

泰康中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57

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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	泰康 500
场内简称	中证 500ETF 泰康
基金主代码	515530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 18 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	21,842,672.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 11 月 9 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p>
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证 500 指数，业绩比较基准为中证 500 指数收益率。
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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</p>

	策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-4,160,792.24
本期利润	-5,727,270.82
加权平均基金份额本期利润	-0.2469
本期加权平均净值利润率	-8.91%
本期基金份额净值增长率	-8.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-12,415,716.45
期末可供分配基金份额利润	-0.5684
期末基金资产净值	57,487,305.12
期末基金份额净值	2.6319
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.76%

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

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

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

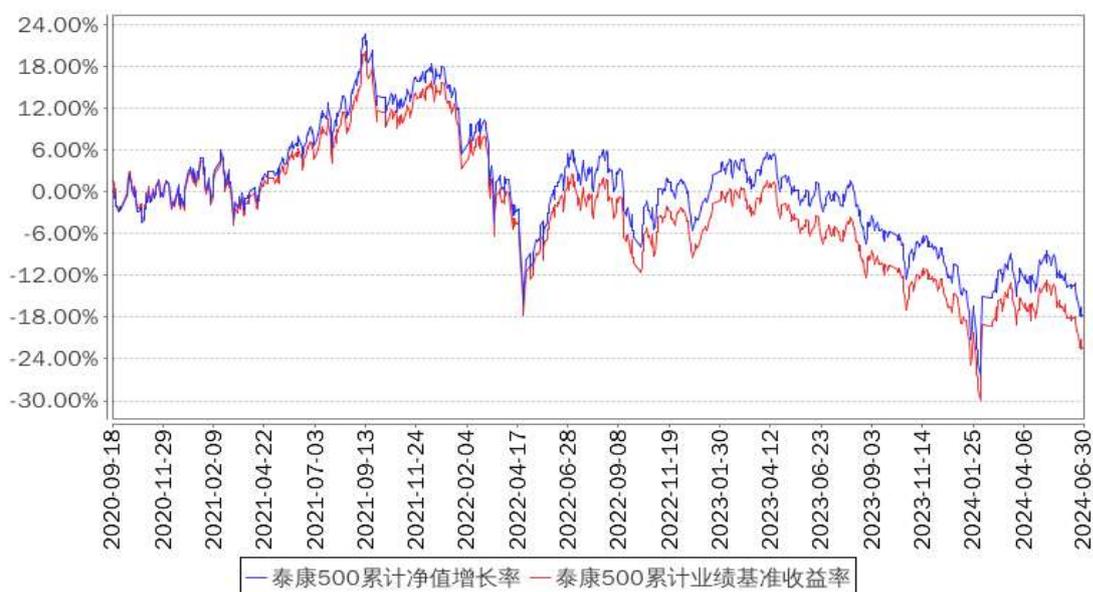
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.31%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.58%	0.00%
过去三个月	-5.52%	1.14%	-6.50%	1.14%	0.98%	0.00%
过去六个月	-8.25%	1.60%	-8.96%	1.61%	0.71%	-0.01%
过去一年	-16.98%	1.27%	-17.60%	1.27%	0.62%	0.00%
过去三年	-24.47%	1.19%	-27.40%	1.20%	2.93%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-17.76%	1.16%	-22.37%	1.17%	4.61%	-0.01%

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500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 2020 年 09 月 18 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2024年6月30日，泰康基金共管理83只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题ETF、双碳、科技、大健康等方面均进行了战略布局，为广大投资者提供了丰富多元的投资选择。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏军	本基金基金经理、量化投资部负责人	2020年9月18日	-	16年	魏军于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 日至今担任泰康中证科创创业 50 指数型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 17 日至今担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 26 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。2023 年 11 月 3 日至今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。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济呈现出结构强分化、总量压力逐步凸显的特征。上半年 GDP 实现了 5.0% 增速，二季度 GDP 增速为 4.7%，边际上有所下滑，核心是消费在二季度表现不佳。居民部门的收入增速、消费倾向、因地产业形势变化的财富效应等在二季度都不太乐观。政策坚持了以中长期结构转型为主导的方向，制造业研发、生产、出口继续对经济形成托底。

权益市场方面，2024 年上半年整体偏弱震荡运行。从大盘指数整体表现上来看，上半年上证指数下跌 0.25%，沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，恒生综合指数上涨 3.39%，恒生科技下跌 5.57%。申万一级行业表现来看，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，综合、计算机、商贸零售、社会服务、传媒等行业下跌较多。

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，跟踪指数宽幅震荡，整体大幅下跌。

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 2.6319 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.25%；同期业绩比较基准增长率为-8.96%。

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，预计经济结构强分化的特征总体延续。政策思路预计继续统一在中国式现代化的框架下，粗放式的需求侧刺激较难出现，取而代之的是经济转型和高质量发展。信贷和社融在下半年或继续抛弃规模情节；财政政策力度在化债的主方针下，空间不会很大；货币政策有继续放松的空间，也需要平衡汇率等因素。下半年可能更多的是等待美国新一任总统上任的过渡期，为可能新的国际形势进行准备。

展望后市，指数估值处于低位，资金快速流入，宽基指数配置价值仍然较高。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，力求为投资者带来更好的投资体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度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

本年度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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,083,468.86	1,193,584.36
结算备付金		764,523.23	1,017,891.30
存出保证金		249,012.74	270,588.30
交易性金融资产	6.4.7.2	55,524,374.46	69,656,380.11
其中：股票投资		55,513,373.64	69,651,079.95
基金投资		-	-
债券投资		11,000.82	5,300.16
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		57,621,379.29	72,138,444.07
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		43.81	299.39
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		7,364.08	22,454.92
应付托管费		2,454.69	2,806.87
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	124,211.58	280,843.69
负债合计		134,074.17	306,404.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	69,903,021.57	80,143,969.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-12,415,716.45	-8,311,930.41
净资产合计		57,487,305.12	71,832,039.20
负债和净资产总计		57,621,379.29	72,138,444.07

