

泰康中证 500 指数增强型发起式 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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53

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	53
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	21,212,774.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	泰康中证 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	13,334,005.85 份	7,878,768.87 份

2.2 基金产品说明

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 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。 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。 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。 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，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。 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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×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。
--------	---

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	恒丰银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	梁明
	联系电话	010-89620366	021-63890689
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	liangming@hfbank.com.cn
客户服务电话		4001895522	95395
传真		010-89620100	021-63890708
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	济南市历下区泺源大街 8 号
办公地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 B 座 5、6 层	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦 16 楼
邮政编码		100031	200023
法定代表人		金志刚	辛树人

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	泰康基金管理有限公司	北京市西城区复兴门内大街 156 号 B 座 5、6 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 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
本期已实现收益	2,594,384.78	1,122,910.00
本期利润	2,349,846.74	842,623.75
加权平均基金份额本期利润	0.1621	0.1163
本期加权平均净值利润率	10.84%	7.87%
本期基金份额净值增长率	12.91%	12.70%
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	7,459,323.48	4,267,731.77
期末可供分配基金份额利润	0.5594	0.5417
期末基金资产净值	20,793,329.33	12,146,500.64
期末基金份额净值	1.5594	1.5417
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	55.94%	54.17%

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

泰康中证 500 指数增强发起 A

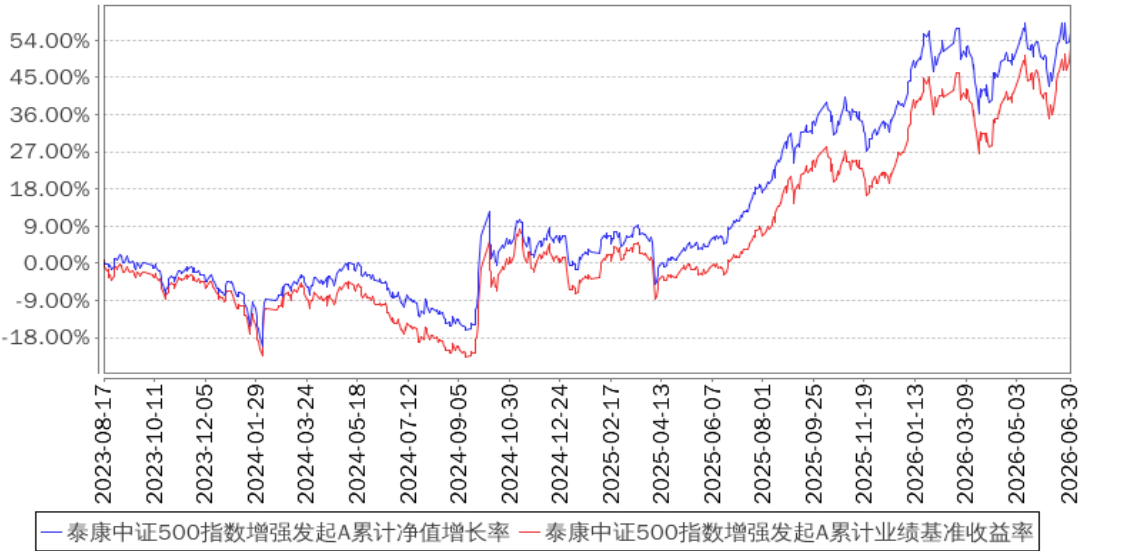
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.01%	1.50%	17.61%	1.56%	-6.60%	-0.06%
过去六个月	12.91%	1.51%	19.93%	1.58%	-7.02%	-0.07%
过去一年	41.98%	1.29%	49.68%	1.35%	-7.70%	-0.06%
自基金合同生效起至今	55.94%	1.38%	52.13%	1.44%	3.81%	-0.06%

