效日为2024年9月27日，无上年度可比期间数据。

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：

金志刚	金志刚	李俊佑
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

泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(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]1261 号《关于准予泰康中证 A500 交易型开放

式指数证券投资基金注册的批复》核准，由泰康基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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1,999,747,724.00元(含募集股票市值)，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第2400511号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2024年9月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,000,026,938.00份基金份额，其中认购资金利息折合279,214.00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(以下简称“泰康基金”)，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2024]133号核准，本基金2,000,026,938.00份基金份额于2024年10月15日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份券、备选成份券。为更好地实现投资目标，还可投资于部分非成份券(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、股指期货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，但须符合中国证监会相关规定。本基金可根据法律法规的规定参与融资和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。基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；本基金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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率。

本基金的基金管理人以本基金为目标ETF，募集成立了泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“泰康中证A500ETF联接基金”)。泰康中证A500ETF联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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的要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况、自2025年1月1日至2025年6月30日止期间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

本基金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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、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号文《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号文《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》、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》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；对国债、地方政府债利息收入以及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。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)对证券投资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。

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。

(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。

(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。

(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 2025年6月30日
活期存款	32,393,037.73

等于：本金	32,390,077.42
加：应计利息	2,960.31
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	32,393,037.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,239,746,890.75	-	6,165,876,826.75	-73,870,064.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	124,500.00	8.19	124,508.19	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	124,500.00	8.19	124,508.19	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,239,871,390.75	8.19	6,166,001,334.94	-73,870,064.00

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生	-	-	-	

工具				
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	65,661,063.83	-	-	-
其中：股指期货投资	65,661,063.83	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	65,661,063.83	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2509	IC2509	12.00	13,861,920.00	527,520.00
IF2509	IF2509	46.00	53,640,600.00	1,313,936.17
合计				1,841,456.17
减：可抵销期货暂收款				1,841,456.17
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	255,966.12
其中：交易所市场	255,966.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	100,169.02
应退替代款	5,811,776.19
合计	6,167,911.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,645,026,938.00	8,645,026,938.00
本期申购	1,149,000,000.00	1,149,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,342,000,000.00	-3,342,000,000.00
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	6,452,026,938.00	6,452,026,938.00

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-46,527,172.42	-370,153,474.59	-416,680,647.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-46,527,172.42	-370,153,474.59	-416,680,647.01
本期利润	-28,184,869.34	157,388,250.56	129,203,381.22
本期基金份额交易产生的变动数	23,951,818.49	56,633,288.38	80,585,106.87
其中：基金申购款	-9,153,451.87	-78,417,259.72	-87,570,711.59
基金赎回款	33,105,270.36	135,050,548.10	168,155,818.46
本期已分配利润	-11,374,040.17	-	-11,374,040.17
本期末	-62,134,263.44	-156,131,935.65	-218,266,199.09

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	51,618.67
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	268,790.16
其他	3,409.63
合计	323,818.46

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-71,015,800.63

股票投资收益——赎回差价收入	-33,781,065.91
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	-104,796,866.54

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,983,817,569.23
减：卖出股票成本总额	2,053,070,286.93
减：交易费用	1,763,082.93
买卖股票差价收入	-71,015,800.63

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,173,844,181.54
减：现金支付赎回款总额	1,447,161,485.54
减：赎回股票成本总额	1,760,463,761.91
减：交易费用	-
赎回差价收入	-33,781,065.91

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	106.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	225,993.06
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	226,099.85

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,401,551.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,175,400.00
减：应计利息总额	101.87
减：交易费用	56.10
买卖债券差价收入	225,993.06

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-240,071.60

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	81,966,255.56
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	81,966,255.56

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	155,132,374.39
股票投资	155,132,374.39
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	2,255,876.17
权证投资	-
期货投资	2,255,876.17
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	157,388,250.56

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,650,756.54

合计	1,650,756.54

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	30,744.66
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	11,361.78
其他	9,916.99
合计	111,530.80

6.4.7.24 分部报告

无。

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

本基金于2025年7月10日公告进行2025年度第三次分红，权益登记日为2025年7月14日，除息日为2025年7月15日，现金红利发放日为2025年7月18日。本基金每10份基金份额分红数为人民币0.0700元。

截至本财务报告批准报出日，除以上事项外，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
泰康基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人

泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
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

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,397,800.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	283,479.81
应支付基金管理人的净管理费	5,114,320.68

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值*0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,799,266.83

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.05%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*0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额 的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,258,219,940.00	65.9982	4,999,523,757.00	57.8312

6.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	32,393,037.73	51,618.67

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有3,323,200股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币129,094,776.83元，估值总额为人民币152,701,040.00元，占基金资产净值的比例为2.45% （上年度末，本基金持有4,457,900股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币170,967,473.23元，估值总额为人民币175,195,470.00元，占基金资产净值的比例为2.13%）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025年01月13日	2025年1月14日	2025年1月14日	0.0060	5,386,819.27	-	5,386,819.27	-
2	2025年04月14日	2025年4月15日	2025年4月15日	0.0080	5,987,220.90	-	5,987,220.90	-
合计	-	-	-	0.0140	11,374,040.17	-	11,374,040.17	-

6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信	2025	6个月	新	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

	凯科技	年4月2日		股锁定期流通受限						
001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股锁定期流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股锁定期流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定期流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	网下新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001390	古	2025	6个月	新	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-

	麒绒材	年 5 月 21 日		股锁定期流通受限						
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
300383	光环新网	2025 年 3 月 26 日	6 个月	大宗交易流通受限	15.33	13.36	385,000	5,902,050.00	5,143,600.00	-
300457	赢合科技	2025 年 6 月 23 日	6 个月	大宗交易流通受限	20.48	20.96	105,000	2,150,400.00	2,200,800.00	-
300676	华大基因	2025 年 3 月 14 日	6 个月	大宗交易流通受限	55.10	47.51	55,000	3,030,500.00	2,613,050.00	-
301173	毓恬冠	2025 年 2 月 24	6 个月	新股锁	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-

	佳	日		定期流通受限						
301275	汉朔科技	2025年3月4日	6个月	新股锁定期流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定期流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定期流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定期流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优	2025年5	6个月	新股	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

	绿能	月28日		锁定期流通受限						
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定期流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股锁定期流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定期流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首	2025	6个月	新	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-

	航新能	年 3 月 26 日		股锁定期流通受限						
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定期流通受限	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-

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	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定期流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期流通受	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-

