

泰康沪深 300 交易型开放式指数
证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	泰康 300
场内简称	沪深 300ETF 泰康
基金主代码	515380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 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	767,799,814.00 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	2020 年 3 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资策略	<p>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股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股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金

	与货币市场基金。 本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	张姗
	联系电话	010-89620366	400-61-95555
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	400-61-95555
传真		010-89620100	0755-83195201
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		金志刚	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	19,136,930.80
本期利润	46,551,432.76
加权平均基金份额本期利润	0.0517
本期加权平均净值利润率	1.19%
本期基金份额净值增长率	1.27%
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	284,481,570.67
期末可供分配基金份额利润	0.3705
期末基金资产净值	3,436,411,560.37
期末基金份额净值	4.4757
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	9.03%

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
过去一个月	3.31%	0.58%	2.50%	0.58%	0.81%	0.00%
过去三个月	2.33%	1.10%	1.25%	1.10%	1.08%	0.00%
过去六个月	1.27%	1.02%	0.03%	1.02%	1.24%	0.00%
过去一年	17.18%	1.39%	13.71%	1.38%	3.47%	0.01%
过去三年	-5.07%	1.10%	-12.24%	1.10%	7.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.03%	1.21%	-2.23%	1.21%	11.26%	0.00%

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

泰康300累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 12 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。

3.3 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	2019年12月27日	-	17年	魏军，博士研究生。2019年5月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人、量化基金经理。曾历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理等职务。2019年12月27日至今担任泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月30日至今担任泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020年9月18日至今担任泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年7月7日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年8月27日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年12月6日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金基金

				<p>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。</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 公平交易制度的执行情况

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

决策方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

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 4.4757 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.27%；同期业绩比较基准增长率为 0.03%。

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，业绩更为稳健的沪深 300 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：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	17,848,904.37	10,877,137.93
结算备付金		6,964,957.67	10,077,462.03
存出保证金		2,173,306.81	2,186,489.34
交易性金融资产	6.4.7.2	3,419,146,136.13	4,220,655,132.45
其中：股票投资		3,419,146,136.13	4,220,655,132.45
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	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		871,473.59	4,514,551.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,447,004,778.57	4,248,310,772.76
负债和净资产			
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		1,297,348.62	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,169,123.41	1,387,506.76
应付托管费		146,140.41	173,438.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	43,026.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	7,980,605.76	6,088,823.33
负债合计		10,593,218.20	7,692,795.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,151,929,989.70	3,938,886,391.67
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	284,481,570.67	301,731,585.75
净资产合计		3,436,411,560.37	4,240,617,977.42
负债和净资产总计		3,447,004,778.57	4,248,310,772.76

注：（1）报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.4757 元，基金份额总额 767,799,814.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.2 利润表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		55,694,541.78	95,772,391.56
1. 利息收入		86,490.82	1,601,327.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	86,490.82	125,609.81
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		-	1,475,717.46
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,190,186.74	-211,484,118.24
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-22,175,778.06	-251,380,199.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	88,655.32	397,735.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	320,634.29	1,164,750.77
股利收益	6.4.7.19	48,956,675.19	38,333,595.76
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	27,414,501.96	305,279,260.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,003,362.26	375,921.75
减：二、营业总支出		9,143,109.02	8,925,425.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,786,629.80	7,318,716.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	973,328.67	914,839.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,311.71	11,407.52
8. 其他费用	6.4.7.23	381,838.84	680,461.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,551,432.76	86,846,966.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,551,432.76	86,846,966.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46,551,432.76	86,846,966.53

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,938,886,391.	-	301,731,585.75	4,240,617,977.4

	67			2
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,938,886,391.67	-	301,731,585.75	4,240,617,977.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-786,956,401.97	-	-17,250,015.08	-804,206,417.05
(一)、综合收益总额	-	-	46,551,432.76	46,551,432.76
(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)	-786,956,401.97	-	-63,801,447.84	-850,757,849.81
其中：1. 基金申购款	354,684,575.48	-	11,850,542.87	366,535,118.35
2. 基金赎回款	-1,141,640,977.45	-	-75,651,990.71	-1,217,292,968.16
(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	3,151,929,989.70	-	284,481,570.67	3,436,411,560.37
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024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	4,596,530,709.07	-	-401,851,019.26	4,194,679,689.81
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,596,530,709.07	-	-401,851,019.26	4,194,679,689.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,049,275,202.83	-	154,908,026.37	-894,367,176.46
(一)、综合收益总额	-	-	86,846,966.53	86,846,966.53
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,049,275,202.83	-	68,061,059.84	-981,214,142.99
其中：1. 基金申购款	376,852,361.55	-	-33,706,285.05	343,146,076.50
2. 基金赎回款	-1,426,127,564.38	-	101,767,344.89	-1,324,360,219.49
(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	3,547,255,506.24	-	-246,942,992.89	3,300,312,513.35

