

泰康中证 A500 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2025 年年度报告

2025 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 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。毕马威华振会计师事务所（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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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的真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>67</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	67

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	67
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 .....	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	83
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 .....	83
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 .....	83
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 .....	84
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 .....	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.12 投资组合报告附注 .....	84
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>86</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
9.4 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 .....	87
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>88</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>89</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	89
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 .....	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	89
11.4 基金投资策略的改变 .....	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	89
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	90
11.8 其他重大事件 .....	93
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>96</b>
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 .....	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>97</b>
13.1 备查文件目录 .....	97
13.2 存放地点 .....	97
13.3 查阅方式 .....	97

## § 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	2,999,026,938.00 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

注：2026 年 3 月 16 日，基金管理人发布《关于泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金变更场内扩位简称的公告》，该基金的场内扩位简称由“中证 A500ETF”变更为“中证 A500ETF 泰康”。

### 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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，</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>

### 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 4 至 5 层 1-14 内 5 层 501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 B 座 5、6 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100031	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	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任	北京市西城区太平桥大街 17 号

---

	公司	
--	----	--

### § 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	2025 年	2024 年 9 月 27 日（基金合同生效日） - 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	325,380,967.34	-24,841,187.93
本期利润	1,032,173,596.93	-254,258,046.32
加权平均基金份额本期利润	0.1833	-0.0423
本期加权平均净值利润率	18.52%	-4.39%
本期基金份额净值增长率	25.18%	-4.82%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	211,093,010.56	-416,680,647.01
期末可供分配基金份额利润	0.0704	-0.0482
期末基金资产净值	3,504,943,918.59	8,228,346,290.99
期末基金份额净值	1.1687	0.9518
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末
基金份额累计净值增长率	19.15%	-4.82%

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

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	0.78%	1.06%	0.43%	1.05%	0.35%	0.01%

过去六个月	23.13%	1.00%	21.86%	1.00%	1.27%	0.00%
过去一年	25.18%	1.05%	22.43%	1.05%	2.75%	0.00%
自基金合同生效起至今	19.15%	1.13%	37.50%	1.35%	-	-0.22%

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

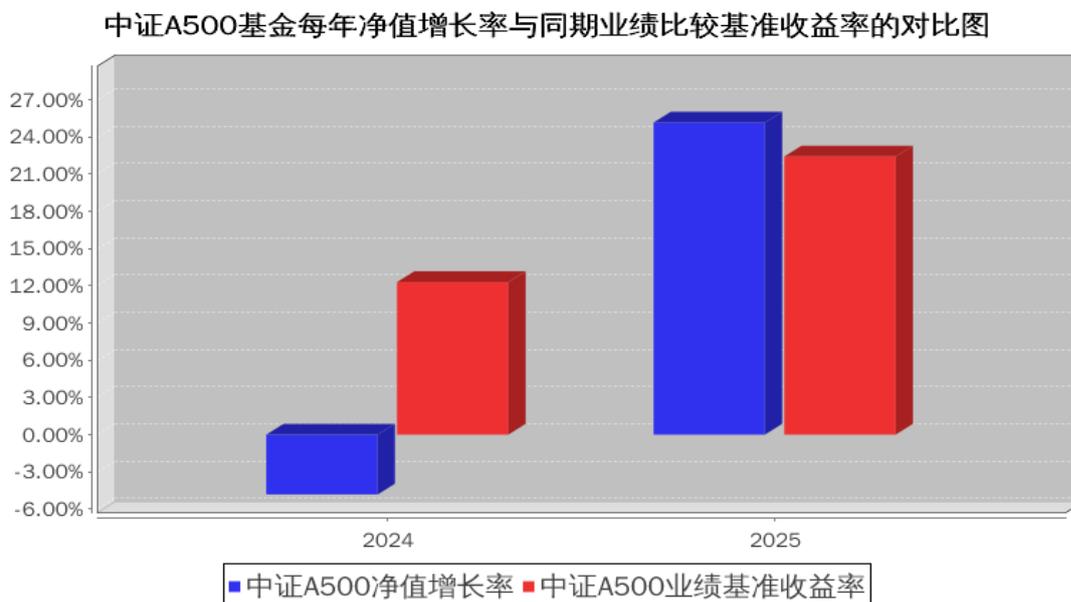
中证A500累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2024 年 09 月 27 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 自基金合同生效以来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



注：本基金成立于 2024 年 09 月 27 日，2024 年度净值增长率的计算期间为 2024 年 09 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.2090	91,825,565.37	-	91,825,565.37	-
2024 年	-	-	-	-	-
合计	0.2090	91,825,565.37	-	91,825,565.37	-

## § 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12月31日，泰康基金共管理90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	-	18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

					<p>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。2026 年 1 月 27 日至今担任泰康中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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，2025 年为经济新旧动能转换的关键之年：传统经济内生增长动力持续承压，政策端积极推出消费品以旧换新等举措发力托底；外贸出口竞争力进一步得到证实并持续强化，以 AI 为代表的新经济领域也取得实质性积极进展。政策层面，全年加大了财政逆周期调节力度，“反内卷”相关举措的提出与渐进落地，也在逐步缓解物价低迷的态势。

权益市场方面，2025 年 A 股权益市场整体表现强劲，主要指数全线收涨，市场交投活跃。从大盘指数来看，创业板指以 49.57%的年度涨幅领跑，深证成指上涨 29.87%，上证指数全年上涨 18.41%，沪深 300 指数上涨 17.66%，恒生综合指数与恒生科技指数分别上涨 30.98%和 23.45%，展现强劲的全球资产吸引力。行业表现方面，有色金属与通信行业表现尤为突出，全年涨幅分别高达 94.73%和 84.75%，成为市场核心驱动力；电子、电力设备与综合行业亦表现优异，涨幅均超

40%。食品饮料与煤炭行业全年分别下跌 9.69%和 5.27%，房地产、美容护理等板块表现疲软。

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，跟踪指数整体上涨。管理人将继续紧跟市场，控制跟踪误差，通过精细化投资管理，参与大宗交易、可转债投资、股票打新等，力求为投资者带来更好的投资体验。

#### 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 1.1687 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.18%；同期业绩比较基准增长率为 22.43%。

#### 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 2026 年，宏观经济的核心主线或将聚焦名义 GDP 增速的逐步回升。从增长动能来看，传统经济动能偏弱的格局料将延续，经济增长仍需依托外需韧性与财政政策的持续拉动。物价层面，全球制造业周期回暖、美元走弱催生的实物资产配置需求，叠加“反内卷”举措的渐进落地，多重因素有望推动物价增速逐步企稳和弱回升。综合内生增长动力的修复节奏来看，当前担忧出现显著通胀或滞胀风险，尚为时过早。当前市场政策支持力度较大，流动性宽松，中期来看，市场走势仍将取决于经济复苏力度。中证 A500 作为集聚各细分行业龙头公司的主要指数，业绩确定性更高，或在 9 月份更加受益。且由于龙头公司在经济修复过程中往往有望率先受益，未来或将实现更快的业绩修复，建议重点关注。

#### 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、专户业务部）、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**

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 91,825,565.37 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

#### **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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、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 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	毕马威华振审字第 2606577 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	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求,我们独立于该基金,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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>该基金管理人泰康基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大</p>

	<p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价该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。</p> <p>(4) 对该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，就可能导致对该基金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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。</p> <p>我们与该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。</p>

会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	左艳霞	陈曦
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2026年3月26日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	18,773,212.74	33,562,373.40
结算备付金		15,568,293.37	49,386,585.37
存出保证金		4,858,573.00	11,478,016.86
交易性金融资产	7.4.7.2	3,470,819,177.38	8,148,836,332.35
其中：股票投资		3,470,819,177.38	8,148,836,332.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		-	548,579.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		3,510,019,256.49	8,243,811,887.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,196,347.50	2,357,487.15
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		443,071.39	1,070,729.27
应付托管费		147,690.47	356,909.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,873.18	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	3,278,355.36	11,680,470.38
负债合计		5,075,337.90	15,465,596.53
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,999,026,938.00	8,645,026,938.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	505,916,980.59	-416,680,647.01
净资产合计		3,504,943,918.59	8,228,346,290.99
负债和净资产总计		3,510,019,256.49	8,243,811,887.52