				限						
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股锁定期流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603260	合盛硅业	2025年3月12日	6个月	大宗交易流通受限	51.43	46.29	80,000	4,114,400.00	3,703,200.00	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股锁定期流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股锁定期流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股锁定期流通受	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-

				限						
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股锁定期流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股锁定期流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股锁定期流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股锁定期流通	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-

				受限						
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定期流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	配债流通受限	100.00	100.01	1,245	124,500.00	124,508.19	-

注：1、根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

2、根据弘景光电 2024 年年度权益分派实施公告，以公司总股本 6,354.6667 万股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 15 元（含税），每 10 股转增 4 股。除权除息日为 2025 年 5 月 28

日，本基金所持有的弘景光电获得转增股52股。根据思看科技2024年年度权益分派实施公告，以公司总股本68,000,000股为基数，向全体股东每股派发现金红利0.55元（含税），每股转增0.3股。除权除息日为2025年6月19日，本基金所持有的思看科技获得转增股52股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币型市场基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括标的成分股、备选成份股以及经中国证监会核准发行的股票、债券和货币市场工具等。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。

6.4.13.2 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招商银行股份有限公司，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

6.4.13.2.1 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 2025年6月30日	上年度末 2024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。

6.4.13.2.2 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 2025年6月30日	上年度末 2024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。

6.4.13.2.3 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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。

6.4.13.2.4 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	124,508.19	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	124,508.19	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。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。

6.4.13.2.5 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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。

6.4.13.2.6 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 2025年6月30日	上年度末 2024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。

6.4.13.3 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2025年6月30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。

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时间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2025年6月30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 2025年6月30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。

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货币资金、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	32,393,037.73	-	-	-	32,393,037.73
结算备付金	37,513,117.29	-	-	-	37,513,117.29
存出保证金	8,808,586.31	-	-	-	8,808,586.31
交易性金融资产	-	-	124,508.19	6,165,876,826.75	6,166,001,334.94
应收清算款	-	-	-	257,032.91	257,032.91
资产总计	78,714,741.33	-	124,508.19	6,166,133,859.66	6,244,973,109.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	789,332.40	789,332.40
应付托管费	-	-	-	263,110.77	263,110.77
应付清算款	-	-	-	3,992,015.43	3,992,015.43
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	6,167,911.33	6,167,911.33
负债总计	-	-	-	11,212,370.27	11,212,370.27
利率敏感度缺口	78,714,741.33	-	124,508.19	6,154,921,489.39	6,233,760,738.91
上年度末 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	33,562,373.40	-	-	-	33,562,373.40
结算备付金	49,386,585.37	-	-	-	49,386,585.37
存出保证金	11,478,016.86	-	-	-	11,478,016.86
交易性金融资产	-	-	-	8,148,836,332.35	8,148,836,332.35
应收清算款	-	-	-	548,579.54	548,579.54
资产总计	94,426,975.63	-	-	8,149,384,911.89	8,243,811,887.52
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,070,729.27	1,070,729.27
应付托管费	-	-	-	356,909.73	356,909.73
应付清算款	-	-	-	2,357,487.15	2,357,487.15
其他负债	-	-	-	11,680,470.38	11,680,470.38
负债总计	-	-	-	15,465,596.53	15,465,596.53
利率敏感度缺口	94,426,975.63	-	-	8,133,919,315.36	8,228,346,290.99

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

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率下调 0.25%	0.00	0.00

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。基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。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。

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 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	6,165,876,826.75	98.91	8,148,836,332.35	99.03
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	6,165,876,826.75	98.91	8,148,836,332.35	99.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2025年6月30日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	6,151,744,425.00	8,136,437,353.63
第二层次	139,893.73	12,256,250.50
第三层次	14,117,016.21	142,728.22
合计	6,166,001,334.94	8,148,836,332.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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。

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

(1)基金申购款

本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 1,061,429,288.41 元，其中包括以股票支付的申购款 573,364,559.04 元和以现金支付的申购款 488,064,729.37 元。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	6,165,876,826.75	98.73
	其中：股票	6,165,876,826.75	98.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	124,508.19	0.00
	其中：债券	124,508.19	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	69,906,155.02	1.12
8	其他各项资产	9,065,619.22	0.15
9	合计	6,244,973,109.18	100.00

注：（1）本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为0.00元，占期末资产净值比例为0.00%。

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

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	33,522,824.00	0.54
B	采矿业	311,263,105.18	4.99
C	制造业	3,580,159,340.72	57.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	189,879,368.00	3.05
E	建筑业	117,056,716.14	1.88
F	批发和零售业	43,471,415.59	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	214,957,564.00	3.45
H	住宿和餐饮业	5,260,965.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	410,194,787.70	6.58
J	金融业	997,758,837.60	16.01

K	房地产业	64,481,842.00	1.03
L	租赁和商务服务业	68,540,687.80	1.10
M	科学研究和技术服务业	68,383,659.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	13,487,421.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,072,248.00	0.07
Q	卫生和社会工作	23,458,194.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	19,415,893.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	6,165,364,868.73	98.90

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	463,677.88	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	31,536.78	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,499.36	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	511,958.02	0.01

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通过港股通交易机制投资的港股。

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	600519	贵州茅台	168,397	237,358,939.44	3.81
2	300750	宁德时代	709,780	179,020,711.60	2.87
3	601318	中国平安	2,889,400	160,303,912.00	2.57
4	600036	招商银行	3,323,200	152,701,040.00	2.45
5	601166	兴业银行	4,462,900	104,164,086.00	1.67
6	600900	长江电力	3,285,400	99,021,956.00	1.59
7	000333	美的集团	1,321,200	95,390,640.00	1.53
8	601899	紫金矿业	4,421,228	86,213,946.00	1.38
9	002594	比亚迪	243,300	80,753,703.00	1.30
10	300059	东方财富	3,394,800	78,521,724.00	1.26
11	600030	中信证券	2,621,080	72,394,229.60	1.16
12	601398	工商银行	9,409,100	71,415,069.00	1.15
13	600276	恒瑞医药	1,198,820	62,218,758.00	1.00
14	000858	五 粮 液	521,800	62,042,020.00	1.00
15	601328	交通银行	7,162,700	57,301,600.00	0.92
16	000651	格力电器	1,202,800	54,029,776.00	0.87
17	601288	农业银行	8,577,000	50,432,760.00	0.81
18	600887	伊利股份	1,698,759	47,361,400.92	0.76
19	002475	立讯精密	1,362,900	47,279,001.00	0.76
20	600919	江苏银行	3,940,100	47,044,794.00	0.75
21	688981	中芯国际	533,400	47,029,878.00	0.75
22	603259	药明康德	671,400	46,695,870.00	0.75
23	601816	京沪高铁	7,878,000	45,298,500.00	0.73
24	600000	浦发银行	3,152,500	43,756,700.00	0.70
25	000725	京东方 A	9,866,800	39,368,532.00	0.63
26	002371	北方华创	86,530	38,264,431.30	0.61
27	300760	迈瑞医疗	162,582	36,540,304.50	0.59
28	601088	中国神华	886,100	35,922,494.00	0.58
29	688041	海光信息	251,100	35,477,919.00	0.57
30	300308	中际旭创	238,900	34,845,954.00	0.56
31	601601	中国太保	919,400	34,486,694.00	0.55
32	300502	新易盛	266,694	33,875,471.88	0.54
33	688256	寒武纪	56,300	33,864,450.00	0.54
34	300124	汇川技术	506,800	32,724,076.00	0.52

