

泰康中证 A500 交易型开放式指数 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 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、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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	11
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	12
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70

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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70
§ 8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
§ 9 开放式基金份额变动.....	74
§ 10 重大事件揭示.....	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	75
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	75
10.8 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 12 备查文件目录.....	82
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 A500
场内简称	中证 A500ETF 泰康
基金主代码	560510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 27 日
基金管理人	泰康基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,420,026,938.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	张姗
	联系电话	010-89620366	400-61-95555
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	400-61-95555
传真		010-89620100	0755-83195201
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 4 至 5 层 1-14 内 5 层 501	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 B 座 5、6 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100031	518040
法定代表人		金志刚	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	322,731,267.32
本期利润	413,686,116.62
加权平均基金份额本期利润	0.1542
本期加权平均净值利润率	12.57%
本期基金份额净值增长率	13.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	453,065,488.39
期末可供分配基金份额利润	0.1872
期末基金资产净值	3,185,043,871.03
期末基金份额净值	1.3161
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	34.88%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.28%	1.40%	14.26%	1.41%	1.02%	-0.01%
过去六个月	13.20%	1.28%	11.91%	1.29%	1.29%	-0.01%
过去一年	39.38%	1.14%	36.38%	1.14%	3.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	34.88%	1.17%	53.88%	1.33%	-19.00%	-0.16%

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

中证A500累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2024 年 09 月 27 日生效。

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

3.3 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 2026 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 93 只证券投资基金。旗下产品已形成了包括货币、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，旗下公募基金覆盖沪深 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的投资选择。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏军	本基金基金经理、量化投资部负责人	2024 年 9 月 27 日	—	18 年	魏军，博士研究生。2019 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人、量化基金经理。曾历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理等职务。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 27 日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 6 日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022

					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 2026 年 7 月 10 日担任泰康中证科创创业 50 指数型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 17 日至 2025 年 2 月 7 日担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 26 日至 2025 年 2 月 7 日担任泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 11 月 3 日至 2024 年 10 月 12 日担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 31 日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2024 年 3 月 15 日至今担任泰康中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 29 日担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 9 月 27 日至今担任泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 10 月 29 日至今担任泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025 年 1 月 17 日至今担任泰康中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2026 年 1 月 27 日至今担任泰康中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 9 日至今担任泰康中证全指电力公用事业指数型证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 23 日至今担任泰康中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险

的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，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

上半年宏观经济结构分化特征显著：出口增速持续抬升，科技产业营收与利润持续向好；但内需端消费、投资进一步下滑，这种现象一方面源于经济周期仍处于底部筑底阶段，另一方面受国补同比退坡、财政投放节奏调整等阶段性因素拖累。受有色金属、国际油价及 AI 产业链价格上行带动，PPI 同比显著回升，推动 GDP 平减指数由负转正。总体来看，实际 GDP 增速维持低位、名义增速边际修复、行业结构分化持续加深，是上半年的主要特征。

权益市场方面，2026 年上半年整体呈现显著分化格局。从大盘指数整体表现上来看，上半年上证指数上涨 3.16%，创业板指上涨 35.58%，科创综指上涨 53.99%，恒生指数下跌 10.73%。A 股主要指数中，科创综指表现最为亮眼，创业板指紧随其后，而港股表现相对疲弱。申万一级行业表现来看，电子、通信、建筑材料、机械设备等行业表现相对较好，其中电子涨幅 86.29%，通信上涨 73.59%，建筑材料上涨 46.26%，机械设备上涨 22.60%。表现相对落后的行业方面，商贸零售、农林牧渔、美容护理等行业跌幅居前。

具体投资上，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内跟踪误差主要来自基金份额的申购和赎回、指数成分股调整。报告期内，跟踪指数整体震荡上行。管理人将继续紧跟市场，控制跟踪误差，通过精细化投资管理，参与大宗交易、可转债投资、股票打新等，力求为投资者带来更好的投资体

验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3161 元,本报告期基金份额净值增长率为 13.20%;同期业绩比较基准增长率为 11.91%。

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,经济结构分化的底色仍将持续,但分化幅度有望小幅收窄。回顾历史,在技术革命中前期,经济分化加剧都是主要的宏观特征,直到生产效率的提升能惠及到大部分行业,分化格局才会缓解。回到当下,下半年内需由于基数作用、财政节奏加快等原因,预计能略有好转;而以存储价格为代表的 AI 价格涨幅环比动能放缓,传统经济和新经济的分化程度或能略有收敛,但各自运行趋势不会发生根本性变化。因此,全年总量经济指标整体波动有限。

当前市场政策支持力度较大,流动性宽松,中期来看,市场走势仍将取决于经济复苏力度。中证 A500 作为集聚各细分行业龙头公司的主要指数,业绩确定性更高,或在 9 月份更加受益。且由于龙头公司在经济修复过程中往往有望率先受益,未来或将实现更快的业绩修复,建议重点关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值小组,并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名,成员由各相关部门选派,包括运营管理部、风险控制部、各投资部门(包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部、专户业务部)、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但不参与最终估值决策。

本报告期内,本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证,并经托管人复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况,本基金应分配且已分配利润 17,625,973.18 元;本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低

于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,780,955.69	18,773,212.74
结算备付金		8,485,483.30	15,568,293.37
存出保证金		4,067,721.76	4,858,573.00
交易性金融资产	6.4.7.2	3,151,500,010.48	3,470,819,177.38
其中：股票投资		3,151,161,001.12	3,470,819,177.38
基金投资		-	-
债券投资		339,009.36	-
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		8,642,120.96	-
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		3,193,476,292.19	3,510,019,256.49
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		1,720,040.20	1,196,347.50
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		380,422.38	443,071.39
应付托管费		126,807.45	147,690.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,313.65	9,873.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,203,837.48	3,278,355.36
负债合计		8,432,421.16	5,075,337.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,420,026,938.00	2,999,026,938.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	765,016,933.03	505,916,980.59
净资产合计		3,185,043,871.03	3,504,943,918.59
负债和净资产总计		3,193,476,292.19	3,510,019,256.49

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3161 元，基金份额总额 2,420,026,938.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.2 利润表

会计主体：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		417,072,773.57	136,518,242.83
1. 利息收入		137,308.15	323,818.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	137,308.15	323,818.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		325,374,228.70	-22,844,582.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	292,946,315.32	-104,796,866.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9.09	226,099.85
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	3,876,859.67	-240,071.60
股利收益	6.4.7.19	28,551,044.62	81,966,255.56
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	90,954,849.30	157,388,250.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	606,387.42	1,650,756.54
减：二、营业总支出		3,386,656.95	7,314,861.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,449,425.91	5,397,800.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	816,475.30	1,799,266.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		13,982.24	6,263.49
8. 其他费用	6.4.7.23	106,773.50	111,530.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		413,686,116.62	129,203,381.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		413,686,116.62	129,203,381.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		413,686,116.62	129,203,381.22