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

基金管理人负责人

金志刚

主管会计工作负责人

李俊佐

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康沪深 300 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[2019]1824 号《关于准予泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 7,158,504,619.00 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 1900636 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,160,604,619.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,100,000.00 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,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《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》,本基金以 2020 年 2 月 12 日为折算日,进行了基金份额折算,折算前基金份额总额为 7,160,604,619.00 份,折算后基金份额总额为 1,744,299,814.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]65 号核准,本基金 1,744,299,814.00 份基金份额于 2020 年 3 月 23 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《泰康沪深 300 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股、备选成份股。为更好地实现投资目标,还可投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、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。本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股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收

申购款等；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人以本基金为目标 ETF，募集成立了泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“泰康沪深 300ETF 联接基金”)。泰康沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 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等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局

证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人

投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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	17,848,904.37
等于：本金	17,846,019.58
加：应计利息	2,884.79
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	17,848,904.37

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	3,355,739,916.55	-	3,419,146,136.13	63,406,219.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,355,739,916.55	-	3,419,146,136.13	63,406,219.58

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	15,910,552.00	-	-	
其中： 股指期货投资	15,910,552.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	15,910,552.00	-	-	

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
IF2509	IF2509	14.00	16,325,400.00	414,848.00
合计				414,848.00
减：可抵销期货暂收款				414,848.00
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	83,325.42

其中：交易所市场	83,325.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,177.14
应付指数使用费	280,264.03
应退替代款	7,517,839.17
合计	7,980,605.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	959,499,814.00	3,938,886,391.67
本期申购	86,400,000.00	354,684,575.48
本期赎回（以“-”号填列）	-278,100,000.00	-1,141,640,977.45
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	767,799,814.00	3,151,929,989.70

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	873,950,294.48	-572,218,708.73	301,731,585.75
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	873,950,294.48	-572,218,708.73	301,731,585.75
本期利润	19,136,930.80	27,414,501.96	46,551,432.76
本期基金份额交易产生的变动数	-176,530,648.77	112,729,200.93	-63,801,447.84
其中：基金申购款	79,009,655.72	-67,159,112.85	11,850,542.87
基金赎回款	-255,540,304.49	179,888,313.78	-75,651,990.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	716,556,576.51	-432,075,005.84	284,481,570.67

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	39,671.14
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	46,365.67
其他	454.01
合计	86,490.82

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	-44,204,395.93
股票投资收益——赎回差价收入	22,028,617.87
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	-22,175,778.06

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	643,029,725.43
减：卖出股票成本总额	686,683,173.21
减：交易费用	550,948.15
买卖股票差价收入	-44,204,395.93

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,217,292,968.16
减：现金支付赎回款总额	457,482,022.16
减：赎回股票成本总额	737,782,328.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	22,028,617.87

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	47.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	88,607.91
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	88,655.32

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	676,183.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	587,500.00
减：应计利息总额	48.93
减：交易费用	27.04
买卖债券差价收入	88,607.91

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	320,634.29

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	48,956,675.19
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	48,956,675.19

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	27,124,453.96
股票投资	27,124,453.96
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	290,048.00
权证投资	-
期货投资	290,048.00
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	27,414,501.96

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,003,362.26
合计	1,003,362.26

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,397.67
指数使用费	280,264.03
其他	9,916.99
合计	381,838.84

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
泰康沪深 300 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,786,629.80	7,318,716.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	106,533.32	95,134.12
应支付基金管理人的净管理费	7,680,096.48	7,223,582.49

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} * 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	973,328.67	914,839.63

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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
泰康沪深300 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金	15,819,286.00	2.0603	22,378,786.00	2.3323

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		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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	17,848,904.37	39,671.14	11,032,450.00	40,403.17

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有 2,029,712 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 77,735,472.99 元，估值总额为人民币 93,265,266.40 元，占基金资产净值的比例为 2.71% (上年度末，本基金持有 2,534,812 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 96,377,528.27 元，估值总额为人民币 99,618,111.60 元，占基金资产净值的比例为 2.35%)。

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
001335	信	2025	6个月	新	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

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

	麒 绒 材	年 5 月 21 日		股 锁 定 期 流 通 受 限						
001395	亚 联 机 械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓 恬 冠 佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉 朔 科 技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301479	弘 景 光 电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-

301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定期流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定期流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定期流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定期流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-

				限						
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股锁定期流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定期流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定期流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股锁定期流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定期流通	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

				受限						
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股锁定期流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股锁定期流通受限	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股锁定期流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股锁定期流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股锁定期流	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-

				通受限						
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股锁定期流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股锁定期流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股锁定期流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603260	合盛硅业	2025年3月12日	6个月	大宗交易流通受限	51.43	46.29	50,000	2,571,500.00	2,314,500.00	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股锁定期流	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-

				通受限						
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股锁定期流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股锁定期流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股锁定期流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股锁定期流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股锁定期	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-

				流通受限						
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股锁定期流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股锁定期流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股锁定期流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