注：（1）报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1687 元，基金份额总额 2,999,026,938.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 9 月 27 日（基 金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		1,043,671,028.97	-251,320,814.96
1. 利息收入		494,312.23	707,266.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	494,312.23	707,266.16
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）		332,008,247.31	-28,156,305.32
其中：股票投资收益	7.4.7.14	191,164,448.29	-36,926,763.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	661,402.00	-

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	10,107,219.59	-5,245,529.76
股利收益	7.4.7.19	130,075,177.43	14,015,988.35
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	706,792,629.59	-229,416,858.39
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	4,375,839.84	5,545,082.59
<b>减：二、营业总支出</b>		11,497,432.04	2,937,231.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,427,633.52	2,161,794.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,809,211.20	720,598.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		36,440.90	-
8. 其他费用	7.4.7.23	224,146.42	54,839.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,032,173,596.93	-254,258,046.32
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,032,173,596.93	-254,258,046.32
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,032,173,596.93	-254,258,046.32

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 27 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2024 年 9 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日止期间。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	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	8,645,026,938.00	-	416,680,647.01	8,228,346,290.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
	5,646,000,000.00	-	922,597,627.60	4,723,402,372.40
(一)、综合收益总额	-	-	1,032,173,596.93	1,032,173,596.93
(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)	-	-	-	-
	5,646,000,000.00	-	-17,750,403.96	5,663,750,403.96
其中：1. 基金申购款	1,479,000,000.00	-	-43,945,887.29	1,435,054,112.71
2. 基金赎回款	-	-	-	-
	7,125,000,000.00	-	26,195,483.33	7,098,804,516.67
(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)	-	-	-91,825,565.37	-91,825,565.37
(四)、其他综合	-	-	-	-

收益结转留存收益				
四、本期期末净资产	2,999,026,938.00	-	505,916,980.59	3,504,943,918.59
项目	上年度可比期间			
	2024年9月27日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,000,026,938.00	-	-	2,000,026,938.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,645,000,000.00	-	416,680,647.01	6,228,319,352.99
(一)、综合收益总额	-	-	254,258,046.32	-254,258,046.32
(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)	6,645,000,000.00	-	162,422,600.69	6,482,577,399.31
其中: 1. 基金申购款	8,241,000,000.00	-	226,571,458.05	8,014,428,541.95
2. 基金赎回款	1,596,000,000.00	-	64,148,857.36	1,531,851,142.64
(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	8,645,026,938.00	-	416,680,647.01	8,228,346,290.99

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 27 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2024 年 9 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日止期间。

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。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康基金于 2026 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 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,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时, 于资产负债表内确认。

在初始确认时, 金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债, 相关交易费用直接计入当期损益; 对于其他类别的金融资产或金融负债, 相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后, 对于该类金融资产以公允价值进行后续计量, 产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益, 除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后, 对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失, 在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时, 计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债以公允价值进行后续计量, 除与套期会计有关外, 产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后, 对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时, 本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- 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;
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资

产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金管理人有权根据实际情况决定是否进行收益分配，但如满足以下条件，本基金每个自然季度至少进行一次收益分配：每季度最后一个交易日对基金相对标的指数的超额收益率进行评价，计算基金份额净值增长率、标的指数同期增长率和超额收益率；当超额收益率大于 0 时，本基金将进行收益分配，否则不进行收益分配；收益分配比例不低于超额收益率的 60%；基金管理人将在次季度起的 15 个工作日内拟定收益分配方案。其中，基金份额净值增长率、标的指数同期增长率和超额收益率按照以下方式确定 (1) 基金份额净值增长率=(收益评价日的基金份额净值-基金上市前一个交易日的基金份额净值)/基金上市前一个交易日的基金份额净值\*100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算) (2) 标的指数同期增长率=(收益评价日的标的指数收盘值-基金上市前一个交易日的标的指数收盘值)/基金上市前一个交易日的标的指数收盘值\*100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算) (3) 超额收益率=基金份额净值增长率-标的指数同期增长率。《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；除基金合同另有约定的情况外本基金收益分配采取现金分红方式；每一基金份额享有同等分配权；基于本基金的性质和特点本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发 [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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值

日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对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。

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。

#### 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	18,773,212.74	33,562,373.40
等于：本金	18,771,210.08	33,558,382.73
加：应计利息	2,002.66	3,990.67
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	18,773,212.74	33,562,373.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,994,342,486.18	-	3,470,819,177.38	476,476,691.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,994,342,486.18	-	3,470,819,177.38	476,476,691.20
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,377,838,770.74	-	8,148,836,332.35	229,002,438.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,377,838,770.74	-	8,148,836,332.35	-

				229,002,438.39
--	--	--	--	----------------

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。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	34,177,920.00	-	-	-
其中：股指期货投资	34,177,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	34,177,920.00	-	-	-
项目	上年度末 2024年12月31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	81,295,740.00	-	-	-
其中：股指期货投资	81,295,740.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	81,295,740.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 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/	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		卖)		
IC2603	IC2603	5.00	7,366,600.00	414,160.00
IF2601	IF2601	20.00	27,710,400.00	484,920.00
合计				899,080.00
减:可抵销期货 暂收款				899,080.00
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。

#### 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

无。

##### 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	173,842.32	1,495,916.33
其中：交易所市场	173,842.32	1,495,916.33
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	82,000.00	47,662.30
应退替代款	2,921,620.54	10,125,404.01
可退替代款	100,892.50	11,487.74
合计	3,278,355.36	11,680,470.38

##### 7.4.7.10 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12月31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	1,479,000,000.00	1,479,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,125,000,000.00	-7,125,000,000.00
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	2,999,026,938.00	2,999,026,938.00

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

##### 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

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	325,380,967.34	706,792,629.59	1,032,173,596.93
本期基金份额交易产生的变动数	24,064,781.01	-41,815,184.97	-17,750,403.96
其中：基金申购款	3,733,338.11	-47,679,225.40	-43,945,887.29
基金赎回款	20,331,442.90	5,864,040.43	26,195,483.33
本期已分配利润	-91,825,565.37	-	-91,825,565.37
本期末	211,093,010.56	294,823,970.03	505,916,980.59

## 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	88,071.66	259,381.23
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	401,610.72	444,693.97
其他	4,629.85	3,190.96
合计	494,312.23	707,266.16

## 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	130,823,302.88	-20,040,088.97
股票投资收益——赎回差价收入	60,341,145.41	-16,886,674.94
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	191,164,448.29	-36,926,763.91

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合 同生效日）至2024年12月31 日
卖出股票成交总 额	4,452,142,177.73	1,572,589,996.20
减：卖出股票成本 总额	4,317,509,983.92	1,589,831,781.03
减：交易费用	3,808,890.93	2,798,304.14
买卖股票差价收 入	130,823,302.88	-20,040,088.97

7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合 同生效日）至2024年12月 31日
赎回基金份额对价总 额	7,098,804,516.67	1,531,851,142.64
减：现金支付赎回款 总额	3,290,180,016.67	697,701,777.64
减：赎回股票成本总 额	3,748,283,354.59	851,036,039.94
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	60,341,145.41	-16,886,674.94

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	194.13	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	661,207.87	-
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	661,402.00	-

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,041,629.57	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,380,100.00	-
减：应计利息总额	199.96	-
减：交易费用	121.74	-
买卖债券差价收入	661,207.87	-

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股指期货投资收益	10,107,219.59	-5,245,529.76

### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	130,075,177.43	14,015,988.35
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	130,075,177.43	14,015,988.35

### 7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1. 交易性金融资产	705,479,129.59	-229,002,438.39

股票投资	705,479,129.59	-229,002,438.39
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	1,313,500.00	-414,420.00
权证投资	-	-
期货投资	1,313,500.00	-414,420.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	706,792,629.59	-229,416,858.39

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	4,375,839.84	5,287,484.25
其他	-	257,598.34
合计	4,375,839.84	5,545,082.59

