泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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 7
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料 8

§3 主要财务指标和基金净值表现 9

3.1 主要会计数据和财务指标 9
3.2 基金净值表现 10
3.3 其他指标 12

§4 管理人报告 13

4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
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 17

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 18

6.1 资产负债表 18
6.2 利润表 19
6.3 净资产变动表 20
6.4 报表附注 21

§7 投资组合报告 47

7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
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 61
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 62

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 62
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 62
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 62
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 62
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
7.13 投资组合报告附注 62

§8 基金份额持有人信息 64

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 64

§9 开放式基金份额变动 66

§10 重大事件揭示 67

10.1 基金份额持有人大会决议 67
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 67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 67
10.4 基金投资策略的改变 67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 67
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 67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 67
10.8 其他重大事件 68

§11 影响投资者决策的其他重要信息 71

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 71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 71

§12 备查文件目录 72

12.1 备查文件目录 72
12.2 存放地点 72
12.3 查阅方式 72

§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联接基金		
基金简称	泰康中证 A500ETF 联接		
基金主代码	022426		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 10 月 29 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	4,613,739,670.53 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	泰康中证 A500ETF 联接 A	泰康中证 A500ETF 联接 C	泰康中证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	022426	022427	022942
报告期末下属分级基金的份额总额	1,733,704,640.44 份	2,876,773,972.38 份	3,261,057.71 份

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	泰康基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便投资人通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。 1、资产配置策略：本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股，其中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（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、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。 2、目标 ETF 投资策略：本基金投资目标 ETF 有如下两种方式：

	（1）申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申购或赎回目标 ETF。（2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。 3、成份股、备选成份股投资策略：本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将考虑使用其他合理方法进行部分或全部替代。 4、债券投资策略：基于基金流动性管理和有效利用资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。 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，确定投资决策。 6、资产支持证券投资策略：本基金将深入研究资产支持证券，通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型分析，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。 7、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。本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。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。 8、其他金融工具投资策略：本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等金融工具对基金投资组合进行管理。 （1）参与股指期货交易策略：本基金参与股指期货交易将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪指数。 （2）参与国债期货交易策略：本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，以套期保值为目的，参与国债期货的交易。 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，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*95%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，其长期平均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 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

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	《证券时报》
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	泰康基金管理有限公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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)		
	泰康中证 A500ETF 联接 A	泰康中证 A500ETF 联接 C	泰康中证 A500ETF 联接 Y
本期已实现收益	-9,203,032.34	-18,588,050.58	-10,516.79
本期利润	29,802,228.48	45,071,209.99	98,373.48
加权平均基金份额本期利润	0.0164	0.0141	0.0555
本期加权平均净值利润率	1.71%	1.48%	5.77%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.67%	1.76%
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	-30,201,519.86	-53,889,788.12	-41,794.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0174	-0.0187	-0.0128
期末基金资产净值	1,703,503,120.58	2,822,884,184.26	3,219,262.76
期末基金份额净值	0.9826	0.9813	0.9872
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	-1.74%	-1.87%	1.46%

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 10 月 29 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

泰康中证 A500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.41%	0.57%	2.68%	0.57%	0.73%	0.00%
过去三个月	1.99%	1.13%	0.83%	1.14%	1.16%	-0.01%
过去六个月	1.76%	1.05%	0.49%	1.05%	1.27%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.74%	1.01%	-0.84%	1.06%	-0.90%	-0.05%

泰康中证 A500ETF 联接 C

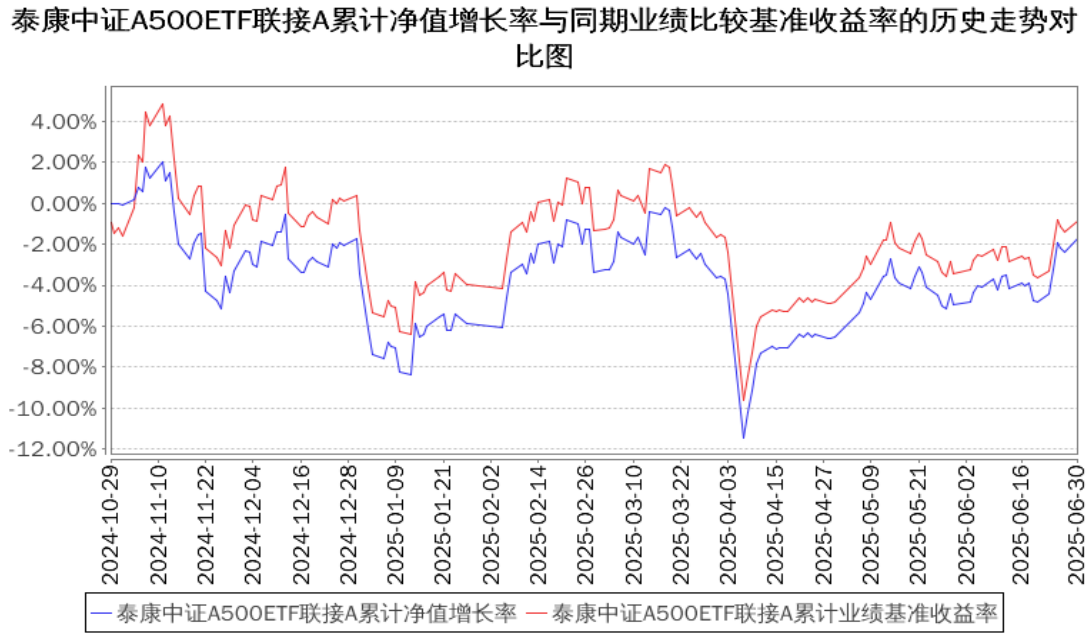
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.39%	0.57%	2.68%	0.57%	0.71%	0.00%
过去三个月	1.94%	1.13%	0.83%	1.14%	1.11%	-0.01%
过去六个月	1.67%	1.05%	0.49%	1.05%	1.18%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.87%	1.01%	-0.84%	1.06%	-1.03%	-0.05%