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	2,999,026,938.00	-	505,916,980.59	3,504,943,918.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,999,026,938.00	-	505,916,980.59	3,504,943,918.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 579,000,000.00	-	259,099,952.44	-319,900,047.56
(一)、综合收益总额	-	-	413,686,116.62	413,686,116.62
(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)	- 579,000,000.00	-	- 136,960,191.00	-715,960,191.00
其中：1. 基金申购款	567,000,000.00	-	129,252,036.60	696,252,036.60
2. 基金赎回款	- 1,146,000,000.00	-	- 266,212,227.60	- 1,412,212,227.60
(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)	-	-	-17,625,973.18	-17,625,973.18
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,420,026,938.00	-	765,016,933.03	3,185,043,871.03
项目	上年度可比期间 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	8,645,026,938.	-	-	8,228,346,290.9

资产	00		416,680,647.01	9
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	8,645,026,938.00	-	- 416,680,647.01	8,228,346,290.9 9
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 2,193,000,000.00	-	- 198,414,447.92	- 1,994,585,552.0 8
(一)、综合收益总额	-	-	129,203,381.22	129,203,381.22
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 2,193,000,000.00	-	- 80,585,106.87	- 2,112,414,893.1 3
其中：1. 基金申购款	1,149,000,000.00	-	-87,570,711.59	1,061,429,288.4 1
2. 基金赎回款	- 3,342,000,000.00	-	- 168,155,818.46	- 3,173,844,181.5 4
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-11,374,040.17	-11,374,040.17
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,452,026,938.00	-	- 218,266,199.09	6,233,760,738.9 1

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

李俊佑

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1261 号《关于准予泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由泰康基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,999,747,724.00 元(含募集股票市值),业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2400511 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,026,938.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 279,214.00 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司(以下简称“泰康基金”),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份券、备选成份券。为更好地实现投资目标,还可投资于部分非成份券(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、

存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通

知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	20,780,955.69
等于：本金	20,778,804.23
加：应计利息	2,151.46
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	20,780,955.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2, 583, 756, 971. 00	-	3, 151, 161, 001. 12	567, 404, 030. 12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	339, 000. 00	9. 36	339, 009. 36	0. 00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	339, 000. 00	9. 36	339, 009. 36	0. 00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	2,584,095,971.00	9.36	3,151,500,010.48	567,404,030.12

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 2026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	30,816,509.62	-	-	
其中： 股指期货投资	30,816,509.62	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	30,816,509.62	-	-	

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
IC2609	IC2609	4.00	7,009,120.00	325,860.00
IF2609	IF2609	17.00	24,733,980.00	600,730.38
合计				926,590.38
减：可抵销期货暂收款				926,590.38
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 2026 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	235,770.59

其中：交易所市场	235,770.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	100,169.02
应退替代款	5,688,080.71
可退替代款	179,817.16
合计	6,203,837.48

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,999,026,938.00	2,999,026,938.00
本期申购	567,000,000.00	567,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,146,000,000.00	-1,146,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,420,026,938.00	2,420,026,938.00

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	211,093,010.56	294,823,970.03	505,916,980.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	211,093,010.56	294,823,970.03	505,916,980.59
本期利润	322,731,267.32	90,954,849.30	413,686,116.62
本期基金份额交易产生的变动数	-63,132,816.31	-73,827,374.69	-136,960,191.00
其中：基金申购款	72,451,566.66	56,800,469.94	129,252,036.60
基金赎回款	-135,584,382.97	-130,627,844.63	-266,212,227.60
本期已分配利润	-17,625,973.18	-	-17,625,973.18
本期末	453,065,488.39	311,951,444.64	765,016,933.03

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	31,658.85
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	105,081.42
其他	567.88
合计	137,308.15

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	235,903,668.69
股票投资收益——赎回差价收入	57,042,646.63
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	292,946,315.32

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,093,564,446.47
减：卖出股票成本总额	856,652,894.64
减：交易费用	1,007,883.14
买卖股票差价收入	235,903,668.69

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,412,212,227.60
减：现金支付赎回款总额	743,545,979.60
减：赎回股票成本总额	611,623,601.37
减：交易费用	-
赎回差价收入	57,042,646.63

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	9.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	9.09

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,876,859.67

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	28,551,044.62
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	28,551,044.62

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	90,927,338.92
股票投资	90,927,338.92
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	27,510.38
权证投资	—
期货投资	27,510.38
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	90,954,849.30

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	606,387.42
合计	606,387.42

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	6,604.48
其他	9,916.99
合计	106,773.50

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2026 年 7 月 16 日公告进行 2026 年度第三次分红，权益登记日为 2026 年 7 月 20 日，除息日为 2026 年 7 月 21 日，现金红利发放日为 2026 年 7 月 24 日。本基金每 10 份基金份额分红数为人民币 0.1120 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、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	2,449,425.91	5,397,800.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	136,757.00	283,479.81
应支付基金管理人的净管理费	2,312,668.91	5,114,320.68

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值*0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	816,475.30	1,799,266.83

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值*0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份额 的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
泰康中证 A500 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联接基金	1,133,902,573.00	46.8550	1,419,072,197.00	47.3178

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	20,780,955.69	31,658.85	32,393,037.73	51,618.67

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有 1,176,300 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 46,039,063.16 元，估值总额为人民币 41,758,650.00 元，占基金资产净值的比例为 1.31%（上年度末，本基金持有 1,495,600 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 58,839,728.78 元，估值总额为人民币 62,964,760.00 元，占基金资产净值的比例为 1.80%）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发放 总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 19 日	2026 年 1 月 20 日	-	0.0330	9,500,788.83	-	9,500,788.83	-
2	2026 年 4 月 20	2026 年 4 月 21	-	0.0310	8,125,184.35	-	8,125,184.35	-

	日	日						
合计	-	-	-	0.0640	17,625,973.18	-	17,625,973.18	-

6.4.12 期末（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	网上新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

				流通受限						
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股锁定期流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定期流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股锁定期流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股锁定期流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
002938	鹏鼎控股	2026年5月22日	6个月	大宗锁定	92.59	94.93	63,000	5,833,170.00	5,980,590.00	-

		日		期 流 通 受 限						
300757	罗 博 特 科	2026 年 4 月 8 日	6 个月	大 宗 锁 定 期 流 通 受 限	432.50	563.41	10,000	4,325,000.00	5,634,100.00	-
301236	软 通 动 力	2026 年 5 月 12 日	6 个月	大 宗 锁 定 期 流 通 受 限	36.86	38.80	60,000	2,211,600.00	2,328,000.00	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智	2026 年 4 月	6 个月	新 股 锁	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

	能	22 日		定期 流通 受限						
301666	大普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特 电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德 电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明 电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301687	新广	2025 年	6 个月	新股	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

	益	12月24日		锁定期流通受限						
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定期流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定期流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股锁定期流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定期流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至	2026	6个月	新	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

	信 股 份	年 1 月 8 日		股 锁 定 期 流 通 受 限						
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
603986	兆易创新	2026 年 5 月 19 日	6 个月	大 宗 锁 定 期 流 通 受 限	382.31	730.26	62,000	23,703,220.00	45,276,120.00	-

688521	芯原股份	2026年6月26日	6个月	大宗锁定 定期流通 受限	295.68	321.85	35,000	10,348,800.00	11,264,750.00	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定 定期流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定 定期流通 受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股锁定 定期流通 受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定 定期流通 受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-