泰康中证 500 指数增强发起 C

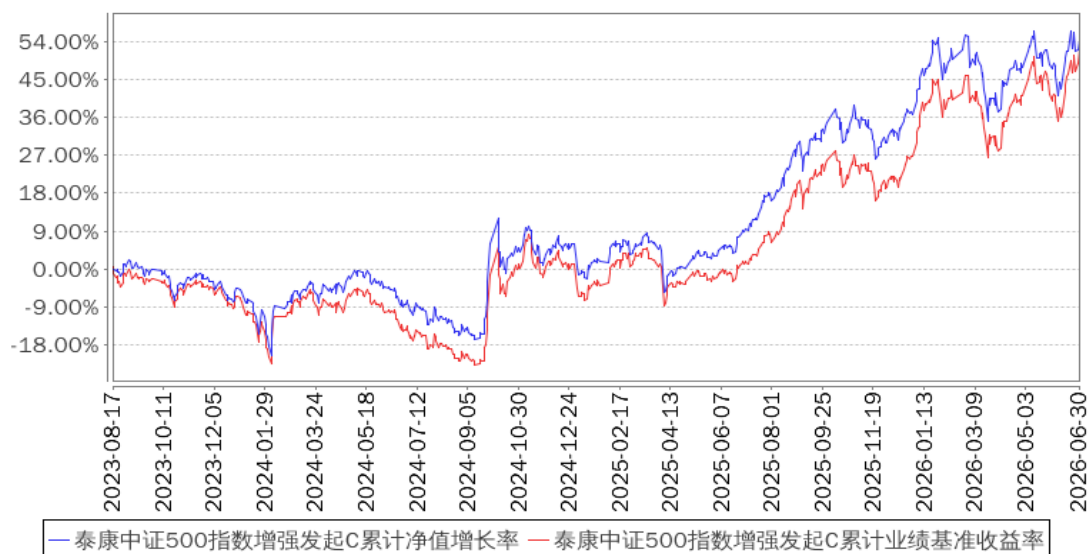
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	10.90%	1.50%	17.61%	1.56%	-6.71%	-0.06%
过去六个月	12.70%	1.51%	19.93%	1.58%	-7.23%	-0.07%
过去一年	41.43%	1.29%	49.68%	1.35%	-8.25%	-0.06%
自基金合同生效起至今	54.17%	1.38%	52.13%	1.44%	2.04%	-0.06%

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		
袁帅	本基金基金经理	2025 年 2 月 7 日	-	8 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基金经理。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基金经理。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基金经理。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基金经理。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基金经理。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基金经理。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合规守信情况的说明

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。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.5594 元,本报告期基金 A 份额净值增长率为 12.91%;截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.5417 元,本报告期基金 C 份额净值增长率为 12.70%;同期业绩比较基准增长率为 19.93%。

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。

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。

4.6 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

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

金运作管理办法》第四十一条的披露规定。

§ 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

本报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，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 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	3,113,056.15	2,175,375.10
结算备付金		431,722.72	507,045.15
存出保证金		210,273.60	176,798.40
交易性金融资产	6.4.7.2	29,581,687.00	20,823,943.80
其中：股票投资		29,581,687.00	20,823,943.80
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		28,804.23	11,412.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		33,365,543.70	23,694,575.19
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		-	-
应付赎回款		381,878.99	14,605.48

应付管理人报酬		27,227.78	20,084.55
应付托管费		3,267.34	2,410.16
应付销售服务费		3,971.60	2,054.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	712.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	9,368.02	8,000.00
负债合计		425,713.73	47,867.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	21,212,774.72	17,163,231.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,727,055.25	6,483,476.24
净资产合计		32,939,829.97	23,646,708.06
负债和净资产总计		33,365,543.70	23,694,575.19

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 21,212,774.72 份，其中泰康中证 500 指数增强发起 A 基金份额总额 13,334,005.85 份，基金份额净值 1.5594 元；泰康中证 500 指数增强发起 C 基金份额总额 7,878,768.87 份，基金份额净值 1.5417 元。

6.2 利润表

会计主体：泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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		3,397,669.41	1,566,583.20
1. 利息收入		10,524.21	8,172.74
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,524.21	8,172.74
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）		3,910,878.99	348,084.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,523,035.21	75,777.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	2,012.68
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	187,227.29	22,462.21
股利收益	6.4.7.19	200,616.49	247,832.46
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	-524,824.29	1,186,298.74
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	1,090.50	24,026.96
减：二、营业总支出		205,198.92	193,417.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	160,219.65	133,128.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,226.38	15,975.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	21,111.09	14,937.56
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		674.28	212.78
8. 其他费用	6.4.7.23	3,967.52	29,162.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,192,470.49	1,373,165.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,192,470.49	1,373,165.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,192,470.49	1,373,165.92

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	17,163,231.82	-	6,483,476.24	23,646,708.06

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	17,163,231.82	-	6,483,476.24	23,646,708.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,049,542.90	-	5,243,579.01	9,293,121.91
(一)、综合收益总额	-	-	3,192,470.49	3,192,470.49
(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)	4,049,542.90	-	2,051,108.52	6,100,651.42
其中：1. 基金申购款	16,171,538.00	-	8,143,824.53	24,315,362.53
2. 基金赎回款	-12,121,995.10	-	-6,092,716.01	-18,214,711.11
(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	21,212,774.72	-	11,727,055.25	32,939,829.97
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、上期期末净资产	33,448,747.91	-	1,295,773.65	34,744,521.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	33,448,747.91	-	1,295,773.65	34,744,521.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,374,375.47	-	639,649.79	-12,734,725.68
(一)、综合收益总额	-	-	1,373,165.92	1,373,165.92
(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)	-13,374,375.47	-	-733,516.13	-14,107,891.60
其中：1. 基金申购款	3,492,798.44	-	167,025.93	3,659,824.37
2. 基金赎回款	-16,867,173.91	-	-900,542.06	-17,767,715.97
(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	20,074,372.44	-	1,935,423.44	22,009,795.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

