

泰康中证 1000 指数增强型发起式  
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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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	13
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	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
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	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55

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	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12	投资组合报告附注	55
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>57</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	58
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>59</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>60</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4	基金投资策略的改变	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8	其他重大事件	61
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>63</b>
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	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>64</b>
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	泰康中证 1000 指数增强发起	
基金主代码	019185	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 10 月 26 日	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,794,856.53 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 1000 指数增强发起 A	泰康中证 1000 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	019185	019186
报告期末下属分级基金的份额总额	18,467,472.48 份	34,327,384.05 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 1000 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 1000 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

	<p>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。当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金可投资存托凭证，在控制风险的前提下，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择具有比较优势的存托凭证进行投资。出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。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。</p> <p>本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p>
业绩比较基准	中证 1000 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。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	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	周直毅
	联系电话	010-89620366	021-68475608
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		4001895522	95594
传真		010-89620100	021-68476901
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层
邮政编码		100033	200120
法定代表人		金志刚	金煜

### 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	泰康基金管理有限公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	泰康中证 1000 指数增强发起 A	泰康中证 1000 指数增强发起 C
本期已实现收益	-2,817,692.93	-4,334,585.66
本期利润	-3,055,408.03	-5,290,777.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1326	-0.1575
本期加权平均净值利润率	-14.50%	-17.27%
本期基金份额净值增长率	-11.73%	-11.90%
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	-2,416,903.53	-4,573,612.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1309	-0.1332
期末基金资产净值	16,050,568.95	29,753,771.37
期末基金份额净值	0.8691	0.8668
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	-13.09%	-13.32%

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。

（4）本基金合同生效日为 2023 年 10 月 26 日，截至报告期末不满一年。



### 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 1000 指数增强发起 A

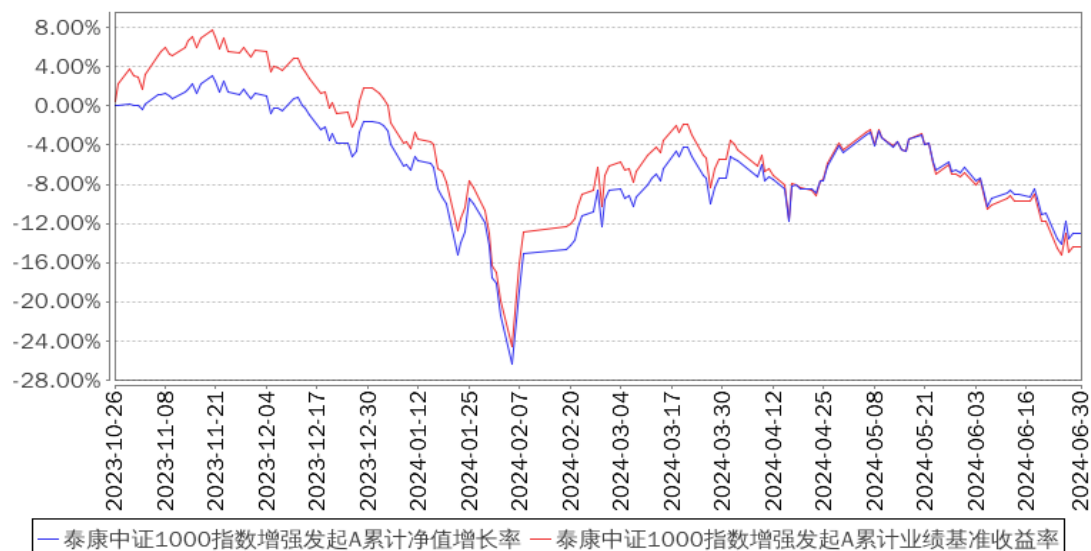
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.25%	1.33%	-8.15%	1.36%	0.90%	-0.03%
过去三个月	-6.18%	1.37%	-9.51%	1.42%	3.33%	-0.05%
过去六个月	-11.73%	1.85%	-15.97%	1.87%	4.24%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-13.09%	1.61%	-14.46%	1.66%	1.37%	-0.05%

泰康中证 1000 指数增强发起 C

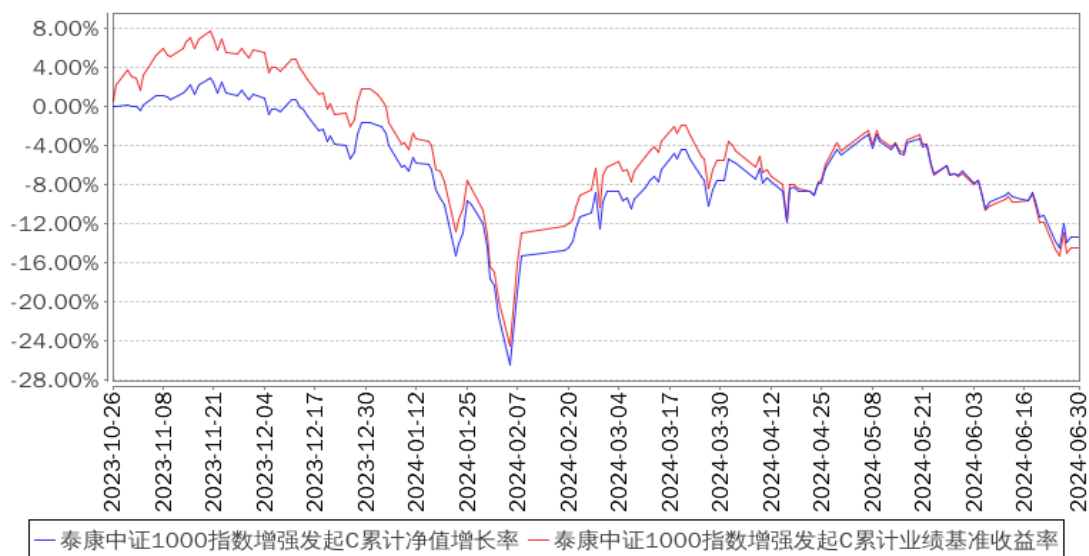
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.26%	1.33%	-8.15%	1.36%	0.89%	-0.03%
过去三个月	-6.26%	1.37%	-9.51%	1.42%	3.25%	-0.05%
过去六个月	-11.90%	1.85%	-15.97%	1.87%	4.07%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-13.32%	1.62%	-14.46%	1.66%	1.14%	-0.04%

