

泰康中证 500 指数增强型发起式  
证券投资基金  
2025 年第 4 季度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：恒丰银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 1 月 21 日

## §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责任。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 10 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 泰康中证 500 指数增强发起  |
| 基金主代码      | 018116   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2023 年 8 月 17 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 17,163,231.82 份  |
| 投资目标       | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求控制本基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。  |
| 投资策略       | 本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对中证 500 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。指数化被动投资策略参照标的指数的成份券、备选成份券及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整，力求控制本基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>7.75%。量化增强投资策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。根据模型结果基金管理人结合市场环境进行组合投资。在正常的市场情况下，本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将持续追踪 A 股市场和港股市场的相对估值和市场情况，适时调整组合中港股通标的股票的投资比例。当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金可投资存托凭证，在控制风险的前提下，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择具有比较优势的存托凭证进行投资。出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。本基金通过对资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素的研究，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资。在股指期货投资上，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金本着谨慎原则适度参与国债期货投资，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。</p> <p>本基金投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，</p> |
|--|---|

|                 |  |                   |
|-----------------|--|-------------------|
|                 | <p>对交易对手方、创设机构的财务状况、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。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，确定投资决策。本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，并适当控制债券投资组合整体的久期，防范流动性风险。</p> <p>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。为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> |                   |
| 业绩比较基准          | 中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%   |                   |
| 风险收益特征          | 本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。  |                   |
| 基金管理人           | 泰康基金管理有限公司   |                   |
| 基金托管人           | 恒丰银行股份有限公司   |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 泰康中证 500 指数增强发起 A  | 泰康中证 500 指数增强发起 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 018116   | 018117            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 12,742,245.11 份  | 4,420,986.71 份    |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标     | 报告期（2025 年 10 月 1 日-2025 年 12 月 31 日） |                   |
|------------|---------------------------------------|-------------------|
|            | 泰康中证 500 指数增强发起 A                     | 泰康中证 500 指数增强发起 C |
| 1. 本期已实现收益 | 1,561,263.86                          | 553,228.73        |
| 2. 本期利润    | 231,396.72                            | 53,235.95         |

|                 |               |              |
|-----------------|---------------|--------------|
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0169        | 0.0108       |
| 4. 期末基金资产净值     | 17,598,743.68 | 6,047,964.38 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3811        | 1.3680       |

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）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康中证 500 指数增强发起 A

| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.57%  | 1.11%         | 0.71%          | 1.18%                 | 0.86%  | -0.07% |
| 过去六个月          | 25.75% | 1.06%         | 24.81%         | 1.11%                 | 0.94%  | -0.05% |
| 过去一年           | 32.75% | 1.17%         | 28.81%         | 1.20%                 | 3.94%  | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 38.11% | 1.36%         | 26.85%         | 1.41%                 | 11.26% | -0.05% |