金志刚

金志刚

李俊佑

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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〔2023〕369 号《关于准予泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由泰康基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型定期开放式，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 107,179,227.73 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2300885 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 107,210,444.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,217.00 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”），基金托管人为恒丰银行股份有限公司（以下简称“恒丰银行”）。

根据经中国证监会备案的《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购/申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，投资者可自行选择认购或申购的基金份额类别。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为计算日该类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额余额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份券及其备选成份券，其他非指数成份券（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证、港股通标的股票）、股指期货、国债期货、债券资产（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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、信用衍生品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。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金以标的指数（中证 500 指数）成份券及备选成份券为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份券和备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净

值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：
中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（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

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》、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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

(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。

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。对于本基金通过沪港通、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。

(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	1,256,575.97
等于：本金	1,256,342.02
加：应计利息	233.95
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	1,856,480.18
等于：本金	1,856,340.65

加：应计利息	139.53
减：坏账准备	-
合计	3,113,056.15

注：其他存款为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	29,649,273.48	-	29,581,687.00	-67,586.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,649,273.48	-	29,581,687.00	-67,586.48

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	1,513,120.00	-	-	
其中：股指期货投资	1,513,120.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,513,120.00	-	-	

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

		卖)		
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	239,160.00
合计				239,160.00
减:可抵销期货 暂收款				239,160.00
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 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	3,967.52
其他应付款	5,400.50
合计	9,368.02

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康中证 500 指数增强发起 A

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	12,742,245.11	12,742,245.11
本期申购	6,105,759.95	6,105,759.95
本期赎回（以“-”号填列）	-5,513,999.21	-5,513,999.21
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	13,334,005.85	13,334,005.85

泰康中证 500 指数增强发起 C

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	4,420,986.71	4,420,986.71
本期申购	10,065,778.05	10,065,778.05
本期赎回（以“-”号填列）	-6,607,995.89	-6,607,995.89
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	7,878,768.87	7,878,768.87

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

泰康中证 500 指数增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,902,036.77	-45,538.20	4,856,498.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,902,036.77	-45,538.20	4,856,498.57
本期利润	2,594,384.78	-244,538.04	2,349,846.74
本期基金份额交易产生的变动数	177,129.76	75,848.41	252,978.17
其中：基金申购款	2,909,763.79	198,339.08	3,108,102.87
基金赎回款	-2,732,634.03	-122,490.67	-2,855,124.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,673,551.31	-214,227.83	7,459,323.48

泰康中证 500 指数增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,642,693.36	-15,715.69	1,626,977.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,642,693.36	-15,715.69	1,626,977.67
本期利润	1,122,910.00	-280,286.25	842,623.75
本期基金份额交易产生的变动数	1,627,342.79	170,787.56	1,798,130.35
其中：基金申购款	4,772,156.31	263,565.35	5,035,721.66
基金赎回款	-3,144,813.52	-92,777.79	-3,237,591.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,392,946.15	-125,214.38	4,267,731.77

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	4,294.91

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,646.76
结算备付金利息收入	2,386.45
其他	1,196.09
合计	10,524.21

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	3,523,035.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,523,035.21

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	89,249,046.95
减：卖出股票成本总额	85,634,351.35
减：交易费用	91,660.39
买卖股票差价收入	3,523,035.21

6.4.7.14.3 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

无。

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	187,227.29

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	200,616.49
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	200,616.49
----	------------

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	-687,744.29
股票投资	-687,744.29
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	162,920.00
权证投资	-
期货投资	162,920.00
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	-524,824.29

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	905.51
基金转换费收入	184.99
合计	1,090.50

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

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

6.4.7.22 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	3,967.52
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	3,967.52

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

截至本财务报告批准报出日，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、注册登记机构、基金销售机构
恒丰银行股份有限公司（“恒丰银行”）	基金托管人
泰康人寿保险有限责任公司（“泰康人寿”）	与基金管理人同受最终控股母公司控制、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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	160,219.65	133,128.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,708.82	37,991.65
应支付基金管理人的净管理费	135,510.83	95,137.22