注：1、截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股

上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

5、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

根据弘景光电 2024 年年度权益分派实施公告，以公司总股本 6,354.6667 万股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 15 元（含税），每 10 股转增 4 股。除权除息日为 2025 年 5 月 28 日，本基金所持有的弘景光电获得转增股 52 股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币型市场基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括标的成分股、备选成份股以及经中国证监会核准发行的股票、债券和货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持

一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	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。

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 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、存出保证金、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	17,848,904.37	-	-	-	17,848,904.37
结算备付金	6,964,957.67	-	-	-	6,964,957.67
存出保证金	2,173,306.81	-	-	-	2,173,306.81
交易性金融资产	-	-	-	3,419,146,136.13	3,419,146,136.13
应收清算款	-	-	-	871,473.59	871,473.59
资产总计	26,987,168.85	-	-	3,420,017,609.72	3,447,004,778.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,169,123.41	1,169,123.41
应付托管费	-	-	-	146,140.41	146,140.41
应付清算款	-	-	-	1,297,348.62	1,297,348.62
其他负债	-	-	-	7,980,605.76	7,980,605.76
负债总计	-	-	-	10,593,218.20	10,593,218.20
利率敏感度缺口	26,987,168.85	-	-	3,409,424,391.52	3,436,411,560.37
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	10,877,137.93	-	-	-	10,877,137.93
结算备付金	10,077,462.03	-	-	-	10,077,462.03
存出保证金	2,186,489.34	-	-	-	2,186,489.34
交易性金融资产	-	-	-	4,220,655,132.45	4,220,655,132.45
应收清算款	-	-	-	4,514,551.01	4,514,551.01
资产总计	23,141,089.30	-	-	4,225,169,683.	4,248,310,772.76

				46	
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,387,506.76	1,387,506.76
应付托管费	-	-	-	173,438.33	173,438.33
应交税费	-	-	-	43,026.92	43,026.92
其他负债	-	-	-	6,088,823.33	6,088,823.33
负债总计	-	-	-	7,692,795.34	7,692,795.34
利率敏感度缺口	23,141,089.30	-	-	4,217,476,888.12	4,240,617,977.42

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变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率下调 0.25%	0.00	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,419,146,136.13	99.50	4,220,655,132.45	99.53
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	3,419,146,136.13	99.50	4,220,655,132.45	99.53

6.4.13.4.3.2 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6月30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%	171,074,817.19	214,919,011.68
	业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-171,074,817.19	-214,919,011.68

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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	3,416,359,884.38	4,213,457,403.27
第二层次	15,385.54	6,639,812.50
第三层次	2,770,866.21	557,916.68
合计	3,419,146,136.13	4,220,655,132.45

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。

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

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 366,535,118.35 元(上年度可比期间：343,146,076.50 元)，其中包括以股票支付的申购款 226,120,124.81 元和以现金支付的申购款 140,414,993.54 元(上年度可比期间：其中包括以股票支付的申购款 210,874,135.00 元和以现金支付的申购款 132,271,941.50 元)。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,419,146,136.13	99.19
	其中：股票	3,419,146,136.13	99.19
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	24,813,862.04	0.72
8	其他各项资产	3,044,780.40	0.09
9	合计	3,447,004,778.57	100.00

注：（1）本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	33,761,368.35	0.98
B	采矿业	171,041,201.61	4.98
C	制造业	1,713,047,126.84	49.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,691,407.88	3.60
E	建筑业	64,232,462.06	1.87
F	批发和零售业	8,258,232.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	120,367,236.69	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	162,110,137.73	4.72
J	金融业	919,578,887.73	26.76

K	房地产业	25,251,204.96	0.73
L	租赁和商务服务业	31,164,341.12	0.91
M	科学研究和技术服务业	36,610,090.64	1.07
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	9,552,017.28	0.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,418,665,714.89	99.48

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	463,677.88	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,499.36	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	480,421.24	0.01
--	----	------------	------

