泰康沪深 300 交易型开放式指数
证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰康 300
场内简称	沪深 300ETF 泰康
基金主代码	515380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 27 日
报告期末基金份额总额	657,999,814.00 份
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	本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的

	目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	64,775,655.81
2.本期利润	-419,258,171.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6355
4.期末基金资产净值	3,391,268,032.31
5.期末基金份额净值	5.1539

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

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

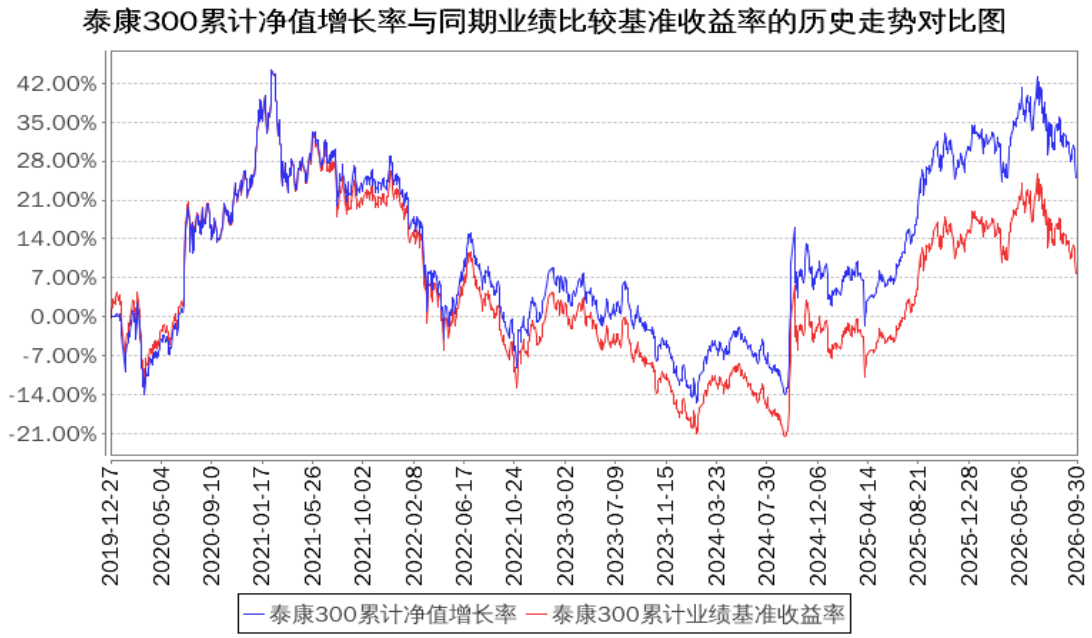
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	-11.17%	1.28%	-12.49%	1.28%	1.32%	0.00%
过去六个月	0.29%	1.27%	-2.08%	1.28%	2.37%	-0.01%

过去一年	-3.23%	1.13%	-6.10%	1.13%	2.87%	0.00%
过去三年	28.40%	1.15%	18.11%	1.15%	10.29%	0.00%
过去五年	1.68%	1.12%	-10.45%	1.12%	12.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	25.55%	1.18%	8.24%	1.19%	17.31%	-0.01%

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



注：1、本基金基金合同于 2019 年 12 月 27 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏军	本基金基金经理、量化投资部负责人	2019 年 12 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度呈现地缘冲突再度升级、经济结构分化加剧的特征。地缘层面，美伊 6 月达成谅解备忘录后，7 月冲突再度发酵，霍尔木兹海峡航运受阻，国际油价大幅上行。海外

方面，输入性通胀叠加就业韧性，美联储 9 月重启加息，美债收益率大幅上行，10 年期美债重回 5%上方、创 2007 年以来新高，带动全球长端利率同步走高。国内需求端则延续“外热内冷”格局，AI 产业链量价齐升支撑出口高增，但内需持续走弱，消费、投资表现偏弱，实体融资需求延续走弱；AI 高景气仍集中于新经济部门，叠加财政发力偏克制、政府债发行节奏较慢，新旧经济分化进一步加大。通胀端，PPI 同比受油价扰动高位震荡，但核心通胀持续低位，内需主导的通胀压力有限。

权益市场方面，2026 年第三季度呈现显著分化格局，沪深 300 下跌 12.49%，上证指数下跌 6.16%，创业板指下跌 27.8%，科创 50 下跌 30.7%，恒生科技指数下跌 4.88%。申万一级行业表现来看，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行等行业表现相对较好，电子、通信、建筑材料、电力设备等行业表现相对落后。

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

4.5 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 5.1539 元,本报告期基金份额净值增长率为-11.17%;同期业绩比较基准增长率为-12.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,355,779,488.81	98.90
	其中：股票	3,355,779,488.81	98.90
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	32,657,302.38	0.96
8	其他资产	4,563,810.40	0.13
9	合计	3,393,000,601.59	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	26,518,899.15	0.78
B	采矿业	188,027,898.90	5.54
C	制造业	1,910,483,966.86	56.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	100,504,905.67	2.96
E	建筑业	43,517,987.11	1.28
F	批发和零售业	5,737,170.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	97,248,916.21	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	166,301,952.58	4.90
J	金融业	707,264,990.25	20.86
K	房地产业	15,326,174.55	0.45
L	租赁和商务服务业	17,346,994.24	0.51
M	科学研究和技术服务业	55,815,922.32	1.65
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	5,034,470.28	0.15
R	文化、体育和娱乐业	2,164,381.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	3,341,294,629.12	98.53

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39,069.96	0.00
C	制造业	13,251,651.33	0.39
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,194,138.40	0.04
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	-	-
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	14,484,859.69	0.43

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	150,540	121,702,557.60	3.59
2	600519	贵州茅台	84,409	106,238,855.58	3.13
3	300750	宁德时代	356,835	103,878,236.85	3.06
4	601318	中国平安	1,438,149	76,638,960.21	2.26
5	300502	新易盛	187,960	73,116,440.00	2.16
6	600036	招商银行	1,670,312	68,917,073.12	2.03
7	601899	紫金矿业	2,224,000	66,252,960.00	1.95

8	603259	药明康德	333,548	55,815,922.32	1.65
9	000333	美的集团	656,139	52,556,733.90	1.55
10	600900	长江电力	1,650,658	47,109,779.32	1.39

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

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688825	长鑫科技	295,247	11,411,296.55	0.34
2	688801	燧原科技	3,640	1,194,138.40	0.04
3	301666	大普微	1,220	403,990.80	0.01
4	688820	盛合晶微	2,391	268,891.86	0.01
5	688836	宇树科技	418	133,015.96	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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IF2612	IF2612	26	33,535,320.00	-727,800.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-727,800.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,749,273.61

股指期货投资本期公允价值变动（元）	-1,823,766.04

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

招商银行股份有限公司因未依法履行其他职责受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,184,821.32
2	应收证券清算款	378,989.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,563,810.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	11,411,296.55	0.34	新股锁定期流通受限
2	688801	燧原科技	1,194,138.40	0.04	新股锁定期流通受限
3	301666	大普微	403,990.80	0.01	新股锁定期流通受限
4	688820	盛合晶微	268,891.86	0.01	新股锁定期流通受限
5	688836	宇树科技	133,015.96	0.00	新股锁定期流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	639,999,814.00
报告期期间基金总申购份额	62,100,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	44,100,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	657,999,814.00

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20260701-20260930	525,108,066.00	0.00	0.00	525,108,066.00	79.80
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

（二）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（三）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（四）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（五）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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 10 月 26 日