#### 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1000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1000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10月26日生效，截止报告期末本基金未满一年。

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	2023 年 10 月 26 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。

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 0.8691 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为-11.73%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 0.8668 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为-11.90%；同期业绩比较基准增长率为-15.97%。

## 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。

下半年操作方面，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）、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，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、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

### 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，认为复核内容真实、准确、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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,872,529.54	6,899,674.11
结算备付金		1,685,578.37	4,444,279.95
存出保证金		344,174.40	841,910.40
交易性金融资产	6.4.7.2	40,317,177.90	66,557,856.31
其中：股票投资		40,317,177.90	66,508,853.00
基金投资		-	-
债券投资		-	49,003.31
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		1,178,867.74	72,508.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		50,398,327.95	78,816,229.60
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
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		4,490,722.14	-



应付管理人报酬		31,448.59	51,411.34
应付托管费		3,931.09	6,426.41
应付销售服务费		10,202.73	14,396.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	57,683.08	15,000.00
负债合计		4,593,987.63	87,233.89
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	52,794,856.53	79,991,563.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-6,990,516.21	-1,262,567.85
净资产合计		45,804,340.32	78,728,995.71
负债和净资产总计		50,398,327.95	78,816,229.60

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 52,794,856.53 份，其中泰康中证 1000 指数增强发起 A 基金份额总额 18,467,472.48 份，基金份额净值 0.8691 元；泰康中证 1000 指数增强发起 C 基金份额总额 34,327,384.05 份，基金份额净值 0.8668 元。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-7,994,774.02
1. 利息收入		36,471.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	36,471.48
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）		-6,859,203.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,728,424.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	6,828.71
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	-560,237.79
股利收益	6.4.7.19	422,629.52

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	-1,193,907.27
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	21,865.54
<b>减：二、营业总支出</b>		351,411.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	205,818.72
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,727.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	60,920.29
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		0.02
8. 其他费用	6.4.7.23	58,945.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,346,185.86
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,346,185.86
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-8,346,185.86

注：本基金合同生效日为 2023 年 10 月 26 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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	79,991,563.56	-	-1,262,567.85	78,728,995.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	79,991,563.56	-	-1,262,567.85	78,728,995.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,196,707.03	-	-5,727,948.36	-32,924,655.39
(一)、综合收益总额	-	-	-8,346,185.86	-8,346,185.86
(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)	-27,196,707.03	-	2,618,237.50	-24,578,469.53
其中：1. 基金申购款	93,922,014.02	-	-7,612,073.46	86,309,940.56
2. 基金赎回款	- 121,118,721.05	-	10,230,310.96	-110,888,410.09
(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	52,794,856.53	-	-6,990,516.21	45,804,340.32

注：本基金合同生效日为 2023 年 10 月 26 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

金志刚

基金管理人负责人

金志刚

主管会计工作负责人

李俊佑

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰康中证 1000 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〕1761 号《关于准予泰康中证 1000 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 1000 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，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 74,777,807.99 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 2300950 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 10 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 74,791,738.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 13,930.61 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”），基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）。

根据经中国证监会备案的《泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《泰康中证 1000 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 1000 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 1000 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）、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 1000 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 1000 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%；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 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、自 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。

#### 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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推

开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。

(b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资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，股权的股息、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。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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
	2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,823,707.49
等于：本金	5,822,697.14
加：应计利息	1,010.35
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	1,048,822.05
等于：本金	1,048,612.48
加：应计利息	209.57
减：坏账准备	-
合计	6,872,529.54

#### 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	42,768,741.73	-	40,317,177.90	-2,451,563.83
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	42,768,741.73	-	40,317,177.90	-2,451,563.83

#### 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			备注
	2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,165,840.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,165,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,165,840.00	-	-	-

#### 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
IM2409	IM2409	3.00	2,868,120.00	-297,720.00
合计				-297,720.00
减：可抵销期货暂收款				-297,720.00
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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,683.08
合计	57,683.08

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康中证 1000 指数增强发起 A

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	34,108,836.34	34,108,836.34
本期申购	3,778,902.48	3,778,902.48
本期赎回（以“-”号填列）	-19,420,266.34	-19,420,266.34
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	18,467,472.48	18,467,472.48

## 泰康中证 1000 指数增强发起 C

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	45,882,727.22	45,882,727.22
本期申购	90,143,111.54	90,143,111.54
本期赎回(以“-”号填列)	-101,698,454.71	-101,698,454.71
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	34,327,384.05	34,327,384.05