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	103,309	145,616,101.68	4.24
2	300750	宁德时代	433,335	109,295,753.70	3.18
3	601318	中国平安	1,764,549	97,897,178.52	2.85
4	600036	招商银行	2,029,712	93,265,266.40	2.71
5	601166	兴业银行	2,724,783	63,596,435.22	1.85
6	600900	长江电力	2,005,458	60,444,504.12	1.76
7	000333	美的集团	806,039	58,196,015.80	1.69
8	601899	紫金矿业	2,699,900	52,648,050.00	1.53
9	002594	比亚迪	148,142	49,169,811.22	1.43
10	300059	东方财富	2,073,516	47,960,425.08	1.40
11	600030	中信证券	1,600,770	44,213,267.40	1.29
12	601398	工商银行	5,746,500	43,615,935.00	1.27
13	600276	恒瑞医药	731,508	37,965,265.20	1.10
14	000858	五粮液	317,972	37,806,870.80	1.10
15	601211	国泰海通	1,852,824	35,500,107.84	1.03
16	601328	交通银行	4,374,500	34,996,000.00	1.02
17	000651	格力电器	734,527	32,994,952.84	0.96
18	601288	农业银行	5,235,400	30,784,152.00	0.90
19	600887	伊利股份	1,037,064	28,913,344.32	0.84
20	002475	立讯精密	831,395	28,841,092.55	0.84
21	600919	江苏银行	2,409,300	28,767,042.00	0.84
22	688981	中芯国际	326,000	28,743,420.00	0.84
23	603259	药明康德	410,048	28,518,838.40	0.83
24	601816	京沪高铁	4,814,000	27,680,500.00	0.81
25	600000	浦发银行	1,925,172	26,721,387.36	0.78
26	000725	京东方 A	6,023,900	24,035,361.00	0.70
27	002371	北方华创	52,053	23,018,357.13	0.67
28	300760	迈瑞医疗	99,682	22,403,529.50	0.65
29	601088	中国神华	541,425	21,949,369.50	0.64
30	688041	海光信息	152,200	21,504,338.00	0.63
31	300308	中际旭创	145,340	21,199,292.40	0.62
32	601601	中国太保	561,000	21,043,110.00	0.61
33	688256	寒武纪	34,700	20,872,050.00	0.61
34	300502	新易盛	162,600	20,653,452.00	0.60

35	300124	汇川技术	308,695	19,932,436.15	0.58
36	601728	中国电信	2,545,900	19,730,725.00	0.57
37	601668	中国建筑	3,390,000	19,560,300.00	0.57
38	600016	民生银行	4,070,800	19,336,300.00	0.56
39	002352	顺丰控股	394,277	19,224,946.52	0.56
40	000001	平安银行	1,591,872	19,213,895.04	0.56
41	002714	牧原股份	448,575	18,844,635.75	0.55
42	002230	科大讯飞	379,338	18,162,703.44	0.53
43	601127	赛力斯	133,500	17,931,720.00	0.52
44	603501	豪威集团	139,016	17,745,392.40	0.52
45	600031	三一重工	973,972	17,482,797.40	0.51
46	601229	上海银行	1,632,334	17,319,063.74	0.50
47	000063	中兴通讯	528,600	17,174,214.00	0.50
48	603019	中科曙光	239,540	16,863,616.00	0.49
49	002415	海康威视	605,659	16,794,924.07	0.49
50	600309	万华化学	308,523	16,740,457.98	0.49
51	600941	中国移动	147,700	16,623,635.00	0.48
52	601169	北京银行	2,428,000	16,583,240.00	0.48
53	300274	阳光电源	237,881	16,121,195.37	0.47
54	601857	中国石油	1,858,700	15,891,885.00	0.46
55	601919	中远海控	1,033,892	15,549,735.68	0.45
56	688008	澜起科技	187,900	15,407,800.00	0.45
57	600690	海尔智家	615,220	15,245,151.60	0.44
58	600660	福耀玻璃	262,742	14,978,921.42	0.44
59	601688	华泰证券	839,400	14,949,714.00	0.44
60	601012	隆基绿能	994,250	14,933,635.00	0.43
61	300498	温氏股份	873,345	14,916,732.60	0.43
62	002142	宁波银行	542,089	14,831,555.04	0.43
63	600406	国电南瑞	658,364	14,753,937.24	0.43
64	600809	山西汾酒	79,841	14,083,153.99	0.41
65	601766	中国中车	1,993,330	14,033,043.20	0.41
66	601138	工业富联	651,300	13,924,794.00	0.41
67	603986	兆易创新	109,122	13,807,206.66	0.40
68	000568	泸州老窖	121,122	13,735,234.80	0.40
69	600050	中国联通	2,562,800	13,685,352.00	0.40
70	000338	潍柴动力	888,600	13,666,668.00	0.40
71	600028	中国石化	2,392,220	13,492,120.80	0.39
72	000100	TCL 科技	3,080,730	13,339,560.90	0.39
73	688012	中微公司	72,700	13,253,210.00	0.39
74	601988	中国银行	2,344,400	13,175,528.00	0.38
75	601006	大秦铁路	1,981,801	13,079,886.60	0.38
76	600926	杭州银行	754,500	12,690,690.00	0.37
77	601818	光大银行	3,041,000	12,620,150.00	0.37

