

# 泰康基金管理有限公司

## 泰康中证 A500 交易型开放式指数证券 投资基金基金份额发售公告

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

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

## 重要提示

1、泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2024 年 9 月 6 日证监许可[2024] 1261 号文注册。中国证监会对本基金的注册并不代表其对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或者保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

2、本基金类别为股票型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

3、本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”），登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购三种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构通过上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构使用上海证券交易所网上系统以外的系统以现金进行的认购；网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

6、本基金将自 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 23 日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购三种方式认购本基金。其中，网上现金认购的日期为 2024 年 9 月 13 日至 2024 年 9 月 23 日，网下现金认购和网下股票认购的日期为 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 23 日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。基金管理人可以根据募集情况适当缩短或延长本基金的募集期限并及时公告。本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

7、本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，且本基金设置首次募集规模上限。

本基金网上现金认购和网下现金认购的合计首次募集规模上限为人民币 20 亿元（不含募集期利息），网下股票认购的首次募集规模上限为人民币 10 亿元，具体规模控制的方案详见“一、（九）基金的募集规模上限及规模控制方案”。

8、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户（以下合称“上海证券账户”）。应注意：上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证 A500 指数成份券或备选成份券中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证 A500 指数成份券或备选成份券中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

9、本基金认购费用或认购佣金不超过认购份额的 0.80%。投资人在认购本基金时，需按基金管理人或发售代理机构的规定，备足认购股票和资金，办理认购手续。

10、网上现金认购、网下现金认购以基金份额申请。办理网上现金认购的投资者应以上海证券账户认购，单一账户每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

网下股票认购以单只股票股数申报，投资者应以 A 股账户认购。用以认购的股票必须是中证 A500 指数成份券和已公告的备选成份券（具体名单见本公告第十部分“网下股票认购清单”）。单只股票最低认购申报股数为 1000 股，超过 1000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

11、投资者在认购本基金时，需按基金管理人及发售代理机构的规定，备足认购资金/股票，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日接受认购申报的时段内撤销认购申请，申请一经确认，认购资金即被冻结。通过基金管理人的网下现金和网下股票认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下现金和网下股票认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

12、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构的确认结果为准，投资者应及时查询其认购申请及认购份额的确认结果。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读刊登在本公司网站（[www.tkfunds.com.cn](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>）上的本基金《基金合同》和《招募说明书》。本公告和《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》将同步刊登在 2024 年 9 月 7 日的《上海证券报》上。

14、各销售机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

15、在募集期间，除本公告所列的发售代理机构外，如增加或减少其他发售代理机构，本公司将及时公告。

16、投资者可拨打本公司的客户服务电话 400-18-95522（免长途话费）、010-52160966 及各发售代理机构客服电话咨询认购事宜。

17、基金管理人可综合各种情况对基金份额的发售安排做适当调整，本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

18、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单，报上海证券交易所，经有关部门认可后，由基金管理人公告。本基金上市后，未登记在申购赎回代理券商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖，如投资者需进行本基金的申购赎回交易，须转托管到本基金的申购赎回代理券商。

19、本基金标的指数为中证 A500 指数(000510)。中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。有关标的指数具体编制方案及成份券信息详见中证指数有限公司网站，网址：<http://www.csindex.com.cn/>。

## 20、风险提示

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。

本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，

跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金主要投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：投资组合的风险（包括市场风险、信用风险、流动性风险等）、管理风险、合规性风险、操作风险、股票型 ETF 基金特有的风险、投资股指期货风险、投资资产支持证券风险、投资存托凭证风险、投资证券公司短期公司债券的风险、转融通证券出借业务风险和其他风险等。

由于本基金为交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的特有风险包括：（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；（2）标的指数波动的风险；（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离以及跟踪误差控制未达约定目标的风险；（4）标的指数变更的风险；（5）指数编制机构停止服务的风险；（6）成份券停牌的风险；（7）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险；（8）IOPV 计算错误的风险；（9）申购赎回清单差错风险；（10）退市风险；（11）退补现金替代方式的风险；（12）投资者申购失败的风险；（13）投资者赎回失败的风险；（14）基金份额赎回对价的变现风险；（15）基金在二级市场的流动性风险；（16）第三方机构服务的风险；（17）因终止上市导致终止基金合同并进行基金财产清算的风险等。详见招募说明书“风险揭示”部分。

投资者应当在基金管理人或其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金初始募集面值 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

## 目录

一、本次募集的基本情况.....	1
二、发售方式及相关规定.....	3
三、投资者的开户.....	9
四、网上现金认购的程序.....	10
五、网下现金认购的程序.....	10
六、网下股票认购的程序.....	13
七、清算与交割.....	16
八、本次募集基金的验资与基金合同的生效.....	17
九、本次募集当事人及中介机构.....	18
十、网下股票认购清单.....	22