35	601728	中国电信	4,169,200	32,311,300.00	0.52
36	601668	中国建筑	5,548,500	32,014,845.00	0.51
37	002352	顺丰控股	647,400	31,567,224.00	0.51
38	000001	平安银行	2,603,900	31,429,073.00	0.50
39	002714	牧原股份	733,400	30,810,134.00	0.49
40	002230	科大讯飞	620,500	29,709,540.00	0.48
41	601127	赛力斯	219,500	29,483,240.00	0.47
42	603501	豪威集团	228,700	29,193,555.00	0.47
43	600031	三一重工	1,593,400	28,601,530.00	0.46
44	000063	中兴通讯	865,500	28,120,095.00	0.45
45	603019	中科曙光	392,800	27,653,120.00	0.44
46	002415	海康威视	991,600	27,497,068.00	0.44
47	600309	万华化学	506,000	27,455,560.00	0.44
48	600941	中国移动	242,400	27,282,120.00	0.44
49	300274	阳光电源	389,900	26,423,523.00	0.42
50	601857	中国石油	3,046,300	26,045,865.00	0.42
51	601919	中远海控	1,692,800	25,459,712.00	0.41
52	688008	澜起科技	309,500	25,379,000.00	0.41
53	600690	海尔智家	1,007,400	24,963,372.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	430,000	24,514,300.00	0.39
55	601012	隆基绿能	1,629,400	24,473,588.00	0.39
56	600406	国电南瑞	1,077,930	24,156,411.30	0.39
57	601766	中国中车	3,264,440	22,981,657.60	0.37
58	603986	兆易创新	178,100	22,534,993.00	0.36
59	600050	中国联通	4,195,100	22,401,834.00	0.36
60	000568	泸州老窖	197,400	22,385,160.00	0.36
61	000338	潍柴动力	1,454,400	22,368,672.00	0.36
62	600028	中国石化	3,914,740	22,079,133.60	0.35
63	000100	TCL科技	5,048,200	21,858,706.00	0.35
64	300476	胜宏科技	161,800	21,742,684.00	0.35
65	601988	中国银行	3,847,100	21,620,702.00	0.35
66	688012	中微公司	118,100	21,529,630.00	0.35
67	601006	大秦铁路	3,250,300	21,451,980.00	0.34
68	601985	中国核电	2,208,700	20,585,084.00	0.33
69	601225	陕西煤业	1,040,000	20,009,600.00	0.32
70	600104	上汽集团	1,243,700	19,961,385.00	0.32
71	002027	分众传媒	2,710,300	19,785,190.00	0.32
72	600150	中国船舶	599,900	19,520,746.00	0.31
73	600418	江淮汽车	469,000	18,802,210.00	0.30
74	601628	中国人寿	447,700	18,440,763.00	0.30
75	605499	东鹏饮料	56,260	17,668,453.00	0.28
76	688111	金山办公	62,500	17,503,125.00	0.28
77	603288	海天味业	448,600	17,455,026.00	0.28

78	600760	中航沈飞	296,200	17,363,244.00	0.28
79	000425	徐工机械	2,207,500	17,152,275.00	0.28
80	688271	联影医疗	133,500	17,053,290.00	0.27
81	000625	长安汽车	1,335,200	17,037,152.00	0.27
82	000792	盐湖股份	993,300	16,965,564.00	0.27
83	600111	北方稀土	680,000	16,932,000.00	0.27
84	600938	中国海油	642,000	16,762,620.00	0.27
85	600905	三峡能源	3,836,000	16,341,360.00	0.26
86	600436	片仔癀	81,400	16,280,814.00	0.26
87	601658	邮储银行	2,959,500	16,188,465.00	0.26
88	600089	特变电工	1,355,300	16,168,729.00	0.26
89	002625	光启技术	404,200	16,159,916.00	0.26
90	601888	中国中免	262,900	16,029,013.00	0.26
91	603993	洛阳钼业	1,887,500	15,892,750.00	0.25
92	002050	三花智控	601,500	15,867,570.00	0.25
93	300033	同花顺	58,100	15,861,881.00	0.25
94	300015	爱尔眼科	1,253,500	15,643,680.00	0.25
95	600048	保利发展	1,931,200	15,642,720.00	0.25
96	600019	宝钢股份	2,356,900	15,531,971.00	0.25
97	600547	山东黄金	485,556	15,503,803.08	0.25
98	601390	中国中铁	2,755,100	15,456,111.00	0.25
99	002463	沪电股份	361,400	15,388,412.00	0.25
100	002241	歌尔股份	656,600	15,311,912.00	0.25
101	600415	小商品城	738,200	15,265,976.00	0.24
102	300014	亿纬锂能	329,000	15,071,490.00	0.24
103	601600	中国铝业	2,131,800	15,007,872.00	0.24
104	601989	中国重工	3,067,400	14,232,736.00	0.23
105	000977	浪潮信息	277,000	14,093,760.00	0.23
106	600585	海螺水泥	645,200	13,852,444.00	0.22
107	002384	东山精密	366,100	13,827,597.00	0.22
108	600893	航发动力	358,200	13,805,028.00	0.22
109	002179	中航光电	340,418	13,739,270.48	0.22
110	600570	恒生电子	406,500	13,634,010.00	0.22
111	603799	华友钴业	365,700	13,538,214.00	0.22
112	000538	云南白药	240,000	13,389,600.00	0.21
113	600584	长电科技	384,100	12,940,329.00	0.21
114	000938	紫光股份	537,500	12,894,625.00	0.21
115	000988	华工科技	269,800	12,683,298.00	0.20
116	601727	上海电气	1,699,600	12,560,044.00	0.20
117	002028	思源电气	166,720	12,155,555.20	0.19
118	600438	通威股份	724,000	12,127,000.00	0.19
119	300408	三环集团	360,800	12,050,720.00	0.19
120	002049	紫光国微	181,900	11,979,934.00	0.19