78	601985	中国核电	1,347,500	12,558,700.00	0.37
79	601225	陕西煤业	635,700	12,230,868.00	0.36
80	600104	上汽集团	759,200	12,185,160.00	0.35
81	002027	分众传媒	1,657,700	12,101,210.00	0.35
82	600150	中国船舶	367,100	11,945,434.00	0.35
83	601628	中国人寿	273,743	11,275,474.17	0.33
84	601009	南京银行	966,123	11,226,349.26	0.33
85	605499	东鹏饮料	34,680	10,891,254.00	0.32
86	688111	金山办公	38,500	10,781,925.00	0.31
87	600999	招商证券	609,680	10,724,271.20	0.31
88	603288	海天味业	274,095	10,665,036.45	0.31
89	600760	中航沈飞	181,132	10,617,957.84	0.31
90	688271	联影医疗	82,300	10,513,002.00	0.31
91	000425	徐工机械	1,348,342	10,476,617.34	0.30
92	000792	盐湖股份	608,400	10,391,472.00	0.30
93	601939	建设银行	1,100,000	10,384,000.00	0.30
94	000625	长安汽车	813,765	10,383,641.40	0.30
95	600111	北方稀土	415,300	10,340,970.00	0.30
96	600938	中国海油	391,600	10,224,676.00	0.30
97	600905	三峡能源	2,347,300	9,999,498.00	0.29
98	601658	邮储银行	1,806,800	9,883,196.00	0.29
99	600089	特变电工	827,300	9,869,689.00	0.29
100	600436	片仔癀	48,987	9,797,889.87	0.29
101	300033	同花顺	35,815	9,777,853.15	0.28
102	601888	中国中免	159,896	9,748,859.12	0.28
103	002050	三花智控	367,510	9,694,913.80	0.28
104	603993	洛阳钼业	1,151,200	9,693,104.00	0.28
105	300015	爱尔眼科	765,386	9,552,017.28	0.28
106	600048	保利发展	1,178,883	9,548,952.30	0.28
107	600547	山东黄金	297,077	9,485,668.61	0.28
108	600019	宝钢股份	1,439,400	9,485,646.00	0.28
109	601390	中国中铁	1,682,600	9,439,386.00	0.27
110	002463	沪电股份	220,500	9,388,890.00	0.27
111	002241	歌尔股份	400,844	9,347,682.08	0.27
112	600415	小商品城	450,400	9,314,272.00	0.27
113	300014	亿纬锂能	201,850	9,246,748.50	0.27
114	601825	沪农商行	947,700	9,192,690.00	0.27
115	601600	中国铝业	1,300,000	9,152,000.00	0.27
116	601989	中国重工	1,869,804	8,675,890.56	0.25
117	000977	浪潮信息	169,128	8,605,232.64	0.25
118	600585	海螺水泥	393,059	8,438,976.73	0.25
119	002179	中航光电	209,072	8,438,145.92	0.25
120	600893	航发动力	218,360	8,415,594.40	0.24

121	601916	浙商银行	2,474,200	8,387,538.00	0.24
122	601838	成都银行	416,700	8,375,670.00	0.24
123	600570	恒生电子	248,013	8,318,356.02	0.24
124	600958	东方证券	857,604	8,301,606.72	0.24
125	603799	华友钴业	223,119	8,259,865.38	0.24
126	600015	华夏银行	1,042,800	8,248,548.00	0.24
127	000776	广发证券	484,500	8,144,445.00	0.24
128	000538	云南白药	145,757	8,131,783.03	0.24
129	601336	新华保险	136,050	7,958,925.00	0.23
130	002311	海大集团	135,797	7,956,346.23	0.23
131	600584	长电科技	234,578	7,902,932.82	0.23
132	000938	紫光股份	327,699	7,861,499.01	0.23
133	002028	思源电气	102,500	7,473,275.00	0.22
134	600438	通威股份	443,700	7,431,975.00	0.22
135	000166	申万宏源	1,476,600	7,412,532.00	0.22
136	601998	中信银行	868,714	7,384,069.00	0.21
137	002049	紫光国微	111,740	7,359,196.40	0.21
138	300408	三环集团	219,233	7,322,382.20	0.21
139	300433	蓝思科技	326,686	7,285,097.80	0.21
140	601077	渝农商行	1,014,400	7,242,816.00	0.21
141	000002	万科 A	1,118,200	7,178,844.00	0.21
142	600795	国电电力	1,459,200	7,062,528.00	0.21
143	601377	兴业证券	1,132,460	7,009,927.40	0.20
144	600489	中金黄金	476,800	6,975,584.00	0.20
145	601669	中国电建	1,414,633	6,889,262.71	0.20
146	601995	中金公司	192,000	6,789,120.00	0.20
147	601689	拓普集团	142,255	6,721,548.75	0.20
148	600010	包钢股份	3,709,000	6,639,110.00	0.19
149	002422	科伦药业	183,500	6,591,320.00	0.19
150	600009	上海机场	205,045	6,514,279.65	0.19
151	002304	洋河股份	99,200	6,403,360.00	0.19
152	601100	恒立液压	88,188	6,349,536.00	0.18
153	600160	巨化股份	221,300	6,346,884.00	0.18
154	002460	赣锋锂业	185,539	6,265,652.03	0.18
155	000768	中航西飞	227,586	6,222,201.24	0.18
156	601881	中国银河	355,904	6,103,753.60	0.18
157	300394	天孚通信	76,400	6,099,776.00	0.18
158	601186	中国铁建	755,900	6,054,759.00	0.18
159	688036	传音控股	75,800	6,041,260.00	0.18
160	600183	生益科技	200,100	6,033,015.00	0.18
161	002252	上海莱士	869,300	5,972,091.00	0.17
162	000157	中联重科	814,600	5,889,558.00	0.17
163	601360	三六零	573,400	5,848,680.00	0.17