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

## 泰康中证 1000 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	227,133.15	-751,575.10	-524,441.95
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	227,133.15	-751,575.10	-524,441.95
本期利润	-2,817,692.93	-237,715.10	-3,055,408.03
本期基金份额交易产生的变动数	734,734.46	428,211.99	1,162,946.45
其中：基金申购款	-182,784.57	-243,176.59	-425,961.16
基金赎回款	917,519.03	671,388.58	1,588,907.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,855,825.32	-561,078.21	-2,416,903.53

## 泰康中证 1000 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	272,357.34	-1,010,483.24	-738,125.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	272,357.34	-1,010,483.24	-738,125.90
本期利润	-4,334,585.66	-956,192.17	-5,290,777.83
本期基金份额交易产生的变动数	530,464.41	924,826.64	1,455,291.05
其中：基金申购款	-5,168,592.44	-2,017,519.86	-7,186,112.30
基金赎回款	5,699,056.85	2,942,346.50	8,641,403.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,531,763.91	-1,041,848.77	-4,573,612.68

#### 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	15,386.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,084.12
结算备付金利息收入	18,000.21
其他	0.73
合计	36,471.48

#### 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	-6,728,424.21
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	-6,728,424.21

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	161,648,660.19
减：卖出股票成本总额	168,028,301.54
减：交易费用	348,782.86
买卖股票差价收入	-6,728,424.21

## 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

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	5.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,823.49
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	6,828.71

## 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	55,834.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,000.00
减：应计利息总额	8.71
减：交易费用	2.23
买卖债券差价收入	6,823.49

## 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	-560,237.79

## 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	422,629.52
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	422,629.52

## 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	-979,707.27
股票投资	-979,707.27
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	-214,200.00
权证投资	-
期货投资	-214,200.00
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	-1,193,907.27

#### 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	21,865.54
合计	21,865.54

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,901.52
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	1,262.35
合计	58,945.43

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
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
当期发生的基金应支付的管理费	205,818.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	92,867.90

应支付基金管理人的净管理费	112,950.82
---------------	------------

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

#### 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
当期发生的基金应支付的托管费	25,727.38

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

#### 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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 1000 指数增强发起 A	泰康中证 1000 指数增强发起 C	合计
泰康基金管理有限公司	-	951.57	951.57
合计	-	951.57	951.57

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：

$$\text{C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类份额基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

#### 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

本报告期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

泰康中证 1000 指数增强发起 A

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 (%)
泰康资产管理有限责任公司	9,900,935.09	53.6128	9,900,935.09	29.0275

份额单位：份

泰康中证 1000 指数增强发起 C

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 (%)
泰康资产管理有限责任公司	100,009.44	0.2913	100,009.44	0.2180

## 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	
	期末余额	当期利息收入
上海银行-银行存款	5,823,707.49	15,386.42
上海银行-券商保证金	1,048,822.05	3,084.12

注：1、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。

2、本基金的券商保证金为存放在基金托管人专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

## 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

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上海银行股份有限公司，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	0.00	49,003.31
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	49,003.31

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同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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

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	6,872,529.54	-	-	-	6,872,529.54
结算备付金	1,685,578.37	-	-	-	1,685,578.37
存出保证金	344,174.40	-	-	-	344,174.40
交易性金融资产	-	-	-	40,317,177.90	40,317,177.90
应收申购款	-	-	-	1,178,867.74	1,178,867.74
资产总计	8,902,282.31	-	-	41,496,045.64	50,398,327.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,490,722.14	4,490,722.14
应付管理人报酬	-	-	-	31,448.59	31,448.59
应付托管费	-	-	-	3,931.09	3,931.09
应付销售服务费	-	-	-	10,202.73	10,202.73
其他负债	-	-	-	57,683.08	57,683.08
负债总计	-	-	-	4,593,987.63	4,593,987.63
利率敏感度缺口	8,902,282.31	-	-	36,902,058.01	45,804,340.32
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	6,899,674.11	-	-	-	6,899,674.11
结算备付金	4,444,279.95	-	-	-	4,444,279.95
存出保证金	841,910.40	-	-	-	841,910.40
交易性金融资产	-	39,002.56	10,000.75	66,508,853.00	66,557,856.31
应收申购款	-	-	-	72,508.83	72,508.83
资产总计	12,185,864.46	39,002.56	10,000.75	66,581,361.83	78,816,229.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,411.34	51,411.34
应付托管费	-	-	-	6,426.41	6,426.41
应付销售服务费	-	-	-	14,396.03	14,396.03
应交税费	-	-	-	0.11	0.11
其他负债	-	-	-	15,000.00	15,000.00
负债总计	-	-	-	87,233.89	87,233.89
利率敏感度缺口	12,185,864.46	39,002.56	10,000.75	66,494,127.94	78,728,995.71

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。本基金的投资组合比例为：本基金以标的指数（中证 1000 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 1000 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%；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。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	40,317,177.90	88.02	66,508,853.00	84.48
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	40,317,177.90	88.02	66,508,853.00	84.48

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	40,317,177.90	66,508,853.00
第二层次	-	49,003.31
第三层次	-	-
合计	40,317,177.90	66,557,856.31

###### 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	40,317,177.90	80.00
	其中：股票	40,317,177.90	80.00
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	8,558,107.91	16.98
8	其他各项资产	1,523,042.14	3.02
9	合计	50,398,327.95	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	264,860.00	0.58
B	采矿业	1,122,658.00	2.45
C	制造业	21,397,560.00	46.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	853,797.00	1.86
E	建筑业	928,647.00	2.03
F	批发和零售业	1,296,042.00	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	742,024.00	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,835,523.00	8.37
J	金融业	1,041,608.30	2.27
K	房地产业	255,412.00	0.56
L	租赁和商务服务	1,109,915.00	2.42