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。

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	62,000.00	43,400.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	22,146.42	6,776.84
其他	20,000.00	4,662.30
合计	224,146.42	54,839.14

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2026 年 1 月 15 日公告进行 2026 年度第一次分红，权益登记日为 2026 年 1 月 19 日，除息日为 2026 年 1 月 20 日，现金红利发放日为 2026 年 1 月 23 日。本基金每 10 份基金份额分红数为人民币 0.0330 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。

#### 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、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

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 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金 合同生效日）至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,427,633.52	2,161,794.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	437,408.08	140,350.36
应支付基金管理人的净管理费	7,990,225.44	2,021,443.85

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年9月27日（基金 合同生效日）至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,809,211.20	720,598.01

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31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	1,419,072,197.00	47.3178	4,999,523,757.00	57.8312

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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）至 2024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
招商银行	18,773,212.74	88,071.66	33,562,373.40	259,381.23

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

本报告期末，本基金持有 1,495,600 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 58,839,728.78 元，估值总额为人民币 62,964,760.00 元，占基金资产净值的比例为 1.80%（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%)。

### 7.4.11 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 1 月 13 日	2025 年 1 月 14 日	-	0.0060	5,386,819.27	-	5,386,819.27	-
2	2025 年 4 月 14 日	2025 年 4 月 15 日	-	0.0080	5,987,220.90	-	5,987,220.90	-
3	2025 年 7 月 14 日	2025 年 7 月 15 日	-	0.0700	40,901,188.00	-	40,901,188.00	-
4	2025 年 10 月 27 日	2025 年 10 月 28 日	-	0.1250	39,550,337.20	-	39,550,337.20	-
合计	-	-	-	0.2090	91,825,565.37	-	91,825,565.37	-

### 7.4.12 期末 (2025 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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股锁定期流	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-

				通受限						
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股锁定期流通受限	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铝业	2025年11月25日	6个月	新股锁定期流通受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股锁定期流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣材料	2025年12月23日	6个月	新股锁定期流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定期	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-

				流通受限						
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股锁定期流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
300308	中际旭创	2025年12月8日	6个月	大宗锁定期流通受限	547.20	537.62	90,000	49,248,000.00	48,385,800.00	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定期流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定期流通受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-

		日		期 流 通 受 限						
301575	艾芬达	2025 年9 月3 日	6个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025 年9 月18 日	6个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025 年7 月16 日	6个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301638	南网数字	2025 年11 月11 日	6个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动	2025 年9 月	6个 月	新 股 锁	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-

	力	17日		定期 流通 受限						
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股 锁定 定期 流通 受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股 锁定 定期 流通 受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股 锁定 定期 流通 受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股 锁定 定期 流通 受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力	2025年	6个月	新股	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-

	佳	10月30日		锁定期流通受限						
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股锁定期流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股锁定期流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股锁定期流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股锁定期流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华	2025	6个月	新	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-

	新精科	年8月27日	月	股锁定期流通受限						
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股锁定期流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股锁定期流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股锁定期流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股锁定期流通受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-

688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股锁定期流通受限	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股锁定期流通受限	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-
688765	禾元生物	2025年10月16日	6个月	新股锁定期流通受限	29.06	52.62	3,529	102,552.74	185,695.98	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月	新股锁定期流通受限	8.62	18.36	14,790	127,489.80	271,544.40	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月	新股锁定期流通受限	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-

688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月	限 新 股 锁 定 期 流 通 受 限	114.28	416.18	2,321	265,243.88	965,953.78	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	6个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	104.66	399.31	814	85,193.24	325,038.34	-
688805	健信超导	2025年12月17日	6个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新 股 锁 定 期 流 通	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-

				受 限						
--	--	--	--	--------	--	--	--	--	--	--

注：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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年1月5日	278.00	52,900	10,890,382.31	14,426,888.00	-
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项停牌	78.81	2026年1月15日	86.69	82,400	5,744,879.53	6,493,944.00	-

#### 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

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份券、备选成份券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。

#### 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。

**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 2025年12月31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。

**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 2025年12月31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。

**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 2025年12月31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。

**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	上年度末
--------	-----	------

	2025 年 12 月 31 日	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。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	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	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。

#### 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	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	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。

#### 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 2025 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同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 2025 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 2025 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、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 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	18,773,212.74	-	-	-	18,773,212.74
结算备付金	15,568,293.37	-	-	-	15,568,293.37
存出保证金	4,858,573.00	-	-	-	4,858,573.00
交易性金融资产	-	-	-	3,470,819,177.38	3,470,819,177.38
<b>资产总计</b>	<b>39,200,079.11</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,470,819,177.38</b>	<b>3,510,019,256.49</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	443,071.39	443,071.39
应付托管费	-	-	-	147,690.47	147,690.47
应付清算款	-	-	-	1,196,347.50	1,196,347.50
应交税费	-	-	-	9,873.18	9,873.18
其他负债	-	-	-	3,278,355.36	3,278,355.36
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,075,337.90</b>	<b>5,075,337.90</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>39,200,079.11</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,465,743,839.48</b>	<b>3,504,943,918.59</b>
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
<b>资产</b>					
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。

#### 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12月31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	

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。

#### 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 2025年12月31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	3,470,819,177.38	99.03	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	3,470,819,177.38	99.03	8,148,836,332.35	99.03

#### 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨5%	202,038,135.89	-
业绩比较基准中的权益指数下跌5%	-202,038,135.89	-	

注：于2024年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 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。

**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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	3,398,959,249.01	8,136,437,353.63
第二层次	20,920,832.00	12,256,250.50
第三层次	50,939,096.37	142,728.22
合计	3,470,819,177.38	8,148,836,332.35

**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。

**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 2025年1月1日至2025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	-	142,728.22	142,728.22
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,191,608.22	1,191,608.22
转出第三层次	-	768,022.20	768,022.20
当期利得或损失总额	-	50,372,782.13	50,372,782.13
其中：计入损益的利得或	-	50,372,782.13	50,372,782.13

损失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	50,939,096.37	50,939,096.37
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	-	707,777.97	707,777.97
项目	上年度可比期间 2024年9月27日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	66,912.52	66,912.52
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	75,815.70	75,815.70
其中：计入损益的利得或损失	-	75,815.70	75,815.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	142,728.22	142,728.22
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	-	75,815.70	75,815.70

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	50,939,096.37	亚式期权模型	预期年化波动率	0.1800-3.0791	负相关关系

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	142,728.22	亚式期权模型	预期年化波动率	1.4783-4.9648	负相关关系

**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。

**7.4.15 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 1,435,054,112.71 元(上年度可比期间：8,014,428,541.95 元)，其中包括以股票支付的申购款 760,693,050.04 元和以现金支付的申购款 674,361,062.67 元(上年度可比期间：其中包括以股票支付的申购款 4,323,495,863.60 元和以现金支付的申购款 3,690,932,678.35 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。

## § 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	3,470,819,177.38	98.88
	其中：股票	3,470,819,177.38	98.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	34,341,506.11	0.98
8	其他各项资产	4,858,573.00	0.14
9	合计	3,510,019,256.49	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。

### 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	18,047,862.00	0.51
B	采矿业	201,955,105.02	5.76
C	制造业	2,172,703,704.64	61.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,996,438.00	2.40
E	建筑业	51,653,201.51	1.47
F	批发和零售业	21,847,441.20	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	95,882,623.00	2.74
H	住宿和餐饮业	2,726,384.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务	209,194,080.60	5.97

	业		
J	金融业	474,672,068.80	13.54
K	房地产业	29,083,645.00	0.83
L	租赁和商务服务业	38,842,126.60	1.11
M	科学研究和技术服务业	38,573,720.64	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	7,231,362.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,623,724.00	0.05
Q	卫生和社会工作	9,683,178.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	6,478,171.00	0.18
S	综合	4,071,045.00	0.12
	合计	3,468,265,881.01	98.95

**8.2.2 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	103,284.72	0.00
C	制造业	2,344,943.81	0.07
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	26,694.44	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,753.98	0.00
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	27,619.42	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	2,553,296.37	0.07