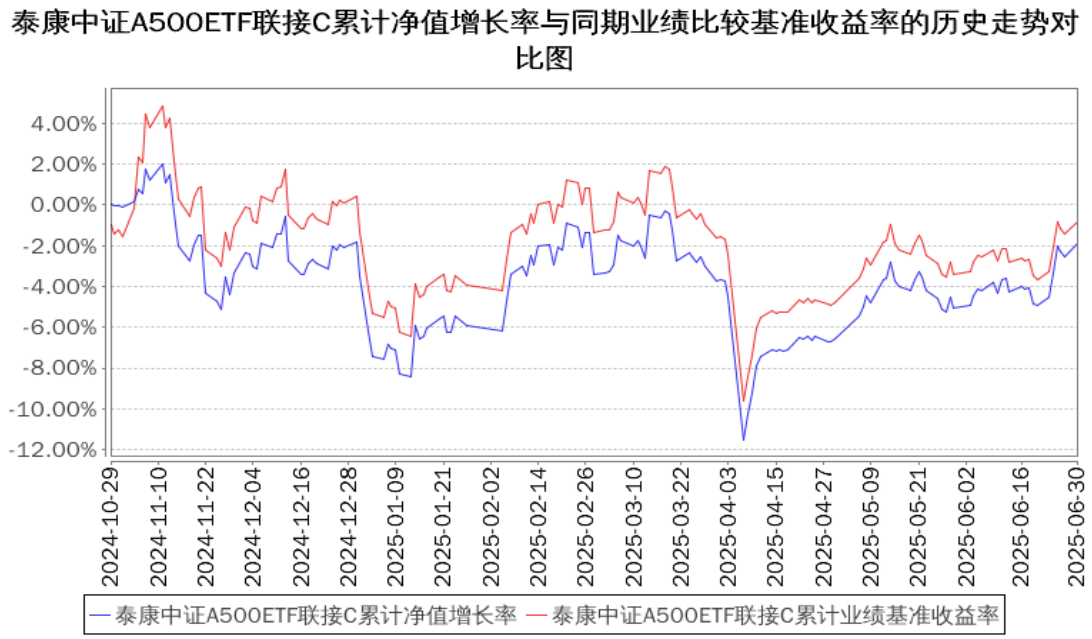
泰康中证 A500ETF 联接 Y

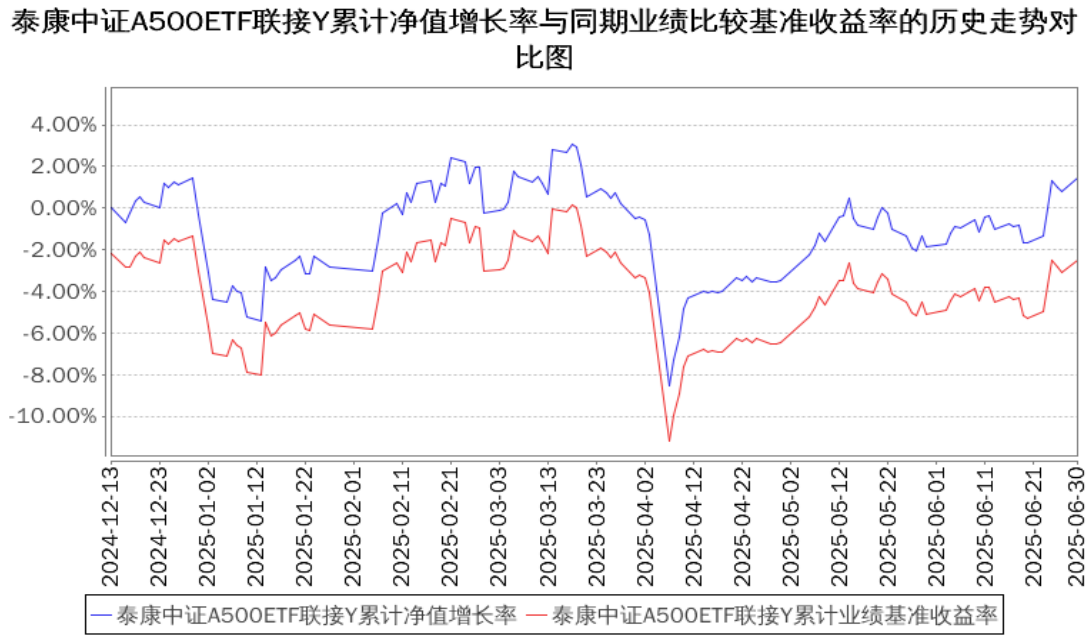
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.42%	0.57%	2.68%	0.57%	0.74%	0.00%
过去三个月	1.99%	1.13%	0.83%	1.14%	1.16%	-0.01%

过去六个月	1.76%	1.05%	0.49%	1.05%	1.27%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.46%	1.01%	-2.53%	1.03%	3.99%	-0.02%

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 10 月 29 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 10 月 29 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。本基金继续秉承指数化投资管理策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，为投资者提供一个标准化的中证 A500 指数的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 0.9826 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 1.76%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 0.9813 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 1.67%；截至本报告期末本基金 Y 份额净值为 0.9872 元,本报告期基金 Y 份额净值增长率为 1.76%；同期业绩比较基准增长率为 0.49%。

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

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

4.8 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联接基金

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	131,919,677.07	185,633,929.58
结算备付金		27,651,045.24	34,975,613.37
存出保证金		4,190,083.20	10,137,945.60
交易性金融资产	6.4.7.2	4,413,890,887.90	4,870,169,862.60
其中：股票投资		155,320,070.71	-
基金投资		4,114,292,106.03	4,758,546,711.91
债券投资		144,278,711.16	111,623,150.69
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		307,198.87	2,758,482.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,577,958,892.28	5,103,675,833.82
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		-	-
应付赎回款		47,716,258.49	10,733,008.15

应付管理人报酬		52,989.43	40,326.45
应付托管费		17,663.14	13,442.15
应付销售服务费		465,268.55	568,747.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	100,145.07	45,179.65
负债合计		48,352,324.68	11,400,703.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,613,739,670.53	5,275,006,691.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-84,133,102.93	-182,731,562.01
净资产合计		4,529,606,567.60	5,092,275,129.86
负债和净资产总计		4,577,958,892.28	5,103,675,833.82

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额总额 4,613,739,670.53 份，其中泰康中证 A500ETF 联接 A 基金份额总额 1,733,704,640.44 份，基金份额净值 0.9826 元;泰康中证 A500ETF 联接 C 基金份额总额 2,876,773,972.38 份，基金份额净值 0.9813 元;泰康中证 A500ETF 联接 Y 基金份额总额 3,261,057.71 份，基金份额净值 0.9872 元。

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联接基金

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		78,449,294.56
1.利息收入		503,424.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	415,403.20
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		88,021.59
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,400,786.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-108,126.26
基金投资收益	6.4.7.15	-32,969,298.86
债券投资收益	6.4.7.16	1,077,938.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-1,676,528.44

股利收益	6.4.7.20	8,275,228.87
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）	6.4.7.21	102,773,411.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	573,244.52
减：二、营业总支出		3,477,482.61
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	248,931.12
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	82,977.05
3．销售服务费	6.4.10.2.3	3,033,424.24
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	6.4.7.23	-
7．税金及附加		-
8．其他费用	6.4.7.24	112,150.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		74,971,811.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		74,971,811.95
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		74,971,811.95

注：本基金合同生效日为 2024 年 10 月 29 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联接基金

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	5,275,006,691.87	-	-182,731,562.01	5,092,275,129.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	5,275,006,691.87	-	-182,731,562.01	5,092,275,129.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-661,267,021.34	-	98,598,459.08	-562,668,562.26
（一）、综合收益总额	-	-	74,971,811.95	74,971,811.95
（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）	-661,267,021.34	-	23,626,647.13	-637,640,374.21
其中：1.基金申购款	512,726,623.94	-	-24,710,567.17	488,016,056.77
2.基金赎回款	-1,173,993,645.28	-	48,337,214.30	-1,125,656,430.98
（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	4,613,739,670.53	-	-84,133,102.93	4,529,606,567.60

注：本基金合同生效日为 2024 年 10 月 29 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联接基金(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]1427 号《关于准予泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,258,579,354.60 元，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 2400575 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联接基金基金合同》于 2024 年 10 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,258,579,354.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.00 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”)。

根据经中国证监会备案的《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合同》和《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费等收取方式和客户类型的不同，将基金份额分为 A 类、C 类和 Y 类不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额；针对个人养老金投资基金业务单独设立的一类基金份额，称为 Y 类基金份额。Y 类份额仅接受个人养老金通过个人养老金资金账户的申购申请；A 类、C 类份额不受上述限制。本基金 A 类、C 类和 Y 类基金份额分别设置代码。Y 类基金份额的申赎安排、资金账户管理等事项还应当遵守国家关于个人养老金账户管理的规定。在向投资人充分披露的情况下，为鼓励投资人在个人养老金领取期长期领取，基金管理人可设置定期分红、定期支付、定额赎回等机制；基金管理人亦可对运作方式、持有期限、投资策略、估值方法、申赎转换等方面做出其他安排。具体见更新的招募说明书及相关公告。由于基金费用等的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 Y 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为：计算日某类基金份额净值＝计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额余额总数。

本基金为泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 A500 指数紧密跟踪的被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，正常市场情况下，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

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联接基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选

成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（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）、债券资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据法律法规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：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%。

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	76,995,369.13
等于：本金	76,988,177.67
加：应计利息	7,191.46
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	54,924,307.94
等于：本金	54,918,586.85
加：应计利息	5,721.09
减：坏账准备	-
合计	131,919,677.07