	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	422,824.00	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	134,106.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	322,976.00	0.71
S	综合	-	-
	合计	33,727,952.30	73.63

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	435,220.00	0.95
C	制造业	4,777,749.60	10.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	198,536.00	0.43
E	建筑业	19,980.00	0.04
F	批发和零售业	140,826.00	0.31
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	836,858.00	1.83
J	金融业	62,040.00	0.14
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	10,496.00	0.02
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	107,520.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	-	-

	乐业		
S	综合	-	-
	合计	6,589,225.60	14.39

### 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	000415	渤海租赁	101,000	257,550.00	0.56
2	300476	胜宏科技	7,700	248,402.00	0.54
3	688088	虹软科技	8,400	242,424.00	0.53
4	300573	兴齐眼药	1,460	239,440.00	0.52
5	000928	中钢国际	42,900	238,095.00	0.52
6	000426	兴业银锡	16,700	226,786.00	0.50
7	002139	拓邦股份	21,300	226,206.00	0.49
8	002649	博彦科技	27,800	221,288.00	0.48
9	000758	中色股份	41,300	209,804.00	0.46
10	688578	艾力斯	3,200	203,968.00	0.45
11	601001	晋控煤业	12,200	201,544.00	0.44
12	300049	福瑞股份	4,000	201,360.00	0.44
13	002745	木林森	24,600	198,276.00	0.43
14	600761	安徽合力	9,100	196,924.00	0.43
15	600320	振华重工	57,400	196,308.00	0.43
16	002004	华邦健康	51,000	193,800.00	0.42
17	600711	盛屯矿业	52,200	191,574.00	0.42
18	000690	宝新能源	37,300	190,230.00	0.42
19	000795	英洛华	34,200	189,468.00	0.41
20	300857	协创数据	3,300	188,100.00	0.41
21	603308	应流股份	15,100	187,542.00	0.41
22	688018	乐鑫科技	1,900	187,492.00	0.41
23	000034	神州数码	8,000	183,120.00	0.40
24	300679	电连技术	4,500	181,035.00	0.40
25	002389	航天彩虹	13,000	180,570.00	0.39
26	002245	蔚蓝锂芯	23,000	178,250.00	0.39
27	002807	江阴银行	46,700	176,059.00	0.38
28	601126	四方股份	9,000	172,980.00	0.38
29	601222	林洋能源	27,500	172,425.00	0.38
30	601375	中原证券	50,300	171,523.00	0.37
31	600422	昆药集团	9,500	169,385.00	0.37

32	300182	捷成股份	45,600	169,176.00	0.37
33	300638	广和通	9,800	167,580.00	0.37
33	603505	金石资源	6,000	167,580.00	0.37
34	600750	江中药业	7,200	166,392.00	0.36
35	002145	中核钛白	50,700	166,296.00	0.36
36	002925	盈趣科技	13,100	165,977.00	0.36
37	600667	太极实业	29,000	165,590.00	0.36
38	300034	钢研高纳	10,400	165,256.00	0.36
39	300229	拓尔思	12,300	165,189.00	0.36
40	600821	金开新能	32,100	164,994.00	0.36
41	600552	凯盛科技	17,400	164,082.00	0.36
42	000035	中国天楹	36,000	163,080.00	0.36
43	002484	江海股份	12,300	162,975.00	0.36
44	002617	露笑科技	33,900	162,720.00	0.36
45	002701	奥瑞金	39,000	162,240.00	0.35
46	600201	生物股份	22,500	162,225.00	0.35
47	000927	中国铁物	67,900	161,602.00	0.35
48	600273	嘉化能源	22,600	161,364.00	0.35
49	600602	云赛智联	14,600	161,184.00	0.35
50	002036	联创电子	23,800	160,650.00	0.35
50	688278	特宝生物	3,000	160,650.00	0.35
51	600596	新安股份	21,100	160,360.00	0.35
52	002583	海能达	39,300	159,951.00	0.35
53	300303	聚飞光电	32,900	159,894.00	0.35
54	601678	滨化股份	45,900	159,732.00	0.35
55	000810	创维数字	18,600	159,588.00	0.35
56	002100	天康生物	22,900	158,697.00	0.35
57	600562	国睿科技	11,600	158,456.00	0.35
58	600420	国药现代	14,800	158,064.00	0.35
59	688016	心脉医疗	1,600	156,880.00	0.34
60	002467	二六三	46,900	156,646.00	0.34
61	000650	仁和药业	26,500	156,350.00	0.34
62	603766	隆鑫通用	23,000	155,940.00	0.34
63	600577	精达股份	39,100	155,227.00	0.34
64	002351	漫步者	11,800	155,170.00	0.34
65	000420	吉林化纤	49,000	154,840.00	0.34
66	002948	青岛银行	45,800	154,346.00	0.34
67	002237	恒邦股份	13,400	154,234.00	0.34
68	300170	汉得信息	25,100	154,114.00	0.34
69	002020	京新药业	14,700	153,909.00	0.34
70	600158	中体产业	20,000	153,800.00	0.34
71	603358	华达科技	5,300	152,905.00	0.33
72	002171	楚江新材	23,200	152,888.00	0.33