121	300433	蓝思科技	534,900	11,928,270.00	0.19
122	000002	万　科A	1,828,900	11,741,538.00	0.19
123	600795	国电电力	2,394,600	11,589,864.00	0.19
124	600489	中金黄金	782,100	11,442,123.00	0.18
125	601669	中国电建	2,307,400	11,237,038.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	447,000	11,121,360.00	0.18
127	601689	拓普集团	233,350	11,025,787.50	0.18
128	600010	包钢股份	6,085,200	10,892,508.00	0.17
129	300339	润和软件	213,900	10,872,537.00	0.17
130	002422	科伦药业	301,200	10,819,104.00	0.17
131	002456	欧菲光	895,300	10,609,305.00	0.17
132	600009	上海机场	332,800	10,573,056.00	0.17
133	600160	巨化股份	363,200	10,416,576.00	0.17
134	601100	恒立液压	143,400	10,324,800.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	303,400	10,245,818.00	0.16
136	000768	中航西飞	373,200	10,203,288.00	0.16
137	300394	天孚通信	124,980	9,978,403.20	0.16
138	601186	中国铁建	1,237,600	9,913,176.00	0.16
139	600183	生益科技	326,300	9,837,945.00	0.16
140	688036	传音控股	123,400	9,834,980.00	0.16
141	002252	上海莱士	1,429,800	9,822,726.00	0.16
142	600839	四川长虹	994,300	9,664,596.00	0.16
143	000157	中联重科	1,331,200	9,624,576.00	0.15
144	601360	三六零	941,600	9,604,320.00	0.15
145	600989	宝丰能源	591,000	9,538,740.00	0.15
146	600886	国投电力	645,400	9,513,196.00	0.15
147	000963	华东医药	235,000	9,484,600.00	0.15
148	002074	国轩高科	290,300	9,423,138.00	0.15
149	600115	中国东航	2,298,600	9,263,358.00	0.15
150	601058	赛轮轮胎	704,700	9,245,664.00	0.15
151	300442	润泽科技	184,700	9,148,191.00	0.15
152	000408	藏格矿业	211,300	9,016,171.00	0.14
153	000807	云铝股份	559,000	8,932,820.00	0.14
154	002517	恺英网络	460,500	8,892,255.00	0.14
155	002466	天齐锂业	277,300	8,884,692.00	0.14
156	600066	宇通客车	357,300	8,882,478.00	0.14
157	688169	石头科技	56,000	8,766,800.00	0.14
158	002001	新 和 成	411,400	8,750,478.00	0.14
159	002340	格林美	1,377,900	8,749,665.00	0.14
160	000661	长春高新	88,000	8,727,840.00	0.14
161	600426	华鲁恒升	400,100	8,670,167.00	0.14
162	002195	岩山科技	1,524,700	8,584,061.00	0.14
163	600029	南方航空	1,452,000	8,566,800.00	0.14

164	600196	复星医药	340,900	8,553,181.00	0.14
165	001979	招商蛇口	975,100	8,551,627.00	0.14
166	002558	巨人网络	362,700	8,541,585.00	0.14
167	000975	山金国际	447,700	8,479,438.00	0.14
168	601800	中国交建	953,200	8,473,948.00	0.14
169	002236	大华股份	532,300	8,452,924.00	0.14
170	600011	华能国际	1,181,800	8,438,052.00	0.14
171	300661	圣邦股份	115,650	8,415,850.50	0.14
172	600674	川投能源	524,300	8,409,772.00	0.13
173	301236	软通动力	153,500	8,387,240.00	0.13
174	002156	通富微电	325,200	8,331,624.00	0.13
175	688126	沪硅产业	443,600	8,304,192.00	0.13
176	600487	亨通光电	530,100	8,110,530.00	0.13
177	600346	恒力石化	565,700	8,066,882.00	0.13
178	300207	欣旺达	397,600	7,975,856.00	0.13
179	601111	中国国航	1,008,200	7,954,698.00	0.13
180	300418	昆仑万维	236,500	7,953,495.00	0.13
181	300251	光线传媒	392,300	7,951,921.00	0.13
182	688608	恒玄科技	22,800	7,933,944.00	0.13
183	002648	卫星化学	453,900	7,866,087.00	0.13
184	600745	闻泰科技	234,000	7,846,020.00	0.13
185	600372	中航机载	648,400	7,819,704.00	0.13
186	688213	思特威	76,200	7,789,164.00	0.12
187	600460	士兰微	312,800	7,763,696.00	0.12
188	601868	中国能建	3,474,000	7,747,020.00	0.12
189	002916	深南电路	71,830	7,743,992.30	0.12
190	003816	中国广核	2,112,700	7,690,228.00	0.12
191	000066	中国长城	519,300	7,685,640.00	0.12
192	688777	中控技术	170,600	7,661,646.00	0.12
193	002920	德赛西威	74,700	7,629,111.00	0.12
194	600096	云天化	343,200	7,540,104.00	0.12
195	601117	中国化学	981,000	7,524,270.00	0.12
196	688120	华海清科	44,600	7,524,020.00	0.12
197	600741	华域汽车	424,700	7,495,955.00	0.12
198	601319	中国人保	859,400	7,485,374.00	0.12
199	002273	水晶光电	372,200	7,432,834.00	0.12
200	601168	西部矿业	446,200	7,420,306.00	0.12
201	002465	海格通信	532,200	7,418,868.00	0.12
202	600879	航天电子	708,300	7,415,901.00	0.12
203	600256	广汇能源	1,223,800	7,367,276.00	0.12
204	600588	用友网络	550,720	7,363,126.40	0.12
205	300347	泰格医药	137,700	7,342,164.00	0.12
206	600176	中国巨石	643,700	7,338,180.00	0.12