注：（1）报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.6319 元，基金份额总额 21,842,672.00 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 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,472,446.02	2,720,779.46
1. 利息收入		10,678.73	13,140.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,678.73	13,140.16
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）		-3,905,080.68	342,021.05
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,672,356.86	-474,508.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,380.33	-
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	12,040.64	-34,554.47
股利收益	6.4.7.19	752,855.21	851,084.06
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	-1,566,478.58	2,220,183.15
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	-11,565.49	145,435.10
减：二、营业总支出		254,824.80	328,871.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	92,682.44	158,117.13
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,002.81	19,764.65
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		44.45	341.41
8. 其他费用	6.4.7.23	146,095.10	150,648.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,727,270.82	2,391,908.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,727,270.82	2,391,908.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,727,270.82	2,391,908.11

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	80,143,969.61	-	-8,311,930.41	71,832,039.20

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	80,143,969.61	-	-8,311,930.41	71,832,039.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,240,948.04	-	-4,103,786.04	-14,344,734.08
(一)、综合收益总额	-	-	-5,727,270.82	-5,727,270.82
(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)	-10,240,948.04	-	1,623,484.78	-8,617,463.26
其中：1. 基金申购款	33,283,081.15	-	-4,843,330.73	28,439,750.42
2. 基金赎回款	-43,524,029.19	-	6,466,815.51	-37,057,213.68
(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	69,903,021.57	-	-12,415,716.45	57,487,305.12
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023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	75,023,495.60	-	-2,981,543.69	72,041,951.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	75,023,495.60	-	-2,981,543.69	72,041,951.91

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,560,236.99	-	2,255,070.37	4,815,307.36
(一)、综合收益总额	-	-	2,391,908.11	2,391,908.11
(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)	2,560,236.99	-	-136,837.74	2,423,399.25
其中：1. 基金申购款	40,963,792.15	-	1,036,621.83	42,000,413.98
2. 基金赎回款	-38,403,555.16	-	-1,173,459.57	-39,577,014.73
(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	77,583,732.59	-	-726,473.32	76,857,259.27

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 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[2020]1284 号《关于准予泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

243,998,555.00 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 2000722 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 243,999,138.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 583.00 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《关于泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》,本基金以 2020 年 10 月 15 日为折算日,进行了基金份额折算,折算前基金份额总额为 243,999,138.00 份,折算后基金份额总额为 76,242,672.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]357 号核准,本基金 76,242,672.00 份基金份额于 2020 年 11 月 9 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,还可投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他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。本基金的投资组合比例为:在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证 500 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 500 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 500ETF 联接基金”)。泰康中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业

会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的

通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,083,468.86
等于：本金	1,083,360.19
加：应计利息	108.67
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	1,083,468.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	62,747,534.42	-	55,513,373.64	-7,234,160.78	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,000.00	0.82	11,000.82	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,000.00	0.82	11,000.82	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	62,758,534.42	0.82	55,524,374.46	-7,234,160.78	

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
----	-----

	2024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	2,162,720.00	-	-	
其中：股指 期货投资	2,162,720.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	2,162,720.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/ 卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	2.00	1,950,080.00	-212,640.00
合计				-212,640.00
减：可抵销期货 暂收款				-212,640.00
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 2024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	14,511.48
其中：交易所市场	14,511.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,700.10
应付指数使用费	35,000.00
合计	124,211.58

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,042,672.00	80,143,969.61
本期申购	10,400,000.00	33,283,081.15
本期赎回（以“-”号填列）	-13,600,000.00	-43,524,029.19
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	21,842,672.00	69,903,021.57

注：申购包含红利再投、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	4,059,424.42	-12,371,354.83	-8,311,930.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,059,424.42	-12,371,354.83	-8,311,930.41
本期利润	-4,160,792.24	-1,566,478.58	-5,727,270.82
本期基金份额交易产生的变动数	-137,337.77	1,760,822.55	1,623,484.78
其中：基金申购款	614,922.27	-5,458,253.00	-4,843,330.73
基金赎回款	-752,260.04	7,219,075.55	6,466,815.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-238,705.59	-12,177,010.86	-12,415,716.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	1,930.93
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	8,627.03
其他	120.77
合计	10,678.73

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,474,874.87
股票投资收益——赎回差价收入	-1,197,481.99
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	-4,672,356.86

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	28,772,193.19
减：卖出股票成本总额	32,201,083.60
减：交易费用	45,984.46
买卖股票差价收入	-3,474,874.87

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 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	37,057,213.68
减：现金支付赎回款总额	20,563,170.68
减：赎回股票成本总额	17,691,524.99
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,197,481.99

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 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	2.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,377.73
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	2,380.33

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,680.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,300.00
减：应计利息总额	1.95
减：交易费用	0.66
买卖债券差价收入	2,377.73

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	12,040.64

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	752,855.21
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	752,855.21

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,390,558.58
股票投资	-1,390,558.58
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	-175,920.00
权证投资	-
期货投资	-175,920.00
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	-1,566,478.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-11,565.49
合计	-11,565.49

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	1,395.00
指数使用费	70,000.00
其他	20,000.00
合计	146,095.10

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期与基金管理人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 500 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	92,682.44	158,117.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,616.07	8,243.91
应支付基金管理人的净管理费	88,066.37	149,873.22

注：自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 4 月 9 日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净

值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

根据《关于调整泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2024 年 4 月 10 日起，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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,002.81	19,764.65

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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500 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金	12,500,100.00	57.2279	13,494,700.00	53.8868

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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,083,468.86	1,930.93	1,156,670.56	2,064.82

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（2024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

6.4.12.1.2 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
113685	升 24 转 债	2024 年 6 月 17 日	1-6个 月 (含)	新 债 未 上 市	100.00	100.01	110	11,000.00	11,000.82	-

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	11,000.82	5,300.16
未评级	0.00	0.00
合计	11,000.82	5,300.16

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 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 2024 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、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	1,083,468.86	-	-	-	1,083,468.86
结算备付金	764,523.23	-	-	-	764,523.23
存出保证金	249,012.74	-	-	-	249,012.74
交易性金融资产	-	-	11,000.82	55,513,373.64	55,524,374.46
资产总计	2,097,004.83	-	11,000.82	55,513,373.64	57,621,379.29
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	7,364.08	7,364.08
应付托管费	-	-	-	2,454.69	2,454.69
应付清算款	-	-	-	43.81	43.81
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	124,211.58	124,211.58
负债总计	-	-	-	134,074.17	134,074.17
利率敏感度缺口	2,097,004.83	-	11,000.82	55,379,299.47	57,487,305.12
上年度末 2023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	1,193,584.36	-	-	-	1,193,584.36
结算备付金	1,017,891.30	-	-	-	1,017,891.30
存出保证金	270,588.30	-	-	-	270,588.30
交易性金融资产	-	-	5,300.16	69,651,079.95	69,656,380.11
资产总计	2,482,063.96	-	5,300.16	69,651,079.95	72,138,444.07
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,454.92	22,454.92
应付托管费	-	-	-	2,806.87	2,806.87
应付清算款	-	-	-	299.39	299.39
其他负债	-	-	-	280,843.69	280,843.69
负债总计	-	-	-	306,404.87	306,404.87
利率敏感度缺口	2,482,063.96	-	5,300.16	69,344,675.08	71,832,039.20