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 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	19,226.38	15,975.36

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.12%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.12% / 当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康中证 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C	合计
	强发起 A	强发起 C	
泰康基金管理有限公司	-	13,463.35	13,463.35
合计	-	13,463.35	13,463.35
获得销售服务费的各关	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康中证 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C	合计
泰康基金管理有限公司	-	2,043.77	2,043.77
合计	-	2,043.77	2,043.77

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类份额基金资产净值 × 0.40% / 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰康中证 500 指数增强发起 A

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 (%)
泰康资产管理有限责任公司	9,902,805.28	74.2673	9,902,805.28	77.7163

份额单位：份

泰康中证 500 指数增强发起 C

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 （%）
泰康资产 管理有限 责任公司	100,028.33	1.2696	100,028.33	2.2626

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
恒丰银行	1,256,575.97	4,294.91	1,363,783.87	4,043.41

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

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

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。同时本基金为指数增强型基金，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。基金投资的金融工具包括港股通标的股票、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、外汇风险等。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恒丰银行股份有限公司，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	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 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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	3,113,056.15	-	-	-	3,113,056.15
结算备付金	431,722.72	-	-	-	431,722.72
存出保证金	210,273.60	-	-	-	210,273.60
交易性金融资产	-	-	-	29,581,687.00	29,581,687.00
应收申购款	-	-	-	28,804.23	28,804.23
资产总计	3,755,052.47	-	-	29,610,491.23	33,365,543.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	381,878.99	381,878.99
应付管理人报酬	-	-	-	27,227.78	27,227.78
应付托管费	-	-	-	3,267.34	3,267.34
应付销售服务费	-	-	-	3,971.60	3,971.60
其他负债	-	-	-	9,368.02	9,368.02
负债总计	-	-	-	425,713.73	425,713.73
利率敏感度缺口	3,755,052.47	-	-	29,184,777.50	32,939,829.97
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	2,175,375.10	-	-	-	2,175,375.10
结算备付金	507,045.15	-	-	-	507,045.15
存出保证金	176,798.40	-	-	-	176,798.40
交易性金融资产	-	-	-	20,823,943.80	20,823,943.80
应收申购款	-	-	-	11,412.74	11,412.74
资产总计	2,859,218.65	-	-	20,835,356.54	23,694,575.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,605.48	14,605.48
应付管理人报酬	-	-	-	20,084.55	20,084.55
应付托管费	-	-	-	2,410.16	2,410.16
应付销售服务费	-	-	-	2,054.49	2,054.49
应交税费	-	-	-	712.45	712.45
其他负债	-	-	-	8,000.00	8,000.00
负债总计	-	-	-	47,867.13	47,867.13
利率敏感度缺口	2,859,218.65	-	-	20,787,489.41	23,646,708.06

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	29,581,687.00	89.81	20,823,943.80	88.06
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	29,581,687.00	89.81	20,823,943.80	88.06

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%	1,975,399.25	1,252,888.83
	业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-1,975,399.25	-1,252,888.83

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	29,581,687.00	20,816,062.80
第二层次	-	7,881.00
第三层次	-	-
合计	29,581,687.00	20,823,943.80

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

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	29,581,687.00	88.66
	其中：股票	29,581,687.00	88.66
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	3,544,778.87	10.62
8	其他各项资产	239,077.83	0.72
9	合计	33,365,543.70	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	169,104.00	0.51
B	采矿业	1,040,641.00	3.16
C	制造业	20,279,779.00	61.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	359,334.00	1.09
E	建筑业	169,386.00	0.51
F	批发和零售业	968,397.00	2.94
G	交通运输、仓储和邮政业	164,724.00	0.50
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,111,620.00	3.37
J	金融业	757,514.00	2.30
K	房地产业	160,056.00	0.49
L	租赁和商务服务	—	—

	业		
M	科学研究和技术服务业	425,359.00	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	470,382.00	1.43
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	26,076,296.00	79.16

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	6,564.00	0.02
B	采矿业	31,718.00	0.10
C	制造业	2,727,840.00	8.28
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	139,357.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	275,594.00	0.84
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	163,607.00	0.50
J	金融业	150,987.00	0.46
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	5,040.00	0.02
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	—	—