注：其他存款为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金。

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		153,711,099.30	-	155,320,070.71	1,608,971.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,100.00	0.20	3,100.20	0.00
	银行间市场	141,265,360.00	3,378,610.96	144,275,610.96	-368,360.00
	合计	141,268,460.00	3,378,611.16	144,278,711.16	-368,360.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		4,158,349,116.75	-	4,114,292,106.03	-44,057,010.72
其他		-	-	-	-
合计		4,453,328,676.05	3,378,611.16	4,413,890,887.90	-42,816,399.31

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	33,960,855.00	-	-	-
其中：股指期货投资	33,960,855.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,960,855.00	-	-	-

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	6.00	6,930,960.00	265,440.00
IF2509	IF2509	24.00	27,986,400.00	691,065.00
合计				956,505.00
减：可抵销期货暂收款				956,505.00

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。

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	1,100.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,100.00
应付利息	-
预提费用	94,752.03
待结转股票分红款	4,293.04
合计	100,145.07

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康中证 A500ETF 联接 A

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	1,828,502,472.68	1,828,502,472.68
本期申购	297,496,647.68	297,496,647.68
本期赎回（以“-”号填列）	-392,294,479.92	-392,294,479.92
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	1,733,704,640.44	1,733,704,640.44

泰康中证 A500ETF 联接 C

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	3,446,117,866.60	3,446,117,866.60
本期申购	212,197,253.87	212,197,253.87
本期赎回（以“-”号填列）	-781,541,148.09	-781,541,148.09
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	2,876,773,972.38	2,876,773,972.38

泰康中证 A500ETF 联接 Y

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	386,352.59	386,352.59
本期申购	3,032,722.39	3,032,722.39
本期赎回（以“-”号填列）	-158,017.27	-158,017.27
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	3,261,057.71	3,261,057.71

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

泰康中证 A500ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,679,449.10	-50,266,659.61	-62,946,108.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-12,679,449.10	-50,266,659.61	-62,946,108.71
本期利润	-9,203,032.34	39,005,260.82	29,802,228.48
本期基金份额交易产生的变动数	1,261,722.33	1,680,638.04	2,942,360.37
其中：基金申购款	-2,382,630.23	-8,786,542.36	-11,169,172.59
基金赎回款	3,644,352.56	10,467,180.40	14,111,532.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,620,759.11	-9,580,760.75	-30,201,519.86

泰康中证 A500ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-25,053,728.07	-94,720,177.36	-119,773,905.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-25,053,728.07	-94,720,177.36	-119,773,905.43
本期利润	-18,588,050.58	63,659,260.57	45,071,209.99
本期基金份额交易产生的变动数	5,742,959.64	15,069,947.68	20,812,907.32

其中：基金申购款	-1,863,847.92	-11,542,955.88	-13,406,803.80
基金赎回款	7,606,807.56	26,612,903.56	34,219,711.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-37,898,819.01	-15,990,969.11	-53,889,788.12

泰康中证 A500ETF 联接 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22.67	-11,525.20	-11,547.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-22.67	-11,525.20	-11,547.87
本期利润	-10,516.79	108,890.27	98,373.48
本期基金份额交易产生的变动数	-5,938.93	-122,681.63	-128,620.56
其中：基金申购款	-6,289.06	-128,301.72	-134,590.78
基金赎回款	350.13	5,620.09	5,970.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,478.39	-25,316.56	-41,794.95

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	171,331.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	111,044.18
结算备付金利息收入	132,994.09
其他	33.85
合计	415,403.20

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	-108,126.26
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-108,126.26

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	11,269,965.26
减：卖出股票成本总额	11,327,306.26
减：交易费用	50,785.26
买卖股票差价收入	-108,126.26

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,038,971,326.99
减：卖出/赎回基金成本总额	1,071,885,949.02
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	54,676.83
基金投资收益	-32,969,298.86

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 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	1,397,578.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-319,640.00
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	1,077,938.28

6.4.7.16.2 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	112,075,000.00

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	110,318,540.00
减：应计利息总额	2,075,000.00
减：交易费用	1,100.00
买卖债券差价收入	-319,640.00

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 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	-1,676,528.44

6.4.7.20 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	1,411,098.51
其中:证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	6,864,130.36
合计	8,275,228.87

6.4.7.21 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	100,902,307.84
股票投资	1,608,971.41
债券投资	-387,820.00
资产支持证券投资	-
基金投资	99,681,156.43
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	1,871,103.82
权证投资	-
期货投资	1,871,103.82
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	102,773,411.66

6.4.7.22 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	572,124.16
基金转换费收入	1,120.36
合计	573,244.52

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

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

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 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	12,898.17
债券帐户维护费	9,000.00
合计	112,150.20

6.4.7.25 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 16 日公告进行 2025 年度第一次分红，权益登记日为 2025 年 7 月 17 日，除息日为 2025 年 7 月 17 日，现金红利发放日为 2025 年 7 月 18 日。本基金每 10 份 A 类基金份额分红数为人民币 0.0670 元,每 10 份 C 类基金份额分红数为人民币 0.0670 元,每 10 份 Y 类基金份额分红数为人民币 0.0670 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、注册登记机构、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、基金销售机构
泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金的目标基金
泰康人寿保险有限责任公司(“泰康人寿”)	与基金管理人同受最终控股母公司控制、基金销售机构

泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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	248,931.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,741,604.19
应支付基金管理人的净管理费	-1,492,673.07

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的目标 ETF 而调减，因此应支付基金管理人的净管理费可能为负。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 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扣除所持有目标 ETF 基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）*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	82,977.05

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 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扣除所持有目标 ETF 基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）*0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰康中证 A500ETF 联接 A	泰康中证 A500ETF 联接 C	泰康中证 A500ETF 联接 Y	合计
招商银行	-	2,942,058.63	-	2,942,058.63
泰康基金管理有限公司	-	12,371.77	-	12,371.77
合计	-	2,954,430.40	-	2,954,430.40

注：本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额不计提销售服务费，C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费＝C 类基金份额前一日基金资产净值*0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

无。

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-银行存款	76,995,369.13	171,331.08
招商银行-其他存款	54,924,307.94	111,044.18

注：1、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。

2、本基金的其他存款为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金，由基金托管人保管，按协议约定利率计息。

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 4,258,219,940.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 66.00%(上年度末，本基金持有 4,999,523,757.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 57.83%)。

本报告期末，本基金持有 83,600 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 3,718,248.39 元，估值总额为人民币 3,841,420.00 元，占基金资产净值的比例为 0.08%（上年度末，本基金未持有关联方股票）。

6.4.11 利润分配情况

无。

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
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	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定期流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
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	31	3,100.00	3,100.20	-

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。

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 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，其长期平均和预期收益高于混合型基金、

债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具包括目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股以及中国证监会核准的股票、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行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,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	3,100.20	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	3,100.20	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	131,919,677.07	-	-	-	131,919,677.07
结算备付金	27,651,045.24	-	-	-	27,651,045.24
存出保证金	4,190,083.20	-	-	-	4,190,083.20
交易性金融资产	144,275,610.96	-	3,100.20	4,269,612,176.74	4,413,890,887.90
应收申购款	-	-	-	307,198.87	307,198.87
资产总计	308,036,416.47	-	3,100.20	4,269,919,375.61	4,577,958,892.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	47,716,258.49	47,716,258.49
应付管理人报酬	-	-	-	52,989.43	52,989.43
应付托管费	-	-	-	17,663.14	17,663.14
应付销售服务费	-	-	-	465,268.55	465,268.55
其他负债	-	-	-	100,145.07	100,145.07
负债总计	-	-	-	48,352,324.68	48,352,324.68
利率敏感度缺口	308,036,416.47	-	3,100.20	4,221,567,050.93	4,529,606,567.60
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	185,633,929.58	-	-	-	185,633,929.58
结算备付金	34,975,613.37	-	-	-	34,975,613.37
存出保证金	10,137,945.60	-	-	-	10,137,945.60
交易性金融资产	111,623,150.69	-	-	4,758,546,711.91	4,870,169,862.60
应收申购款	-	-	-	2,758,482.67	2,758,482.67