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率下调 0.25%	0.00	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	55,513,373.64	96.57	69,651,079.95	96.96
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	55,513,373.64	96.57	69,651,079.95	96.96

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	3,253,173.51	2,933,968.17
	业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-3,253,173.51	-2,933,968.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	55,513,373.64	69,651,079.95
第二层次	11,000.82	5,300.16
第三层次	-	-
合计	55,524,374.46	69,656,380.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 28,439,750.42 元(上年度可比期间：42,000,413.98 元)，其中包括以股票支付的申购款 11,648,759.00 元和以现金支付的申购款 16,790,991.42 元(上年度可比期间：其中包括以股票支付的申购款 19,852,028.00 元和以现金支付的申购款 22,148,385.98 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	55,513,373.64	96.34
	其中：股票	55,513,373.64	96.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,000.82	0.02
	其中：债券	11,000.82	0.02
	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	1,847,992.09	3.21
8	其他各项资产	249,012.74	0.43
9	合计	57,621,379.29	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	349,735.00	0.61
B	采矿业	2,602,970.00	4.53
C	制造业	35,054,739.73	60.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,238,153.59	3.89
E	建筑业	567,689.00	0.99
F	批发和零售业	1,199,446.48	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,119,168.00	1.95
H	住宿和餐饮业	176,619.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务	3,940,527.62	6.85

	业		
J	金融业	5,169,960.74	8.99
K	房地产业	630,685.00	1.10
L	租赁和商务服务业	425,232.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	445,169.88	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	250,549.60	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	61,812.00	0.11
Q	卫生和社会工作	345,059.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	835,889.00	1.45
S	综合	99,968.00	0.17
	合计	55,513,373.64	96.57

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

本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

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	300502	新易盛	6,700	707,185.00	1.23
2	002028	思源电气	5,800	388,020.00	0.67
3	601058	赛轮轮胎	24,700	345,800.00	0.60
4	688169	石头科技	840	329,784.00	0.57
5	600066	宇通客车	12,500	322,500.00	0.56
6	002340	格林美	48,100	306,397.00	0.53
7	000933	神火股份	14,800	299,404.00	0.52
8	601077	渝农商行	58,000	291,160.00	0.51
9	601168	西部矿业	15,700	281,815.00	0.49
10	000988	华工科技	9,400	281,342.00	0.49
11	300394	天孚通信	3,140	277,638.80	0.48
12	002384	东山精密	12,800	264,960.00	0.46
13	000423	东阿阿胶	4,200	262,920.00	0.46
14	000630	铜陵有色	72,000	259,920.00	0.45

15	600418	江淮汽车	16,400	259,776.00	0.45
16	600988	赤峰黄金	15,600	254,904.00	0.44
17	601233	桐昆股份	15,800	252,168.00	0.44
18	002625	光启技术	14,200	246,370.00	0.43
19	600157	永泰能源	208,400	245,912.00	0.43
20	600096	云天化	12,000	233,040.00	0.41
21	601567	三星医疗	6,600	231,000.00	0.40
22	000400	许继电气	6,700	230,547.00	0.40
23	688777	中控技术	5,900	222,430.00	0.39
24	002156	通富微电	9,900	221,661.00	0.39
25	002128	电投能源	10,500	221,550.00	0.39
26	002273	水晶光电	13,000	220,740.00	0.38
27	601555	东吴证券	37,300	220,070.00	0.38
28	002078	太阳纸业	15,700	219,015.00	0.38
29	600885	宏发股份	7,780	215,350.40	0.37
30	601128	常熟银行	28,290	214,155.30	0.37
31	002532	天山铝业	26,200	212,482.00	0.37
32	300207	欣旺达	14,000	212,380.00	0.37
33	002223	鱼跃医疗	5,600	210,560.00	0.37
34	600352	浙江龙盛	24,400	209,596.00	0.36
35	002138	顺络电子	7,600	208,696.00	0.36
36	600398	海澜之家	22,500	207,900.00	0.36
37	002966	苏州银行	27,440	205,800.00	0.36
38	002353	杰瑞股份	5,800	203,464.00	0.35
39	601108	财通证券	30,500	201,605.00	0.35
40	600765	中航重机	9,660	197,064.00	0.34
41	002185	华天科技	24,100	196,415.00	0.34
42	002517	恺英网络	20,200	192,910.00	0.34
43	600879	航天电子	24,700	191,919.00	0.33
44	603606	东方电缆	3,900	190,359.00	0.33
45	301236	软通动力	5,400	190,134.00	0.33
46	600873	梅花生物	18,700	187,374.00	0.33
47	600177	雅戈尔	26,000	185,120.00	0.32
48	601577	长沙银行	22,600	184,868.00	0.32
49	600109	国金证券	24,400	184,220.00	0.32
50	688099	晶晨股份	3,100	183,892.00	0.32
51	600079	人福医药	10,700	183,719.00	0.32
52	600060	海信视像	7,400	183,076.00	0.32
53	300003	乐普医疗	12,300	182,532.00	0.32
54	688617	惠泰医疗	400	182,440.00	0.32
55	002738	中矿资源	6,800	182,240.00	0.32
56	300017	网宿科技	22,900	180,910.00	0.31
57	603160	汇顶科技	2,600	178,750.00	0.31