207	300450	先导智能	293,800	7,300,930.00	0.12
208	601021	春秋航空	131,100	7,295,715.00	0.12
209	002601	龙佰集团	448,700	7,273,427.00	0.12
210	300782	卓胜微	101,500	7,244,055.00	0.12
211	688235	百济神州	31,000	7,242,840.00	0.12
212	000831	中国稀土	200,100	7,227,612.00	0.12
213	000786	北新建材	272,900	7,226,392.00	0.12
214	601633	长城汽车	335,200	7,200,096.00	0.12
215	002555	三七互娱	415,400	7,182,266.00	0.12
216	600219	南山铝业	1,870,700	7,164,781.00	0.11
217	600352	浙江龙盛	701,700	7,129,272.00	0.11
218	300896	爱美客	40,720	7,118,263.20	0.11
219	000933	神火股份	423,700	7,050,368.00	0.11
220	002294	信立泰	148,900	7,047,437.00	0.11
221	300017	网宿科技	656,300	7,035,536.00	0.11
222	600885	宏发股份	314,900	7,025,419.00	0.11
223	600482	中国动力	302,900	6,987,903.00	0.11
224	302132	中航成飞	79,400	6,982,436.00	0.11
225	002185	华天科技	688,500	6,953,850.00	0.11
226	600039	四川路桥	700,900	6,938,910.00	0.11
227	688002	睿创微纳	98,600	6,874,392.00	0.11
228	000630	铜陵有色	2,058,100	6,874,054.00	0.11
229	688617	惠泰医疗	23,000	6,831,000.00	0.11
230	688396	华润微	143,100	6,748,596.00	0.11
231	002493	荣盛石化	814,800	6,746,544.00	0.11
232	002129	TCL中环	869,700	6,679,296.00	0.11
233	600085	同仁堂	184,700	6,660,282.00	0.11
234	001965	招商公路	551,300	6,615,600.00	0.11
235	601877	正泰电器	290,200	6,578,834.00	0.11
236	300866	安克创新	57,500	6,532,000.00	0.10
237	600362	江西铜业	278,200	6,518,226.00	0.10
238	002709	天赐材料	358,200	6,490,584.00	0.10
239	688099	晶晨股份	91,400	6,490,314.00	0.10
240	002130	沃尔核材	271,000	6,455,220.00	0.10
241	688506	百利天恒	21,700	6,425,804.00	0.10
242	300454	深信服	68,100	6,413,658.00	0.10
243	002281	光迅科技	129,500	6,386,940.00	0.10
244	002085	万丰奥威	400,900	6,370,301.00	0.10
245	688122	西部超导	122,400	6,350,112.00	0.10
246	002131	利欧股份	1,812,200	6,342,700.00	0.10
247	000423	东阿阿胶	120,600	6,307,380.00	0.10
248	002595	豪迈科技	106,500	6,306,930.00	0.10
249	300122	智飞生物	320,900	6,286,431.00	0.10

250	300223	北京君正	90,800	6,283,360.00	0.10
251	603129	春风动力	28,900	6,256,850.00	0.10
252	300058	蓝色光标	953,080	6,252,204.80	0.10
253	002532	天山铝业	751,900	6,248,289.00	0.10
254	300002	神州泰岳	528,700	6,238,660.00	0.10
255	603392	万泰生物	102,220	6,235,420.00	0.10
256	002738	中矿资源	193,700	6,229,392.00	0.10
257	300474	景嘉微	84,300	6,153,900.00	0.10
258	002180	纳思达	267,720	6,141,496.80	0.10
259	600161	天坛生物	318,500	6,112,015.00	0.10
260	002138	顺络电子	217,300	6,110,476.00	0.10
261	002472	双环传动	181,100	6,065,039.00	0.10
262	002078	太阳纸业	450,000	6,057,000.00	0.10
263	002436	兴森科技	454,200	6,013,608.00	0.10
264	603596	伯特利	113,900	6,001,391.00	0.10
265	300832	新产业	105,400	5,978,288.00	0.10
266	002938	鹏鼎控股	186,100	5,960,783.00	0.10
267	002410	广联达	443,200	5,943,312.00	0.10
268	600233	圆通速递	460,900	5,941,001.00	0.10
269	002128	电投能源	300,300	5,939,934.00	0.10
270	000301	东方盛虹	708,300	5,900,139.00	0.09
271	600862	中航高科	225,500	5,881,040.00	0.09
272	300346	南大光电	184,960	5,852,134.40	0.09
273	600143	金发科技	565,700	5,832,367.00	0.09
274	600188	兖矿能源	478,000	5,817,260.00	0.09
275	300136	信维通信	259,500	5,812,800.00	0.09
276	300759	康龙化成	236,800	5,811,072.00	0.09
277	688072	拓荆科技	37,800	5,810,238.00	0.09
278	300024	机器人	337,100	5,791,378.00	0.09
279	688047	龙芯中科	43,400	5,789,126.00	0.09
280	002065	东华软件	603,000	5,788,800.00	0.09
281	300054	鼎龙股份	201,300	5,773,284.00	0.09
282	000034	神州数码	153,100	5,762,684.00	0.09
283	002353	杰瑞股份	164,100	5,743,500.00	0.09
284	002223	鱼跃医疗	161,000	5,731,600.00	0.09
285	002202	金风科技	555,900	5,697,975.00	0.09
286	601618	中国中冶	1,910,000	5,691,800.00	0.09
287	603606	东方电缆	109,900	5,682,929.00	0.09
288	300395	菲利华	111,200	5,682,320.00	0.09
289	300496	中科创达	99,300	5,681,946.00	0.09
290	688578	艾力斯	60,800	5,656,832.00	0.09
291	601615	明阳智能	486,500	5,589,885.00	0.09
292	688223	晶科能源	1,076,600	5,587,554.00	0.09