### 8.2.3 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。

### 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

#### 8.3.1 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	300750	宁德时代	320,080	117,552,580.80	3.35
2	600519	贵州茅台	75,597	104,110,676.46	2.97
3	601318	中国平安	1,288,300	88,119,720.00	2.51
4	300308	中际旭创	145,500	82,240,800.00	2.35
5	601899	紫金矿业	1,991,028	68,630,735.16	1.96
6	600036	招商银行	1,495,600	62,964,760.00	1.80
7	300502	新易盛	120,294	51,832,278.72	1.48
8	000333	美的集团	595,900	46,569,585.00	1.33
9	601166	兴业银行	2,046,400	43,097,184.00	1.23
10	600900	长江电力	1,478,300	40,194,977.00	1.15
11	300059	东方财富	1,528,800	35,437,584.00	1.01
12	002475	立讯精密	616,700	34,973,057.00	1.00
13	688256	寒武纪	25,600	34,702,080.00	0.99
14	600030	中信证券	1,179,480	33,862,870.80	0.97
15	600276	恒瑞医药	539,620	32,145,163.40	0.92
16	002594	比亚迪	328,900	32,140,108.00	0.92
17	601398	工商银行	3,909,800	31,004,714.00	0.88
18	300274	阳光电源	175,200	29,966,208.00	0.85
19	688981	中芯国际	241,800	29,700,294.00	0.85
20	601211	国泰海通	1,364,600	28,042,530.00	0.80
21	603259	药明康德	299,000	27,101,360.00	0.77
22	601288	农业银行	3,474,400	26,683,392.00	0.76
23	688041	海光信息	112,800	25,313,448.00	0.72
24	000858	五粮液	234,800	24,874,712.00	0.71
25	002371	北方华创	52,215	23,970,862.20	0.68
26	601328	交通银行	3,225,300	23,383,425.00	0.67
27	600887	伊利股份	764,459	21,863,527.40	0.62

28	000651	格力电器	541,900	21,795,218.00	0.62
29	300476	胜宏科技	73,700	21,194,646.00	0.60
30	603993	洛阳钼业	1,055,200	21,104,000.00	0.60
31	600000	浦发银行	1,608,900	20,014,716.00	0.57
32	000725	京东方 A	4,438,600	18,686,506.00	0.53
33	601816	京沪高铁	3,545,000	18,256,750.00	0.52
34	600150	中国船舶	545,231	18,134,383.06	0.52
35	600309	万华化学	227,200	17,421,696.00	0.50
36	601601	中国太保	414,000	17,350,740.00	0.50
37	603986	兆易创新	80,640	17,277,120.00	0.49
38	300124	汇川技术	228,500	17,212,905.00	0.49
39	002714	牧原股份	330,300	16,706,574.00	0.48
40	688008	澜起科技	139,000	16,374,200.00	0.47
41	601088	中国神华	398,300	16,131,150.00	0.46
42	600031	三一重工	717,600	15,162,888.00	0.43
43	603019	中科曙光	176,900	15,149,716.00	0.43
44	002050	三花智控	270,700	14,972,417.00	0.43
45	000063	中兴通讯	389,600	14,742,464.00	0.42
46	688012	中微公司	52,900	14,426,888.00	0.41
47	601857	中国石油	1,370,900	14,271,069.00	0.41
48	600111	北方稀土	305,900	14,108,108.00	0.40
49	002230	科大讯飞	279,500	14,056,055.00	0.40
50	300760	迈瑞医疗	73,282	13,956,556.90	0.40
51	600089	特变电工	610,400	13,563,088.00	0.39
52	000001	平安银行	1,173,200	13,386,212.00	0.38
53	601012	隆基绿能	732,100	13,324,220.00	0.38
54	002415	海康威视	442,700	13,210,168.00	0.38
55	000425	徐工机械	1,136,900	13,165,302.00	0.38
56	002384	东山精密	155,200	13,137,680.00	0.37
57	603501	豪威集团	102,400	12,892,160.00	0.37
58	601668	中国建筑	2,496,200	12,805,506.00	0.37
59	600660	福耀玻璃	193,600	12,539,472.00	0.36
60	603799	华友钴业	183,500	12,525,710.00	0.36
61	601127	赛力斯	98,800	11,950,848.00	0.34
62	002463	沪电股份	162,600	11,881,182.00	0.34
63	600690	海尔智家	453,500	11,831,815.00	0.34
64	601728	中国电信	1,876,100	11,819,430.00	0.34
65	601600	中国铝业	959,300	11,722,646.00	0.33
66	002028	思源电气	75,220	11,628,259.80	0.33
67	601919	中远海控	760,800	11,548,944.00	0.33
68	000100	TCL 科技	2,516,200	11,423,548.00	0.33
69	300394	天孚通信	56,180	11,406,225.40	0.33
70	000338	潍柴动力	654,400	11,255,680.00	0.32

71	601888	中国中免	117,900	11,148,624.00	0.32
72	002352	顺丰控股	289,700	11,101,304.00	0.32
73	600941	中国移动	109,300	11,044,765.00	0.32
74	600406	国电南瑞	486,030	10,925,954.40	0.31
75	600028	中国石化	1,761,540	10,886,317.20	0.31
76	000792	盐湖股份	384,600	10,830,336.00	0.31
77	600183	生益科技	146,958	10,494,270.78	0.30
78	600418	江淮汽车	211,000	10,444,500.00	0.30
79	000568	泸州老窖	89,000	10,343,580.00	0.30
80	601766	中国中车	1,469,340	10,020,898.80	0.29
81	601225	陕西煤业	468,200	9,982,024.00	0.28
82	601988	中国银行	1,732,900	9,929,517.00	0.28
83	300014	亿纬锂能	150,500	9,896,880.00	0.28
84	600050	中国联通	1,892,100	9,668,631.00	0.28
85	000988	华工科技	121,600	9,646,528.00	0.28
86	601628	中国人寿	201,300	9,159,150.00	0.26
87	002027	分众传媒	1,225,500	9,031,935.00	0.26
88	002625	光启技术	182,500	8,898,700.00	0.25
89	600938	中国海油	288,500	8,706,930.00	0.25
90	002241	歌尔股份	300,700	8,639,111.00	0.25
91	688111	金山办公	28,100	8,628,667.00	0.25
92	601985	中国核电	994,700	8,604,155.00	0.25
93	002460	赣锋锂业	136,600	8,590,774.00	0.25
94	600547	山东黄金	218,856	8,471,915.76	0.24
95	600104	上汽集团	554,500	8,439,490.00	0.24
96	300033	同花顺	26,100	8,408,898.00	0.24
97	000977	浪潮信息	124,200	8,271,720.00	0.24
98	000807	云铝股份	251,600	8,262,544.00	0.24
99	600489	中金黄金	351,200	8,204,032.00	0.23
100	601689	拓普集团	105,050	8,107,759.00	0.23
101	000408	藏格矿业	94,900	8,009,560.00	0.23
102	002709	天赐材料	171,600	7,950,228.00	0.23
103	600019	宝钢股份	1,052,500	7,841,125.00	0.22
104	688271	联影医疗	60,000	7,530,000.00	0.21
105	601006	大秦铁路	1,458,600	7,526,376.00	0.21
106	002837	英维克	70,400	7,525,056.00	0.21
107	002916	深南电路	32,330	7,509,935.70	0.21
108	603288	海天味业	202,100	7,481,742.00	0.21
109	300408	三环集团	162,400	7,429,800.00	0.21
110	300433	蓝思科技	240,900	7,292,043.00	0.21
111	601658	邮储银行	1,331,500	7,256,675.00	0.21
112	300136	信维通信	116,800	7,241,600.00	0.21
113	000625	长安汽车	599,900	7,114,814.00	0.20