	乐业		
S	综合	4,684.00	0.01
	合计	3,505,391.00	10.64

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	688498	源杰科技	300	565,800.00	1.72
2	300604	长川科技	1,600	546,272.00	1.66
3	002008	大族激光	3,200	480,352.00	1.46
4	001309	德明利	500	471,450.00	1.43
5	300857	协创数据	1,180	401,082.00	1.22
6	300475	香农芯创	1,200	360,000.00	1.09
7	600105	永鼎股份	5,300	357,644.00	1.09
8	688002	睿创微纳	2,300	355,787.00	1.08
9	300223	君正股份	1,300	323,570.00	0.98
10	002273	水晶光电	8,800	312,224.00	0.95
11	300548	长芯博创	1,100	305,800.00	0.93
12	300395	菲利华	2,200	294,206.00	0.89
13	001389	广合科技	1,200	284,700.00	0.86
14	300390	天华新能	3,000	280,530.00	0.85
15	600988	赤峰黄金	10,600	278,992.00	0.85
16	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.83
17	002185	华天科技	12,200	272,182.00	0.83
18	300373	扬杰科技	1,700	267,291.00	0.81
19	002738	中矿资源	4,500	265,455.00	0.81
20	002487	大金重工	4,400	255,068.00	0.77
21	603308	应流股份	4,200	253,680.00	0.77
22	600885	宏发股份	7,100	244,879.00	0.74
23	301536	星辰科技	1,900	244,549.00	0.74
24	300972	万辰集团	1,400	242,774.00	0.74
25	600711	盛屯矿业	22,000	241,340.00	0.73
26	300432	富临精工	11,900	239,071.00	0.73
27	603256	宏和科技	900	238,797.00	0.72
28	300759	康龙化成	7,900	228,547.00	0.69
29	603659	璞泰来	7,800	225,654.00	0.69
30	301358	湖南裕能	2,900	220,023.00	0.67
31	002402	和而泰	8,500	219,555.00	0.67

32	600497	驰宏锌锗	17,900	216,769.00	0.66
33	301200	大族数控	600	216,390.00	0.66
34	300458	全志科技	5,440	214,662.40	0.65
35	002078	太阳纸业	16,900	211,081.00	0.64
36	603156	养元饮品	4,300	211,001.00	0.64
37	002517	恺英网络	12,800	208,000.00	0.63
38	601108	财通证券	24,000	207,600.00	0.63
39	001286	陕西能源	20,400	206,856.00	0.63
40	603606	东方电缆	4,980	206,719.80	0.63
41	688235	百济神州	800	203,688.00	0.62
42	600352	浙江龙盛	16,800	203,448.00	0.62
43	300142	沃森生物	15,600	202,644.00	0.62
44	000967	盈峰环境	19,200	202,176.00	0.61
45	000783	长江证券	20,700	201,825.00	0.61
46	600884	杉杉股份	14,700	199,185.00	0.60
47	003031	中瓷电子	1,100	198,330.00	0.60
48	300953	震裕科技	1,480	197,876.00	0.60
49	002271	东方雨虹	16,600	197,042.00	0.60
50	000034	神州数码	7,100	197,025.00	0.60
51	300012	华测检测	14,200	196,812.00	0.60
52	600298	安琪酵母	5,400	195,480.00	0.59
53	601233	桐昆股份	9,000	194,850.00	0.59
54	000060	中金岭南	25,700	194,549.00	0.59
55	300919	中伟新材	4,400	192,500.00	0.58
56	300454	深信服	2,000	192,400.00	0.58
57	002414	高德红外	14,500	192,270.00	0.58
58	000893	亚钾国际	4,700	192,183.00	0.58
59	300073	当升科技	4,000	192,160.00	0.58
60	002841	视源股份	5,500	189,915.00	0.58
61	600595	中孚实业	32,200	180,964.00	0.55
62	002266	浙富控股	35,500	179,630.00	0.55
63	600499	科达制造	13,000	179,400.00	0.54
64	000983	山西焦煤	30,900	179,220.00	0.54
65	603444	吉比特	500	179,210.00	0.54
66	000519	中兵红箭	8,500	179,095.00	0.54
67	000703	恒逸石化	13,100	177,767.00	0.54
68	000951	中国重汽	9,100	177,541.00	0.54
69	600312	平高电气	10,000	176,600.00	0.54
70	603345	安井食品	2,200	176,418.00	0.54
71	600332	白云山	8,800	176,352.00	0.54
72	601699	潞安环能	12,300	175,644.00	0.53
73	600765	中航重机	13,500	174,420.00	0.53
74	603298	杭叉集团	7,300	174,178.00	0.53