73	603599	广信股份	12,600	152,838.00	0.33
74	600252	中恒集团	70,300	152,551.00	0.33
75	300035	中科电气	17,900	152,329.00	0.33
76	002212	天融信	31,200	151,944.00	0.33
77	600037	歌华有线	25,400	151,892.00	0.33
78	600409	三友化工	30,200	151,604.00	0.33
79	600459	贵研铂业	11,200	151,312.00	0.33
80	600688	上海石化	57,900	151,119.00	0.33
81	600267	海正药业	21,500	150,930.00	0.33
82	002123	梦网科技	21,400	150,442.00	0.33
83	300188	国投智能	13,500	149,985.00	0.33
84	601369	陕鼓动力	18,700	149,974.00	0.33
85	002061	浙江交科	41,000	149,650.00	0.33
86	002174	游族网络	19,700	149,523.00	0.33
87	688100	威胜信息	3,900	148,785.00	0.32
88	000821	京山轻机	13,100	148,423.00	0.32
89	002635	安洁科技	9,600	148,224.00	0.32
90	002010	传化智联	38,400	147,456.00	0.32
90	300113	顺网科技	14,400	147,456.00	0.32
91	000727	冠捷科技	71,500	147,290.00	0.32
92	002354	天娱数科	49,200	147,108.00	0.32
93	600480	凌云股份	14,900	146,467.00	0.32
94	600125	铁龙物流	24,500	146,265.00	0.32
95	002215	诺普信	19,600	146,020.00	0.32
96	002681	奋达科技	39,900	145,635.00	0.32
97	603699	纽威股份	8,500	145,520.00	0.32
98	002276	万马股份	20,200	144,834.00	0.32
99	002906	华阳集团	5,400	144,504.00	0.32
100	600055	万东医疗	11,700	144,495.00	0.32
101	600557	康缘药业	9,200	144,440.00	0.32
102	000811	冰轮环境	14,900	143,785.00	0.31
103	002468	申通快递	17,100	143,640.00	0.31
104	600933	爱柯迪	9,700	143,463.00	0.31
105	300463	迈克生物	12,600	143,388.00	0.31
106	688007	光峰科技	8,900	143,290.00	0.31
107	000065	北方国际	13,800	143,106.00	0.31
108	002127	南极电商	55,000	143,000.00	0.31
109	002315	焦点科技	5,300	142,888.00	0.31
110	301035	润丰股份	3,200	142,528.00	0.31
111	002498	汉缆股份	43,200	142,128.00	0.31
112	600556	天下秀	39,000	141,960.00	0.31
113	002727	一心堂	9,400	141,846.00	0.31
114	000990	诚志股份	19,000	141,360.00	0.31

115	301071	力量钻石	5,100	141,321.00	0.31
116	601619	嘉泽新能	46,500	140,895.00	0.31
117	300379	东方通	17,400	140,592.00	0.31
118	688409	富创精密	3,800	140,372.00	0.31
119	300233	金城医药	9,400	140,248.00	0.31
120	603368	柳药集团	8,000	140,000.00	0.31
121	688123	聚辰股份	2,300	139,909.00	0.31
122	603328	依顿电子	17,700	139,122.00	0.30
123	300226	上海钢联	8,200	138,908.00	0.30
124	300409	道氏技术	16,200	138,672.00	0.30
125	603919	金徽酒	7,600	138,092.00	0.30
126	600997	开滦股份	20,100	137,886.00	0.30
127	300687	赛意信息	9,900	137,808.00	0.30
128	300451	创业慧康	39,800	137,708.00	0.30
129	300087	荃银高科	22,200	137,196.00	0.30
130	600623	华谊集团	23,700	136,986.00	0.30
131	000550	江铃汽车	6,300	136,773.00	0.30
132	002390	信邦制药	41,300	136,703.00	0.30
133	002705	新宝股份	9,700	136,479.00	0.30
134	603100	川仪股份	5,800	136,358.00	0.30
135	000828	东莞控股	15,100	136,051.00	0.30
136	600835	上海机电	11,800	135,818.00	0.30
137	600391	航发科技	8,900	135,725.00	0.30
138	002204	大连重工	31,600	134,932.00	0.29
139	688503	聚和材料	4,800	134,880.00	0.29
140	002291	遥望科技	31,300	134,590.00	0.29
141	600477	杭萧钢构	57,700	134,441.00	0.29
142	603936	博敏电子	16,000	134,400.00	0.29
143	600729	重庆百货	6,000	134,160.00	0.29
144	600169	太原重工	73,300	134,139.00	0.29
145	002219	新里程	72,100	134,106.00	0.29
146	002250	联化科技	27,900	133,920.00	0.29
147	000567	海德股份	23,830	133,686.30	0.29
148	605333	沪光股份	4,800	133,680.00	0.29
149	601609	金田股份	23,600	133,576.00	0.29
150	001213	中铁特货	33,800	133,510.00	0.29
151	600812	华北制药	32,400	133,488.00	0.29
152	300119	瑞普生物	9,800	133,476.00	0.29
153	002283	天润工业	31,100	133,419.00	0.29
154	603638	艾迪精密	9,500	133,285.00	0.29
155	300323	华灿光电	30,600	133,110.00	0.29
156	002267	陕天然气	17,600	133,056.00	0.29
157	600929	雪天盐业	25,100	133,030.00	0.29