164	600989	宝丰能源	360,400	5,816,856.00	0.17
165	000963	华东医药	143,700	5,799,732.00	0.17
166	600886	国投电力	392,988	5,792,643.12	0.17
167	002074	国轩高科	178,100	5,781,126.00	0.17
168	601788	光大证券	319,800	5,750,004.00	0.17
169	601058	赛轮轮胎	431,300	5,658,656.00	0.16
170	600115	中国东航	1,401,600	5,648,448.00	0.16
171	300442	润泽科技	113,000	5,596,890.00	0.16
172	000408	藏格矿业	128,500	5,483,095.00	0.16
173	002736	国信证券	473,356	5,453,061.12	0.16
174	000807	云铝股份	340,400	5,439,592.00	0.16
175	002466	天齐锂业	169,617	5,434,528.68	0.16
176	600066	宇通客车	217,300	5,402,078.00	0.16
177	688169	石头科技	34,500	5,400,975.00	0.16
178	002001	新和成	252,660	5,374,078.20	0.16
179	601901	方正证券	676,900	5,354,279.00	0.16
180	600426	华鲁恒升	242,900	5,263,643.00	0.15
181	600196	复星医药	209,600	5,258,864.00	0.15
182	000661	长春高新	53,000	5,256,540.00	0.15
183	600029	南方航空	882,600	5,207,340.00	0.15
184	001979	招商蛇口	593,058	5,201,118.66	0.15
185	000975	山金国际	274,300	5,195,242.00	0.15
186	601800	中国交建	582,715	5,180,336.35	0.15
187	600011	华能国际	720,600	5,145,084.00	0.15
188	002236	大华股份	323,822	5,142,293.36	0.15
189	300661	圣邦股份	70,460	5,127,374.20	0.15
190	301236	软通动力	93,800	5,125,232.00	0.15
191	600674	川投能源	318,400	5,107,136.00	0.15
192	601066	中信建投	211,800	5,093,790.00	0.15
193	688126	沪硅产业	270,700	5,067,504.00	0.15
194	600346	恒力石化	345,800	4,931,108.00	0.14
195	601878	浙商证券	451,300	4,923,683.00	0.14
196	601111	中国国航	616,414	4,863,506.46	0.14
197	300418	昆仑万维	143,400	4,822,542.00	0.14
198	603369	今世缘	123,618	4,812,448.74	0.14
199	600372	中航机载	397,500	4,793,850.00	0.14
200	002648	卫星化学	276,360	4,789,318.80	0.14
201	600460	士兰微	191,700	4,757,994.00	0.14
202	601868	中国能建	2,130,100	4,750,123.00	0.14
203	003816	中国广核	1,286,401	4,682,499.64	0.14
204	002916	深南电路	43,155	4,652,540.55	0.14
205	601117	中国化学	603,300	4,627,311.00	0.13
206	002920	德赛西威	45,100	4,606,063.00	0.13

207	600741	华域汽车	258,970	4,570,820.50	0.13
208	601319	中国人保	524,500	4,568,395.00	0.13
209	300347	泰格医药	84,807	4,521,909.24	0.13
210	600176	中国巨石	393,696	4,488,134.40	0.13
211	600588	用友网络	334,929	4,478,000.73	0.13
212	601021	春秋航空	80,400	4,474,260.00	0.13
213	301269	华大九天	36,000	4,459,680.00	0.13
214	002601	龙佰集团	274,920	4,456,453.20	0.13
215	300896	爱美客	25,260	4,415,700.60	0.13
216	601633	长城汽车	204,600	4,394,808.00	0.13
217	600219	南山铝业	1,145,100	4,385,733.00	0.13
218	000786	北新建材	165,518	4,382,916.64	0.13
219	300782	卓胜微	61,100	4,360,707.00	0.13
220	600482	中国动力	184,800	4,263,336.00	0.12
221	600039	四川路桥	427,040	4,227,696.00	0.12
222	302132	中航成飞	47,900	4,212,326.00	0.12
223	000630	铜陵有色	1,256,300	4,196,042.00	0.12
224	000895	双汇发展	171,100	4,176,551.00	0.12
225	688396	华润微	88,400	4,168,944.00	0.12
226	002493	荣盛石化	498,285	4,125,799.80	0.12
227	002129	TCL 中环	529,395	4,065,753.60	0.12
228	600085	同仁堂	112,653	4,062,267.18	0.12
229	001965	招商公路	335,000	4,020,000.00	0.12
230	603296	华勤技术	49,620	4,003,341.60	0.12
231	600600	青岛啤酒	57,532	3,996,172.72	0.12
232	601877	正泰电器	176,150	3,993,320.50	0.12
233	600362	江西铜业	170,300	3,990,129.00	0.12
234	002709	天赐材料	219,496	3,977,267.52	0.12
235	002600	领益智造	460,200	3,953,118.00	0.12
236	688506	百利天恒	13,300	3,938,396.00	0.11
237	300122	智飞生物	196,645	3,852,275.55	0.11
238	603392	万泰生物	61,637	3,759,857.00	0.11
239	600161	天坛生物	195,580	3,753,180.20	0.11
240	002180	纳思达	163,400	3,748,396.00	0.11
241	002938	鹏鼎控股	114,589	3,670,285.67	0.11
242	600233	圆通速递	282,600	3,642,714.00	0.11
243	300832	新产业	64,100	3,635,752.00	0.11
244	000596	古井贡酒	27,200	3,621,680.00	0.11
245	000301	东方盛虹	434,600	3,620,218.00	0.11
246	600188	兖矿能源	294,110	3,579,318.70	0.10
247	300759	康龙化成	145,450	3,569,343.00	0.10
248	688047	龙芯中科	26,600	3,548,174.00	0.10
249	601618	中国中冶	1,175,600	3,503,288.00	0.10