				限						
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通 受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 锁定 定期 流通	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

				受限						
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定期流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
920136	永励精密	2026年6月25日	1个月内(含)	网上新股流通受限	19.28	19.28	100	1,928.00	1,928.00	-
920189	康美特	2026年6月30日	1个月内(含)	网上新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉和昌	2026年6月18日	1个月内(含)	网上新股流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
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
111025	圣泉	2026年6	1个月内	配债	100.00	100.00	1,900	190,000.00	190,002.50	-

	转债	月 26 日	(含)	流通 受限						
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月 内 (含)	配 债 流 通 受 限	100.00	100.00	1,490	149,000.00	149,006.86	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大 事项 停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	18,700	5,145,568.17	15,558,400.00	-

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基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括标的成份券、备选成份券以及经中国证监会核准发行的股票、债券和货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

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

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

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

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	339,009.36	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	339,009.36	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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 2026 年 06 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公司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 2026 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 2026 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 2026 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	20,780,955.69	-	-	-	20,780,955.69
结算备付金	8,485,483.30	-	-	-	8,485,483.30
存出保证金	4,067,721.76	-	-	-	4,067,721.76
交易性金融资产	-	-	339,009.36	3,151,161,001.12	3,151,500,010.48
应收清算款	-	-	-	8,642,120.96	8,642,120.96
资产总计	33,334,160.75	-	339,009.36	3,159,803,122.08	3,193,476,292.19
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	380,422.38	380,422.38
应付托管费	-	-	-	126,807.45	126,807.45
应付清算款	-	-	-	1,720,040.20	1,720,040.20
应交税费	-	-	-	1,313.65	1,313.65
其他负债	-	-	-	6,203,837.48	6,203,837.48
负债总计	-	-	-	8,432,421.16	8,432,421.16

利率敏感度缺口	33,334,160.75	-	339,009.36	3,151,370,700.92	3,185,043,871.03
上年度末 2025 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	18,773,212.74	-	-	-	18,773,212.74
结算备付金	15,568,293.37	-	-	-	15,568,293.37
存出保证金	4,858,573.00	-	-	-	4,858,573.00
交易性金融资产	-	-	-	3,470,819,177.38	3,470,819,177.38
资产总计	39,200,079.11	-	-	3,470,819,177.38	3,510,019,256.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	443,071.39	443,071.39
应付托管费	-	-	-	147,690.47	147,690.47
应付清算款	-	-	-	1,196,347.50	1,196,347.50
应交税费	-	-	-	9,873.18	9,873.18
其他负债	-	-	-	3,278,355.36	3,278,355.36
负债总计	-	-	-	5,075,337.90	5,075,337.90
利率敏感度缺口	39,200,079.11	-	-	3,465,743,839.48	3,504,943,918.59

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 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。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	3,151,161,001.12	98.94	3,470,819,177.38	99.03
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,151,161,001.12	98.94	3,470,819,177.38	99.03

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	208,511,540.38	202,038,135.89
	业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-208,511,540.38	-202,038,135.89

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	3,063,197,443.54	3,398,959,249.01
第二层次	15,913,631.36	20,920,832.00
第三层次	72,388,935.58	50,939,096.37
合计	3,151,500,010.48	3,470,819,177.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 696,252,036.60 元(上年度可比期间：

1,061,429,288.41 元)，其中包括以股票支付的申购款 304,673,517.59 元和以现金支付的申购款 391,578,519.01 元(上年度可比期间：其中包括以股票支付的申购款 573,364,559.04 元和以现金支付的申购款 488,064,729.37 元)。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,151,161,001.12	98.67
	其中：股票	3,151,161,001.12	98.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	339,009.36	0.01
	其中：债券	339,009.36	0.01
	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	29,266,438.99	0.92
8	其他各项资产	12,709,842.72	0.40
9	合计	3,193,476,292.19	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	9,904,569.00	0.31
B	采矿业	129,487,439.26	4.07
C	制造业	2,226,717,277.04	69.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,678,079.00	2.16
E	建筑业	38,364,439.67	1.20
F	批发和零售业	24,323,120.09	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	70,106,459.94	2.20
H	住宿和餐饮业	1,486,520.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务	176,007,767.10	5.53

	业		
J	金融业	305,286,716.35	9.59
K	房地产业	17,627,237.00	0.55
L	租赁和商务服务业	22,762,756.80	0.71
M	科学研究和技术服务业	37,649,858.94	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	5,450,463.20	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,041,840.00	0.03
Q	卫生和社会工作	6,173,481.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	2,401,708.00	0.08
S	综合	5,701,268.00	0.18
	合计	3,149,171,000.39	98.87

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	36,149.82	0.00
C	制造业	1,944,083.47	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	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	1,994,370.73	0.06

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	300308	中际旭创	106,000	134,620,000.00	4.23
2	300750	宁德时代	251,280	98,755,552.80	3.10
3	300502	新易盛	132,572	80,471,204.00	2.53
4	600519	贵州茅台	59,397	70,414,549.53	2.21
5	603986	兆易创新	70,040	51,828,720.00	1.63
6	601318	中国平安	1,013,400	48,379,716.00	1.52
7	688256	寒武纪	29,800	47,547,390.00	1.49
8	600036	招商银行	1,176,300	41,758,650.00	1.31
9	601899	紫金矿业	1,562,228	39,274,411.92	1.23
10	002371	北方华创	41,115	36,368,684.40	1.14
11	000333	美的集团	461,900	34,887,307.00	1.10
12	002475	立讯精密	484,800	34,129,920.00	1.07
13	688008	澜起科技	109,002	33,779,719.80	1.06
14	688012	中微公司	71,243	33,377,345.50	1.05
15	688041	海光信息	88,100	32,623,430.00	1.02
16	002384	东山精密	121,800	31,954,230.00	1.00
17	600900	长江电力	1,162,400	30,768,728.00	0.97
18	688981	中芯国际	190,100	30,191,682.00	0.95
19	000725	京东方 A	3,453,500	29,976,380.00	0.94
20	603259	药明康德	235,200	29,284,752.00	0.92
21	600030	中信证券	927,795	26,655,550.35	0.84
22	601166	兴业银行	1,608,300	26,633,448.00	0.84
23	300059	东方财富	1,203,000	24,517,140.00	0.77
24	600183	生益科技	138,458	24,008,617.20	0.75
25	600276	恒瑞医药	424,320	22,081,612.80	0.69
26	300274	阳光电源	137,900	21,928,858.00	0.69
27	601398	工商银行	3,072,700	21,723,989.00	0.68