## 一、本次募集的基本情况

### （一）基金名称

泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

### （二）基金简称与代码

场内扩位简称：中证 A500ETF

认购代码：560513

基金二级市场交易代码：560510

### （三）基金类型及运作方式

本基金类型为股票型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

### （四）基金存续期限

不定期。

### （五）基金份额发售面值、认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。

### （六）发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

### （七）基金募集期

本基金将自 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 23 日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购三种方式认购本基金。其中，网上现金认购的日期为 2024 年 9 月 13 日至 2024 年 9 月 23 日，网下现金认购和网下股票认购的日期为 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 23 日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。

基金管理人可以根据募集情况适当缩短或延长本基金的募集期限并及时公告。本基金的募集期限不超过 3 个月。

## （八）基金的最低募集份额总额和募集金额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币。

## （九）基金的募集规模上限及规模控制方案

本基金网上现金认购和网下现金认购（以下简称“现金认购”）的合计首次募集规模上限为人民币 20 亿元（不含募集期利息），网下股票认购的首次募集规模上限为人民币 10 亿元。

1、现金认购采取“全程比例确认”的方式对上述规模限制进行控制。具体处理方式如下：

（1）募集结束后，若本基金募集期内的现金认购有效认购申请全部确认后不超过人民币 20 亿元，则投资者在募集期内提交的现金认购有效认购申请全部予以确认。

（2）募集结束后，若本基金募集期内的现金认购有效认购申请全部确认后超过人民币 20 亿元，将对募集期内的现金认购有效认购申请采用“全程比例确认”的原则给予部分确认，未确认部分将在募集期结束后退还给投资者。当发生比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况和结果。认购申请确认比例的计算方法如下（不含募集期利息）：

募集期有效认购申请确认比例=20 亿份/（募集期内有效网上现金认购份额+募集期内有效网下现金认购份额）。

网上现金认购和网下现金认购的投资者有效认购申请确认份额=投资者在募集期内提交的有效认购申请份额\*募集期有效认购申请确认比例

（3）当发生部分确认时，本基金登记结算机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期每笔现金认购有效认购申请份额进行部分确认处理，因对每笔认购明细处理的精度等原因，最终确认的本基金的现金认购有效认购份额（不含募集期利息）可能会略微高于或低于 20 亿份。最终投资者有效认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记结算机构的计算并确认的结果为准。

2、对于网下股票认购，募集结束后，若本基金募集期内的网下股票认购有效认购申请全部确认后不超过人民币 10 亿元，则投资者在募集期内提交的网下股

票认购有效认购申请根据招募说明书的规定进行确认。募集结束后，若本基金募集期内的网下股票认购有效认购申请全部确认后超过人民币 10 亿元，基金管理人可以根据拟跟踪指数的基本情况、参与认购股票的流动性和数量、招募说明书的规定等多种因素拒绝全部或部分的认购申报，使得确认的网下股票认购有效认购申请不超过人民币 10 亿元。

#### **(十) 基金份额发售机构**

##### **1、发售协调人**

中信证券股份有限公司

##### **2、网上现金认购的发售代理机构**

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

##### **3、网下现金认购和网下股票认购的直销机构**

泰康基金管理有限公司。详见本公告“九（三）3、网下现金和网下股票发售直销机构”。

##### **4、网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构**

详见本公告“九（三）4、网下现金和网下股票发售代理机构”。

5、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，变更发售代理机构或选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。

## **二、发售方式及相关规定**

### **(一) 发售方式**

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购三种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构通过上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构使用上海证券交易所网上系统以外的系统以现金进行的认购；

网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票

进行的认购。

基金管理人可以根据具体情况变更发售代理机构或调整本基金的发售方式。

若证券/期货交易所、中国证券登记结算有限责任公司对发售方式、发售场所有所调整的，本基金将进行相应调整。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构的确认结果为准，投资者应及时查询其认购申请及认购份额的确认结果。

## （二）认购费用

认购费用由投资者承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的费用，不列入基金财产。

本基金认购费率如下表所示：

认购份额 (M)	认购费率
M < 50 万份	0.80%
50 万份 ≤ M < 100 万份	0.50%
M ≥ 100 万份	按笔收取，1,000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用，基金管理人办理网下股票认购时不收取认购费用。投资者申请多次现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不高于 0.80% 的标准收取一定的佣金。

## （三）网上现金认购

### 1、认购限额：

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。

### 2、认购手续：

投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日接受认购申报的时段内撤销认购申请，申请一经确认，认购资金即被冻结。

### 3、认购金额的计算：

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过网上现金认购 1,000 份本基金，假设发售代理机构确认的佣金比率为 0.80%，则需准备的认购资金金额计算如下：