58	600497	驰宏锌锗	33,400	178,356.00	0.31
59	300136	信维通信	9,100	178,178.00	0.31
60	603979	金诚信	3,500	176,855.00	0.31
61	002202	金风科技	25,900	174,048.00	0.30
62	002739	万达电影	14,300	172,887.00	0.30
63	000932	华菱钢铁	38,888	172,273.84	0.30
64	688120	华海清科	900	170,622.00	0.30
65	002409	雅克科技	2,700	169,857.00	0.30
66	600985	淮北矿业	10,100	169,074.00	0.29
67	002465	海格通信	16,300	168,868.00	0.29
68	000683	远兴能源	24,400	168,604.00	0.29
69	600348	华阳股份	16,900	168,324.00	0.29
70	002281	光迅科技	4,500	168,165.00	0.29
71	002444	巨星科技	6,800	167,960.00	0.29
72	000009	中国宝安	19,400	166,840.00	0.29
73	600536	中国软件	5,559	166,325.28	0.29
74	000878	云南铜业	13,200	164,472.00	0.29
75	002008	大族激光	7,900	164,320.00	0.29
76	002436	兴森科技	15,800	163,056.00	0.28
77	600642	申能股份	18,300	161,589.00	0.28
78	300474	景嘉微	2,550	161,236.50	0.28
79	688122	西部超导	4,200	160,944.00	0.28
80	601615	明阳智能	17,000	160,480.00	0.28
81	002797	第一创业	31,500	160,335.00	0.28
82	601990	南京证券	20,800	159,744.00	0.28
83	000039	中集集团	17,250	159,735.00	0.28
84	600298	安琪酵母	5,700	159,201.00	0.28
85	300012	华测检测	15,800	158,948.00	0.28
86	300054	鼎龙股份	7,000	158,760.00	0.28
87	000066	中国长城	18,100	158,375.00	0.28
88	600529	山东药玻	6,200	157,108.00	0.27
89	002673	西部证券	25,200	155,988.00	0.27
90	601666	平煤股份	13,900	155,680.00	0.27
91	603596	伯特利	4,000	155,600.00	0.27
92	600839	四川长虹	34,600	155,354.00	0.27
93	601179	中国西电	19,200	154,368.00	0.27
94	688525	佰维存储	2,400	153,960.00	0.27
95	000831	中国稀土	6,000	152,100.00	0.26
96	300395	菲利华	4,900	150,675.00	0.26
97	000783	长江证券	31,100	150,213.00	0.26
98	002432	九安医疗	3,700	149,998.00	0.26
99	601717	郑煤机	10,100	149,480.00	0.26
100	300002	神州泰岳	18,400	149,408.00	0.26

101	603816	顾家家居	4,600	148,534.00	0.26
102	000738	航发控制	7,400	148,518.00	0.26
103	000728	国元证券	24,500	148,470.00	0.26
104	600862	中航高科	7,800	146,484.00	0.25
105	000703	恒逸石化	20,540	145,628.60	0.25
106	688180	君实生物	5,000	145,250.00	0.25
107	603338	浙江鼎力	2,400	145,008.00	0.25
108	601198	东兴证券	18,200	144,872.00	0.25
109	601997	贵阳银行	27,400	144,398.00	0.25
110	000960	锡业股份	9,300	144,057.00	0.25
111	688188	柏楚电子	780	143,949.00	0.25
112	002595	豪迈科技	3,761	143,557.37	0.25
113	002155	湖南黄金	7,900	142,990.00	0.25
114	600863	内蒙华电	30,600	141,984.00	0.25
115	000921	海信家电	4,400	141,856.00	0.25
116	601162	天风证券	65,000	141,700.00	0.25
117	601696	中银证券	15,600	141,648.00	0.25
118	600521	华海药业	8,300	141,515.00	0.25
119	603345	安井食品	1,900	141,189.00	0.25
120	300724	捷佳伟创	2,600	140,426.00	0.24
121	300866	安克创新	1,970	140,283.70	0.24
122	002984	森麒麟	5,800	139,722.00	0.24
123	603939	益丰药房	5,688	139,640.40	0.24
124	300037	新宙邦	4,880	139,372.80	0.24
125	600038	中直股份	3,390	139,362.90	0.24
126	300001	特锐德	6,900	138,828.00	0.24
127	002472	双环传动	6,300	138,726.00	0.24
128	002294	信立泰	5,200	138,476.00	0.24
129	600549	厦门钨业	8,000	138,000.00	0.24
130	600699	均胜电子	9,300	137,826.00	0.24
131	002850	科达利	1,800	137,484.00	0.24
132	600141	兴发集团	7,200	137,376.00	0.24
133	002407	多氟多	11,180	136,731.40	0.24
134	300699	光威复材	5,500	136,565.00	0.24
135	600546	山煤国际	9,300	135,966.00	0.24
136	002262	恩华药业	5,700	135,318.00	0.24
137	301358	湖南裕能	4,300	135,278.00	0.24
138	600820	隧道股份	20,700	135,171.00	0.24
139	600895	张江高科	7,300	134,904.00	0.23
140	600369	西南证券	37,500	134,250.00	0.23
141	300285	国瓷材料	7,500	133,875.00	0.23
142	600872	中炬高新	5,900	133,871.00	0.23
143	002195	岩山科技	53,200	133,532.00	0.23

144	002064	华峰化学	18,600	133,362.00	0.23
145	603589	口子窖	3,400	133,246.00	0.23
146	000021	深科技	8,800	133,056.00	0.23
147	601000	唐山港	27,800	130,660.00	0.23
148	300073	当升科技	3,800	130,378.00	0.23
149	000513	丽珠集团	3,500	130,235.00	0.23
150	300146	汤臣倍健	9,600	130,080.00	0.23
151	600486	扬农化工	2,300	129,835.00	0.23
152	603087	甘李药业	2,800	129,696.00	0.23
153	600021	上海电力	13,101	129,568.89	0.23
154	300058	蓝色光标	23,400	127,296.00	0.22
155	600704	物产中大	29,300	127,162.00	0.22
156	601966	玲珑轮胎	6,900	126,753.00	0.22
157	300114	中航电测	2,800	126,700.00	0.22
158	600153	建发股份	14,100	125,913.00	0.22
159	603179	新泉股份	3,200	125,568.00	0.22
160	600155	华创云信	21,200	125,292.00	0.22
161	002756	永兴材料	3,500	125,230.00	0.22
162	000830	鲁西化工	10,800	125,172.00	0.22
163	002558	巨人网络	13,000	122,720.00	0.21
164	688065	凯赛生物	2,700	122,553.00	0.21
165	300529	健帆生物	4,500	122,445.00	0.21
166	600583	海油工程	20,700	122,337.00	0.21
167	600118	中国卫星	5,500	122,265.00	0.21
168	601156	东航物流	6,000	122,100.00	0.21
169	002152	广电运通	11,600	121,336.00	0.21
170	000591	太阳能	25,700	121,047.00	0.21
171	000623	吉林敖东	9,000	120,600.00	0.21
172	002025	航天电器	2,600	120,588.00	0.21
173	600970	中材国际	9,900	119,394.00	0.21
174	002439	启明星辰	6,900	119,094.00	0.21
175	002385	大北农	30,750	118,387.50	0.21
176	300144	宋城演艺	14,700	118,041.00	0.21
177	300373	扬杰科技	3,000	116,700.00	0.20
178	601216	君正集团	31,600	116,604.00	0.20
179	000729	燕京啤酒	13,200	116,556.00	0.20
180	600380	健康元	10,415	116,335.55	0.20
181	605358	立昂微	5,000	115,700.00	0.20
182	600143	金发科技	17,500	115,675.00	0.20
183	000723	美锦能源	24,300	115,668.00	0.20
184	300251	光线传媒	13,700	115,217.00	0.20
185	600282	南钢股份	23,100	115,038.00	0.20
186	600637	东方明珠	18,900	114,912.00	0.20