75	600685	中船防务	6,800	172,992.00	0.53
76	301526	国际复材	3,700	172,679.00	0.52
77	603486	科沃斯	3,400	172,550.00	0.52
78	600562	国睿科技	8,100	171,882.00	0.52
79	600329	达仁堂	4,600	171,212.00	0.52
80	000683	博源化工	29,700	171,072.00	0.52
81	002603	以岭药业	11,400	171,000.00	0.52
82	002064	华峰化学	18,000	170,820.00	0.52
83	603338	浙江鼎力	4,000	170,000.00	0.52
84	603816	顾家家居	7,600	169,936.00	0.52
85	600170	上海建工	76,300	169,386.00	0.51
86	600598	北大荒	15,600	169,104.00	0.51
87	600166	福田汽车	58,000	168,780.00	0.51
88	600486	扬农化工	3,300	167,310.00	0.51
89	000878	云南铜业	10,500	166,740.00	0.51
90	002152	广电运通	17,700	166,026.00	0.50
91	603939	益丰药房	9,200	165,416.00	0.50
92	002120	韵达股份	25,900	164,724.00	0.50
93	000987	越秀资本	21,000	164,220.00	0.50
94	600535	天士力	12,400	164,052.00	0.50
95	002299	圣农发展	10,700	162,212.00	0.49
96	000997	新大陆	9,900	161,370.00	0.49
97	601608	中信重工	33,700	160,749.00	0.49
98	300957	贝泰妮	5,100	160,701.00	0.49
99	600546	山煤国际	14,700	160,671.00	0.49
100	003022	联泓新科	6,200	160,580.00	0.49
101	601155	新城控股	15,600	160,056.00	0.49
102	301606	绿联科技	2,600	158,652.00	0.48
103	300339	润和软件	4,100	157,891.00	0.48
104	000709	河钢股份	80,700	156,558.00	0.48
105	600801	华新建材	9,900	154,440.00	0.47
106	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.47
107	002153	石基信息	21,300	153,999.00	0.47
108	688475	萤石网络	5,600	153,160.00	0.46
109	600808	马钢股份	61,000	152,500.00	0.46
110	600098	广州发展	25,800	152,478.00	0.46
111	600688	上海石化	51,800	151,774.00	0.46
112	603806	福斯特	9,000	151,110.00	0.46
113	300140	节能环保	30,400	151,088.00	0.46
114	603225	新凤鸣	7,300	143,445.00	0.44
115	600292	电投水电	11,600	139,664.00	0.42
116	600927	永安期货	11,200	139,440.00	0.42
117	688347	华虹宏力	400	134,520.00	0.41

118	300136	信维通信	1,100	131,175.00	0.40
119	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.38
120	002436	兴森科技	2,300	117,185.00	0.36
121	688120	华海清科	280	90,210.40	0.27
122	600498	烽火通信	1,200	88,320.00	0.27
123	002444	巨星科技	1,900	59,090.00	0.18
124	688777	中控技术	500	58,750.00	0.18
125	688385	复旦微电	800	57,032.00	0.17
126	000739	普洛药业	3,400	56,644.00	0.17
127	000729	燕京啤酒	5,400	54,702.00	0.17
128	688469	芯联集成	5,100	54,111.00	0.16
129	300054	鼎龙股份	500	52,985.00	0.16
130	603699	纽威股份	1,000	50,300.00	0.15
131	688172	燕东微	600	50,196.00	0.15
132	002851	麦格米特	300	50,154.00	0.15
133	601665	齐鲁银行	7,700	44,429.00	0.13
134	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.11
135	300285	国瓷材料	200	20,636.00	0.06
136	000800	一汽解放	3,300	19,635.00	0.06
137	688281	华秦科技	280	14,064.40	0.04
138	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.03
139	300037	新宙邦	100	9,285.00	0.03
140	600378	昊华科技	100	7,538.00	0.02
141	600143	金发科技	400	6,180.00	0.02
142	600177	雅戈尔	800	6,024.00	0.02
143	300207	欣旺达	300	5,697.00	0.02
144	603179	新泉股份	100	4,965.00	0.02
145	002155	湖南黄金	200	4,774.00	0.01
146	000960	锡业股份	100	4,269.00	0.01
147	000062	深圳华强	100	3,182.00	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	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.49
2	688678	福立旺	6,500	157,105.00	0.48
3	601872	招商轮船	8,800	154,616.00	0.47
4	000100	TCL 科技	26,300	153,066.00	0.46
5	301511	德福科技	1,000	143,850.00	0.44
6	000938	紫光股份	4,900	141,414.00	0.43
7	002415	海康威视	4,100	140,220.00	0.43