293	000999	华润三九	178,290	5,576,911.20	0.09
294	002624	完美世界	364,700	5,532,499.00	0.09
295	002008	大族激光	226,300	5,514,931.00	0.09
296	600845	宝信软件	232,900	5,501,098.00	0.09
297	002271	东方雨虹	511,900	5,492,687.00	0.09
298	601872	招商轮船	871,600	5,456,216.00	0.09
299	002405	四维图新	636,900	5,439,126.00	0.09
300	600515	海南机场	1,530,300	5,417,262.00	0.09
301	603659	璞泰来	288,100	5,410,518.00	0.09
302	688266	泽璟制药	50,200	5,397,002.00	0.09
303	600549	厦门钨业	256,700	5,370,164.00	0.09
304	600895	张江高科	207,900	5,343,030.00	0.09
305	603087	甘李药业	97,500	5,341,050.00	0.09
306	002459	晶澳科技	534,100	5,330,318.00	0.09
307	300459	汤姆猫	949,100	5,314,960.00	0.09
308	300604	长川科技	118,000	5,299,380.00	0.09
309	300012	华测检测	452,900	5,294,401.00	0.08
310	603605	珀莱雅	63,900	5,290,281.00	0.08
311	000426	兴业银锡	334,600	5,286,680.00	0.08
312	002155	湖南黄金	294,610	5,258,788.50	0.08
313	000733	振华科技	104,700	5,240,235.00	0.08
314	300383	光环新网	389,100	5,202,230.00	0.08
315	605117	德业股份	98,200	5,171,212.00	0.08
316	300627	华测导航	147,280	5,154,800.00	0.08
317	688599	天合光能	352,800	5,126,184.00	0.08
318	605589	圣泉集团	182,600	5,067,150.00	0.08
319	300253	卫宁健康	475,000	5,035,000.00	0.08
320	601216	君正集团	907,800	5,011,056.00	0.08
321	600332	白云山	188,300	4,963,588.00	0.08
322	300699	光威复材	156,500	4,956,355.00	0.08
323	688180	君实生物	145,700	4,950,886.00	0.08
324	000617	中油资本	675,600	4,931,880.00	0.08
325	600392	盛和资源	374,200	4,928,214.00	0.08
326	000519	中兵红箭	224,600	4,916,494.00	0.08
327	300037	新宙邦	139,500	4,910,400.00	0.08
328	002444	巨星科技	192,000	4,897,920.00	0.08
329	000932	华菱钢铁	1,109,200	4,880,480.00	0.08
330	600153	建发股份	469,200	4,865,604.00	0.08
331	601799	星宇股份	38,800	4,850,000.00	0.08
332	300003	乐普医疗	351,200	4,839,536.00	0.08
333	601233	桐昆股份	455,000	4,823,000.00	0.08
334	000878	云南铜业	378,000	4,808,160.00	0.08
335	002389	航天彩虹	186,600	4,776,960.00	0.08

336	300001	特锐德	198,600	4,760,442.00	0.08
337	300073	当升科技	108,500	4,759,895.00	0.08
338	002821	凯莱英	53,900	4,756,675.00	0.08
339	300142	沃森生物	431,200	4,743,200.00	0.08
340	300316	晶盛机电	174,700	4,743,105.00	0.08
341	002414	高德红外	460,800	4,723,200.00	0.08
342	300628	亿联网络	135,800	4,720,408.00	0.08
343	600803	新奥股份	248,900	4,704,210.00	0.08
344	603979	金诚信	101,200	4,699,728.00	0.08
345	600699	均胜电子	265,500	4,630,320.00	0.07
346	002007	华兰生物	293,400	4,597,578.00	0.07
347	002812	恩捷股份	156,700	4,589,743.00	0.07
348	300568	星源材质	361,900	4,588,892.00	0.07
349	600177	雅戈尔	624,400	4,558,120.00	0.07
350	600118	中国卫星	158,700	4,534,059.00	0.07
351	600521	华海药业	243,100	4,528,953.00	0.07
352	601238	广汽集团	597,100	4,472,279.00	0.07
353	603260	合盛硅业	96,200	4,471,080.00	0.07
354	002152	广电运通	332,100	4,463,424.00	0.07
355	600398	海澜之家	641,000	4,461,360.00	0.07
356	000738	航发控制	213,100	4,421,825.00	0.07
357	300315	掌趣科技	727,300	4,414,711.00	0.07
358	300413	芒果超媒	202,100	4,409,822.00	0.07
359	600704	物产中大	834,500	4,397,815.00	0.07
360	000623	吉林敖东	258,100	4,374,795.00	0.07
361	600497	驰宏锌锗	821,300	4,344,677.00	0.07
362	000009	中国宝安	487,200	4,326,336.00	0.07
363	600316	洪都航空	114,700	4,324,190.00	0.07
364	002044	美年健康	840,900	4,322,226.00	0.07
365	600765	中航重机	253,840	4,284,819.20	0.07
366	600141	兴发集团	208,600	4,282,558.00	0.07
367	002318	久立特材	182,200	4,261,658.00	0.07
368	600018	上港集团	744,500	4,251,095.00	0.07
369	601567	三星医疗	188,800	4,232,896.00	0.07
370	600038	中直股份	108,900	4,226,409.00	0.07
371	002409	雅克科技	76,700	4,194,723.00	0.07
372	000400	许继电气	190,600	4,149,362.00	0.07
373	300919	中伟股份	126,000	4,142,880.00	0.07
374	601677	明泰铝业	332,200	4,125,924.00	0.07
375	300757	罗博特科	27,400	4,109,178.00	0.07
376	688188	柏楚电子	31,100	4,094,626.00	0.07
377	002607	中公教育	1,330,800	4,072,248.00	0.07
378	300724	捷佳伟创	74,900	4,067,070.00	0.07

379	000960	锡业股份	264,800	4,051,440.00	0.06
380	600637	东方明珠	540,200	4,035,294.00	0.06
381	300088	长信科技	674,500	4,020,020.00	0.06
382	601607	上海医药	224,200	4,008,696.00	0.06
383	600498	烽火通信	189,600	3,987,288.00	0.06
384	603939	益丰药房	162,700	3,981,269.00	0.06
385	002245	蔚蓝锂芯	308,700	3,960,621.00	0.06
386	300558	贝达药业	68,300	3,957,985.00	0.06
387	600563	法拉电子	36,200	3,949,058.00	0.06
388	300182	捷成股份	713,100	3,929,181.00	0.06
389	600529	山东药玻	176,900	3,916,566.00	0.06
390	000039	中集集团	498,100	3,915,066.00	0.06
391	002407	多氟多	320,200	3,903,238.00	0.06
392	002739	万达电影	340,700	3,894,201.00	0.06
393	002841	视源股份	112,000	3,875,200.00	0.06
394	600026	中远海能	374,100	3,864,453.00	0.06
395	300068	南都电源	239,900	3,819,208.00	0.06
396	002025	航天电器	74,100	3,809,481.00	0.06
397	600486	扬农化工	65,600	3,804,800.00	0.06
398	601018	宁波港	1,036,600	3,793,956.00	0.06
399	301358	湖南裕能	120,800	3,767,752.00	0.06
400	300285	国瓷材料	215,900	3,745,865.00	0.06
401	000887	中鼎股份	212,100	3,730,839.00	0.06
402	300763	锦浪科技	64,700	3,713,133.00	0.06
403	688303	大全能源	172,900	3,686,228.00	0.06
404	300144	宋城演艺	425,800	3,640,590.00	0.06
405	603806	福斯特	280,100	3,630,096.00	0.06
406	603486	科沃斯	61,900	3,604,437.00	0.06
407	600820	隧道股份	588,800	3,591,680.00	0.06
408	600008	首创环保	1,187,300	3,585,646.00	0.06
409	688009	中国通号	692,300	3,558,422.00	0.06
410	002064	华峰化学	535,600	3,540,316.00	0.06
411	002497	雅化集团	310,300	3,537,420.00	0.06
412	300296	利亚德	577,200	3,520,920.00	0.06
413	002312	川发龙蟒	305,500	3,507,140.00	0.06
414	600998	九州通	681,600	3,503,424.00	0.06
415	603568	伟明环保	183,400	3,499,272.00	0.06
416	600763	通策医疗	84,600	3,492,288.00	0.06
417	600516	方大炭素	751,300	3,486,032.00	0.06
418	600166	福田汽车	1,269,300	3,439,803.00	0.06
419	600170	上海建工	1,427,700	3,412,203.00	0.05
420	600208	衢州发展	1,150,600	3,405,776.00	0.05
421	601179	中国西电	549,500	3,373,930.00	0.05