250	600023	浙能电力	660,900	3,502,770.00	0.10
251	000876	新希望	372,708	3,496,001.04	0.10
252	000999	华润三九	110,398	3,453,249.44	0.10
253	688223	晶科能源	658,600	3,418,134.00	0.10
254	600875	东方电气	200,100	3,349,674.00	0.10
255	600515	海南机场	938,500	3,322,290.00	0.10
256	600845	宝信软件	140,544	3,319,649.28	0.10
257	601872	招商轮船	528,200	3,306,532.00	0.10
258	600027	华电国际	600,400	3,284,188.00	0.10
259	601898	中煤能源	298,200	3,262,308.00	0.09
260	002459	晶澳科技	324,980	3,243,300.40	0.09
261	600061	国投资本	418,949	3,150,496.48	0.09
262	688599	天合光能	214,900	3,122,497.00	0.09
263	605117	德业股份	59,087	3,111,521.42	0.09
264	600332	白云山	115,549	3,045,871.64	0.09
265	000617	中油资本	412,300	3,009,790.00	0.09
266	000983	山西焦煤	467,400	2,991,360.00	0.09
267	601799	星宇股份	23,700	2,962,500.00	0.09
268	600918	中泰证券	455,413	2,928,305.59	0.09
269	300316	晶盛机电	107,600	2,921,340.00	0.09
270	300999	金龙鱼	97,700	2,885,081.00	0.08
271	600803	新奥股份	152,600	2,884,140.00	0.08
272	300628	亿联网络	82,635	2,872,392.60	0.08
273	601698	中国卫通	138,000	2,824,860.00	0.08
274	600025	华能水电	294,100	2,808,655.00	0.08
275	603260	合盛硅业	59,100	2,745,840.00	0.08
276	601238	广汽集团	364,200	2,727,858.00	0.08
277	601059	信达证券	158,800	2,715,480.00	0.08
278	300413	芒果超媒	124,011	2,705,920.02	0.08
279	600018	上港集团	456,000	2,603,760.00	0.08
280	601607	上海医药	137,500	2,458,500.00	0.07
281	600026	中远海能	227,500	2,350,075.00	0.07
282	688303	大全能源	107,300	2,287,636.00	0.07
283	603806	福斯特	171,504	2,222,691.84	0.06
284	688472	阿特斯	242,800	2,221,620.00	0.06
285	688009	中国通号	424,400	2,181,416.00	0.06
286	603195	公牛集团	44,203	2,132,794.75	0.06
287	601699	潞安环能	196,900	2,077,295.00	0.06
288	000708	中信特钢	166,100	1,953,336.00	0.06
289	601236	红塔证券	230,120	1,949,116.40	0.06
290	601865	福莱特	125,600	1,910,376.00	0.06
291	688187	时代电气	43,200	1,842,480.00	0.05
292	601136	首创证券	89,500	1,779,260.00	0.05

293	603833	欧派家居	30,480	1,720,596.00	0.05
294	688082	盛美上海	14,700	1,674,918.00	0.05
295	601808	中海油服	97,700	1,344,352.00	0.04
296	300979	华利集团	25,400	1,335,278.00	0.04
297	600377	宁沪高速	81,600	1,251,744.00	0.04
298	000800	一汽解放	159,000	1,090,740.00	0.03
299	001391	国货航	141,086	949,508.78	0.03
300	001289	龙源电力	25,900	419,062.00	0.01

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

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
4	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
5	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
6	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
9	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
10	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
11	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
12	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
13	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
14	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
15	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
16	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
17	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
18	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
19	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
20	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
21	603194	中力股份	191	8,669.49	0.00
22	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
23	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
24	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
25	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
26	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
27	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
28	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
29	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
30	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00