28	300408	三环集团	127,500	21,279,750.00	0.67
29	002594	比亚迪	258,200	20,578,540.00	0.65
30	600487	亨通光电	187,400	20,490,316.00	0.64
31	300476	胜宏科技	58,000	20,092,940.00	0.63
32	601211	国泰海通	1,074,200	19,550,440.00	0.61
33	002463	沪电股份	127,900	19,543,120.00	0.61
34	300394	天孚通信	62,292	18,854,542.56	0.59
35	688498	源杰科技	9,500	17,917,000.00	0.56
36	688525	佰维存储	35,900	17,760,807.00	0.56
37	000988	华工科技	95,600	17,648,716.00	0.55
38	301308	江波龙	24,100	16,961,580.00	0.53
39	600176	中国巨石	228,200	16,631,216.00	0.52
40	601288	农业银行	2,729,000	16,565,030.00	0.52
41	601328	交通银行	2,533,700	16,291,691.00	0.51
42	000651	格力电器	426,300	15,986,250.00	0.50
43	600522	中天科技	259,500	15,746,460.00	0.49
44	688072	拓荆科技	18,700	15,558,400.00	0.49
45	603019	中科曙光	138,800	14,883,524.00	0.47
46	688521	芯原股份	44,600	14,827,694.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	830,000	14,566,500.00	0.46
48	600150	中国船舶	429,331	14,507,094.49	0.46
49	300604	长川科技	42,200	14,407,924.00	0.45
50	600887	伊利股份	600,159	14,379,809.64	0.45
51	600584	长电科技	136,100	14,093,155.00	0.44
52	000338	潍柴动力	510,900	13,922,025.00	0.44
53	000858	五粮液	184,300	13,638,200.00	0.43
54	688347	华虹宏力	38,800	13,048,440.00	0.41
55	601816	京沪高铁	2,779,758	12,592,303.74	0.40
56	600309	万华化学	178,400	12,204,344.00	0.38
57	688120	华海清科	37,700	12,146,186.00	0.38
58	300124	汇川技术	180,100	11,946,033.00	0.38
59	002415	海康威视	348,500	11,918,700.00	0.37
60	002916	深南电路	25,830	11,827,557.00	0.37
61	002281	光迅科技	46,000	11,819,240.00	0.37
62	002008	大族激光	78,200	11,738,602.00	0.37
63	600111	北方稀土	239,900	11,527,195.00	0.36
64	000100	TCL 科技	1,974,600	11,492,172.00	0.36
65	000063	中兴通讯	305,800	11,066,902.00	0.35
66	300857	协创数据	32,500	11,046,750.00	0.35
67	300136	信维通信	92,000	10,971,000.00	0.34
68	600000	浦发银行	1,266,200	10,901,982.00	0.34
69	600089	特变电工	480,402	10,809,045.00	0.34
70	601857	中国石油	1,231,800	10,692,024.00	0.34

71	002028	思源电气	59,120	10,227,760.00	0.32
72	601088	中国神华	261,000	10,189,440.00	0.32
73	300433	蓝思科技	189,100	10,147,106.00	0.32
74	600031	三一重工	563,300	9,733,824.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	144,800	9,416,344.00	0.30
76	300475	香农芯创	31,300	9,390,000.00	0.29
77	002050	三花智控	212,600	9,318,258.00	0.29
78	601601	中国太保	325,500	9,283,260.00	0.29
79	000001	平安银行	922,500	9,271,125.00	0.29
80	300223	君正股份	36,800	9,159,520.00	0.29
81	000792	盐湖股份	302,100	9,120,399.00	0.29
82	002714	牧原股份	259,300	9,072,907.00	0.28
83	600549	厦门钨业	105,500	8,988,600.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	58,400	8,906,000.00	0.28
85	002156	通富微电	115,500	8,762,985.00	0.28
86	600406	国电南瑞	381,330	8,713,390.50	0.27
87	601668	中国建筑	1,961,270	8,511,911.80	0.27
88	000657	中钨高新	86,500	8,279,780.00	0.26
89	002436	兴森科技	161,500	8,228,425.00	0.26
90	601919	中远海控	597,100	7,917,546.00	0.25
91	002602	世纪华通	560,400	7,901,640.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	57,582	7,821,363.06	0.25
93	601988	中国银行	1,361,800	7,789,496.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	152,500	7,692,100.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	72,500	7,682,825.00	0.24
96	603501	豪威集团	80,600	7,644,910.00	0.24
97	601728	中国电信	1,472,700	7,643,313.00	0.24
98	601012	隆基绿能	575,600	7,551,872.00	0.24
99	601225	陕西煤业	368,600	7,501,010.00	0.24
100	002230	科大讯飞	182,500	7,453,300.00	0.23
101	600941	中国移动	85,800	7,389,954.00	0.23
102	600690	海尔智家	355,800	7,261,878.00	0.23
103	002352	顺丰控股	227,700	7,117,902.00	0.22
104	601985	中国核电	781,300	7,055,139.00	0.22
105	688777	中控技术	59,800	7,026,500.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	107,300	7,017,420.00	0.22
107	002709	天赐材料	135,400	6,963,622.00	0.22
108	603799	华友钴业	144,100	6,954,266.00	0.22
109	002938	鹏鼎控股	72,200	6,950,086.00	0.22
110	300757	罗博特科	12,100	6,934,000.00	0.22
111	300033	同花顺	28,600	6,892,600.00	0.22
112	000977	浪潮信息	97,800	6,846,000.00	0.21
113	600160	巨化股份	127,900	6,779,979.00	0.21

114	300442	润泽科技	78,000	6,479,460.00	0.20
115	002851	麦格米特	38,700	6,469,866.00	0.20
116	000425	徐工机械	779,100	6,302,919.00	0.20
117	000938	紫光股份	217,700	6,282,822.00	0.20
118	002202	金风科技	262,700	6,278,530.00	0.20
119	688126	沪硅产业	157,385	6,278,087.65	0.20
120	601600	中国铝业	755,100	6,206,922.00	0.19
121	600938	中国海油	227,294	6,171,032.10	0.19
122	600028	中国石化	1,382,875	6,167,622.50	0.19
123	300346	南大光电	65,460	6,064,869.00	0.19
124	600460	士兰微	110,700	6,050,862.00	0.19
125	002466	天齐锂业	98,300	6,027,756.00	0.19
126	002600	领益智造	347,300	6,022,182.00	0.19
127	601766	中国中车	1,156,340	6,012,968.00	0.19
128	600050	中国联通	1,481,000	5,924,000.00	0.19
129	300661	圣邦股份	41,195	5,910,658.60	0.19
130	300567	精测电子	18,600	5,907,360.00	0.19
131	002837	英维克	72,700	5,784,012.00	0.18
132	002049	紫光国微	64,600	5,733,250.00	0.18
133	002080	中材科技	63,700	5,733,000.00	0.18
134	002407	多氟多	112,900	5,670,967.00	0.18
135	002185	华天科技	252,600	5,635,506.00	0.18
136	002138	顺络电子	76,600	5,599,460.00	0.18
137	601628	中国人寿	158,300	5,595,905.00	0.18
138	002179	中航光电	120,618	5,572,551.60	0.17
139	688002	睿创微纳	35,800	5,537,902.00	0.17
140	601100	恒立液压	51,000	5,485,560.00	0.17
141	000568	泸州老窖	70,100	5,434,152.00	0.17
142	601872	招商轮船	307,000	5,393,990.00	0.17
143	300395	菲利华	40,100	5,362,573.00	0.17
144	600879	航天电子	251,000	5,343,790.00	0.17
145	002241	歌尔股份	236,000	5,317,080.00	0.17
146	603288	海天味业	158,700	5,262,492.00	0.17
147	601006	大秦铁路	1,131,700	5,217,137.00	0.16
148	000408	藏格矿业	74,700	5,178,204.00	0.16
149	300390	天华新能	55,100	5,152,401.00	0.16
150	601658	邮储银行	1,043,700	5,145,441.00	0.16
151	605117	德业股份	48,220	5,119,999.60	0.16
152	688469	芯联集成	479,000	5,082,190.00	0.16
153	688017	绿的谐波	12,100	5,056,106.00	0.16
154	600905	三峡能源	1,358,400	5,039,664.00	0.16
155	600489	中金黄金	276,300	4,987,215.00	0.16
156	601888	中国中免	92,500	4,968,175.00	0.16