187	600998	九州通	23,547	114,909.36	0.20
188	000519	中兵红箭	7,800	114,426.00	0.20
189	300383	光环新网	13,500	114,075.00	0.20
190	600516	方大炭素	26,400	113,784.00	0.20
191	300677	英科医疗	4,240	113,674.40	0.20
192	000636	风华高科	8,700	113,622.00	0.20
193	600763	通策医疗	2,100	113,505.00	0.20
194	600392	盛和资源	13,100	112,922.00	0.20
195	000818	航锦科技	5,100	112,608.00	0.20
196	300024	机器人	11,528	112,282.72	0.20
197	002958	青农商行	41,700	111,756.00	0.19
198	601665	齐鲁银行	22,700	111,457.00	0.19
199	600909	华安证券	26,460	111,396.60	0.19
200	002044	美年健康	29,400	111,132.00	0.19
201	600566	济川药业	3,500	110,985.00	0.19
202	600008	首创环保	41,200	110,416.00	0.19
203	000883	湖北能源	18,300	109,983.00	0.19
204	600867	通化东宝	13,000	108,810.00	0.19
205	000629	钒钛股份	43,500	108,750.00	0.19
206	601016	节能风电	36,330	108,626.70	0.19
207	300088	长信科技	23,000	108,100.00	0.19
208	601456	国联证券	11,200	107,968.00	0.19
209	600511	国药股份	3,500	107,765.00	0.19
210	600170	上海建工	50,000	107,500.00	0.19
211	600582	天地科技	15,600	107,484.00	0.19
212	000997	新大陆	7,700	107,107.00	0.19
213	600129	太极集团	3,700	107,004.00	0.19
214	688213	思特威	2,200	106,700.00	0.19
215	600498	烽火通信	6,700	106,530.00	0.19
216	600499	科达制造	12,600	106,218.00	0.18
217	600535	天士力	8,400	105,672.00	0.18
218	601933	永辉超市	42,500	105,400.00	0.18
219	000598	兴蓉环境	14,000	105,280.00	0.18
220	002120	韵达股份	13,600	105,264.00	0.18
221	600004	白云机场	11,100	105,228.00	0.18
222	601991	大唐发电	34,900	105,049.00	0.18
223	000750	国海证券	36,000	104,760.00	0.18
224	600580	卧龙电驱	8,600	104,490.00	0.18
225	300118	东方日升	8,600	104,060.00	0.18
226	002261	拓维信息	9,400	104,058.00	0.18
227	603000	人民网	5,200	103,948.00	0.18
228	000060	中金岭南	24,500	103,880.00	0.18
229	603486	科沃斯	2,200	103,796.00	0.18

230	300568	星源材质	12,600	103,320.00	0.18
231	002429	兆驰股份	21,300	102,453.00	0.18
232	002430	杭氧股份	4,600	102,350.00	0.18
233	603156	养元饮品	4,800	102,096.00	0.18
234	002939	长城证券	15,200	101,840.00	0.18
235	603228	景旺电子	3,200	101,760.00	0.18
236	300567	精测电子	1,800	101,718.00	0.18
237	600166	福田汽车	45,100	101,475.00	0.18
238	603658	安图生物	2,200	101,354.00	0.18
239	600325	华发股份	15,500	100,750.00	0.18
240	600816	建元信托	37,000	100,270.00	0.17
241	600673	东阳光	14,200	99,968.00	0.17
242	601231	环旭电子	6,200	99,510.00	0.17
243	603927	中科软	5,500	99,495.00	0.17
244	002508	老板电器	4,500	99,450.00	0.17
245	600563	法拉电子	1,300	99,034.00	0.17
246	600754	锦江酒店	4,300	98,814.00	0.17
247	000893	亚钾国际	6,100	98,576.00	0.17
248	300765	新诺威	3,900	98,397.00	0.17
249	300601	康泰生物	6,300	98,343.00	0.17
250	300487	蓝晓科技	2,350	98,136.00	0.17
251	000027	深圳能源	13,400	97,820.00	0.17
252	601636	旗滨集团	15,100	97,395.00	0.17
253	000998	隆平高科	9,900	97,317.00	0.17
254	603568	伟明环保	4,720	97,137.60	0.17
255	603883	老百姓	5,277	96,885.72	0.17
256	002926	华西证券	14,700	96,873.00	0.17
257	002624	完美世界	12,700	96,520.00	0.17
258	002497	雅化集团	10,800	96,336.00	0.17
259	603298	杭叉集团	4,900	96,236.00	0.17
260	600737	中粮糖业	10,000	95,900.00	0.17
261	300763	锦浪科技	2,300	95,772.00	0.17
262	601866	中远海发	37,100	95,718.00	0.17
263	300253	卫宁健康	16,200	95,580.00	0.17
264	002299	圣农发展	7,000	95,480.00	0.17
265	603077	和邦生物	57,800	95,370.00	0.17
266	688772	珠海冠宇	6,400	95,360.00	0.17
267	002653	海思科	3,100	95,170.00	0.17
268	300604	长川科技	3,500	95,095.00	0.17
269	600373	中文传媒	6,400	94,976.00	0.17
270	002065	东华软件	21,000	94,920.00	0.17
271	688114	华大智造	2,000	94,820.00	0.16
272	002056	横店东磁	7,600	94,772.00	0.16