114	601100	恒立液压	64,600	7,100,186.00	0.20
115	002558	巨人网络	163,500	7,077,915.00	0.20
116	600905	三峡能源	1,728,600	7,069,974.00	0.20
117	002466	天齐锂业	124,900	6,916,962.00	0.20
118	600362	江西铜业	125,300	6,881,476.00	0.20
119	002738	中矿资源	87,000	6,833,850.00	0.19
120	600879	航天电子	318,200	6,784,024.00	0.19
121	600118	中国卫星	71,200	6,760,440.00	0.19
122	605499	东鹏饮料	25,220	6,743,575.80	0.19
123	688072	拓荆科技	20,400	6,732,000.00	0.19
124	600438	通威股份	327,200	6,714,144.00	0.19
125	601390	中国中铁	1,239,200	6,704,072.00	0.19
126	300450	先导智能	132,500	6,622,350.00	0.19
127	601727	上海电气	762,200	6,562,542.00	0.19
128	600010	包钢股份	2,743,300	6,529,054.00	0.19
129	600580	卧龙电驱	132,500	6,505,750.00	0.19
130	002049	紫光国微	82,400	6,493,944.00	0.19
131	600893	航发动力	160,600	6,428,818.00	0.18
132	600584	长电科技	173,100	6,366,618.00	0.18
133	600585	海螺水泥	290,200	6,343,772.00	0.18
134	600988	赤峰黄金	200,900	6,276,116.00	0.18
135	600160	巨化股份	162,500	6,243,250.00	0.18
136	300015	爱尔眼科	562,800	6,179,544.00	0.18
137	600436	片仔癀	36,600	6,177,348.00	0.18
138	600115	中国东航	1,029,400	6,176,400.00	0.18
139	688521	芯原股份	44,800	6,136,256.00	0.18
140	000538	云南白药	107,600	6,107,376.00	0.17
141	000426	兴业银锡	171,500	6,105,400.00	0.17
142	002202	金风科技	293,100	5,979,240.00	0.17
143	600522	中天科技	329,400	5,968,728.00	0.17
144	000938	紫光股份	242,600	5,967,960.00	0.17
145	600487	亨通光电	239,100	5,912,943.00	0.17
146	000630	铜陵有色	973,600	5,851,336.00	0.17
147	600346	恒力石化	255,600	5,758,668.00	0.16
148	600760	中航沈飞	102,500	5,755,375.00	0.16
149	300803	指南针	43,500	5,692,845.00	0.16
150	600426	华鲁恒升	179,200	5,632,256.00	0.16
151	601168	西部矿业	202,000	5,583,280.00	0.16
152	600570	恒生电子	183,500	5,532,525.00	0.16
153	002156	通富微电	146,600	5,526,820.00	0.16
154	600549	厦门钨业	134,300	5,514,358.00	0.16
155	002532	天山铝业	337,000	5,452,660.00	0.16
156	002179	中航光电	153,718	5,447,765.92	0.16

157	601669	中国电建	1,042,700	5,422,040.00	0.15
158	300604	长川科技	53,500	5,420,085.00	0.15
159	600795	国电电力	1,074,700	5,416,488.00	0.15
160	600415	小商品城	332,000	5,295,400.00	0.15
161	600048	保利发展	867,600	5,292,360.00	0.15
162	002353	杰瑞股份	74,300	5,262,669.00	0.15
163	600066	宇通客车	160,600	5,251,620.00	0.15
164	600029	南方航空	653,500	5,234,535.00	0.15
165	000933	神火股份	190,300	5,227,541.00	0.15
166	600989	宝丰能源	266,000	5,221,580.00	0.15
167	300442	润泽科技	98,800	5,216,640.00	0.15
168	000157	中联重科	601,300	5,189,219.00	0.15
169	002340	格林美	619,500	5,179,020.00	0.15
170	600096	云天化	154,100	5,148,481.00	0.15
171	601058	赛轮轮胎	317,500	5,137,150.00	0.15
172	002074	国轩高科	130,900	5,119,499.00	0.15
173	000547	航天发展	154,200	5,090,142.00	0.15
174	300395	菲利华	50,400	5,055,120.00	0.14
175	688126	沪硅产业	231,400	5,007,496.00	0.14
176	300058	蓝色光标	432,880	4,986,777.60	0.14
177	600143	金发科技	254,800	4,978,792.00	0.14
178	600176	中国巨石	290,700	4,970,970.00	0.14
179	600009	上海机场	150,300	4,923,828.00	0.14
180	000975	山金国际	201,100	4,892,763.00	0.14
181	002407	多氟多	144,000	4,883,040.00	0.14
182	002195	岩山科技	686,100	4,864,449.00	0.14
183	002851	麦格米特	52,900	4,764,703.00	0.14
184	300339	润和软件	96,200	4,761,900.00	0.14
185	601360	三六零	421,500	4,708,155.00	0.13
186	300207	欣旺达	178,700	4,673,005.00	0.13
187	002001	新和成	185,300	4,667,707.00	0.13
188	688036	传音控股	69,800	4,617,968.00	0.13
189	002131	利欧股份	815,500	4,599,420.00	0.13
190	600885	宏发股份	149,900	4,556,960.00	0.13
191	600219	南山铝业	841,300	4,526,194.00	0.13
192	002517	恺英网络	206,600	4,518,342.00	0.13
193	688120	华海清科	30,100	4,517,408.00	0.13
194	002236	大华股份	238,000	4,507,720.00	0.13
195	688002	睿创微纳	44,500	4,485,600.00	0.13
196	300418	昆仑万维	106,700	4,449,390.00	0.13
197	002555	三七互娱	187,600	4,427,360.00	0.13
198	300223	北京君正	41,100	4,358,244.00	0.12
199	002436	兴森科技	205,500	4,350,435.00	0.12

200	002920	德赛西威	36,100	4,342,830.00	0.12
201	002456	欧菲光	405,400	4,305,348.00	0.12
202	601186	中国铁建	557,300	4,274,491.00	0.12
203	000768	中航西飞	168,400	4,273,992.00	0.12
204	002938	鹏鼎控股	84,400	4,268,952.00	0.12
205	601111	中国国航	453,000	4,244,610.00	0.12
206	002493	荣盛石化	362,200	4,241,362.00	0.12
207	002273	水晶光电	168,400	4,230,208.00	0.12
208	000831	中国稀土	90,200	4,188,888.00	0.12
209	000963	华东医药	106,000	4,181,700.00	0.12
210	300751	迈为股份	20,300	4,181,597.00	0.12
211	600157	永泰能源	2,642,200	4,148,254.00	0.12
212	600895	张江高科	93,800	4,117,820.00	0.12
213	688122	西部超导	55,200	4,116,816.00	0.12
214	002008	大族激光	99,600	4,102,524.00	0.12
215	002281	光迅科技	58,600	4,099,070.00	0.12
216	002595	豪迈科技	48,500	4,098,735.00	0.12
217	600673	东阳光	181,500	4,071,045.00	0.12
218	600839	四川长虹	446,700	4,064,970.00	0.12
219	600196	复星医药	153,400	4,063,566.00	0.12
220	002252	上海莱士	640,100	4,058,234.00	0.12
221	600460	士兰微	141,400	4,017,174.00	0.11
222	002812	恩捷股份	70,900	4,015,776.00	0.11
223	002130	沃尔核材	151,700	3,992,744.00	0.11
224	002422	科伦药业	135,400	3,973,990.00	0.11
225	600011	华能国际	532,600	3,973,196.00	0.11
226	002601	龙佰集团	201,500	3,945,370.00	0.11
227	600372	中航机载	293,600	3,940,112.00	0.11
228	600745	闻泰科技	104,900	3,910,672.00	0.11
229	002472	双环传动	82,000	3,887,620.00	0.11
230	688169	石头科技	25,300	3,847,118.00	0.11
231	000002	万科 A	827,100	3,846,015.00	0.11
232	300390	天华新能	70,100	3,828,161.00	0.11
233	600886	国投电力	291,400	3,823,168.00	0.11
234	605117	德业股份	44,200	3,810,040.00	0.11
235	301236	软通动力	80,300	3,808,629.00	0.11
236	600741	华域汽车	190,200	3,804,000.00	0.11
237	688777	中控技术	77,000	3,799,180.00	0.11
238	002128	电投能源	136,000	3,795,760.00	0.11
239	688235	百济神州	14,100	3,787,260.00	0.11
240	002465	海格通信	239,500	3,772,125.00	0.11
241	001979	招商蛇口	434,700	3,755,808.00	0.11
242	300782	卓胜微	45,600	3,715,488.00	0.11