157	002625	光启技术	163,400	4,954,288.00	0.16
158	688396	华润微	50,600	4,936,030.00	0.15
159	000630	铜陵有色	763,600	4,856,496.00	0.15
160	600893	航发动力	126,500	4,850,010.00	0.15
161	600673	东阳光	143,000	4,801,940.00	0.15
162	600010	包钢股份	2,153,100	4,801,413.00	0.15
163	688271	联影医疗	47,100	4,767,933.00	0.15
164	601127	赛力斯	77,400	4,740,750.00	0.15
165	688111	金山办公	22,100	4,708,405.00	0.15
166	002273	水晶光电	132,600	4,704,648.00	0.15
167	300058	蓝色光标	340,480	4,685,004.80	0.15
168	300037	新宙邦	50,300	4,670,355.00	0.15
169	601689	拓普集团	82,450	4,651,829.00	0.15
170	002027	分众传媒	959,100	4,642,044.00	0.15
171	600118	中国卫星	56,300	4,619,415.00	0.15
172	600019	宝钢股份	829,000	4,501,470.00	0.14
173	300751	迈为股份	15,900	4,491,114.00	0.14
174	000426	兴业银锡	134,600	4,436,416.00	0.14
175	600760	中航沈飞	107,800	4,430,580.00	0.14
176	000807	云铝股份	197,600	4,374,864.00	0.14
177	601168	西部矿业	158,000	4,288,120.00	0.13
178	600104	上汽集团	437,700	4,271,952.00	0.13
179	600989	宝丰能源	209,800	4,265,234.00	0.13
180	600362	江西铜业	98,300	4,256,390.00	0.13
181	300450	先导智能	104,300	4,247,096.00	0.13
182	601727	上海电气	599,500	4,196,500.00	0.13
183	600875	东方电气	145,300	4,180,281.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	158,300	4,166,456.00	0.13
185	002001	新 和 成	146,100	4,152,162.00	0.13
186	688099	晶晨股份	40,100	4,126,290.00	0.13
187	605589	圣泉集团	64,300	4,087,551.00	0.13
188	002422	科伦药业	105,900	4,079,268.00	0.13
189	600667	太极实业	139,083	4,058,441.94	0.13
190	601390	中国中铁	971,800	4,052,406.00	0.13
191	600885	宏发股份	117,300	4,045,677.00	0.13
192	002738	中矿资源	68,400	4,034,916.00	0.13
193	002126	银轮股份	80,700	4,018,860.00	0.13
194	000538	云南白药	84,800	4,016,976.00	0.13
195	000960	锡业股份	93,500	3,991,515.00	0.13
196	600392	盛和资源	133,300	3,968,341.00	0.12
197	600547	山东黄金	171,856	3,968,155.04	0.12
198	600795	国电电力	849,300	3,966,231.00	0.12
199	000831	中国稀土	70,300	3,900,947.00	0.12

200	600585	海螺水泥	228,400	3,871,380.00	0.12
201	600418	江淮汽车	149,400	3,859,002.00	0.12
202	601669	中国电建	819,497	3,851,635.90	0.12
203	300316	晶盛机电	62,500	3,775,000.00	0.12
204	002648	卫星化学	160,200	3,763,098.00	0.12
205	002812	恩捷股份	56,100	3,753,651.00	0.12
206	600141	兴发集团	79,700	3,743,509.00	0.12
207	002129	TCL 中环	308,700	3,710,574.00	0.12
208	600096	云天化	121,100	3,681,440.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	444,300	3,669,918.00	0.12
210	301358	湖南裕能	48,100	3,649,347.00	0.11
211	601179	中国西电	243,000	3,625,560.00	0.11
212	300782	卓胜微	32,800	3,594,224.00	0.11
213	600346	恒力石化	201,100	3,561,481.00	0.11
214	601868	中国能建	1,326,333	3,541,309.11	0.11
215	600482	中国动力	107,900	3,539,120.00	0.11
216	002195	岩山科技	538,000	3,518,520.00	0.11
217	600497	驰宏锌锗	288,300	3,491,313.00	0.11
218	000066	中国长城	183,200	3,489,960.00	0.11
219	002558	巨人网络	126,200	3,478,072.00	0.11
220	300418	昆仑万维	85,400	3,446,744.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	103,778	3,435,051.80	0.11
222	000625	长安汽车	473,500	3,394,995.00	0.11
223	600066	宇通客车	125,800	3,372,698.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	140,400	3,358,368.00	0.11
225	600157	永泰能源	2,080,200	3,349,122.00	0.11
226	000157	中联重科	473,700	3,301,689.00	0.10
227	600221	海航控股	2,443,800	3,299,130.00	0.10
228	002532	天山铝业	307,000	3,294,110.00	0.10
229	600895	张江高科	88,400	3,292,900.00	0.10
230	600711	盛屯矿业	293,200	3,216,404.00	0.10
231	688036	传音控股	54,447	3,209,650.65	0.10
232	002340	格林美	485,500	3,209,155.00	0.10
233	300803	指南针	34,900	3,199,283.00	0.10
234	000933	神火股份	150,300	3,186,360.00	0.10
235	600011	华能国际	419,200	3,181,728.00	0.10
236	605499	东鹏饮料	25,656	3,166,720.08	0.10
237	600048	保利发展	683,800	3,165,994.00	0.10
238	600143	金发科技	203,500	3,144,075.00	0.10
239	600436	片仔癀	28,700	3,136,336.00	0.10
240	600438	通威股份	256,200	3,102,582.00	0.10
241	002821	凯莱英	19,100	3,094,200.00	0.10
242	300017	网宿科技	237,400	3,088,574.00	0.10