资产总计	342,370,639.24	-	-	4,761,305,194.58	5,103,675,833.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,733,008.15	10,733,008.15
应付管理人报酬	-	-	-	40,326.45	40,326.45
应付托管费	-	-	-	13,442.15	13,442.15
应付销售服务费	-	-	-	568,747.56	568,747.56
其他负债	-	-	-	45,179.65	45,179.65
负债总计	-	-	-	11,400,703.96	11,400,703.96
利率敏感度缺口	342,370,639.24	-	-	4,749,904,490.62	5,092,275,129.86

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%	-114,038.40	-103,229.13
	市场利率下调 0.25%	114,219.15	103,424.03

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上

精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	155,320,070.71	3.43	-	-
交易性金融资产－基金投资	4,114,292,106.03	90.83	4,758,546,711.91	93.45
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	4,269,612,176.74	94.26	4,758,546,711.91	93.45

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	4,269,594,294.03	4,758,546,711.91
第二层次	144,294,096.70	111,623,150.69
第三层次	2,497.17	-
合计	4,413,890,887.90	4,870,169,862.60

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

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	155,320,070.71	3.39
	其中：股票	155,320,070.71	3.39
2	基金投资	4,114,292,106.03	89.87
3	固定收益投资	144,278,711.16	3.15
	其中：债券	144,278,711.16	3.15
	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	159,570,722.31	3.49
8	其他各项资产	4,497,282.07	0.10
9	合计	4,577,958,892.28	100.00

注：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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	845,150.00	0.02
B	采矿业	7,829,420.00	0.17
C	制造业	90,148,730.31	1.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,782,826.00	0.11
E	建筑业	2,949,387.00	0.07
F	批发和零售业	1,094,370.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,407,471.00	0.12
H	住宿和餐饮业	133,149.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,423,028.40	0.23
J	金融业	25,115,127.00	0.55
K	房地产业	1,624,727.00	0.04
L	租赁和商务服务业	1,723,096.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,727,130.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	339,553.00	0.01

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	101,898.00	0.00
Q	卫生和社会工作	588,776.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	486,232.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	155,320,070.71	3.43

7.2.2 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

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	4,200	5,919,984.00	0.13
2	300750	宁德时代	17,900	4,514,738.00	0.10
3	601318	中国平安	72,700	4,033,396.00	0.09
4	600036	招商银行	83,600	3,841,420.00	0.08
5	601166	兴业银行	112,300	2,621,082.00	0.06
6	600900	长江电力	82,700	2,492,578.00	0.06
7	000333	美的集团	33,200	2,397,040.00	0.05
8	601899	紫金矿业	111,300	2,170,350.00	0.05
9	002594	比亚迪	6,100	2,024,651.00	0.04
10	300059	东方财富	85,400	1,975,302.00	0.04
11	600030	中信证券	66,000	1,822,920.00	0.04
12	601398	工商银行	236,800	1,797,312.00	0.04
13	600276	恒瑞医药	30,200	1,567,380.00	0.03
14	000858	五 粮 液	13,100	1,557,590.00	0.03
15	601328	交通银行	180,300	1,442,400.00	0.03
16	000651	格力电器	30,300	1,361,076.00	0.03
17	601288	农业银行	215,800	1,268,904.00	0.03
18	600887	伊利股份	42,800	1,193,264.00	0.03
19	002475	立讯精密	34,300	1,189,867.00	0.03
20	600919	江苏银行	99,200	1,184,448.00	0.03
21	688981	中芯国际	13,400	1,181,478.00	0.03
22	603259	药明康德	16,900	1,175,395.00	0.03
23	601816	京沪高铁	198,300	1,140,225.00	0.03
24	600000	浦发银行	79,300	1,100,684.00	0.02
25	000725	京东方 A	248,200	990,318.00	0.02
26	002371	北方华创	2,200	972,862.00	0.02
27	300760	迈瑞医疗	4,100	921,475.00	0.02
28	688041	海光信息	6,400	904,256.00	0.02
29	601088	中国神华	22,300	904,042.00	0.02
30	688256	寒武纪	1,500	902,250.00	0.02

31	300308	中际旭创	6,000	875,160.00	0.02
32	601601	中国太保	23,100	866,481.00	0.02
33	300502	新易盛	6,740	856,114.80	0.02
34	300124	汇川技术	12,700	820,039.00	0.02
35	601728	中国电信	104,800	812,200.00	0.02
36	601668	中国建筑	139,600	805,492.00	0.02
37	002352	顺丰控股	16,300	794,788.00	0.02
38	000001	平安银行	65,500	790,585.00	0.02
39	002714	牧原股份	18,500	777,185.00	0.02
40	002230	科大讯飞	15,600	746,928.00	0.02
41	603501	豪威集团	5,800	740,370.00	0.02
42	601127	赛力斯	5,500	738,760.00	0.02
43	600031	三一重工	40,100	719,795.00	0.02
44	000063	中兴通讯	21,800	708,282.00	0.02
45	603019	中科曙光	9,900	696,960.00	0.02
46	002415	海康威视	25,000	693,250.00	0.02
47	600309	万华化学	12,700	689,102.00	0.02
48	600941	中国移动	6,100	686,555.00	0.02
49	300274	阳光电源	9,800	664,146.00	0.01
50	601857	中国石油	76,500	654,075.00	0.01
51	601919	中远海控	42,600	640,704.00	0.01
52	688008	澜起科技	7,700	631,400.00	0.01
53	600690	海尔智家	25,400	629,412.00	0.01
54	601012	隆基绿能	41,000	615,820.00	0.01
55	600660	福耀玻璃	10,800	615,708.00	0.01
56	600406	国电南瑞	27,200	609,552.00	0.01
57	601766	中国中车	82,100	577,984.00	0.01
58	603986	兆易创新	4,500	569,385.00	0.01
59	000568	泸州老窖	5,000	567,000.00	0.01
60	688012	中微公司	3,100	565,130.00	0.01
61	600050	中国联通	105,700	564,438.00	0.01
62	000338	潍柴动力	36,600	562,908.00	0.01
63	600028	中国石化	98,500	555,540.00	0.01
64	300476	胜宏科技	4,100	550,958.00	0.01
65	000100	TCL 科技	126,700	548,611.00	0.01
66	601988	中国银行	96,700	543,454.00	0.01
67	601006	大秦铁路	81,700	539,220.00	0.01
68	601985	中国核电	55,600	518,192.00	0.01
69	601225	陕西煤业	26,200	504,088.00	0.01
70	600104	上汽集团	31,300	502,365.00	0.01
71	002027	分众传媒	68,400	499,320.00	0.01
72	600150	中国船舶	15,100	491,354.00	0.01
73	688111	金山办公	1,700	476,085.00	0.01