31	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
32	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
33	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
34	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
35	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
36	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
37	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
38	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰海通	26,090,339.12	0.62
2	300750	宁德时代	13,381,742.00	0.32
3	601825	沪农商行	9,939,249.00	0.23
4	601166	兴业银行	9,068,042.00	0.21
5	601058	赛轮轮胎	8,839,688.00	0.21
6	002371	北方华创	8,430,984.00	0.20
7	002594	比亚迪	8,199,953.00	0.19
8	000333	美的集团	7,900,817.00	0.19
9	601077	渝农商行	7,801,778.00	0.18
10	000858	五粮液	6,371,721.00	0.15
11	002230	科大讯飞	6,166,234.00	0.15
12	300059	东方财富	5,888,208.39	0.14
13	301236	软通动力	5,289,180.00	0.12
14	601328	交通银行	4,864,653.00	0.11
15	000651	格力电器	4,864,482.00	0.11
16	302132	中航成飞	4,519,131.00	0.11
17	002475	立讯精密	4,314,121.00	0.10
18	002600	领益智造	4,048,626.00	0.10
19	601006	大秦铁路	3,920,840.00	0.09
20	688047	龙芯中科	3,408,431.12	0.08

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	40,571,604.00	0.96

2	600837	海通证券	23,358,123.12	0.55
3	002594	比亚迪	22,467,324.56	0.53
4	000333	美的集团	21,773,334.73	0.51
5	300059	东方财富	17,543,031.00	0.41
6	000858	五粮液	16,655,905.40	0.39
7	002371	北方华创	14,542,982.00	0.34
8	000651	格力电器	12,741,019.25	0.30
9	300124	汇川技术	11,973,061.98	0.28
10	002475	立讯精密	11,952,901.80	0.28
11	000725	京东方 A	9,687,595.00	0.23
12	600519	贵州茅台	8,932,703.00	0.21
13	300760	迈瑞医疗	8,467,064.21	0.20
14	601988	中国银行	8,155,140.00	0.19
15	688256	寒武纪	7,235,338.48	0.17
16	000001	平安银行	7,102,250.00	0.17
17	002352	顺丰控股	7,034,382.00	0.17
18	300308	中际旭创	6,995,497.00	0.16
19	002415	海康威视	6,893,042.50	0.16
20	000063	中兴通讯	6,886,116.00	0.16

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	369,711,926.25
卖出股票收入（成交）总额	643,029,725.43

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

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

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,173,306.81
2	应收清算款	871,473.59
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	3,044,780.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定期流通受限
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期流通受限
3	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定期流通受限
4	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股锁定期流通受限
5	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	新股锁定期流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
5,332	143,998.46	736,762,783.00	95.96	31,037,031.00	4.04

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“招商银行股份有限公司—泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金”持有的份额。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
招商银行股份有限公司-泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	15,819,286.00	2.06

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	泰康人寿保险有限责任公司—个人分红产品	525,108,066.00	68.39
2	泰康人寿保险有限责任公司—传统保险产品	118,233,147.00	15.40
3	中国平安人寿保险股份有限公司—寿险传统低—自主	13,286,200.00	1.73
4	申万宏源证券有限公司	11,654,300.00	1.52
5	中国国际金融股份有限公司	7,223,000.00	0.94
6	友邦人寿保险有限公司—分红	6,664,000.00	0.87
7	中邮证券有限责任公司	6,200,000.00	0.81
8	友邦人寿保险有限公司—投连优选平衡	4,915,000.00	0.64
9	友邦人寿保险有限公司—传统	4,442,400.00	0.58

10	国贸期货有限公司	3,641,200.00	0.47
11	招商银行股份有限公司—泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	15,819,286.00	2.06

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年12月27日） 基金份额总额	7,160,604,619.00
本报告期期初基金份额总额	959,499,814.00
本报告期基金总申购份额	86,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	278,100,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	767,799,814.00

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。

§ 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

自 2025 年 1 月 17 日起，本基金改聘审计服务机构，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已履行相关程序。

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 (%)	
东方证券	2	421,886,132.00	43.76	78,448.03	43.76	-
浙商证券	2	416,916,320.74	43.24	77,530.46	43.25	-

华泰证券	2	125,307,534.28	13.00	23,296.50	12.99	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

租用协议券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

（一）合规风控能力较强，经营行为规范，近一年内无重大违规行为及风险事件，未受监管机构重大处罚；

（二）财务状况和经营状况良好；

（三）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；

（四）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据公司各类资产管理产品（以下简称“产品”）投资需求提供专门的研究报告；

（五）能及时提供准确的信息资讯服务；

（六）满足产品运作的保密要求；

（七）有较强的交易能力；

（八）符合中国证监会规定的其他条件。

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	676,183.88	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 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	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海证券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（1）	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月18日
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1月18日
3	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第四季度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月21日
4	关于泰康基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	《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3月19日
5	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同更新	《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3月21日

6	泰康沪深 300 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 3 月 21 日
7	泰康沪深 300 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 3 月 21 日
8	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
9	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 3 月 29 日
10	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一季度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 21 日
11	泰康基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 5 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101-20250630	525,108,066.00	0.00	0.00	525,108,066.00	68.39
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

泰康基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日