243	600115	中国东航	809,500	3,084,195.00	0.10
244	002493	荣盛石化	285,400	3,068,050.00	0.10
245	002236	大华股份	186,000	3,067,140.00	0.10
246	002131	利欧股份	643,700	3,057,575.00	0.10
247	600570	恒生电子	143,300	3,036,527.00	0.10
248	600886	国投电力	227,600	3,029,356.00	0.10
249	002456	欧菲光	318,600	3,013,956.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	246,700	2,987,537.00	0.09
251	601233	桐昆股份	136,300	2,950,895.00	0.09
252	688047	龙芯中科	19,000	2,938,730.00	0.09
253	603659	璞泰来	101,000	2,921,930.00	0.09
254	003816	中国广核	746,600	2,919,206.00	0.09
255	300339	润和软件	75,800	2,919,058.00	0.09
256	601058	赛轮轮胎	250,800	2,891,724.00	0.09
257	601360	三六零	332,400	2,888,556.00	0.09
258	688213	思特威	26,900	2,880,183.00	0.09
259	000301	东方盛虹	250,200	2,864,790.00	0.09
260	600026	中远海能	158,100	2,836,314.00	0.09
261	300759	康龙化成	97,800	2,829,354.00	0.09
262	002074	国轩高科	102,600	2,822,526.00	0.09
263	688235	百济神州	11,000	2,800,710.00	0.09
264	688578	艾力斯	25,600	2,795,520.00	0.09
265	002555	三七互娱	146,500	2,764,455.00	0.09
266	300438	鹏辉能源	33,300	2,758,905.00	0.09
267	600009	上海机场	118,900	2,746,590.00	0.09
268	600196	复星医药	121,400	2,727,858.00	0.09
269	688122	西部超导	43,300	2,719,673.00	0.09
270	000768	中航西飞	132,400	2,711,552.00	0.09
271	000975	山金国际	157,500	2,677,500.00	0.08
272	601111	中国国航	442,500	2,677,125.00	0.08
273	002472	双环传动	64,300	2,669,093.00	0.08
274	300001	特锐德	70,400	2,663,232.00	0.08
275	300207	欣旺达	139,900	2,656,701.00	0.08
276	002517	恺英网络	163,000	2,648,750.00	0.08
277	600415	小商品城	260,600	2,647,696.00	0.08
278	600029	南方航空	509,700	2,640,246.00	0.08
279	600674	川投能源	186,200	2,638,454.00	0.08
280	002601	龙佰集团	158,800	2,617,024.00	0.08
281	603129	春风动力	10,200	2,609,160.00	0.08
282	300458	全志科技	66,100	2,608,306.00	0.08
283	002128	电投能源	112,400	2,598,688.00	0.08
284	601186	中国铁建	436,700	2,598,365.00	0.08
285	600219	南山铝业	651,000	2,597,490.00	0.08

286	601877	正泰电器	102,400	2,567,168.00	0.08
287	002595	豪迈科技	55,075	2,566,495.00	0.08
288	600233	圆通速递	162,100	2,553,075.00	0.08
289	601117	中国化学	346,300	2,545,305.00	0.08
290	300115	长盈精密	90,800	2,536,952.00	0.08
291	301236	软通动力	64,000	2,497,800.00	0.08
292	600372	中航机载	228,700	2,481,395.00	0.08
293	002155	湖南黄金	103,610	2,473,170.70	0.08
294	600839	四川长虹	351,301	2,452,080.98	0.08
295	002465	海格通信	189,300	2,417,361.00	0.08
296	300568	星源材质	127,400	2,384,928.00	0.07
297	300454	深信服	24,700	2,376,140.00	0.07
298	300347	泰格医药	49,000	2,352,000.00	0.07
299	000963	华东医药	83,500	2,348,020.00	0.07
300	600741	华域汽车	150,600	2,337,312.00	0.07
301	000547	航天发展	121,800	2,332,470.00	0.07
302	688506	百利天恒	7,900	2,322,837.00	0.07
303	603650	彤程新材	23,600	2,312,328.00	0.07
304	002920	德赛西威	28,300	2,306,450.00	0.07
305	300024	机器人	118,800	2,296,404.00	0.07
306	002130	沃尔核材	118,700	2,250,552.00	0.07
307	300012	华测检测	160,400	2,223,144.00	0.07
308	688676	金盘科技	26,200	2,217,568.00	0.07
309	002497	雅化集团	108,800	2,216,256.00	0.07
310	688331	荣昌生物	16,900	2,201,394.00	0.07
311	000878	云南铜业	138,600	2,200,968.00	0.07
312	001979	招商蛇口	342,000	2,199,060.00	0.07
313	002432	九安医疗	30,900	2,184,012.00	0.07
314	300496	中科创达	35,200	2,175,008.00	0.07
315	002271	东方雨虹	182,800	2,169,836.00	0.07
316	300083	创世纪	158,900	2,164,218.00	0.07
317	002414	高德红外	162,900	2,160,054.00	0.07
318	300866	安克创新	20,500	2,142,250.00	0.07
319	000034	神州数码	77,160	2,141,190.00	0.07
320	601021	春秋航空	46,620	2,124,939.60	0.07
321	002444	巨星科技	68,100	2,117,910.00	0.07
322	603979	金诚信	35,800	2,113,274.00	0.07
323	300474	景嘉微	34,700	2,098,656.00	0.07
324	000733	振华科技	36,800	2,084,352.00	0.07
325	000661	长春高新	31,200	2,077,920.00	0.07
326	300763	锦浪科技	22,800	2,059,980.00	0.06
327	688266	泽璟制药	17,600	2,053,216.00	0.06
328	601319	中国人保	301,500	2,038,140.00	0.06

329	002756	永兴材料	35,800	2,027,712.00	0.06
330	300748	金力永磁	65,200	2,011,420.00	0.06
331	600699	均胜电子	92,900	2,007,569.00	0.06
332	300073	当升科技	41,600	1,998,464.00	0.06
333	601615	明阳智能	172,200	1,992,354.00	0.06
334	002078	太阳纸业	159,000	1,985,910.00	0.06
335	300142	沃森生物	152,300	1,978,377.00	0.06
336	300432	富临精工	97,900	1,966,811.00	0.06
337	002025	航天电器	25,800	1,966,476.00	0.06
338	601677	明泰铝业	117,600	1,952,160.00	0.06
339	000423	东阿阿胶	43,000	1,950,480.00	0.06
340	300919	中伟新材	44,500	1,946,875.00	0.06
341	603087	甘李药业	34,200	1,941,192.00	0.06
342	601800	中国交建	339,300	1,937,403.00	0.06
343	603606	东方电缆	46,600	1,934,366.00	0.06
344	600039	四川路桥	247,300	1,933,886.00	0.06
345	000002	万科 A	651,500	1,928,440.00	0.06
346	002252	上海莱士	440,800	1,913,072.00	0.06
347	600226	亨通股份	197,900	1,897,861.00	0.06
348	688599	天合光能	134,100	1,893,492.00	0.06
349	688608	恒玄科技	11,300	1,889,247.00	0.06
350	300724	捷佳伟创	26,600	1,877,960.00	0.06
351	688169	石头科技	19,700	1,870,909.00	0.06
352	688223	晶科能源	391,200	1,858,200.00	0.06
353	600588	用友网络	196,120	1,800,381.60	0.06
354	002064	华峰化学	188,200	1,786,018.00	0.06
355	601633	长城汽车	117,700	1,776,093.00	0.06
356	001965	招商公路	193,500	1,772,460.00	0.06
357	000786	北新建材	96,600	1,747,494.00	0.05
358	688390	固德威	16,100	1,747,011.00	0.05
359	002831	裕同科技	48,600	1,728,216.00	0.05
360	688180	君实生物	50,600	1,711,292.00	0.05
361	300677	英科医疗	43,200	1,692,144.00	0.05
362	002294	信立泰	52,800	1,683,792.00	0.05
363	000519	中兵红箭	79,700	1,679,279.00	0.05
364	600516	方大炭素	269,900	1,665,283.00	0.05
365	601618	中国中冶	681,400	1,662,616.00	0.05
366	603806	福斯特	98,900	1,660,531.00	0.05
367	600177	雅戈尔	220,000	1,656,600.00	0.05
368	688188	柏楚电子	15,460	1,649,582.00	0.05
369	002176	江特电机	163,600	1,637,636.00	0.05
370	688065	凯赛生物	34,200	1,636,470.00	0.05
371	601607	上海医药	106,200	1,635,480.00	0.05