74	600418	江淮汽车	11,800	473,062.00	0.01
75	601628	中国人寿	11,300	465,447.00	0.01
76	603288	海天味业	11,300	439,683.00	0.01
77	605499	东鹏饮料	1,400	439,670.00	0.01
78	688271	联影医疗	3,400	434,316.00	0.01
79	600760	中航沈飞	7,400	433,788.00	0.01
80	000425	徐工机械	55,600	432,012.00	0.01
81	000625	长安汽车	33,500	427,460.00	0.01
82	000792	盐湖股份	25,000	427,000.00	0.01
83	600111	北方稀土	17,100	425,790.00	0.01
84	600938	中国海油	16,200	422,982.00	0.01
85	600905	三峡能源	96,700	411,942.00	0.01
86	300033	同花顺	1,500	409,515.00	0.01
87	002625	光启技术	10,200	407,796.00	0.01
88	601658	邮储银行	74,500	407,515.00	0.01
89	600089	特变电工	34,100	406,813.00	0.01
90	601888	中国中免	6,600	402,402.00	0.01
91	002050	三花智控	15,200	400,976.00	0.01
92	600436	片仔癀	2,000	400,020.00	0.01
93	603993	洛阳钼业	47,500	399,950.00	0.01
94	300015	爱尔眼科	31,500	393,120.00	0.01
95	600048	保利发展	48,500	392,850.00	0.01
96	600019	宝钢股份	59,300	390,787.00	0.01
97	600547	山东黄金	12,200	389,546.00	0.01
98	601390	中国中铁	69,400	389,334.00	0.01
99	002463	沪电股份	9,100	387,478.00	0.01
100	002241	歌尔股份	16,500	384,780.00	0.01
101	600415	小商品城	18,500	382,580.00	0.01
102	300014	亿纬锂能	8,300	380,223.00	0.01
103	601600	中国铝业	53,500	376,640.00	0.01
104	601989	中国重工	77,000	357,280.00	0.01
105	000977	浪潮信息	7,000	356,160.00	0.01
106	600585	海螺水泥	16,200	347,814.00	0.01
107	002384	东山精密	9,200	347,484.00	0.01
108	002179	中航光电	8,600	347,096.00	0.01
109	600893	航发动力	9,000	346,860.00	0.01
110	600570	恒生电子	10,200	342,108.00	0.01
111	603799	华友钴业	9,200	340,584.00	0.01
112	000538	云南白药	6,000	334,740.00	0.01
113	600584	长电科技	9,700	326,793.00	0.01
114	000938	紫光股份	13,500	323,865.00	0.01
115	000988	华工科技	6,800	319,668.00	0.01
116	601727	上海电气	42,800	316,292.00	0.01

117	600438	通威股份	18,300	306,525.00	0.01
118	002028	思源电气	4,200	306,222.00	0.01
119	300408	三环集团	9,100	303,940.00	0.01
120	002049	紫光国微	4,600	302,956.00	0.01
121	300433	蓝思科技	13,500	301,050.00	0.01
122	000002	万　科 A	46,000	295,320.00	0.01
123	600795	国电电力	60,400	292,336.00	0.01
124	600489	中金黄金	19,700	288,211.00	0.01
125	601669	中国电建	58,200	283,434.00	0.01
126	601689	拓普集团	5,900	278,775.00	0.01
127	600988	赤峰黄金	11,200	278,656.00	0.01
128	300339	润和软件	5,400	274,482.00	0.01
129	600010	包钢股份	153,300	274,407.00	0.01
130	002422	科伦药业	7,600	272,992.00	0.01
131	600009	上海机场	8,400	266,868.00	0.01
132	002456	欧菲光	22,500	266,625.00	0.01
133	600160	巨化股份	9,100	260,988.00	0.01
134	601100	恒立液压	3,600	259,200.00	0.01
135	300394	天孚通信	3,220	257,084.80	0.01
136	000768	中航西飞	9,400	256,996.00	0.01
137	002460	赣锋锂业	7,600	256,652.00	0.01
138	601186	中国铁建	31,100	249,111.00	0.01
139	002252	上海莱士	36,000	247,320.00	0.01
140	600183	生益科技	8,200	247,230.00	0.01
141	688036	传音控股	3,100	247,070.00	0.01
142	600839	四川长虹	25,000	243,000.00	0.01
143	000157	中联重科	33,600	242,928.00	0.01
144	601360	三六零	23,700	241,740.00	0.01
145	688169	石头科技	1,540	241,087.00	0.01
146	600989	宝丰能源	14,900	240,486.00	0.01
147	600886	国投电力	16,300	240,262.00	0.01
148	000963	华东医药	5,900	238,124.00	0.01
149	002074	国轩高科	7,300	236,958.00	0.01
150	601058	赛轮轮胎	17,800	233,536.00	0.01
151	600115	中国东航	57,900	233,337.00	0.01
152	300442	润泽科技	4,600	227,838.00	0.01
153	000408	藏格矿业	5,300	226,151.00	0.00
154	002466	天齐锂业	7,000	224,280.00	0.00
155	002517	恺英网络	11,600	223,996.00	0.00
156	600066	宇通客车	9,000	223,740.00	0.00
157	000807	云铝股份	14,000	223,720.00	0.00
158	002001	新 和 成	10,400	221,208.00	0.00
159	002340	格林美	34,700	220,345.00	0.00

160	000661	长春高新	2,200	218,196.00	0.00
161	300661	圣邦股份	2,990	217,582.30	0.00
162	600426	华鲁恒升	10,000	216,700.00	0.00
163	600196	复星医药	8,600	215,774.00	0.00
164	002195	岩山科技	38,300	215,629.00	0.00
165	002558	巨人网络	9,100	214,305.00	0.00
166	600029	南方航空	36,300	214,170.00	0.00
167	001979	招商蛇口	24,400	213,988.00	0.00
168	601800	中国交建	24,000	213,360.00	0.00
169	301236	软通动力	3,900	213,096.00	0.00
170	002236	大华股份	13,400	212,792.00	0.00
171	600011	华能国际	29,800	212,772.00	0.00
172	000975	山金国际	11,200	212,128.00	0.00
173	600674	川投能源	13,200	211,728.00	0.00
174	002156	通富微电	8,200	210,084.00	0.00
175	688608	恒玄科技	600	208,788.00	0.00
176	688126	沪硅产业	11,100	207,792.00	0.00
177	600346	恒力石化	14,300	203,918.00	0.00
178	600487	亨通光电	13,300	203,490.00	0.00
179	300251	光线传媒	9,900	200,673.00	0.00
180	300207	欣旺达	10,000	200,600.00	0.00
181	002916	深南电路	1,850	199,448.50	0.00
182	601111	中国国航	25,200	198,828.00	0.00
183	300418	昆仑万维	5,900	198,417.00	0.00
184	600745	闻泰科技	5,900	197,827.00	0.00
185	600372	中航机载	16,300	196,578.00	0.00
186	600460	士兰微	7,900	196,078.00	0.00
187	002648	卫星化学	11,300	195,829.00	0.00
188	601868	中国能建	87,600	195,348.00	0.00
189	688213	思特威	1,900	194,218.00	0.00
190	002920	德赛西威	1,900	194,047.00	0.00
191	000066	中国长城	13,100	193,880.00	0.00
192	003816	中国广核	53,200	193,648.00	0.00
193	688777	中控技术	4,300	193,113.00	0.00
194	601117	中国化学	24,700	189,449.00	0.00
195	600096	云天化	8,600	188,942.00	0.00
196	601319	中国人保	21,600	188,136.00	0.00
197	601168	西部矿业	11,300	187,919.00	0.00
198	002273	水晶光电	9,400	187,718.00	0.00
199	600879	航天电子	17,900	187,413.00	0.00
200	600741	华域汽车	10,600	187,090.00	0.00
201	002465	海格通信	13,400	186,796.00	0.00
202	300347	泰格医药	3,500	186,620.00	0.00