8	688472	阿特斯	12,800	138,496.00	0.42
9	600030	中信证券	4,800	137,904.00	0.42
10	300590	移为通信	9,600	137,760.00	0.42
11	600320	振华重工	32,800	135,464.00	0.41
12	600150	中国船舶	4,000	135,160.00	0.41
13	601061	中信金属	12,500	134,625.00	0.41
14	000933	神火股份	6,300	133,560.00	0.41
15	600426	华鲁恒升	5,500	131,560.00	0.40
16	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.39
17	600026	中远海能	6,500	116,610.00	0.35
18	603507	振江股份	3,300	108,537.00	0.33
19	002371	北方华创	100	88,456.00	0.27
20	600372	中航机载	7,700	83,545.00	0.25
21	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.23
22	301308	江波龙	100	70,380.00	0.21
23	600176	中国巨石	900	65,592.00	0.20
24	600037	歌华有线	9,700	60,819.00	0.18
25	600066	宇通客车	1,900	50,939.00	0.15
26	002648	卫星化学	2,000	46,980.00	0.14
27	000338	潍柴动力	1,700	46,325.00	0.14
28	002916	深南电路	100	45,790.00	0.14
29	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.12
30	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.06
31	601899	紫金矿业	700	17,598.00	0.05
32	688690	纳微科技	300	13,230.00	0.04
33	300803	指南针	100	9,167.00	0.03
34	688388	嘉元科技	200	8,800.00	0.03
35	300613	富瀚微	100	8,008.00	0.02
36	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.02
37	603337	杰克科技	200	7,246.00	0.02
38	002993	奥海科技	100	7,161.00	0.02
39	301219	腾远钴业	130	7,124.00	0.02
40	688443	智翔金泰	300	6,975.00	0.02
41	000725	京东方 A	800	6,944.00	0.02
42	301216	万凯新材	300	6,897.00	0.02
43	688591	泰凌微	200	6,876.00	0.02
44	300628	亿联网络	200	6,764.00	0.02
45	603057	紫燕食品	300	6,690.00	0.02
46	600458	时代新材	400	6,620.00	0.02
47	300761	立华股份	400	6,564.00	0.02
48	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.02
49	603992	松霖科技	200	6,480.00	0.02
50	300821	东岳硅材	300	6,168.00	0.02

51	300827	上能电气	200	6,158.00	0.02
52	002466	天齐锂业	100	6,132.00	0.02
53	601633	长城汽车	400	6,036.00	0.02
54	600019	宝钢股份	1,100	5,973.00	0.02
55	300525	博思软件	800	5,952.00	0.02
56	300337	银邦股份	500	5,830.00	0.02
57	603915	国茂股份	400	5,676.00	0.02
58	002558	巨人网络	200	5,512.00	0.02
59	301101	明月镜片	200	5,448.00	0.02
60	603063	禾望电气	100	5,289.00	0.02
61	603826	坤彩科技	200	5,112.00	0.02
62	000975	山金国际	300	5,100.00	0.02
63	000682	东方电子	400	5,052.00	0.02
64	000061	农产品	900	5,040.00	0.02
65	601677	明泰铝业	300	4,980.00	0.02
66	300693	盛弘股份	100	4,875.00	0.01
67	600111	北方稀土	100	4,805.00	0.01
68	600596	新安股份	300	4,788.00	0.01
69	301078	孩子王	700	4,732.00	0.01
70	000833	粤桂股份	200	4,684.00	0.01
71	000603	盛达资源	200	4,620.00	0.01
72	301275	汉朔科技	100	4,490.00	0.01
73	601069	西部黄金	200	4,400.00	0.01
74	002468	申通快递	300	4,368.00	0.01
75	002170	芭田股份	400	4,344.00	0.01
76	000973	佛塑科技	300	4,305.00	0.01
77	002532	天山铝业	400	4,292.00	0.01
78	000612	焦作万方	400	4,236.00	0.01
79	600186	莲花控股	300	4,200.00	0.01
80	601600	中国铝业	500	4,110.00	0.01
81	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.01
82	002961	瑞达期货	200	3,916.00	0.01
83	002922	伊戈尔	100	3,280.00	0.01
84	002838	道恩股份	100	3,062.00	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。

7.4 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	000933	神火股份	731,816.00	3.09
2	002738	中矿资源	709,317.00	3.00