422	603816	顾家家居	131,700	3,360,984.00	0.05
423	600312	平高电气	217,600	3,348,864.00	0.05
424	000683	博源化工	697,300	3,340,067.00	0.05
425	605358	立昂微	142,700	3,324,910.00	0.05
426	002176	江特电机	454,800	3,301,848.00	0.05
427	601155	新城控股	241,000	3,296,880.00	0.05
428	002244	滨江集团	335,600	3,272,100.00	0.05
429	601000	唐山港	798,700	3,242,722.00	0.05
430	300676	华大基因	67,600	3,240,152.00	0.05
431	002432	九安医疗	88,900	3,238,627.00	0.05
432	603613	国联股份	136,000	3,221,840.00	0.05
433	300567	精测电子	53,000	3,212,330.00	0.05
434	000708	中信特钢	273,000	3,210,480.00	0.05
435	000818	航锦科技	142,300	3,201,750.00	0.05
436	000629	钒钛股份	1,247,900	3,194,624.00	0.05
437	603885	吉祥航空	236,900	3,191,043.00	0.05
438	000830	鲁西化工	309,500	3,187,850.00	0.05
439	600323	瀚蓝环境	130,700	3,182,545.00	0.05
440	002603	以岭药业	222,700	3,140,070.00	0.05
441	002439	启明星辰	196,300	3,138,837.00	0.05
442	600535	天士力	199,000	3,114,350.00	0.05
443	601880	辽港股份	2,026,000	3,039,000.00	0.05
444	600499	科达制造	308,800	3,026,240.00	0.05
445	603000	人民网	149,200	3,015,332.00	0.05
446	688005	容百科技	134,600	3,004,272.00	0.05
447	002145	中核钛白	721,400	2,993,810.00	0.05
448	300390	天华新能	156,700	2,988,269.00	0.05
449	600511	国药股份	101,200	2,950,992.00	0.05
450	000563	陕国投A	826,000	2,948,820.00	0.05
451	600859	王府井	210,331	2,921,497.59	0.05
452	600655	豫园股份	524,200	2,909,310.00	0.05
453	000547	航天发展	345,400	2,901,360.00	0.05
454	600325	华发股份	591,600	2,881,092.00	0.05
455	603077	和邦生物	1,643,400	2,875,950.00	0.05
456	600004	白云机场	315,300	2,869,230.00	0.05
457	601966	玲珑轮胎	195,500	2,867,985.00	0.05
458	603899	晨光股份	98,900	2,867,111.00	0.05
459	600131	国网信通	160,400	2,839,080.00	0.05
460	603833	欧派家居	49,700	2,805,565.00	0.05
461	300529	健帆生物	128,870	2,779,725.90	0.04
462	002756	永兴材料	87,500	2,778,125.00	0.04
463	600754	锦江酒店	122,300	2,744,412.00	0.04
464	000998	隆平高科	275,400	2,712,690.00	0.04

465	300601	康泰生物	177,800	2,700,782.00	0.04
466	300751	迈为股份	38,000	2,643,280.00	0.04
467	300070	碧水源	587,100	2,641,950.00	0.04
468	601866	中远海发	1,065,500	2,631,785.00	0.04
469	002120	韵达股份	392,600	2,630,420.00	0.04
470	300438	鹏辉能源	94,300	2,603,623.00	0.04
471	600667	太极实业	394,183	2,593,724.14	0.04
472	600867	通化东宝	314,200	2,576,440.00	0.04
473	002544	普天科技	109,400	2,565,430.00	0.04
474	600258	首旅酒店	178,100	2,516,553.00	0.04
475	000032	深桑达 A	121,700	2,461,991.00	0.04
476	300573	兴齐眼药	46,940	2,431,022.60	0.04
477	002508	老板电器	126,200	2,399,062.00	0.04
478	000069	华侨城 A	1,065,600	2,397,600.00	0.04
479	002831	裕同科技	100,100	2,344,342.00	0.04
480	300118	东方日升	244,700	2,344,226.00	0.04
481	000967	盈峰环境	336,600	2,339,370.00	0.04
482	002292	奥飞娱乐	240,300	2,335,716.00	0.04
483	300457	赢合科技	106,100	2,226,100.00	0.04
484	600129	太极集团	104,400	2,224,764.00	0.04
485	002572	索菲亚	153,200	2,146,332.00	0.03
486	002266	浙富控股	695,800	2,143,064.00	0.03
487	601636	旗滨集团	426,700	2,137,767.00	0.03
488	603650	彤程新材	64,700	2,080,105.00	0.03
489	688063	派能科技	45,800	2,064,664.00	0.03
490	000035	中国天楹	471,000	2,020,590.00	0.03
491	300769	德方纳米	61,000	2,014,220.00	0.03
492	600864	哈投股份	335,500	2,002,935.00	0.03
493	688390	固德威	45,800	1,990,010.00	0.03
494	600315	上海家化	90,100	1,898,407.00	0.03
495	002091	江苏国泰	258,400	1,878,568.00	0.03
496	002372	伟星新材	172,400	1,786,064.00	0.03
497	001914	招商积余	114,700	1,418,839.00	0.02
498	600007	中国国贸	54,100	1,113,378.00	0.02
499	600335	国机汽车	162,500	1,048,125.00	0.02
500	301381	赛维时代	31,300	624,435.00	0.01