372	300972	万辰集团	9,411	1,631,961.51	0.05
373	302132	中航成飞	27,900	1,627,128.00	0.05
374	603260	合盛硅业	33,500	1,616,710.00	0.05
375	000623	吉林敖东	90,800	1,609,884.00	0.05
376	300699	光威复材	55,700	1,595,805.00	0.05
377	000617	中油资本	240,000	1,581,600.00	0.05
378	002085	万丰奥威	142,500	1,580,325.00	0.05
379	300832	新产业	37,600	1,579,200.00	0.05
380	002318	久立特材	65,300	1,560,670.00	0.05
381	300558	贝达药业	23,800	1,548,666.00	0.05
382	002459	晶澳科技	190,100	1,539,810.00	0.05
383	300251	光线传媒	138,400	1,534,856.00	0.05
384	002065	东华软件	214,500	1,531,530.00	0.05
385	300342	天银机电	32,400	1,522,800.00	0.05
386	600085	同仁堂	65,684	1,517,957.24	0.05
387	002266	浙富控股	299,500	1,515,470.00	0.05
388	600499	科达制造	109,800	1,515,240.00	0.05
389	002044	美年健康	299,700	1,507,491.00	0.05
390	605090	九丰能源	40,200	1,494,234.00	0.05
391	688472	阿特斯	137,800	1,490,996.00	0.05
392	300409	道氏技术	74,400	1,482,792.00	0.05
393	600515	海南机场	540,700	1,481,518.00	0.05
394	603596	伯特利	59,432	1,476,290.88	0.05
395	002223	鱼跃医疗	57,500	1,475,450.00	0.05
396	301550	斯菱智驱	16,100	1,472,023.00	0.05
397	688617	惠泰医疗	8,100	1,470,636.00	0.05
398	300003	乐普医疗	124,000	1,469,400.00	0.05
399	000400	许继电气	67,500	1,464,750.00	0.05
400	000032	深桑达 A	58,200	1,452,090.00	0.05
401	002405	四维图新	224,200	1,450,574.00	0.05
402	600521	华海药业	100,600	1,448,640.00	0.05
403	688005	容百科技	47,100	1,441,260.00	0.05
404	000415	渤海租赁	353,500	1,438,745.00	0.05
405	000683	博源化工	249,000	1,434,240.00	0.05
406	000999	华润三九	63,590	1,430,139.10	0.04
407	600862	中航高科	79,200	1,427,976.00	0.04
408	601216	君正集团	319,900	1,426,754.00	0.04
409	000039	中集集团	174,500	1,415,195.00	0.04
410	600704	物产中大	296,700	1,400,424.00	0.04
411	600803	新奥股份	88,400	1,396,720.00	0.04
412	603766	隆鑫通用	116,300	1,387,459.00	0.04
413	600312	平高电气	77,800	1,373,948.00	0.04
414	600018	上港集团	289,700	1,367,384.00	0.04

415	603605	珀莱雅	22,700	1,360,184.00	0.04
416	000887	中鼎股份	75,900	1,357,851.00	0.04
417	000967	盈峰环境	126,800	1,335,204.00	0.04
418	600332	白云山	66,600	1,334,664.00	0.04
419	600153	建发股份	166,900	1,323,517.00	0.04
420	300122	智飞生物	113,100	1,322,139.00	0.04
421	600765	中航重机	102,140	1,319,648.80	0.04
422	688116	天奈科技	34,500	1,317,900.00	0.04
423	000830	鲁西化工	109,800	1,317,600.00	0.04
424	600166	福田汽车	449,400	1,307,754.00	0.04
425	600323	瀚蓝环境	46,700	1,282,382.00	0.04
426	002410	广联达	156,600	1,277,856.00	0.04
427	002007	华兰生物	103,700	1,264,103.00	0.04
428	300896	爱美客	14,320	1,248,704.00	0.04
429	601799	星宇股份	13,500	1,223,370.00	0.04
430	603568	伟明环保	78,240	1,203,331.20	0.04
431	688114	华大智造	23,500	1,200,380.00	0.04
432	600398	海澜之家	228,200	1,193,486.00	0.04
433	002603	以岭药业	79,400	1,191,000.00	0.04
434	601000	唐山港	284,700	1,181,505.00	0.04
435	002389	航天彩虹	65,800	1,169,266.00	0.04
436	688009	中国通号	245,400	1,168,104.00	0.04
437	600486	扬农化工	23,000	1,166,100.00	0.04
438	600529	山东药玻	63,200	1,166,040.00	0.04
439	601018	宁波港	367,300	1,156,995.00	0.04
440	600208	衢州发展	408,500	1,156,055.00	0.04
441	000738	航发控制	62,600	1,144,954.00	0.04
442	600008	首创环保	418,800	1,139,136.00	0.04
443	600316	洪都航空	40,600	1,134,364.00	0.04
444	603486	科沃斯	22,300	1,131,725.00	0.04
445	600170	上海建工	508,386	1,128,616.92	0.04
446	000932	华菱钢铁	323,500	1,122,545.00	0.04
447	600998	九州通	238,800	1,119,972.00	0.04
448	600820	隧道股份	209,300	1,090,453.00	0.03
449	600161	天坛生物	94,000	1,088,520.00	0.03
450	300118	东方日升	86,900	1,081,905.00	0.03
451	601238	广汽集团	211,900	1,076,452.00	0.03
452	688303	大全能源	61,400	1,070,202.00	0.03
453	603885	吉祥航空	103,300	1,062,957.00	0.03
454	002607	中公教育	578,800	1,041,840.00	0.03
455	603816	顾家家居	46,300	1,035,268.00	0.03
456	603939	益丰药房	57,300	1,030,254.00	0.03
457	688166	博瑞医药	29,400	1,029,294.00	0.03