243	600699	均胜电子	117,800	3,694,208.00	0.11
244	601868	中国能建	1,563,000	3,673,050.00	0.10
245	600515	海南机场	687,900	3,666,507.00	0.10
246	000661	长春高新	39,600	3,664,980.00	0.10
247	600392	盛和资源	169,000	3,638,570.00	0.10
248	601877	正泰电器	130,000	3,625,700.00	0.10
249	603129	春风动力	13,000	3,622,840.00	0.10
250	002648	卫星化学	204,700	3,619,096.00	0.10
251	300346	南大光电	83,660	3,589,014.00	0.10
252	003816	中国广核	953,400	3,584,784.00	0.10
253	688099	晶晨股份	41,000	3,576,430.00	0.10
254	301358	湖南裕能	55,100	3,562,766.00	0.10
255	300661	圣邦股份	51,895	3,562,072.80	0.10
256	300759	康龙化成	124,800	3,548,064.00	0.10
257	300454	深信服	30,800	3,546,928.00	0.10
258	601800	中国交建	429,700	3,540,728.00	0.10
259	300347	泰格医药	62,400	3,538,080.00	0.10
260	603659	璞泰来	128,700	3,518,658.00	0.10
261	601021	春秋航空	59,100	3,516,450.00	0.10
262	601872	招商轮船	391,300	3,513,874.00	0.10
263	002138	顺络电子	97,900	3,478,387.00	0.10
264	603979	金诚信	45,600	3,472,440.00	0.10
265	000301	东方盛虹	318,600	3,469,554.00	0.10
266	000878	云南铜业	168,900	3,464,139.00	0.10
267	601319	中国人保	386,300	3,457,385.00	0.10
268	002497	雅化集团	139,100	3,442,725.00	0.10
269	300054	鼎龙股份	91,000	3,421,600.00	0.10
270	688396	华润微	64,600	3,414,756.00	0.10
271	002185	华天科技	311,100	3,412,767.00	0.10
272	688578	艾力斯	32,600	3,395,290.00	0.10
273	601633	长城汽车	150,000	3,394,500.00	0.10
274	600233	圆通速递	205,900	3,380,878.00	0.10
275	000066	中国长城	234,100	3,373,381.00	0.10
276	600352	浙江龙盛	315,700	3,365,362.00	0.10
277	002294	信立泰	67,600	3,349,580.00	0.10
278	601117	中国化学	444,100	3,344,073.00	0.10
279	002129	TCL 中环	388,900	3,332,873.00	0.10
280	300037	新宙邦	63,400	3,322,160.00	0.09
281	000960	锡业股份	118,900	3,314,932.00	0.09
282	600674	川投能源	235,500	3,273,450.00	0.09
283	600588	用友网络	246,520	3,268,855.20	0.09
284	688608	恒玄科技	14,400	3,267,936.00	0.09
285	688213	思特威	34,100	3,242,569.00	0.09

286	300724	捷佳伟创	33,800	3,231,280.00	0.09
287	688506	百利天恒	10,000	3,231,000.00	0.09
288	600141	兴发集团	93,000	3,215,940.00	0.09
289	688047	龙芯中科	24,200	3,197,062.00	0.09
290	002078	太阳纸业	202,500	3,189,375.00	0.09
291	300474	景嘉微	44,200	3,176,654.00	0.09
292	600498	烽火通信	98,900	3,172,712.00	0.09
293	601615	明阳智能	218,300	3,160,984.00	0.09
294	002271	东方雨虹	231,700	3,148,803.00	0.09
295	600039	四川路桥	314,800	3,132,260.00	0.09
296	000786	北新建材	124,000	3,096,280.00	0.09
297	300017	网宿科技	297,600	3,050,400.00	0.09
298	300073	当升科技	52,700	3,046,060.00	0.09
299	300496	中科创达	44,900	3,030,750.00	0.09
300	002414	高德红外	205,900	3,020,553.00	0.09
301	601233	桐昆股份	174,000	2,994,540.00	0.09
302	688017	绿的谐波	15,500	2,977,550.00	0.08
303	603087	甘李药业	43,700	2,974,659.00	0.08
304	300866	安克创新	25,900	2,962,701.00	0.08
305	603606	东方电缆	49,500	2,957,625.00	0.08
306	002444	巨星科技	86,900	2,956,338.00	0.08
307	000617	中油资本	306,100	2,938,560.00	0.08
308	300316	晶盛机电	79,400	2,917,950.00	0.08
309	300251	光线传媒	176,700	2,894,346.00	0.08
310	002085	万丰奥威	178,600	2,859,386.00	0.08
311	300757	罗博特科	12,200	2,846,260.00	0.08
312	300748	金力永磁	82,700	2,820,897.00	0.08
313	302132	中航成飞	35,700	2,820,300.00	0.08
314	601179	中国西电	308,600	2,808,260.00	0.08
315	600482	中国动力	135,500	2,804,850.00	0.08
316	002155	湖南黄金	132,210	2,788,308.90	0.08
317	002223	鱼跃医疗	72,800	2,781,688.00	0.08
318	300012	华测检测	204,200	2,766,910.00	0.08
319	300699	光威复材	70,100	2,766,146.00	0.08
320	300024	机器人	151,900	2,763,061.00	0.08
321	300002	神州泰岳	238,600	2,748,672.00	0.08
322	002459	晶澳科技	238,800	2,734,260.00	0.08
323	688223	晶科能源	484,200	2,730,888.00	0.08
324	300122	智飞生物	144,000	2,717,280.00	0.08
325	600085	同仁堂	83,200	2,684,032.00	0.08
326	002624	完美世界	163,700	2,683,043.00	0.08
327	300832	新产业	47,600	2,677,500.00	0.08
328	000034	神州数码	68,800	2,677,008.00	0.08

329	000423	东阿阿胶	54,500	2,674,860.00	0.08
330	688472	阿特斯	178,900	2,667,399.00	0.08
331	600497	驰宏锌锗	364,600	2,665,226.00	0.08
332	600256	广汇能源	539,200	2,652,864.00	0.08
333	300285	国瓷材料	96,500	2,645,065.00	0.08
334	002064	华峰化学	239,600	2,635,600.00	0.08
335	603596	伯特利	51,300	2,630,151.00	0.08
336	300919	中伟新材	56,700	2,626,911.00	0.07
337	688599	天合光能	157,500	2,606,625.00	0.07
338	300896	爱美客	18,320	2,596,310.40	0.07
339	002405	四维图新	286,500	2,581,365.00	0.07
340	002409	雅克科技	34,800	2,578,680.00	0.07
341	601618	中国中冶	866,200	2,572,614.00	0.07
342	600765	中航重机	133,540	2,558,626.40	0.07
343	001965	招商公路	248,400	2,503,872.00	0.07
344	002410	广联达	198,600	2,498,388.00	0.07
345	600079	ST人福	137,700	2,493,747.00	0.07
346	300568	星源材质	163,400	2,491,850.00	0.07
347	002756	永兴材料	45,900	2,490,075.00	0.07
348	688617	惠泰医疗	10,200	2,481,354.00	0.07
349	002245	蔚蓝锂芯	139,100	2,475,980.00	0.07
350	002065	东华软件	270,300	2,473,245.00	0.07
351	000733	振华科技	47,100	2,468,511.00	0.07
352	300003	乐普医疗	154,800	2,447,388.00	0.07
353	002180	纳思达	120,820	2,442,980.40	0.07
354	601607	上海医药	134,200	2,396,812.00	0.07
355	600637	东方明珠	243,200	2,395,520.00	0.07
356	600862	中航高科	101,200	2,391,356.00	0.07
357	002318	久立特材	82,500	2,388,375.00	0.07
358	000683	博源化工	316,000	2,351,040.00	0.07
359	600026	中远海能	201,100	2,348,848.00	0.07
360	000932	华菱钢铁	416,400	2,340,168.00	0.07
361	600803	新奥股份	111,700	2,318,892.00	0.07
362	605589	圣泉集团	81,900	2,317,770.00	0.07
363	300627	华测导航	66,280	2,313,834.80	0.07
364	300972	万辰集团	11,411	2,294,409.77	0.07
365	300001	特锐德	89,200	2,290,656.00	0.07
366	000830	鲁西化工	138,000	2,286,660.00	0.07
367	603486	科沃斯	28,300	2,283,244.00	0.07
368	000999	华润三九	80,190	2,282,207.40	0.07
369	300438	鹏辉能源	42,500	2,261,850.00	0.06
370	603260	合盛硅业	42,900	2,260,830.00	0.06
371	000039	中集集团	223,600	2,256,124.00	0.06