3	300395	菲利华	683,848.00	2.89
4	002156	通富微电	682,814.00	2.89
5	688525	佰维存储	648,701.11	2.74
6	002273	水晶光电	645,557.00	2.73
7	002444	巨星科技	628,056.00	2.66
8	002128	电投能源	581,300.00	2.46
9	002008	大族激光	545,773.00	2.31
10	688498	源杰科技	539,661.00	2.28
11	603979	金诚信	529,540.00	2.24
12	000426	兴业银锡	527,946.00	2.23
13	000893	亚钾国际	522,359.00	2.21
14	002281	光迅科技	505,246.00	2.14
15	300073	当升科技	504,061.00	2.13
16	600352	浙江龙盛	493,248.00	2.09
17	300012	华测检测	491,334.00	2.08
18	300458	全志科技	489,203.00	2.07
19	600497	驰宏锌锗	488,320.00	2.07
20	000060	中金岭南	487,454.00	2.06
21	600988	赤峰黄金	484,163.00	2.05
22	300136	信维通信	478,804.00	2.02
23	300699	光威复材	478,333.00	2.02
24	300450	先导智能	474,950.00	2.01

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688525	佰维存储	1,022,699.48	4.32
2	002156	通富微电	946,243.00	4.00
3	600549	厦门钨业	903,350.00	3.82
4	000657	中钨高新	864,514.00	3.66
5	600487	亨通光电	856,561.00	3.62
6	301308	江波龙	802,352.00	3.39
7	002281	光迅科技	754,569.00	3.19
8	300450	先导智能	726,100.00	3.07
9	002436	兴森科技	679,262.00	2.87
10	601168	西部矿业	620,529.00	2.62
11	300857	协创数据	601,861.00	2.55
12	002273	水晶光电	578,122.00	2.44
13	300373	扬杰科技	573,268.00	2.42

14	002444	巨星科技	571,250.00	2.42
15	002008	大族激光	568,091.00	2.40
16	601000	唐山港	559,739.00	2.37
17	002128	电投能源	553,731.00	2.34
18	300017	网宿科技	531,884.00	2.25
19	601231	环旭电子	526,629.00	2.23
20	600282	南钢股份	523,385.00	2.21
21	600096	云天化	502,821.00	2.13
22	600352	浙江龙盛	501,390.00	2.12
23	002595	豪迈科技	499,269.00	2.11
24	600143	金发科技	498,305.00	2.11
25	601555	东吴证券	485,660.00	2.05
26	603979	金诚信	481,782.00	2.04
27	601918	新集能源	480,577.00	2.03
28	688183	生益电子	476,651.00	2.02

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	95,079,838.84
卖出股票收入（成交）总额	89,249,046.95

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	210,273.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,804.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239,077.83

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

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。

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

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
泰康中证 500 指数增强发起 A	209	63,799.07	9,921,697.66	74.41	3,412,308.19	25.59
泰康中证 500 指数增强发起 C	186	42,358.97	100,028.33	1.27	7,778,740.54	98.73
合计	374	56,718.65	10,021,725.99	47.24	11,191,048.73	52.76

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰康中证 500 指数增强发起 A	13,458.89	0.1009
	泰康中证 500 指数增强发起 C	2.00	0.0000
	合计	13,460.89	0.0635

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰康中证 500 指数增强发起 A	0
	泰康中证 500 指数增强发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康中证 500 指数增强发起 A	0
	泰康中证 500 指数增强发起 C	0

	合计	0
--	----	---

8.4 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	47.15	10,002,833.61	47.15	3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,833.61	47.15	10,002,833.61	47.15	-

§ 9 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
基金合同生效日 （2023 年 8 月 17 日）基金份额总额	62,631,367.57	44,579,077.16
本报告期期初基金 份额总额	12,742,245.11	4,420,986.71
本报告期基金总申 购份额	6,105,759.95	10,065,778.05
减：本报告期基金 总赎回份额	5,513,999.21	6,607,995.89
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	13,334,005.85	7,878,768.87

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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 (%)	
金融街证	3	184,328,885	100.00	35,209.50	100.00	-

券		. 79				
---	--	------	--	--	--	--

注：1、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，能为券商交易模式的基金提供稳定、及时、保密的交易环境，包括但不限于以下服务内容：（1）稳定性。交易系统稳定，系统升级改造时积极配合；（2）及时性。清算数据按时发送，交易遇到问题时及时解决；（3）保密性。对基金的持仓、交易等敏感数据做到严格保密。

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

3、本基金选择的证券经纪商金融街证券与本公司不存在关联关系。

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(%)
金融街证券	-	-	-	-	-	-

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	《中国证券报》；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 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第四季度报告	《中国证券报》；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
3	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	《中国证券报》；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
4	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	《中国证券报》；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
5	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	《中国证券报》；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
6	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第一季度报告	《中国证券报》；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

7	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金开通相互转换业务的公告	《中国证券报》；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 24 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	10,002,833.61	0.00	0.00	10,002,833.61	47.15
个人	1	20260507-20260630	0.00	4,710,642.18	35,642.00	4,675,000.18	22.04
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 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》。

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（《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 8 月 28 日