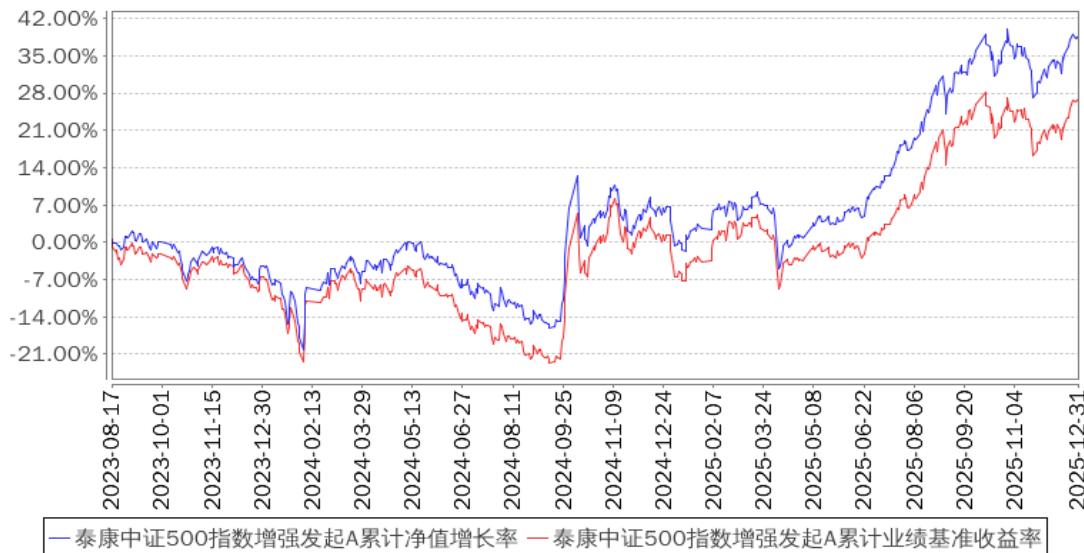
泰康中证 500 指数增强发起 C

| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 1.46%  | 1.11%         | 0.71%          | 1.18%                 | 0.75% | -0.07% |
| 过去六个月          | 25.49% | 1.06%         | 24.81%         | 1.11%                 | 0.68% | -0.05% |
| 过去一年           | 32.21% | 1.17%         | 28.81%         | 1.20%                 | 3.40% | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 36.80% | 1.36%         | 26.85%         | 1.41%                 | 9.95% | -0.05% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

泰康中证500指数增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势  
对比图



泰康中证500指数增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势  
对比图



注：1、本基金基金合同于2023年08月17日生效。

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

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|----------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期           | 离任日期 |        |   |
| 袁帅 | 本基金基金经理 | 2025 年 2 月 7 日 | -    | 7 年    | 袁帅，硕士研究生。2018 年 6 月加入泰康公募，现任泰康基金量化基金经理。2024 年 6 月 7 日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金管理人。2024 年 6 月 7 日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金管理人。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金管理人。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金管理人。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金管理人。2025 年 6 月 30 日至今担任泰康上证科创板综合指数增强型证券投资基金管理人。2025 年 10 月 28 日至今担任泰康沪深 300 指数增强型证券投资基金管理人。 |

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 公平交易专项说明

##### 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，没有出现本基金管理人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 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，四季度内需的经济动能有所减弱，投资与消费均呈现类似趋势。不过，由于 2025 年全年 GDP 增长目标实现压力不大，市场关注点已逐步转为对 2026 年政策规划及经济增长前景的预期，对短期数据的敏感度下降。与此同时，出口延续高景气态势，物价自低位持续回升，这两大因素增强了市场对宏观经济持相对乐观态度的信心。

权益市场方面，2025 年第四季度 A 股权益市场呈现结构性分化格局。从主要指数看，上证指数上涨 2.22%，沪深 300 微跌 0.23%，创业板指下跌 1.08%。港股方面，恒生科技指数大幅回落 14.69%，恒生指数下跌 4.56%。行业表现方面，周期与高端制造板块表现突出，有色金属以 16.25% 的涨幅领跑，石油石化、通信、国防军工和轻工制造紧随其后；医药生物、房地产、美容护理等板块表现不佳。

投资操作方面，在本期，本基金采用量化投资的方法，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。展望后市操作方面，继续以多因子选股框架为核心，以事件驱动策略为辅，并通过 AI 模型进一步加强选股策略表现。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.3811 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 1.57%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.3680 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为 1.46%；同期业绩比较基准增长率为 0.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金且截至本报告期末，合同生效不满三年，不适用《公开募集证券投资基金管理办法》第四十一条的披露规定。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目    | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资  | 20,823,943.80 | 87.88        |
|    | 其中：股票 | 20,823,943.80 | 87.88        |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -             | -      |
| 3 | 固定收益投资            | -             | -      |
|   | 其中：债券             | -             | -      |
|   | 资产支持证券            | -             | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -             | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 2,682,420.25  | 11.32  |
| 8 | 其他资产              | 188,211.14    | 0.79   |
| 9 | 合计                | 23,694,575.19 | 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。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 940,542.00    | 3.98         |
| C  | 制造业              | 12,112,058.80 | 51.22        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 672,047.00    | 2.84         |
| E  | 建筑业              | 125,610.00    | 0.53         |
| F  | 批发和零售业           | 499,331.00    | 2.11         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 228,528.00    | 0.97         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,655,526.00  | 7.00         |
| J  | 金融业              | 1,151,427.00  | 4.87         |
| K  | 房地产业             | 235,012.00    | 0.99         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 116,790.00    | 0.49         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 112,382.00    | 0.48         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 9,504.00      | 0.04         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 108,000.00    | 0.46         |
| S  | 综合               | 183,926.00    | 0.78         |
|    | 合计               | 18,150,683.80 | 76.76        |