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。

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00

3	001391	国货航	4,686	31,536.78	0.00
4	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
5	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
6	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
7	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
8	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
9	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
10	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
11	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
12	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
13	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
14	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
15	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
16	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
17	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
18	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
19	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
20	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
21	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
22	603194	中力股份	191	8,669.49	0.00
23	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
24	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
25	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
26	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
27	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
28	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
29	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
30	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
31	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
32	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
33	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
34	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
35	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
36	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
37	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
38	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
39	603120	肯特催化	65	2,172.95	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。

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	300750	宁德时代	31,555,403.20	0.38
2	600519	贵州茅台	31,372,360.87	0.38
3	000333	美的集团	19,091,861.54	0.23
4	300059	东方财富	15,476,454.07	0.19
5	300760	迈瑞医疗	14,764,803.00	0.18
6	601166	兴业银行	14,745,796.00	0.18
7	002594	比亚迪	13,456,720.70	0.16
8	000651	格力电器	12,634,132.00	0.15
9	000858	五 粮 液	11,827,439.80	0.14
10	002230	科大讯飞	10,329,113.30	0.13
11	002475	立讯精密	9,885,631.00	0.12
12	300124	汇川技术	9,314,691.50	0.11
13	688608	恒玄科技	8,922,101.62	0.11
14	000725	京东方 A	8,869,842.00	0.11
15	300442	润泽科技	8,518,768.97	0.10
16	601328	交通银行	8,516,448.00	0.10
17	688213	思特威	7,467,209.79	0.09
18	300383	光环新网	7,411,499.00	0.09
19	002595	豪迈科技	7,381,909.00	0.09
20	688506	百利天恒	7,347,016.46	0.09

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。

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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	94,268,425.70	1.15
2	000333	美的集团	51,334,130.00	0.62
3	002594	比亚迪	44,071,840.54	0.54
4	300059	东方财富	41,992,275.35	0.51
5	000858	五 粮 液	34,953,946.85	0.42
6	000651	格力电器	30,666,943.66	0.37
7	300760	迈瑞医疗	28,091,054.60	0.34
8	300124	汇川技术	27,745,103.80	0.34
9	002475	立讯精密	27,579,852.50	0.34
10	000725	京东方 A	23,414,654.00	0.28
11	002415	海康威视	17,520,098.00	0.21
12	000063	中兴通讯	17,290,362.25	0.21
13	688256	寒武纪	16,793,083.48	0.20
14	002371	北方华创	16,571,365.00	0.20
15	000001	平安银行	16,469,762.00	0.20
16	688041	海光信息	16,305,297.33	0.20

17	300274	阳光电源	15,664,444.80	0.19
18	002352	顺丰控股	15,506,891.00	0.19
19	002714	牧原股份	14,911,426.00	0.18
20	000568	泸州老窖	14,520,064.86	0.18

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。

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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	1,102,077,609.81
卖出股票收入（成交）总额	1,983,817,569.23

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。

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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）	124,508.19	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,508.19	0.00

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	123257	安克转债	1,245	124,508.19	0.00

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

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

兴业银行股份有限公司因治理违规在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的公开处罚。

招商银行股份有限公司因隐瞒与保险合同有关的重要情况在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局辽宁监管局的公开处罚；因提供隐瞒重要事实的资料和员工行为管理不到位在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的公开处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未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 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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	8,808,586.31
2	应收清算款	257,032.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,065,619.22

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未存在流通受限情况。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定期流通受限
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期流通受限
3	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定期流通受限
4	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股锁定期流通受限

7.12.6 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。

§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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
16,751	385,172.64	5,585,781,390.00	86.57	866,245,548.00	13.43

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“招商银行股份有限公司-泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”持有的份额。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
招商银行股份有限公司-泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,258,219,940.00	66.00

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	泰康人寿保险有限责任公司－个人分红产品 A	438,266,236.00	6.79
2	中国国际金融股份有限公司	82,669,740.00	1.28
3	泰康人寿保险有限责任公司－分红－个人分红－019L－FH002 沪	61,051,556.00	0.95
4	平安养老保险股份有限公司－传统－普通保险产品	51,931,800.00	0.80
5	泰康资管－建设银行－泰康资产诚通金控 5 号资产管理产品	44,999,952.00	0.70
6	泰康人寿保险有限责任公司－分红－团体分红－019L－FH001 沪	31,285,906.00	0.48
7	郭健	30,600,000.00	0.47
8	新华人寿保险股份有限公司	27,807,093.00	0.43
9	中国太平洋人寿保险	25,071,440.00	0.39

	股份有限公司－分红－团体分红		
10	中汇人寿保险股份有限公司－泰康资产权益型组合	23,477,754.00	0.36
11	招商银行股份有限公司－泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,258,219,940.00	66.00

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 9 月 27 日）基金份额总额	2,000,026,938.00
本报告期期初基金份额总额	8,645,026,938.00
本报告期基金总申购份额	1,149,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,342,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,452,026,938.00

注：（1）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。

（2）本基金合同生效日为 2024 年 9 月 27 日，截止报告期末本基金未满一年。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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

本基金管理人于2025年5月30日发布公告，自2025年5月29日起，蒋利娟担任公司副总经理，代胜伟担任公司副总经理、财务负责人，金志刚不再兼任公司财务负责人，同时，由金志刚兼任公司首席信息官，朱伟不再担任公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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(%)	
浙商证券	2	1,661,885,769.52	53.89	309,074.80	53.89	-
长江证券	2	1,419,791,299.10	46.04	264,072.89	46.04	-

中信证券	3	2,150,400.00	0.07	428.21	0.07	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通证券	4	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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、本报告期内本基金新增租用 1 个交易单元，国盛证券北京证券交易所交易单元 1 个。

本报告期内本基金减少租用 2 个交易单元，东亚前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.7.2 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(%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,401,551.03	100.00	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一次分红公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 9 日
2	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（1）	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 18 日
3	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（2）	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 18 日
4	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第四季度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 21 日
5	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
6	泰康基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 29 日

	况	及基金管理人网站	
7	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第二次分红公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 10 日
8	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一季度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 21 日
9	泰康基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 5 月 30 日

§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	20250101-20250630	4,999,523,757.00	355,107,900.00	1,096,411,717.00	4,258,219,940.00	66.00
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

（二）《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（三）《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（四）《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（五）《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《上海证券报》）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8月28日