273	601958	金钼股份	9,100	94,731.00	0.16
274	603290	斯达半导	1,100	94,721.00	0.16
275	603893	瑞芯微	1,600	94,672.00	0.16
276	600131	国网信通	5,600	94,472.00	0.16
277	002500	山西证券	20,100	94,470.00	0.16
278	300390	天华新能	5,490	94,318.20	0.16
279	600655	豫园股份	18,300	94,245.00	0.16
280	002414	高德红外	16,000	94,240.00	0.16
281	688385	复旦微电	3,000	94,140.00	0.16
282	300009	安科生物	11,000	93,940.00	0.16
283	002368	太极股份	4,100	92,455.00	0.16
284	002507	涪陵榨菜	7,540	92,365.00	0.16
285	002372	伟星新材	5,987	92,319.54	0.16
286	688002	睿创微纳	3,300	92,301.00	0.16
287	601611	中国核建	11,400	92,226.00	0.16
288	600707	彩虹股份	13,500	91,935.00	0.16
289	603885	吉祥航空	8,300	91,217.00	0.16
290	000887	中鼎股份	7,400	90,576.00	0.16
291	688301	奕瑞科技	784	90,340.32	0.16
292	002203	海亮股份	11,300	90,174.00	0.16
293	603379	三美股份	2,300	90,022.00	0.16
294	002831	裕同科技	3,500	89,565.00	0.16
295	600755	厦门国贸	12,400	88,908.00	0.15
296	603225	新凤鸣	5,700	88,863.00	0.15
297	688521	芯原股份	3,300	88,275.00	0.15
298	600859	王府井	7,500	88,050.00	0.15
299	600329	达仁堂	2,700	87,453.00	0.15
300	600995	南网储能	9,000	86,940.00	0.15
301	601880	辽港股份	70,500	86,715.00	0.15
302	600801	华新水泥	6,300	86,625.00	0.15
303	002683	广东宏大	4,300	86,559.00	0.15
304	600416	湘电股份	8,700	86,478.00	0.15
305	688390	固德威	1,540	86,424.80	0.15
306	600884	杉杉股份	10,600	86,072.00	0.15
307	600390	五矿资本	21,100	85,455.00	0.15
308	600435	北方导航	9,900	85,338.00	0.15
309	002019	亿帆医药	6,900	85,284.00	0.15
310	002506	协鑫集成	43,900	85,166.00	0.15
311	300070	碧水源	20,300	85,057.00	0.15
312	300296	利亚德	18,900	85,050.00	0.15
313	002244	滨江集团	11,700	84,942.00	0.15
314	600739	辽宁成大	10,100	84,537.00	0.15
315	600483	福能股份	7,200	83,952.00	0.15

316	300803	指南针	2,300	83,743.00	0.15
317	000050	深天马 A	11,500	83,720.00	0.15
318	600598	北大荒	6,700	83,683.00	0.15
319	600399	抚顺特钢	14,800	83,324.00	0.14
320	601098	中南传媒	6,700	83,214.00	0.14
321	300748	金力永磁	6,420	83,203.20	0.14
322	002572	索菲亚	5,400	82,782.00	0.14
323	601598	中国外运	14,700	82,761.00	0.14
324	600901	江苏金租	16,380	82,719.00	0.14
325	688200	华峰测控	900	82,575.00	0.14
326	002568	百润股份	4,900	82,467.00	0.14
327	002487	大金重工	3,600	82,368.00	0.14
328	688052	纳芯微	800	82,224.00	0.14
329	600848	上海临港	9,000	81,990.00	0.14
330	002240	盛新锂能	6,100	81,862.00	0.14
331	000155	川能动力	7,600	81,852.00	0.14
332	002080	中材科技	6,300	81,270.00	0.14
333	002373	千方科技	8,900	80,723.00	0.14
334	001286	陕西能源	7,000	80,710.00	0.14
335	300676	华大基因	2,300	80,523.00	0.14
336	002936	郑州银行	46,448	80,355.04	0.14
337	300595	欧普康视	5,100	79,968.00	0.14
338	688234	天岳先进	1,700	79,764.00	0.14
339	000563	陕国投 A	28,800	79,200.00	0.14
340	002557	洽洽食品	2,800	78,932.00	0.14
341	603858	步长制药	5,200	78,780.00	0.14
342	600968	海油发展	19,100	78,692.00	0.14
343	000778	新兴铸管	22,500	78,300.00	0.14
344	002268	电科网安	5,500	78,265.00	0.14
345	688536	思瑞浦	800	78,248.00	0.14
346	603712	七一二	4,300	78,217.00	0.14
347	300558	贝达药业	2,400	78,120.00	0.14
348	601928	凤凰传媒	7,100	77,816.00	0.14
349	600258	首旅酒店	6,300	77,805.00	0.14
350	601212	白银有色	27,800	77,284.00	0.13
351	600271	航天信息	10,500	77,280.00	0.13
352	688538	和辉光电	39,000	77,220.00	0.13
353	600062	华润双鹤	3,900	76,362.00	0.13
354	600528	中铁工业	10,400	76,128.00	0.13
355	000709	河钢股份	38,900	75,466.00	0.13
356	601155	新城控股	8,500	75,395.00	0.13
357	600977	中国电影	7,000	75,320.00	0.13
358	600378	昊华科技	2,600	75,140.00	0.13