203	600588	用友网络	13,900	185,843.00	0.00
204	600256	广汇能源	30,800	185,416.00	0.00
205	600176	中国巨石	16,200	184,680.00	0.00
206	300450	先导智能	7,400	183,890.00	0.00
207	601021	春秋航空	3,300	183,645.00	0.00
208	002601	龙佰集团	11,300	183,173.00	0.00
209	601633	长城汽车	8,500	182,580.00	0.00
210	688002	睿创微纳	2,600	181,272.00	0.00
211	000831	中国稀土	5,000	180,600.00	0.00
212	000786	北新建材	6,800	180,064.00	0.00
213	600219	南山铝业	47,000	180,010.00	0.00
214	002294	信立泰	3,800	179,854.00	0.00
215	002555	三七互娱	10,400	179,816.00	0.00
216	600352	浙江龙盛	17,600	178,816.00	0.00
217	300782	卓胜微	2,500	178,425.00	0.00
218	000933	神火股份	10,700	178,048.00	0.00
219	300017	网宿科技	16,600	177,952.00	0.00
220	688506	百利天恒	600	177,672.00	0.00
221	600885	宏发股份	7,920	176,695.20	0.00
222	302132	中航成飞	2,000	175,880.00	0.00
223	600482	中国动力	7,600	175,332.00	0.00
224	300896	爱美客	1,000	174,810.00	0.00
225	002185	华天科技	17,300	174,730.00	0.00
226	600039	四川路桥	17,600	174,240.00	0.00
227	000630	铜陵有色	51,800	173,012.00	0.00
228	688617	惠泰医疗	580	172,260.00	0.00
229	688099	晶晨股份	2,400	170,424.00	0.00
230	688396	华润微	3,600	169,776.00	0.00
231	002493	荣盛石化	20,500	169,740.00	0.00
232	600085	同仁堂	4,700	169,482.00	0.00
233	688120	华海清科	1,000	168,700.00	0.00
234	002129	TCL 中环	21,900	168,192.00	0.00
235	001965	招商公路	13,900	166,800.00	0.00
236	601877	正泰电器	7,300	165,491.00	0.00
237	600362	江西铜业	7,000	164,010.00	0.00
238	688235	百济神州	700	163,548.00	0.00
239	002709	天赐材料	9,000	163,080.00	0.00
240	002281	光迅科技	3,300	162,756.00	0.00
241	000423	东阿阿胶	3,100	162,130.00	0.00
242	002130	沃尔核材	6,800	161,976.00	0.00
243	688122	西部超导	3,100	160,828.00	0.00
244	002131	利欧股份	45,800	160,300.00	0.00
245	300454	深信服	1,700	160,106.00	0.00

246	002595	豪迈科技	2,700	159,894.00	0.00
247	300223	北京君正	2,300	159,160.00	0.00
248	300866	安克创新	1,400	159,040.00	0.00
249	002085	万丰奥威	10,000	158,900.00	0.00
250	300122	智飞生物	8,100	158,679.00	0.00
251	603392	万泰生物	2,600	158,600.00	0.00
252	002738	中矿资源	4,900	157,584.00	0.00
253	300002	神州泰岳	13,300	156,940.00	0.00
254	002532	天山铝业	18,800	156,228.00	0.00
255	300058	蓝色光标	23,800	156,128.00	0.00
256	600161	天坛生物	8,100	155,439.00	0.00
257	002138	顺络电子	5,500	154,660.00	0.00
258	002472	双环传动	4,600	154,054.00	0.00
259	688072	拓荆科技	1,000	153,710.00	0.00
260	002180	纳思达	6,700	153,698.00	0.00
261	300474	景嘉微	2,100	153,300.00	0.00
262	603596	伯特利	2,900	152,801.00	0.00
263	002078	太阳纸业	11,300	152,098.00	0.00
264	603129	春风动力	700	151,550.00	0.00
265	002436	兴森科技	11,400	150,936.00	0.00
266	002938	鹏鼎控股	4,700	150,541.00	0.00
267	002410	广联达	11,200	150,192.00	0.00
268	600233	圆通速递	11,600	149,524.00	0.00
269	000301	东方盛虹	17,900	149,107.00	0.00
270	688578	艾力斯	1,600	148,864.00	0.00
271	300346	南大光电	4,700	148,708.00	0.00
272	600862	中航高科	5,700	148,656.00	0.00
273	002128	电投能源	7,500	148,350.00	0.00
274	300832	新产业	2,600	147,472.00	0.00
275	600188	兖矿能源	12,100	147,257.00	0.00
276	300759	康龙化成	6,000	147,240.00	0.00
277	688047	龙芯中科	1,100	146,729.00	0.00
278	600143	金发科技	14,200	146,402.00	0.00
279	300054	鼎龙股份	5,100	146,268.00	0.00
280	300024	机器人	8,500	146,030.00	0.00
281	002065	东华软件	15,200	145,920.00	0.00
282	300136	信维通信	6,500	145,600.00	0.00
283	603606	东方电缆	2,800	144,788.00	0.00
284	002202	金风科技	14,000	143,500.00	0.00
284	002353	杰瑞股份	4,100	143,500.00	0.00
285	300395	菲利华	2,800	143,080.00	0.00
286	300496	中科创达	2,500	143,050.00	0.00
287	601618	中国中冶	48,000	143,040.00	0.00

288	000034	神州数码	3,800	143,032.00	0.00
289	002223	鱼跃医疗	4,000	142,400.00	0.00
290	000999	华润三九	4,510	141,072.80	0.00
291	601615	明阳智能	12,200	140,178.00	0.00
292	688266	泽璟制药	1,300	139,763.00	0.00
293	688223	晶科能源	26,900	139,611.00	0.00
294	002008	大族激光	5,700	138,909.00	0.00
295	300383	光环新网	9,700	138,710.00	0.00
296	002271	东方雨虹	12,900	138,417.00	0.00
297	002624	完美世界	9,100	138,047.00	0.00
298	600515	海南机场	38,800	137,352.00	0.00
299	603659	璞泰来	7,300	137,094.00	0.00
300	600845	宝信软件	5,800	136,996.00	0.00
301	002405	四维图新	16,000	136,640.00	0.00
302	601872	招商轮船	21,800	136,468.00	0.00
303	600895	张江高科	5,300	136,210.00	0.00
304	300604	长川科技	3,000	134,730.00	0.00
305	600549	厦门钨业	6,400	133,888.00	0.00
306	300459	汤姆猫	23,900	133,840.00	0.00
307	002459	晶澳科技	13,400	133,732.00	0.00
308	300012	华测检测	11,400	133,266.00	0.00
309	000426	兴业银锡	8,400	132,720.00	0.00
310	603605	珀莱雅	1,600	132,464.00	0.00
311	300627	华测导航	3,780	132,300.00	0.00
312	002155	湖南黄金	7,400	132,090.00	0.00
313	603087	甘李药业	2,400	131,472.00	0.00
314	688599	天合光能	9,000	130,770.00	0.00
315	000733	振华科技	2,600	130,130.00	0.00
316	605589	圣泉集团	4,600	127,650.00	0.00
317	605117	德业股份	2,420	127,437.20	0.00
318	300037	新宙邦	3,600	126,720.00	0.00
319	300253	卫宁健康	11,900	126,140.00	0.00
320	601216	君正集团	22,700	125,304.00	0.00
321	601799	星宇股份	1,000	125,000.00	0.00
322	002444	巨星科技	4,900	124,999.00	0.00
323	000617	中油资本	17,000	124,100.00	0.00
324	600332	白云山	4,700	123,892.00	0.00
325	600392	盛和资源	9,400	123,798.00	0.00
326	002821	凯莱英	1,400	123,550.00	0.00
327	300699	光威复材	3,900	123,513.00	0.00
328	000932	华菱钢铁	27,900	122,760.00	0.00
329	300003	乐普医疗	8,900	122,642.00	0.00
330	000519	中兵红箭	5,600	122,584.00	0.00