### 5.2.2 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              | 171,465.00   | 0.73         |
| C  | 制造业              | 1,605,735.00 | 6.79         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 103,345.00   | 0.44         |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | 108,747.00   | 0.46         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 11,160.00    | 0.05         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 371,829.00   | 1.57         |
| J  | 金融业              | 9,100.00     | 0.04         |
| K  | 房地产业             | 144,639.00   | 0.61         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 135,564.00   | 0.57         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |
| 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               | 11,676.00    | 0.05         |
|    | 合计               | 2,673,260.00 | 11.30        |

### 5.2.3 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 300450 | 先导智能 | 4,700  | 234,906.00 | 0.99         |
| 2  | 300857 | 协创数据 | 1,300  | 219,284.00 | 0.93         |
| 3  | 002558 | 巨人网络 | 5,000  | 216,450.00 | 0.92         |
| 4  | 600988 | 赤峰黄金 | 6,700  | 209,308.00 | 0.89         |
| 5  | 002156 | 通富微电 | 5,400  | 203,580.00 | 0.86         |
| 6  | 601168 | 西部矿业 | 7,300  | 201,772.00 | 0.85         |
| 7  | 600096 | 云天化  | 6,000  | 200,460.00 | 0.85         |
| 8  | 002340 | 格林美  | 23,700 | 198,132.00 | 0.84         |

|    |        |      |       |            |      |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 9  | 600549 | 厦门钨业 | 4,800 | 197,088.00 | 0.83 |
| 10 | 301308 | 江波龙  | 800   | 195,872.00 | 0.83 |

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。

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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  | 002048 | 宁波华翔 | 3,500  | 110,110.00 | 0.47         |
| 2  | 600210 | 紫江企业 | 14,600 | 107,310.00 | 0.45         |
| 3  | 601138 | 工业富联 | 1,700  | 105,485.00 | 0.45         |
| 4  | 600100 | 同方股份 | 11,700 | 104,364.00 | 0.44         |
| 5  | 601360 | 三六零  | 9,200  | 102,764.00 | 0.43         |

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。

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元)      | 公允价值变动(元) | 风险说明      |
|-------------------|--------|----------|--------------|-----------|-----------|
| IC2603            | IC2603 | 1        | 1,473,320.00 | 76,240.00 | -         |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |          |              |           | 76,240.00 |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |          |              |           | 21,136.53 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |          |              |           | 28,640.00 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 本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

赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年受到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局警示并记入证券期货市场诚信档。

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。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 176,798.40 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 11,412.74  |
| 6  | 其他应收款   | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 7 | 其他 | -          |
| 8 | 合计 | 188,211.14 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告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。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 泰康中证 500 指数增强发起 A | 泰康中证 500 指数增强发起 C |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 14,703,727.33     | 5,123,824.50      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 859,358.68        | 1,989,869.41      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,820,840.90      | 2,692,707.20      |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                 | -                 |
| 报告期期末基金份额总额               | 12,742,245.11     | 4,420,986.71      |

注：报告期内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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金管理人股东     | 10,002,833.61 | 58.28           | 10,002,833.61 | 58.28           | 3 年        |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | -          |
| 合计          | 10,002,833.61 | 58.28           | 10,002,833.61 | 58.28           | -          |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20251001<br>- 20251231   | 10,002,833.61 | 0.00 | 0.00 | 10,002,833.61 | 58.28    |
| 个人   | -              | -                        | -             | -    | -    | -             | -        |
| 产品特有风险   |                |                          |               |      |      |               |          |
| 当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20% 时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。 |                |                          |               |      |      |               |          |

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；

- (三) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》;
- (四) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》;
- (五) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金产品资料概要》。

## 10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

## 10.3 查阅方式

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

泰康基金管理有限公司

2026 年 1 月 21 日