359	002531	天顺风能	8,400	75,096.00	0.13
360	688220	翱捷科技	2,000	74,920.00	0.13
361	002408	齐翔腾达	13,340	74,704.00	0.13
362	000739	普洛药业	5,500	74,635.00	0.13
363	688005	容百科技	3,200	74,496.00	0.13
364	603688	石英股份	2,500	74,025.00	0.13
365	600959	江苏有线	28,000	73,920.00	0.13
366	688017	绿的谐波	900	73,890.00	0.13
367	688331	荣昌生物	1,700	73,440.00	0.13
368	601118	海南橡胶	16,100	73,255.00	0.13
369	000825	太钢不锈	21,500	72,670.00	0.13
370	603737	三棵树	1,980	71,814.60	0.12
371	603444	吉比特	400	71,204.00	0.12
372	603882	金域医学	2,600	70,694.00	0.12
373	600056	中国医药	6,980	70,637.60	0.12
374	603826	坤彩科技	2,420	70,107.40	0.12
375	603456	九洲药业	5,100	69,972.00	0.12
376	600906	财达证券	12,200	69,906.00	0.12
377	688063	派能科技	1,760	69,889.60	0.12
378	600612	老凤祥	1,200	69,828.00	0.12
379	601019	山东出版	5,900	69,738.00	0.12
380	600517	国网英大	16,100	69,713.00	0.12
381	000987	越秀资本	14,055	69,712.80	0.12
382	601399	国机重装	27,000	69,660.00	0.12
383	300212	易华录	4,100	69,003.00	0.12
384	688032	禾迈股份	596	68,408.88	0.12
385	002266	浙富控股	24,500	68,355.00	0.12
386	000937	冀中能源	10,000	67,000.00	0.12
387	600316	洪都航空	4,000	66,520.00	0.12
388	600871	石化油服	38,100	66,294.00	0.12
389	688567	孚能科技	6,900	66,240.00	0.12
390	603529	爱玛科技	2,400	65,592.00	0.11
391	002423	中粮资本	8,700	65,163.00	0.11
392	600925	苏能股份	12,900	65,145.00	0.11
393	603650	彤程新材	2,200	65,010.00	0.11
394	000032	深桑达 A	4,300	64,414.00	0.11
395	603728	鸣志电器	1,600	64,368.00	0.11
396	601965	中国汽研	3,800	64,182.00	0.11
397	001227	兰州银行	26,600	63,308.00	0.11
398	600208	新湖中宝	39,800	62,884.00	0.11
399	688297	中无人机	1,900	62,757.00	0.11
400	600098	广州发展	9,800	62,720.00	0.11
401	601298	青岛港	6,500	62,140.00	0.11

402	601608	中信重工	16,300	62,103.00	0.11
403	688516	奥特维	1,480	61,878.80	0.11
404	002607	中公教育	40,400	61,812.00	0.11
405	600663	陆家嘴	7,000	61,740.00	0.11
406	688029	南微医学	1,000	61,560.00	0.11
407	688561	奇安信	2,600	61,412.00	0.11
408	603233	大参林	4,288	61,318.40	0.11
409	600022	山东钢铁	50,000	61,000.00	0.11
410	002670	国盛金控	7,200	60,984.00	0.11
411	600578	京能电力	18,800	60,912.00	0.11
412	300438	鹏辉能源	3,300	60,522.00	0.11
413	601106	中国一重	25,800	59,598.00	0.10
414	300357	我武生物	2,943	59,507.46	0.10
415	600500	中化国际	16,900	58,981.00	0.10
416	600377	宁沪高速	4,600	57,960.00	0.10
417	600967	内蒙一机	8,000	57,600.00	0.10
418	002865	钧达股份	1,500	57,570.00	0.10
419	003031	中瓷电子	1,240	57,337.60	0.10
420	000785	居然之家	23,500	57,105.00	0.10
421	300776	帝尔激光	1,240	56,990.40	0.10
422	600315	上海家化	3,200	56,896.00	0.10
423	600350	山东高速	6,300	55,755.00	0.10
424	300888	稳健医疗	2,200	55,660.00	0.10
425	000958	电投产融	15,200	55,632.00	0.10
426	600827	百联股份	7,500	55,350.00	0.10
427	000559	万向钱潮	12,400	55,304.00	0.10
428	000537	中绿电	5,800	55,274.00	0.10
429	601568	北元集团	14,890	55,241.90	0.10
430	002608	江苏国信	7,100	55,025.00	0.10
431	688425	铁建重工	14,900	54,832.00	0.10
432	688349	三一重能	2,200	54,648.00	0.10
433	000156	华数传媒	8,700	54,636.00	0.10
434	002690	美亚光电	3,300	54,450.00	0.09
435	603517	绝味食品	3,500	53,900.00	0.09
436	603707	健友股份	4,534	53,863.92	0.09
437	601992	金隅集团	39,300	53,841.00	0.09
438	002867	周大生	4,100	53,546.00	0.09
439	600126	杭钢股份	12,700	52,197.00	0.09
440	003022	联泓新科	3,800	52,098.00	0.09
441	300682	朗新集团	6,100	51,911.00	0.09
442	603786	科博达	800	51,320.00	0.09
443	688475	萤石网络	1,500	51,165.00	0.09
444	688520	神州细胞	1,300	51,155.00	0.09

445	000967	盈峰环境	12,000	50,760.00	0.09
446	603218	日月股份	4,900	50,323.00	0.09
447	688778	厦钨新能	1,600	49,984.00	0.09
448	301267	华夏眼科	2,400	49,728.00	0.09
449	600032	浙江新能	6,800	49,504.00	0.09
450	600361	创新新材	12,200	49,166.00	0.09
451	600481	双良节能	10,500	49,035.00	0.09
452	600339	中油工程	15,700	48,984.00	0.09
453	000898	鞍钢股份	22,500	47,700.00	0.08
454	600095	湘财股份	8,000	47,680.00	0.08
455	688248	南网科技	1,600	47,408.00	0.08
456	003035	南网能源	10,700	47,080.00	0.08
457	603127	昭衍新药	3,544	47,028.88	0.08
458	600808	马钢股份	22,500	45,450.00	0.08
459	603185	弘元绿能	2,600	44,434.00	0.08
460	002153	石基信息	7,658	43,880.34	0.08
461	002563	森马服饰	7,500	43,575.00	0.08
462	601228	广州港	14,200	43,310.00	0.08
463	000539	粤电力 A	8,400	42,672.00	0.07
464	001872	招商港口	2,200	42,350.00	0.07
465	688779	长远锂科	9,100	42,133.00	0.07
466	688281	华秦科技	500	41,660.00	0.07
467	000401	冀东水泥	10,000	40,600.00	0.07
468	600928	西安银行	12,400	40,548.00	0.07
469	001203	大中矿业	4,200	40,362.00	0.07
470	000959	首钢股份	14,500	39,440.00	0.07
471	600764	中国海防	2,000	39,260.00	0.07
472	002518	科士达	2,200	38,940.00	0.07
473	688006	杭可科技	2,200	38,390.00	0.07
474	603056	德邦股份	2,900	37,990.00	0.07
475	603305	旭升集团	3,500	36,960.00	0.06
476	600299	安迪苏	3,800	36,860.00	0.06
477	601139	深圳燃气	5,400	36,072.00	0.06
478	688172	燕东微	2,200	35,596.00	0.06
479	300861	美畅股份	1,800	34,830.00	0.06
480	603317	天味食品	3,023	34,492.43	0.06
481	688276	百克生物	1,200	34,044.00	0.06
482	688819	天能股份	1,400	33,404.00	0.06
483	688387	信科移动	6,500	32,760.00	0.06
484	301029	怡合达	1,620	31,849.20	0.06
485	002791	坚朗五金	1,200	31,044.00	0.05
486	600927	永安期货	2,700	30,105.00	0.05
487	688153	唯捷创芯	800	29,600.00	0.05