331	600153	建发股份	11,800	122,366.00	0.00
332	688180	君实生物	3,600	122,328.00	0.00
333	000878	云南铜业	9,500	120,840.00	0.00
333	601233	桐昆股份	11,400	120,840.00	0.00
334	002389	航天彩虹	4,700	120,320.00	0.00
335	300001	特锐德	5,000	119,850.00	0.00
336	300316	晶盛机电	4,400	119,460.00	0.00
337	600803	新奥股份	6,300	119,070.00	0.00
338	300142	沃森生物	10,800	118,800.00	0.00
339	300073	当升科技	2,700	118,449.00	0.00
340	300628	亿联网络	3,400	118,184.00	0.00
341	002414	高德红外	11,500	117,875.00	0.00
342	600699	均胜电子	6,700	116,848.00	0.00
343	603979	金诚信	2,500	116,100.00	0.00
344	002007	华兰生物	7,400	115,958.00	0.00
345	300568	星源材质	9,100	115,388.00	0.00
346	600177	雅戈尔	15,700	114,610.00	0.00
347	600118	中国卫星	4,000	114,280.00	0.00
348	002812	恩捷股份	3,900	114,231.00	0.00
349	603260	合盛硅业	2,400	113,760.00	0.00
350	600521	华海药业	6,100	113,643.00	0.00
351	002152	广电运通	8,400	112,896.00	0.00
352	601238	广汽集团	15,000	112,350.00	0.00
353	600398	海澜之家	16,100	112,056.00	0.00
354	300315	掌趣科技	18,400	111,688.00	0.00
355	300413	芒果超媒	5,100	111,282.00	0.00
356	600704	物产中大	21,100	111,197.00	0.00
357	688188	柏楚电子	840	110,594.40	0.00
358	000623	吉林敖东	6,500	110,175.00	0.00
359	000738	航发控制	5,300	109,975.00	0.00
360	600316	洪都航空	2,900	109,330.00	0.00
361	600497	驰宏锌锗	20,600	108,974.00	0.00
362	002044	美年健康	21,200	108,968.00	0.00
363	600038	中直股份	2,800	108,668.00	0.00
364	000009	中国宝安	12,200	108,336.00	0.00
365	600765	中航重机	6,400	108,032.00	0.00
366	601567	三星医疗	4,800	107,616.00	0.00
367	002318	久立特材	4,600	107,594.00	0.00
368	600018	上港集团	18,800	107,348.00	0.00
369	600141	兴发集团	5,200	106,756.00	0.00
370	000400	许继电气	4,900	106,673.00	0.00
371	300919	中伟股份	3,200	105,216.00	0.00
372	300757	罗博特科	700	104,979.00	0.00

373	601677	明泰铝业	8,400	104,328.00	0.00
374	002409	雅克科技	1,900	103,911.00	0.00
375	300724	捷佳伟创	1,900	103,170.00	0.00
376	600637	东方明珠	13,700	102,339.00	0.00
377	601607	上海医药	5,700	101,916.00	0.00
378	002607	中公教育	33,300	101,898.00	0.00
379	000960	锡业股份	6,600	100,980.00	0.00
380	600498	烽火通信	4,800	100,944.00	0.00
381	603939	益丰药房	4,100	100,327.00	0.00
382	300088	长信科技	16,800	100,128.00	0.00
383	002245	蔚蓝锂芯	7,800	100,074.00	0.00
384	600529	山东药玻	4,500	99,630.00	0.00
385	002407	多氟多	8,100	98,739.00	0.00
386	300182	捷成股份	17,900	98,629.00	0.00
387	300558	贝达药业	1,700	98,515.00	0.00
388	600563	法拉电子	900	98,181.00	0.00
389	000039	中集集团	12,400	97,464.00	0.00
390	002739	万达电影	8,500	97,155.00	0.00
391	300068	南都电源	6,100	97,112.00	0.00
392	600026	中远海能	9,400	97,102.00	0.00
393	002841	视源股份	2,800	96,880.00	0.00
394	301358	湖南裕能	3,100	96,689.00	0.00
395	601018	宁波港	26,200	95,892.00	0.00
396	000887	中鼎股份	5,400	94,986.00	0.00
397	688303	大全能源	4,400	93,808.00	0.00
398	300285	国瓷材料	5,400	93,690.00	0.00
399	603486	科沃斯	1,600	93,168.00	0.00
400	600486	扬农化工	1,600	92,800.00	0.00
401	002025	航天电器	1,800	92,538.00	0.00
402	300763	锦浪科技	1,600	91,824.00	0.00
403	600820	隧道股份	14,900	90,890.00	0.00
404	603806	福斯特	7,000	90,720.00	0.00
405	600008	首创环保	29,900	90,298.00	0.00
406	300296	利亚德	14,800	90,280.00	0.00
407	300144	宋城演艺	10,500	89,775.00	0.00
408	688009	中国通号	17,400	89,436.00	0.00
409	002064	华峰化学	13,500	89,235.00	0.00
410	002497	雅化集团	7,800	88,920.00	0.00
411	600516	方大炭素	19,100	88,624.00	0.00
412	002312	川发龙蟒	7,700	88,396.00	0.00
413	603568	伟明环保	4,600	87,768.00	0.00
414	600998	九州通	16,900	86,866.00	0.00
415	600763	通策医疗	2,100	86,688.00	0.00

416	600170	上海建工	36,200	86,518.00	0.00
417	600166	福田汽车	31,900	86,449.00	0.00
418	600208	衢州发展	28,800	85,248.00	0.00
419	601179	中国西电	13,800	84,732.00	0.00
420	600312	平高电气	5,500	84,645.00	0.00
421	300676	华大基因	1,700	84,609.00	0.00
422	002176	江特电机	11,600	84,216.00	0.00
422	603816	顾家家居	3,300	84,216.00	0.00
423	605358	立昂微	3,600	83,880.00	0.00
424	000683	博源化工	17,500	83,825.00	0.00
425	002432	九安医疗	2,300	83,789.00	0.00
426	601155	新城控股	6,100	83,448.00	0.00
427	002244	滨江集团	8,400	81,900.00	0.00
428	601000	唐山港	20,100	81,606.00	0.00
429	000708	中信特钢	6,900	81,144.00	0.00
430	000818	航锦科技	3,600	81,000.00	0.00
431	000629	钒钛股份	31,600	80,896.00	0.00
432	603613	国联股份	3,400	80,546.00	0.00
433	002603	以岭药业	5,700	80,370.00	0.00
434	600323	瀚蓝环境	3,300	80,355.00	0.00
435	603885	吉祥航空	5,900	79,473.00	0.00
436	000830	鲁西化工	7,700	79,310.00	0.00
437	300567	精测电子	1,300	78,793.00	0.00
438	002439	启明星辰	4,900	78,351.00	0.00
439	600535	天士力	5,000	78,250.00	0.00
440	601880	辽港股份	50,600	75,900.00	0.00
441	688005	容百科技	3,400	75,888.00	0.00
442	600511	国药股份	2,600	75,816.00	0.00
443	600499	科达制造	7,700	75,460.00	0.00
444	603000	人民网	3,700	74,777.00	0.00
445	300390	天华新能	3,900	74,373.00	0.00
446	002145	中核钛白	17,800	73,870.00	0.00
447	600655	豫园股份	13,300	73,815.00	0.00
448	600859	王府井	5,300	73,617.00	0.00
449	000563	陕国投 A	20,600	73,542.00	0.00
450	601966	玲珑轮胎	5,000	73,350.00	0.00
451	600004	白云机场	8,000	72,800.00	0.00
452	600131	国网信通	4,100	72,570.00	0.00
453	603899	晨光股份	2,500	72,475.00	0.00
454	603077	和邦生物	41,400	72,450.00	0.00
455	000547	航天发展	8,600	72,240.00	0.00
456	600325	华发股份	14,800	72,076.00	0.00
457	300529	健帆生物	3,300	71,181.00	0.00