372	000623	吉林敖东	114,900	2,243,997.00	0.06
373	002821	凯莱英	24,100	2,239,613.00	0.06
374	000400	许继电气	86,500	2,223,915.00	0.06
375	300413	芒果超媒	90,900	2,219,778.00	0.06
376	601677	明泰铝业	149,900	2,217,021.00	0.06
377	688180	君实生物	64,900	2,216,984.00	0.06
378	000887	中鼎股份	95,000	2,204,950.00	0.06
379	688065	凯赛生物	44,000	2,191,200.00	0.06
380	300628	亿联网络	61,300	2,185,345.00	0.06
381	600332	白云山	84,700	2,180,178.00	0.06
382	300383	光环新网	173,600	2,171,736.00	0.06
383	601238	广汽集团	266,100	2,171,376.00	0.06
384	000009	中国宝安	219,100	2,158,135.00	0.06
385	300567	精测电子	23,600	2,152,320.00	0.06
386	600521	华海药业	126,800	2,151,796.00	0.06
387	601799	星宇股份	17,400	2,146,638.00	0.06
388	600177	雅戈尔	281,400	2,138,640.00	0.06
389	688005	容百科技	60,300	2,134,620.00	0.06
390	600845	宝信软件	103,000	2,133,130.00	0.06
391	300142	沃森生物	193,900	2,115,449.00	0.06
392	688266	泽璟制药	22,500	2,085,750.00	0.06
393	688303	大全能源	77,700	2,083,914.00	0.06
394	600704	物产中大	373,200	2,078,724.00	0.06
395	603568	伟明环保	81,700	2,073,546.00	0.06
396	603392	万泰生物	46,120	2,072,632.80	0.06
397	300763	锦浪科技	28,900	2,063,749.00	0.06
398	002152	广电运通	149,100	2,059,071.00	0.06
399	600486	扬农化工	29,400	2,040,066.00	0.06
400	002739	万达电影	179,200	2,028,544.00	0.06
401	000738	航发控制	94,700	2,018,057.00	0.06
402	000708	中信特钢	123,100	2,015,147.00	0.06
403	002841	视源股份	50,700	2,009,241.00	0.06
404	002176	江特电机	206,000	2,006,440.00	0.06
405	002007	华兰生物	132,500	2,004,725.00	0.06
406	002389	航天彩虹	83,200	1,995,136.00	0.06
407	603605	珀莱雅	29,000	1,985,920.00	0.06
408	002044	美年健康	375,700	1,983,696.00	0.06
409	600208	衢州发展	510,500	1,975,635.00	0.06
410	601216	君正集团	409,000	1,971,380.00	0.06
411	600153	建发股份	212,100	1,961,925.00	0.06
412	600516	方大炭素	342,500	1,948,825.00	0.06
413	600161	天坛生物	119,100	1,946,094.00	0.06
414	300459	汤姆猫	423,500	1,943,865.00	0.06

415	600499	科达制造	139,900	1,940,413.00	0.06
416	601567	三星医疗	84,200	1,938,284.00	0.06
417	688188	柏楚电子	14,000	1,902,460.00	0.05
418	300253	卫宁健康	212,400	1,873,368.00	0.05
419	300083	创世纪	202,700	1,866,867.00	0.05
420	603816	顾家家居	59,600	1,832,104.00	0.05
421	000519	中兵红箭	100,600	1,831,926.00	0.05
422	300088	长信科技	301,100	1,824,666.00	0.05
423	000415	渤海租赁	448,900	1,818,045.00	0.05
424	600018	上港集团	335,300	1,817,326.00	0.05
425	600316	洪都航空	51,900	1,811,829.00	0.05
426	600038	中直股份	49,000	1,770,370.00	0.05
427	600398	海澜之家	292,000	1,766,600.00	0.05
428	603806	福斯特	125,900	1,757,564.00	0.05
429	688166	博瑞医药	35,700	1,751,442.00	0.05
430	600820	隧道股份	268,100	1,739,969.00	0.05
431	688009	中国通号	315,700	1,726,879.00	0.05
432	000629	钒钛股份	557,000	1,726,700.00	0.05
433	002603	以岭药业	101,000	1,724,070.00	0.05
434	600312	平高电气	99,300	1,722,855.00	0.05
435	601018	宁波港	474,600	1,722,798.00	0.05
436	600170	上海建工	646,300	1,712,695.00	0.05
437	600563	法拉电子	16,300	1,710,685.00	0.05
438	002544	普天科技	49,500	1,707,255.00	0.05
439	300068	南都电源	109,600	1,703,184.00	0.05
440	603077	和邦生物	747,800	1,690,028.00	0.05
441	600323	瀚蓝环境	58,800	1,681,680.00	0.05
442	600166	福田汽车	575,500	1,680,460.00	0.05
443	002025	航天电器	33,100	1,659,303.00	0.05
444	002607	中公教育	592,600	1,623,724.00	0.05
445	300676	华大基因	35,699	1,619,306.64	0.05
446	300118	东方日升	109,800	1,609,668.00	0.05
447	002432	九安医疗	39,700	1,589,588.00	0.05
448	600008	首创环保	529,700	1,589,100.00	0.05
449	600529	山东药玻	79,600	1,586,428.00	0.05
450	002145	钛能化学	322,100	1,578,290.00	0.05
451	600998	九州通	307,600	1,574,912.00	0.04
452	603939	益丰药房	72,400	1,572,528.00	0.04
453	603885	吉祥航空	104,600	1,556,448.00	0.04
454	300144	宋城演艺	189,900	1,555,281.00	0.04
455	601155	新城控股	109,200	1,523,340.00	0.04
456	600763	通策医疗	37,800	1,519,938.00	0.04
457	002244	滨江集团	151,200	1,519,560.00	0.04

458	002312	川发龙蟒	137,100	1,498,503.00	0.04
459	600859	王府井	95,731	1,486,702.43	0.04
460	300573	兴齐眼药	20,740	1,457,814.60	0.04
461	300558	贝达药业	30,500	1,424,045.00	0.04
462	601880	辽港股份	888,000	1,420,800.00	0.04
463	600667	太极实业	176,683	1,408,163.51	0.04
464	601000	唐山港	357,100	1,371,264.00	0.04
465	600004	白云机场	144,900	1,370,754.00	0.04
466	600754	锦江酒店	54,200	1,369,634.00	0.04
467	600258	首旅酒店	81,000	1,356,750.00	0.04
468	600535	天士力	89,500	1,348,765.00	0.04
469	000998	隆平高科	143,300	1,341,288.00	0.04
470	600816	建元信托	472,500	1,337,175.00	0.04
471	600511	国药股份	46,100	1,325,375.00	0.04
472	000032	深桑达 A	68,400	1,323,540.00	0.04
473	002266	浙富控股	315,900	1,314,144.00	0.04
474	300457	赢合科技	47,100	1,311,735.00	0.04
475	603650	彤程新材	29,700	1,310,958.00	0.04
476	002701	奥瑞金	217,400	1,293,530.00	0.04
477	688390	固德威	20,500	1,273,665.00	0.04
478	601966	玲珑轮胎	87,200	1,267,016.00	0.04
479	000818	航锦科技	63,100	1,217,830.00	0.03
480	000069	华侨城 A	483,200	1,198,336.00	0.03
481	600655	豫园股份	233,400	1,197,342.00	0.03
482	300601	康泰生物	81,000	1,196,370.00	0.03
483	603899	晨光股份	44,100	1,193,346.00	0.03
484	601866	中远海发	467,400	1,177,848.00	0.03
485	600867	通化东宝	143,700	1,174,029.00	0.03
486	002120	韵达股份	173,400	1,168,716.00	0.03
487	688063	派能科技	20,500	1,164,810.00	0.03
488	603833	欧派家居	22,200	1,156,398.00	0.03
489	000967	盈峰环境	155,400	1,140,636.00	0.03
490	600325	华发股份	269,600	1,137,712.00	0.03
491	000035	中国天楹	204,400	1,128,288.00	0.03
492	300529	健帆生物	57,270	1,126,500.90	0.03
493	002091	江苏国泰	117,600	1,061,928.00	0.03
494	300070	碧水源	263,700	1,033,704.00	0.03
495	600864	哈投股份	148,700	985,881.00	0.03
496	002891	中宠股份	18,700	967,912.00	0.03
497	002292	奥飞娱乐	107,900	954,915.00	0.03
498	002572	索菲亚	68,600	933,646.00	0.03
499	001914	招商积余	51,600	551,088.00	0.02
500	600007	中国国贸	25,200	499,464.00	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。