488	601858	中国科传	1,500	28,680.00	0.05
489	000031	大悦城	12,000	28,080.00	0.05
490	688107	安路科技	1,100	27,962.00	0.05
491	601828	美凯龙	10,200	26,010.00	0.05
492	601158	重庆水务	5,400	25,920.00	0.05
493	002945	华林证券	2,500	24,950.00	0.04
494	600956	新天绿能	2,900	23,693.00	0.04
495	688348	昱能科技	400	23,600.00	0.04
496	688375	国博电子	300	21,192.00	0.04
497	688295	中复神鹰	900	18,270.00	0.03
498	301165	锐捷网络	600	17,904.00	0.03
499	603868	飞科电器	400	15,360.00	0.03

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300502	新易盛	288,722.00	0.40
2	688777	中控技术	251,751.78	0.35
3	601567	三星医疗	222,295.00	0.31
4	002422	科伦药业	201,529.00	0.28
5	002202	金风科技	193,881.00	0.27
6	002463	沪电股份	182,425.00	0.25
7	601615	明阳智能	182,351.00	0.25
8	603979	金诚信	179,537.00	0.25
9	688617	惠泰医疗	179,386.00	0.25
10	002436	兴森科技	178,416.00	0.25
11	300866	安克创新	177,873.50	0.25
12	000423	东阿阿胶	177,814.00	0.25
13	002028	思源电气	177,707.00	0.25
14	000988	华工科技	175,654.00	0.24
15	301358	湖南裕能	175,398.00	0.24
16	300394	天孚通信	173,625.00	0.24
17	300002	神州泰岳	169,248.00	0.24
18	000921	海信家电	168,126.00	0.23
19	000933	神火股份	165,873.00	0.23
20	300054	鼎龙股份	161,295.00	0.22

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	002463	沪电股份	694,875.00	0.97
2	002422	科伦药业	614,752.00	0.86
3	000975	山金国际	502,067.60	0.70
4	300418	昆仑万维	478,712.00	0.67
5	300502	新易盛	359,111.00	0.50
6	600160	巨化股份	295,487.00	0.41
7	300394	天孚通信	265,443.00	0.37
8	600161	天坛生物	253,871.00	0.35
9	300866	安克创新	240,694.00	0.34
10	002028	思源电气	229,886.00	0.32
11	002600	领益智造	229,592.00	0.32
12	688072	拓荆科技	221,520.36	0.31
13	000988	华工科技	220,530.00	0.31
14	600415	小商品城	220,299.00	0.31
15	000423	东阿阿胶	218,038.00	0.30
16	002966	苏州银行	213,359.00	0.30
17	000933	神火股份	207,847.00	0.29
18	002032	苏泊尔	201,807.00	0.28
19	600482	中国动力	195,607.00	0.27
20	300144	宋城演艺	191,510.00	0.27

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	25,496,701.86
卖出股票收入（成交）总额	28,772,193.19

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）	11,000.82	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,000.82	0.02

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	113685	升 24 转债	110	11,000.82	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	249,012.74
2	应收清算款	-
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	249,012.74

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

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 (%)
606	36,044.01	17,427,435.00	79.79	4,415,237.00	20.21

注：

机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“招商银行股份有限公司—泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”持有的份额。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
招商银行股份有限公司-泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	12,500,100.00	57.23

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	东方证券股份有限公司	2,778,880.00	12.72
2	中信建投证券股份有限公司	1,472,852.00	6.74
3	广发证券股份有限公司	469,623.00	2.15
4	王少孟	371,300.00	1.70
5	华泰证券股份有限公司	200,080.00	0.92
6	于岚	155,400.00	0.71
7	袁玲	128,439.00	0.59
8	靳绪玲	124,991.00	0.57
9	许春明	120,000.00	0.55
10	李德良	113,017.00	0.52
11	招商银行股份有限公司—泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	12,500,100.00	57.23

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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（2020年9月18日） 基金份额总额	243,999,138.00
本报告期期初基金份额总额	25,042,672.00
本报告期基金总申购份额	10,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,842,672.00

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 1 月 20 日发布公告，陈奕伦先生自 2024 年 1 月 18 日起担任公司董事长，段国圣先生自 2024 年 1 月 18 日起不再担任公司董事长。

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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	33,408,534.12	61.57	17,246.29	61.36	-
中信证券	3	20,852,260.93	38.43	10,862.28	38.64	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-

长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海 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	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	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

交易单元租用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, 并能根据基金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) 满足基金运作的保密要求;

(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和服务质量进行评估, 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、本报告期内本基金减少租用 8 个交易单元, 国海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个, 方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个, 中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个, 中信建投证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	16,680.34	100.00	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-

汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
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	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 01 月 19 日
2	泰康基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 01 月 20 日
3	泰康基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在深圳前海微众银行股份有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告	《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	2024 年 03 月 25 日

4	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 03 月 29 日
5	关于调整泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	《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	2024 年 04 月 09 日
6	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议更新	《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	2024 年 04 月 10 日
7	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 1 次更新)	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 04 月 10 日
8	泰康中证 500 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	2024 年 04 月 10 日
9	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同更新	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 04 月 10 日
10	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 04 月 19 日
11	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中泰证券股份有限公司转换费率优惠活动的公告	《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	2024 年 05 月 23 日
12	泰康中证 500 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	2024 年 06 月 26 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	20240101-20240630	13,494,700.00	9,380,400.00	10,375,000.00	12,500,100.00	57.23
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 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康中证 500 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

2024 年 8 月 29 日