458	300601	康泰生物	4,600	69,874.00	0.00
459	002756	永兴材料	2,200	69,850.00	0.00
460	600754	锦江酒店	3,100	69,564.00	0.00
461	000998	隆平高科	6,900	67,965.00	0.00
462	603833	欧派家居	1,200	67,740.00	0.00
463	300070	碧水源	14,800	66,600.00	0.00
464	600667	太极实业	10,100	66,458.00	0.00
465	601866	中远海发	26,900	66,443.00	0.00
466	002120	韵达股份	9,900	66,330.00	0.00
467	300438	鹏辉能源	2,400	66,264.00	0.00
468	600867	通化东宝	7,900	64,780.00	0.00
469	600258	首旅酒店	4,500	63,585.00	0.00
470	002544	普天科技	2,700	63,315.00	0.00
471	000032	深桑达 A	3,100	62,713.00	0.00
472	300751	迈为股份	900	62,604.00	0.00
473	300573	兴齐眼药	1,200	62,148.00	0.00
474	000069	华侨城 A	27,400	61,650.00	0.00
475	002508	老板电器	3,200	60,832.00	0.00
476	300457	赢合科技	2,600	59,800.00	0.00
477	000967	盈峰环境	8,600	59,770.00	0.00
478	300118	东方日升	6,200	59,396.00	0.00
479	002831	裕同科技	2,500	58,550.00	0.00
480	002292	奥飞娱乐	6,000	58,320.00	0.00
481	600129	太极集团	2,600	55,406.00	0.00
482	002572	索菲亚	3,900	54,639.00	0.00
483	002266	浙富控股	17,600	54,208.00	0.00
484	601636	旗滨集团	10,800	54,108.00	0.00
485	688063	派能科技	1,200	54,096.00	0.00
486	688390	固德威	1,200	52,140.00	0.00
487	603650	彤程新材	1,600	51,440.00	0.00
488	000035	中国天楹	11,800	50,622.00	0.00
489	600864	哈投股份	8,400	50,148.00	0.00
490	300769	德方纳米	1,500	49,530.00	0.00
491	600315	上海家化	2,300	48,461.00	0.00
492	002091	江苏国泰	6,500	47,255.00	0.00
493	002372	伟星新材	4,300	44,548.00	0.00
494	001914	招商积余	2,900	35,873.00	0.00
495	600007	中国国贸	1,400	28,812.00	0.00
496	600335	国机汽车	4,100	26,445.00	0.00
497	301381	赛维时代	800	15,960.00	0.00
498	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
499	603400	华之杰	57	2,497.17	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	600519	贵州茅台	7,261,855.80	0.14
2	300750	宁德时代	4,893,912.00	0.10
3	601318	中国平安	4,114,898.00	0.08
4	600036	招商银行	3,936,184.00	0.08
5	000333	美的集团	2,699,852.00	0.05
6	601166	兴业银行	2,671,596.00	0.05
7	600900	长江电力	2,619,031.00	0.05
8	002594	比亚迪	2,423,826.00	0.05
9	601899	紫金矿业	2,079,817.00	0.04
10	300059	东方财富	1,963,550.00	0.04
11	000858	五 粮 液	1,852,521.00	0.04
12	600030	中信证券	1,841,647.00	0.04
13	601398	工商银行	1,809,294.00	0.04
14	600276	恒瑞医药	1,666,419.00	0.03
15	000651	格力电器	1,488,726.00	0.03
16	601328	交通银行	1,433,258.00	0.03
17	600887	伊利股份	1,358,519.00	0.03
18	601288	农业银行	1,281,229.00	0.03
19	601816	京沪高铁	1,256,854.00	0.02
20	688981	中芯国际	1,212,632.26	0.02

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。

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	600519	贵州茅台	437,125.00	0.01
2	601988	中国银行	339,129.00	0.01
3	300750	宁德时代	252,286.00	0.00
4	601318	中国平安	244,326.00	0.00
5	600036	招商银行	224,651.00	0.00
6	300124	汇川技术	172,916.00	0.00
7	600900	长江电力	149,481.00	0.00
8	000333	美的集团	147,598.00	0.00
9	600027	华电国际	141,916.00	0.00
10	002594	比亚迪	139,970.00	0.00
11	300999	金龙鱼	127,761.00	0.00
12	601899	紫金矿业	122,357.00	0.00
13	601166	兴业银行	121,326.00	0.00

14	300059	东方财富	112,000.00	0.00
15	601398	工商银行	103,363.00	0.00
16	600030	中信证券	101,540.00	0.00
17	000858	五 粮 液	97,573.00	0.00
18	600276	恒瑞医药	90,687.00	0.00
19	002151	北斗星通	82,153.00	0.00
20	000651	格力电器	76,932.00	0.00

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。

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	165,038,405.56
卖出股票收入（成交）总额	11,269,965.26

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。

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	144,275,610.96	3.19
	其中：政策性金融债	144,275,610.96	3.19
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）	3,100.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	144,278,711.16	3.19

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	180214	18 国开 14	700,000	72,568,808.22	1.60
2	200315	20 进出 15	500,000	51,479,356.16	1.14
3	240431	24 农发 31	200,000	20,227,446.58	0.45
4	123257	安克转债	31	3,100.20	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	泰康基金管理有限公司	4,114,292,106.03	90.83

7.11 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

国家开发银行因未依法履行职责在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局北京监管局的公开处罚。

中国进出口银行因未依法履行职责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。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	4,190,083.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	307,198.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,497,282.07

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.13.6 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

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
泰康中证 A500ETF 联接 A	10,685	162,255.93	229,808,721.67	13.26	1,503,895,918.77	86.74
泰康中证 A500ETF 联接 C	16,275	176,760.31	88,849,362.56	3.09	2,787,924,609.82	96.91
泰康中证 A500ETF 联接 Y	1,013	3,219.21	0.00	0.00	3,261,057.71	100.00
合计	27,588	167,237.19	318,658,084.23	6.91	4,295,081,586.30	93.09

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰康中证 A500ETF 联接 A	57,820.90	0.0033
	泰康中证 A500ETF 联接 C	140,967.03	0.0049
	泰康中证 A500ETF 联接 Y	152,968.50	4.6908
	合计	351,756.43	0.0076

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰康中证 A500ETF 联接 A	0~10
	泰康中证 A500ETF 联接 C	0
	泰康中证 A500ETF 联接 Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康中证 A500ETF 联接 A	0
	泰康中证 A500ETF 联接 C	0
	泰康中证 A500ETF 联接 Y	0

	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康中证 A500ETF 联接 A	泰康中证 A500ETF 联接 C	泰康中证 A500ETF 联接 Y
基金合同生效日（2024 年 10 月 29 日）基金份额总额	1,826,963,502.83	3,431,615,851.77	-
本报告期期初基金份额总额	1,828,502,472.68	3,446,117,866.60	386,352.59
本报告期基金总申购份额	297,496,647.68	212,197,253.87	3,032,722.39
减：本报告期基金总赎回份额	392,294,479.92	781,541,148.09	158,017.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,733,704,640.44	2,876,773,972.38	3,261,057.71

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 10 月 29 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(%)	
招商证券	3	176,281,673.56	100.00	33,829.05	100.00	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。券结服务券

商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，能为券商交易模式的产品提供稳定、及时、保密的交易环境，包括但不限于以下服务内容：

（1）稳定性。交易系统稳定，系统升级改造时积极配合；

（2）及时性。清算数据按时发送，交易遇到问题时及时解决；

（3）保密性。对产品的持仓、交易等敏感数据做到严格保密；

2、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、数据传输、交易管理、佣金收取、资金管理、违约责任等作出约定。

3、本基金选择的证券经纪商招商证券与本公司不存在关联关系。

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		基金交易	
	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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
招商证券	-	-	1,158,000,000.00	100.00	-	-	1,366,921,513.70	100.00

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	关于泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 Y 类基金份额参加中国农业银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 10 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）	《证券时报》；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）	《证券时报》；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联接基金 2024 年第四季度报告	《证券时报》；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	关于泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增中银国	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及	2025 年 1 月 24 日

	际证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	基金管理人网站	
6	关于泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 Y 类基金份额新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 5 日
7	关于泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增平安银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 6 日
8	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增泰康人寿保险有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 7 日
9	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 21 日
10	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 25 日
11	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2024 年年度报告	《证券时报》；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
12	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增粤开证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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
13	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	《证券时报》；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 29 日
14	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 16 日
15	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 18 日
16	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2025 年第一季度报告	《证券时报》；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

17	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增国金证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；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 28 日
18	泰康基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》；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
19	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 26 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

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

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联接基金注册的文件；

（二）《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

（三）《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；

（四）《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

（五）《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金产品资料概要》。

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（《证券时报》）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