### 8.3.2 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	688795	摩尔线程	2,321	965,953.78	0.03
2	688802	沐曦股份	814	325,038.34	0.01
3	688783	西安奕材	14,790	271,544.40	0.01
4	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.01
5	688765	禾元生物	3,529	185,695.98	0.01
6	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
7	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
8	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.00
9	688790	昂瑞微	516	60,470.04	0.00
10	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
11	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
12	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
13	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
14	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
15	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
16	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
17	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
18	001369	双欣材料	897	11,562.33	0.00
19	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
20	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
21	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
22	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
23	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
24	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
25	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
26	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
27	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
28	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
29	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
30	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
31	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
32	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
33	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
34	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
35	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
36	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
37	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00

38	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
39	001396	誉帆科技	69	2,441.91	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	300308	中际旭创	80,436,905.00	0.98
2	600519	贵州茅台	67,959,718.87	0.83
3	300750	宁德时代	44,406,524.40	0.54
4	601211	国泰海通	27,684,923.00	0.34
5	002371	北方华创	26,767,541.95	0.33
6	000333	美的集团	25,114,822.54	0.31
7	300760	迈瑞医疗	23,653,246.00	0.29
8	300059	东方财富	21,563,323.07	0.26
9	000651	格力电器	17,897,071.00	0.22
10	601166	兴业银行	17,508,493.00	0.21
11	002594	比亚迪	17,112,366.70	0.21
12	600150	中国船舶	14,887,271.43	0.18
13	000858	五粮液	14,751,581.80	0.18
14	002475	立讯精密	14,285,693.00	0.17
15	002230	科大讯飞	13,244,742.30	0.16
16	300476	胜宏科技	13,153,273.00	0.16
17	300274	阳光电源	12,473,109.00	0.15
18	000725	京东方 A	11,678,861.00	0.14
19	002595	豪迈科技	11,540,209.00	0.14
20	300442	润泽科技	11,226,392.97	0.14

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。

### 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	300750	宁德时代	220,256,907.89	2.68
2	000333	美的集团	110,515,462.51	1.34
3	300308	中际旭创	101,094,280.80	1.23
4	300059	东方财富	93,517,692.50	1.14

5	002594	比亚迪	91,231,392.21	1.11
6	000858	五粮液	73,346,964.85	0.89
7	000651	格力电器	66,417,874.76	0.81
8	002475	立讯精密	62,488,318.50	0.76
9	002371	北方华创	61,899,731.84	0.75
10	300760	迈瑞医疗	57,203,611.60	0.70
11	300124	汇川技术	48,349,922.80	0.59
12	300502	新易盛	48,334,079.16	0.59
13	000725	京东方 A	48,227,258.00	0.59
14	688256	寒武纪	42,968,973.45	0.52
15	300274	阳光电源	40,961,937.60	0.50
16	688041	海光信息	38,888,651.00	0.47
17	000063	中兴通讯	37,060,551.17	0.45
18	002415	海康威视	36,682,568.05	0.45
19	000001	平安银行	36,354,432.43	0.44
20	002714	牧原股份	36,088,963.48	0.44

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。

### 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	1,921,604,003.91
卖出股票收入（成交）总额	4,452,142,177.73

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

### 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

招商银行股份有限公司因数据安全管理工作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的公开处罚和公开批评。

兴业银行股份有限公司因未依法履行其他职责、公司运作和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的公开处罚；因中标承销费引发市场关注在本报告编制前一年内受到中国银行间市场交易商协会的自律调查。

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。

#### 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	4,858,573.00
2	应收清算款	-
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	4,858,573.00

#### 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

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300308	中际旭创	48,385,800.00	1.38	大宗锁定期流通受限

##### 8.12.5.2 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	688795	摩尔线程	965,953.78	0.03	新股锁定期流通受限
2	688802	沐曦股份	325,038.34	0.01	新股锁定期流通受限
3	688783	西安奕材	271,544.40	0.01	新股锁定期流通受限
4	301656	联合动力	188,276.70	0.01	新股锁定期流通受限
5	688765	禾元生物	185,695.98	0.01	新股锁定期流通受限

#### 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

#### 9.1.1 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（%）
14,834	202,172.50	2,465,207,599.00	82.20	533,819,339.00	17.80

#### 9.1.2 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	1,419,072,197.00	47.32

### 9.2 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	14.61
2	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	2.04
3	中国国际金融股份有限公司	45,000,000.00	1.50
4	新华人寿保险股份有限公司	43,080,300.00	1.44
5	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	1.04
6	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	0.78
7	泰康人寿保险有限责任公司-传统-普通保险产品-019L-CT001 沪	22,427,994.00	0.75

8	中汇人寿保险股份有限公司—泰康资产多资产组合	20,942,100.00	0.70
9	孙梅春	18,200,000.00	0.61
10	泰康资管—农业银行—泰康之星3号资产管理计划	17,223,200.00	0.57
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	1,419,072,197.00	47.32

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 9.3 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

### 9.4 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、基金投资和相关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

## § 10 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	1,479,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,125,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,999,026,938.00

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 2025 年 5 月 30 日发布公告，自 2025 年 5 月 29 日起，金志刚先生兼任公司首席信息官，朱伟先生不再担任公司首席信息官；蒋利娟女士担任公司副总经理；代胜伟先生担任公司副总经理、财务负责人，金志刚先生不再兼任公司财务负责人。

本基金管理人于 2025 年 11 月 22 日发布公告，自 2025 年 11 月 20 日起，孙东海先生担任公司首席信息官，金志刚先生不再兼任公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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

本报告期内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，本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 62,000.00 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 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 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 (%)	
浙商证券	2	3,431,371,708.16	54.05	638,038.06	54.02	-
长江证券	2	2,915,236,806.75	45.92	542,720.38	45.95	-
中信证券	3	2,150,400.00	0.03	428.21	0.04	-
财通证券	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，为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 4 个交易单元，为东亚前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个；德邦证券上海、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	成交金额	占当期债券 回购成交总	成交金额	占当期权 证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	3,041,629. 57	100.00	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 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	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中邮证 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	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 01 月 09 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（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 01 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（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 01 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 01 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 03 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况	《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 03 月 29 日
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 04 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 04 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 05 月 30 日
10	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第三次分红公告	《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 07 月 10 日
11	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第二季度报告	《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 07 月 18 日
12	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	《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 08 月 28 日
13	泰康基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	《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 09 月 04 日
14	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第四次分红公告	《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 10 月 23 日
15	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第三季度报告	《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 10 月 27 日
16	泰康基金管理有限公司关于住所变更的公告	《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 11 月 19 日
17	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 11 月 22 日

		站及基金管理人网站	
18	泰康基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	《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 11 月 24 日
19	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 次更新）	《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 11 月 26 日
20	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 2 次更新）	《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 12 月 05 日
21	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	《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 12 月 05 日
22	泰康基金管理有限公司关于旗下部分公募基金风险等级变动的通知	《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 12 月 30 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

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	20250101-20251231	4,999,523,757.00	366,873,300.00	3,947,324,860.00	1,419,072,197.00	47.32
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。

### 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》。

### 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（《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

2026 年 3 月 30 日