458	600038	中直股份	39,400	996,426.00	0.03
459	600763	通策医疗	29,400	996,072.00	0.03
460	601567	三星电气	66,000	986,040.00	0.03
461	603392	万泰生物	36,120	974,156.40	0.03
462	300573	兴齐眼药	23,763	968,579.88	0.03
463	601880	辽港股份	700,370	966,510.60	0.03
464	300676	华大基因	27,399	960,608.94	0.03
465	300049	福瑞医科	24,700	960,336.00	0.03
466	600535	天士力	71,700	948,591.00	0.03
467	600511	国药股份	35,800	932,232.00	0.03
468	300100	双林股份	32,600	905,628.00	0.03
469	002244	滨江集团	118,700	902,120.00	0.03
470	600816	建元信托	369,200	900,848.00	0.03
471	000833	粤桂股份	38,400	899,328.00	0.03
472	002120	韵达股份	138,200	878,952.00	0.03
473	601155	新城控股	85,300	875,178.00	0.03
474	688063	派能科技	16,400	873,628.00	0.03
475	300144	宋城演艺	149,200	866,852.00	0.03
476	002544	普天科技	46,000	838,120.00	0.03
477	000998	隆平高科	110,300	831,662.00	0.03
478	600064	南京高科	113,800	811,394.00	0.03
479	601866	中远海发	364,500	805,545.00	0.03
480	600635	大众公用	187,500	802,500.00	0.03
481	300457	赢合科技	37,300	786,284.00	0.02
482	600754	锦江酒店	43,600	784,364.00	0.02
483	000035	中国天楹	160,900	777,147.00	0.02
484	600655	豫园股份	185,500	762,405.00	0.02
485	300601	康泰生物	64,200	728,028.00	0.02
486	600004	白云机场	98,300	713,658.00	0.02
487	600663	陆家嘴	112,700	707,756.00	0.02
488	603899	晨光股份	34,100	703,483.00	0.02
489	600258	首旅酒店	64,300	702,156.00	0.02
490	600859	王府井	76,031	697,964.58	0.02
491	002091	江苏国泰	93,900	678,897.00	0.02
492	300070	碧水源	210,700	672,133.00	0.02
493	000069	华侨城 A	376,000	616,640.00	0.02
494	600864	哈投股份	117,800	611,382.00	0.02
495	301078	孩子王	82,000	554,320.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	83,900	550,384.00	0.02
497	603833	欧派家居	17,400	523,914.00	0.02
498	002891	中宠股份	18,900	505,008.00	0.02
499	600325	华发股份	212,200	490,182.00	0.02
500	002572	索菲亚	53,700	392,010.00	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	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
2	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
3	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
4	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
5	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
6	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
7	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
8	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
9	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
13	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
14	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
15	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
18	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
19	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
20	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
21	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
22	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
23	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
24	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
25	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
26	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.00
27	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
28	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
29	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
30	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
31	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
32	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
33	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
34	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
35	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

38	920136	永励精密	100	1,928.00	0.00
39	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
40	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
41	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	603986	兆易创新	29,387,099.00	0.84
2	300750	宁德时代	23,288,126.00	0.66
3	300308	中际旭创	18,339,164.00	0.52
4	002371	北方华创	16,917,716.70	0.48
5	688498	源杰科技	13,941,457.99	0.40
6	301308	江波龙	13,175,585.00	0.38
7	688525	佰维存储	12,575,969.89	0.36
8	300502	新易盛	12,345,640.98	0.35
9	688521	芯原股份	12,209,729.45	0.35
10	300394	天孚通信	10,158,193.00	0.29
11	600519	贵州茅台	10,062,718.11	0.29
12	000333	美的集团	9,784,489.08	0.28
13	688347	华虹宏力	8,806,872.10	0.25
14	002602	世纪华通	8,669,963.00	0.25
15	300476	胜宏科技	8,135,485.94	0.23
16	002384	东山精密	8,036,839.00	0.23
17	002938	鹏鼎控股	7,635,647.00	0.22
18	300857	协创数据	7,520,466.00	0.21
19	002475	立讯精密	7,478,102.00	0.21
20	000657	中钨高新	7,320,253.00	0.21

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	50,971,906.60	1.45
2	300308	中际旭创	49,779,166.00	1.42

3	603986	兆易创新	28,221,914.00	0.81
4	300502	新易盛	25,684,558.60	0.73
5	002371	北方华创	22,845,801.80	0.65
6	000333	美的集团	20,408,920.00	0.58
7	002475	立讯精密	15,614,530.00	0.45
8	300394	天孚通信	14,141,293.00	0.40
9	688521	芯原股份	13,312,769.14	0.38
10	300476	胜宏科技	13,109,059.62	0.37
11	300059	东方财富	13,079,091.60	0.37
12	002384	东山精密	13,006,300.71	0.37
13	300274	阳光电源	12,641,664.30	0.36
14	002594	比亚迪	12,602,463.03	0.36
15	688256	寒武纪	10,279,312.12	0.29
16	000725	京东方 A	9,250,125.00	0.26
17	002938	鹏鼎控股	9,015,018.00	0.26
18	000858	五粮液	8,742,017.00	0.25
19	688041	海光信息	8,629,792.69	0.25
20	000651	格力电器	8,461,622.79	0.24

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	753,017,463.24
卖出股票收入（成交）总额	1,093,564,446.47

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	339,009.36	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	339,009.36	0.01

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	111025	圣泉转债	1,900	190,002.50	0.01
2	113704	春风转债	1,490	149,006.86	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是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

招商银行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内受到国家金融监督管理总局的公开处罚；因数据安全管理工作不到位在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚和公开批评。

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约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约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	4,067,721.76
2	应收清算款	8,642,120.96
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	12,709,842.72

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

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	603986	兆易创新	45,276,120.00	1.42	大宗锁定期流通受限

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	301666	大普微	565,262.60	0.02	新股锁定期流通受限
2	688820	盛合晶微	338,302.59	0.01	新股锁定期流通受限
3	001399	惠科股份	179,912.24	0.01	新股锁定期流通受限

4	688818	电科蓝天	120,430.38	0.00	新股锁定期流通受限
5	301682	宏明电子	114,282.84	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（%）
12,442	194,504.66	2,027,729,645.00	83.79	392,297,293.00	16.21

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
招商银行股份有限公司-泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,133,902,573.00	46.85

8.2 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

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 9 月 27 日） 基金份额总额	2,000,026,938.00
本报告期期初基金份额总额	2,999,026,938.00
本报告期基金总申购份额	567,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,146,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,420,026,938.00

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
浙商证券	2	962,768,414	52.21	178,991.75	52.13	-

		. 98				
长江证券	2	834, 629, 015 . 80	45. 26	155, 169. 60	45. 20	-
中信证券	3	46, 646, 070. 06	2. 53	9, 167. 56	2. 67	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生 证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	4	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-

中邮证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

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

（二）财务状况和经营状况良好；

（三）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；

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

（五）能及时提供准确的信息资讯服务；

（六）满足产品运作的保密要求；

（七）有较强的交易能力；

（八）符合中国证监会规定的其他条件。

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

3、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证	-	-	-	-	-	-

券						
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海证券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏	-	-	-	-	-	-

源证券						
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-

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基金持有停牌股票估值调整的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 01 月 12 日
2	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第一次分红公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 01 月 15 日
3	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026 年 01 月 21 日
4	泰康基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 01 月 23 日
5	关于泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金变更场内扩位简称的公告	《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	2026 年 03 月 16 日
6	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 03 月 16 日

7	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	《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	2026 年 03 月 30 日
8	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	2026 年 03 月 31 日
9	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第二次分红公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 04 月 16 日
10	泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 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	2026 年 04 月 21 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	20260101-20260630	1,419,072,197.00	34,507,800.00	319,677,424.00	1,133,902,573.00	46.85
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

泰康基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日