158	000557	西部创业	35,300	132,728.00	0.29
159	000061	农产品	27,300	132,678.00	0.29
160	688388	嘉元科技	13,600	132,600.00	0.29
161	301175	中科环保	30,200	132,578.00	0.29
162	600195	中牧股份	17,600	131,824.00	0.29
163	000498	山东路桥	25,200	131,796.00	0.29
164	603187	海容冷链	11,300	131,758.00	0.29
165	603169	兰石重装	29,200	131,400.00	0.29
166	688630	芯碁微装	2,100	131,397.00	0.29
167	300821	东岳硅材	19,200	131,328.00	0.29
168	002488	金固股份	29,900	131,261.00	0.29
169	600643	爱建集团	34,800	131,196.00	0.29
170	688586	江航装备	14,100	131,130.00	0.29
171	301078	孩子王	25,900	131,054.00	0.29
172	301316	慧博云通	8,900	130,652.00	0.29
173	002191	劲嘉股份	36,100	130,321.00	0.28
174	688232	新点软件	6,600	130,152.00	0.28
175	002782	可立克	11,700	129,636.00	0.28
176	301015	百洋医药	5,500	129,415.00	0.28
177	600861	北京人力	7,900	128,928.00	0.28
178	000517	荣安地产	48,100	128,908.00	0.28
179	300369	绿盟科技	25,200	128,772.00	0.28
180	600662	外服控股	32,100	128,721.00	0.28
181	002135	东南网架	32,500	128,700.00	0.28
182	603229	奥翔药业	12,800	128,640.00	0.28
183	002265	建设工业	14,900	128,587.00	0.28
184	002516	旷达科技	35,300	128,492.00	0.28
185	000597	东北制药	33,200	128,484.00	0.28
186	002041	登海种业	15,800	127,664.00	0.28
187	600475	华光环能	14,600	127,166.00	0.28
188	600225	卓朗科技	73,000	127,020.00	0.28
189	603055	台华新材	12,500	126,625.00	0.28
190	000718	苏宁环球	75,300	126,504.00	0.28
191	603113	金能科技	23,000	125,810.00	0.27
192	603915	国茂股份	12,200	125,538.00	0.27
193	002978	安宁股份	4,500	125,370.00	0.27
194	600810	神马股份	20,200	125,240.00	0.27
195	300080	易成新能	43,200	124,416.00	0.27
196	002901	大博医疗	4,800	123,984.00	0.27
197	601886	江河集团	25,400	123,952.00	0.27
198	001323	慕思股份	4,300	123,711.00	0.27
199	600691	阳煤化工	72,200	123,462.00	0.27
200	688209	英集芯	9,900	122,859.00	0.27

201	300140	节能环境	20,500	122,385.00	0.27
202	002534	西子洁能	12,200	122,122.00	0.27
203	688776	国光电气	2,200	121,880.00	0.27
204	603489	八方股份	4,500	121,410.00	0.27
205	603297	永新光学	2,000	120,980.00	0.26
206	002911	佛燃能源	13,200	120,648.00	0.26
207	300741	华宝股份	7,900	120,396.00	0.26
208	601068	中铝国际	28,400	119,564.00	0.26
209	603093	南华期货	13,800	119,508.00	0.26
210	600400	红豆股份	55,000	119,350.00	0.26
211	300973	立高食品	4,200	117,978.00	0.26
212	603057	紫燕食品	7,700	117,964.00	0.26
213	000030	富奥股份	24,000	117,840.00	0.26
214	002961	瑞达期货	10,700	117,165.00	0.26
215	601279	英利汽车	29,100	108,543.00	0.24
216	603013	亚普股份	8,000	107,760.00	0.24
217	600874	创业环保	18,600	103,974.00	0.23
218	002318	久立特材	3,800	88,654.00	0.19
219	300624	万兴科技	1,400	74,298.00	0.16
220	688208	道通科技	3,000	72,420.00	0.16
221	002456	欧菲光	8,900	69,509.00	0.15
222	300352	北信源	16,700	64,128.00	0.14
223	688798	艾为电子	1,000	56,620.00	0.12
224	300820	英杰电气	1,300	51,142.00	0.11
225	000088	盐田港	11,000	49,830.00	0.11
226	601137	博威合金	3,200	48,768.00	0.11
227	603876	鼎胜新材	5,100	47,277.00	0.10
228	600458	时代新材	4,400	44,440.00	0.10
229	003021	兆威机电	900	41,535.00	0.09
230	601099	太平洋	12,500	38,125.00	0.08
231	688608	恒玄科技	200	29,276.00	0.06
232	600710	苏美达	3,400	27,710.00	0.06
233	002402	和而泰	2,400	25,704.00	0.06
234	603197	保隆科技	800	25,200.00	0.06
235	603236	移远通信	300	14,019.00	0.03
236	603118	共进股份	2,000	13,400.00	0.03
237	000403	派林生物	500	13,330.00	0.03
238	300339	润和软件	400	8,268.00	0.02
239	600682	南京新百	1,000	4,990.00	0.01
240	605365	立达信	300	4,761.00	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	601016	节能风电	66,400	198,536.00	0.43
2	002602	世纪华通	49,800	170,814.00	0.37
3	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.32
4	002463	沪电股份	3,600	131,400.00	0.29
5	002225	濮耐股份	28,300	115,747.00	0.25
6	601728	中国电信	18,500	113,775.00	0.25
7	688111	金山办公	500	113,750.00	0.25
8	600386	北巴传媒	40,600	113,274.00	0.25
9	002449	国星光电	15,800	112,496.00	0.25
10	002282	博深股份	17,600	112,464.00	0.25
11	002787	华源控股	16,600	112,216.00	0.24
12	603618	杭电股份	25,600	112,128.00	0.24
13	002519	银河电子	22,700	111,457.00	0.24
14	300016	北陆药业	25,200	111,132.00	0.24
15	002638	勤上股份	74,500	111,005.00	0.24
16	600050	中国联通	23,600	110,920.00	0.24
17	000551	创元科技	12,700	110,871.00	0.24
18	000725	京东方 A	27,100	110,839.00	0.24
19	000630	铜陵有色	30,700	110,827.00	0.24
20	002392	北京利尔	35,100	110,565.00	0.24
21	603993	洛阳钼业	13,000	110,500.00	0.24
22	601857	中国石油	10,700	110,424.00	0.24
23	002692	远程股份	32,800	109,880.00	0.24
24	000576	甘化科工	18,300	109,800.00	0.24
25	600183	生益科技	5,200	109,512.00	0.24
26	688089	嘉必优	8,200	108,568.00	0.24
27	002551	尚荣医疗	46,500	108,345.00	0.24
28	600690	海尔智家	3,800	107,844.00	0.24
29	300124	汇川技术	2,100	107,730.00	0.24
30	600327	大东方	33,600	107,520.00	0.23
31	000975	山金国际	6,600	107,514.00	0.23
32	600941	中国移动	1,000	107,500.00	0.23
33	600547	山东黄金	3,900	106,782.00	0.23
34	603538	美诺华	9,300	103,881.00	0.23
35	688358	祥生医疗	4,000	103,880.00	0.23
36	002688	金河生物	28,500	103,455.00	0.23
37	300396	迪瑞医疗	4,900	99,519.00	0.22
38	688176	亚虹医药	19,400	99,134.00	0.22
39	688677	海泰新光	2,400	94,152.00	0.21

40	688095	福昕软件	1,700	77,877.00	0.17
41	600405	动力源	20,200	72,922.00	0.16
42	002121	科陆电子	18,700	70,873.00	0.15
43	688599	天合光能	4,100	69,372.00	0.15
44	601633	长城汽车	2,700	68,310.00	0.15
45	603396	金辰股份	2,100	68,187.00	0.15
46	000999	华润三九	1,600	68,128.00	0.15
47	601318	中国平安	1,500	62,040.00	0.14
48	002555	三七互娱	4,600	60,030.00	0.13
49	300002	神州泰岳	7,200	58,464.00	0.13
50	300179	四方达	7,700	50,897.00	0.11
51	600219	南山铝业	13,200	50,292.00	0.11
52	603601	再升科技	16,400	45,264.00	0.10
53	002206	海利得	11,700	44,694.00	0.10
54	002522	浙江众成	14,100	44,556.00	0.10
55	688550	瑞联新材	1,900	44,061.00	0.10
56	300740	水羊股份	3,000	44,040.00	0.10
57	603217	元利科技	3,100	43,710.00	0.10
58	000589	贵州轮胎	8,600	43,602.00	0.10
59	600067	冠城大通	24,100	42,175.00	0.09
60	002483	润邦股份	9,200	41,492.00	0.09
61	600262	北方股份	2,400	39,432.00	0.09
62	300193	佳士科技	5,300	39,326.00	0.09
63	300445	康斯特	2,400	38,640.00	0.08
64	002833	弘亚数控	2,100	38,304.00	0.08
65	601717	郑煤机	2,500	37,000.00	0.08
66	002083	孚日股份	8,400	35,532.00	0.08
67	603408	建霖家居	2,600	34,294.00	0.07
68	603610	麒盛科技	3,400	33,592.00	0.07
69	688772	珠海冠宇	2,000	29,800.00	0.07
70	603296	华勤技术	500	27,615.00	0.06
71	601113	华鼎股份	8,400	27,552.00	0.06
72	603160	汇顶科技	400	27,500.00	0.06
73	000823	超声电子	3,100	26,381.00	0.06
74	603890	春秋电子	2,900	26,274.00	0.06
75	002106	莱宝高科	2,400	26,160.00	0.06
76	002273	水晶光电	1,500	25,470.00	0.06
77	003019	宸展光电	1,000	25,330.00	0.06
78	300566	激智科技	1,800	25,182.00	0.05
79	688002	睿创微纳	900	25,173.00	0.05
80	300296	利亚德	5,500	24,750.00	0.05
81	002236	大华股份	1,600	24,736.00	0.05
82	002448	中原内配	4,300	24,682.00	0.05

83	300258	精锻科技	3,000	24,390.00	0.05
84	300207	欣旺达	1,600	24,272.00	0.05
85	688049	炬芯科技	1,080	23,889.60	0.05
86	603611	诺力股份	1,400	23,856.00	0.05
87	688099	晶晨股份	400	23,728.00	0.05
88	600699	均胜电子	1,600	23,712.00	0.05
89	300707	威唐工业	1,900	23,522.00	0.05
90	300969	恒帅股份	300	20,739.00	0.05
91	002897	意华股份	400	15,064.00	0.03
92	600498	烽火通信	900	14,310.00	0.03
93	000063	中兴通讯	500	13,985.00	0.03
94	688418	震有科技	800	13,704.00	0.03
95	601668	中国建筑	2,000	10,620.00	0.02
96	300384	三联虹普	800	10,496.00	0.02
97	600339	中油工程	3,000	9,360.00	0.02
98	600619	海立股份	1,000	5,170.00	0.01
99	002615	哈尔斯	800	4,960.00	0.01
100	603579	荣泰健康	300	4,638.00	0.01
101	600626	申达股份	1,900	4,598.00	0.01
102	003028	振邦智能	100	3,606.00	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	000415	渤海租赁	737,176.00	0.94
2	002643	万润股份	588,725.00	0.75
3	002004	华邦健康	545,000.00	0.69
4	601137	博威合金	528,102.00	0.67
5	002100	天康生物	522,093.00	0.66
6	000034	神州数码	515,362.00	0.65
7	600667	太极实业	514,539.00	0.65
8	300747	锐科激光	507,131.00	0.64
9	600273	嘉化能源	500,295.00	0.64
10	002332	仙琚制药	500,065.00	0.64
11	002911	佛燃能源	497,235.00	0.63
12	000921	海信家电	471,284.00	0.60
13	603100	DR 川仪股	469,871.00	0.60
14	603599	广信股份	467,313.00	0.59
15	600717	天津港	456,194.00	0.58
16	600812	华北制药	447,535.00	0.57

17	002402	和而泰	445,752.00	0.57
18	603308	应流股份	443,045.00	0.56
19	000928	中钢国际	438,755.00	0.56
20	688235	百济神州	436,538.70	0.55

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	601137	博威合金	824,895.00	1.05
2	601677	明泰铝业	715,721.00	0.91
3	000686	东北证券	685,965.00	0.87
4	002405	四维图新	678,645.00	0.86
5	000921	海信家电	672,413.00	0.85
6	002402	和而泰	666,848.00	0.85
7	000034	神州数码	589,935.00	0.75
8	002004	华邦健康	581,394.00	0.74
9	603100	川仪股份	575,885.00	0.73
10	600575	淮河能源	544,497.00	0.69
11	002643	万润股份	541,240.00	0.69
12	601375	中原证券	538,881.00	0.68
13	002891	中宠股份	530,380.50	0.67
14	603876	鼎胜新材	528,838.00	0.67
15	603766	隆鑫通用	525,320.00	0.67
16	000951	中国重汽	524,458.00	0.67
17	600577	精达股份	520,672.00	0.66
18	601222	林洋能源	511,436.00	0.65
19	000969	安泰科技	504,873.00	0.64
20	000650	仁和药业	497,046.00	0.63

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	142,816,333.71
卖出股票收入（成交）总额	161,648,660.19

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）填写，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

中国有色金属建设股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内收到中国证券监督管理委员会北京监管局出具的警示函。

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

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	344,174.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,178,867.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,523,042.14

**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 1000 指数增强发起 A	171	107,996.92	10,165,055.93	55.04	8,302,416.55	44.96
泰康中证 1000 指数增强发起 C	526	65,261.19	100,009.44	0.29	34,227,374.61	99.71
合计	686	76,960.43	10,265,065.37	19.44	42,529,791.16	80.56

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 1000 指数增强发起 A	3,856.79	0.0209
	泰康中证 1000 指数增强发起 C	1.00	0.0000
	合计	3,857.79	0.0073

### 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	泰康中证 1000 指数增强发起 A	0~10
	泰康中证 1000 指数增强发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康中证 1000 指数增强发起 A	0~10
	泰康中证 1000 指数增强发起 C	0

	合计	0~10
--	----	------

#### 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	10,000,944.53	18.94	10,000,944.53	18.94	3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,944.53	18.94	10,000,944.53	18.94	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康中证 1000 指数增强发起 A	泰康中证 1000 指数增强发起 C
基金合同生效日 (2023 年 10 月 26 日) 基金份额总额	33,477,122.33	41,314,616.27
本报告期期初基金 份额总额	34,108,836.34	45,882,727.22
本报告期基金总申 购份额	3,778,902.48	90,143,111.54
减：本报告期基金 总赎回份额	19,420,266.34	101,698,454.71
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	18,467,472.48	34,327,384.05

注：(1) 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。

(2) 本基金合同生效日为 2023 年 10 月 26 日，截止报告期末本基金未满一年。

## § 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
广发证券	3	304,454,353.90	100.00	-	-	-

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广发证券与本公司不存在关联关系。

### 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(%)
广发证券	55,834.43	100.00	-	-	-	-

### 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务公告	《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 04 日
2	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增招商银行股份有限公司为销售机构并参加其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 01 月 09 日
3	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其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 01 月 17 日
4	泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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
5	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
6	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增德邦证券股份有限公司为销售机构并参加其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 01 月 31 日
7	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	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网	2024 年 03 月 25 日

	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	站及基金管理人网站	
8	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参加其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 03 月 28 日
9	泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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
10	泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金（泰康中证 1000 指数增强发起 A 份额）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
13	泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（泰康中证 1000 指数增强发起 C 份额）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	20240322-20240411	10,000,944.53	0.00	0.00	10,000,944.53	18.94
	2	20240425-20240513	10,000,944.53	0.00	0.00	10,000,944.53	18.94
	3	20240515-20240515	10,000,944.53	0.00	0.00	10,000,944.53	18.94
	4	20240521-20240523	10,000,944.53	0.00	0.00	10,000,944.53	18.94
	5	20240528-20240530	10,000,944.53	0.00	0.00	10,000,944.53	18.94
	6	20240607-20240611	10,000,944.53	0.00	0.00	10,000,944.53	18.94
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 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康中证 1000 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（《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