认购金额=1.00×1,000×(1+0.80%)=1,008 元

认购佣金=1.00×1,000×0.80%=8 元

即投资者需准备 1,008 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

通过发售代理机构进行网上现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

4、认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售机构或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

### （四）网下现金认购

1、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

2、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售机构办理相关认购手续，并备足认购资金。通过基金管理人的网下现金认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下现金认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

3、通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算

通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

（或若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

$$\text{认购总份额} = \text{认购份额} + \text{利息折算的份额}$$

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。通过基金管理人进行网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息，将折算为基金份额归基金份额持有人所有。

例：某投资人通过基金管理人采用网下现金认购的方式认购本基金 800,000 份，认购费率为 0.50%，假定认购金额产生的利息为 100 元，则该投资人的认购金额为：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 800,000 \times 0.50\% = 4,000 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 800,000 \times (1 + 0.50\%) = 804,000 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算的份额} = 100 / 1.00 = 100 \text{ 份}$$

$$\text{认购总份额} = 800,000 + 100 = 800,100 \text{ 份}$$

即，某投资人通过基金管理人采用网下现金认购的方式认购本基金 800,000 份，认购费率为 0.5%，假定认购金额产生的利息为 100 元，则该投资人的认购金额为 804,000 元，可得到 800,100 份基金份额。

5、认购确认：基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售机构或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

## （五）网下股票认购

### 1、认购限额：

网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证 A500 指数成份券和已公告的备选成份券（详见十、网下股票认购清单）。单只股票最低认购申报股数为 1000 股，超过 1000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

## 2、认购手续：

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定到销售机构网点办理认购手续，并备足认购股票。通过基金管理人的网下股票认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下股票认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

## 3、特殊情形

(1) 已公告的将被调出中证 A500 指数的成份券不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据个股市场情况、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购开始日前公告限制认购规模的个股名单。如果投资者用以认购的中证 A500 指数成份券和已公告的备选成份券个股规模超过该成份券在标的指数的构成比例，基金管理人有权不经公告，对超过构成比例的部分予以拒绝。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间停牌、价格波动异常、估值调整或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份券，将不能用于认购本基金。

## 4、认购份额的计算方式

网下股票认购以单只股票股数申请，在销售机构允许的条件下，投资人可以现金或基金份额的方式支付认购佣金。认购份额的计算方式为：

$$\text{认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票在 } T \text{ 日的均价} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中：

(1)  $i$  代表投资人提交认购申请的第  $i$  只股票， $n$  代表投资人提交的股票总只数，如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则  $n=1$ 。

(2) “第  $i$  只股票在  $T$  日的均价”由基金管理人根据证券交易所的  $T$  日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在  $T$  日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。“ $T$  日”为本基金发售期最后一日（即网下股票认购期最后一日）。

若某一股票在  $T$  日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、

送股(转增)、配股等权益变动,则由于投资者获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在 T 日的均价进行调整:

1) 除息: 调整后价格 = T 日均价 - 每股现金股利或股息

2) 送股: 调整后价格 = T 日均价 / (1 + 每股送股比例)

3) 配股: 调整后价格 = (T 日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股配股比例)

4) 送股且配股: 调整后价格 = (T 日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

5) 除息、送股且配股: 调整后价格 = (T 日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

(3) “有效认购数量”是由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。

1) 对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限的计算方式详见届时相关公告。如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限,则按照各投资人的认购申报数量同比例收取。对于基金管理人未确认的认购股票,登记结算机构将不办理股票的过户业务,正常情况下,投资人未获基金管理人确认的认购股票将在认购截止日后的 4 个工作日内可用。

2) 若某一股票在 T 日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行,基金管理人将根据登记结算机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

## 5、认购佣金的计算

通过基金管理人进行网下股票认购时不收取认购费用。

通过发售代理机构进行网下股票认购的投资者,在发售代理机构允许的条件下,投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。

网下股票认购的认购佣金按以下公式计算:

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

如以基金份额方式支付认购佣金,则在扣除认购佣金后,投资者最终可得到的基金份额按以下公式计算:

净认购份额 = 认购份额 - 认购佣金 / 认购价格

例：某投资者持有本基金标的指数成份券中股票 A 和股票 B 各 10,000 股和 20,000 股，至某发售代理机构网点认购本基金并以现金方式支付认购佣金。假设网下股票认购期最后一日股票 A 和股票 B 的均价分别为 14.94 元和 4.50 元，基金管理人确认的有效认购数量为 10,000 股股票 A 和 20,000 股股票 B，发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购份额} = (10,000 \times 14.94) / 1.00 + (20,000 \times 4.50) / 1.00 = 239,400 \text{ 份}$$

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 239,400 \times 0.8\% = 1,915 \text{ 元 (保留至整数位)}$$

即投资者可认购到 239,400 份本基金基金份额，并另行支付 1,915 元的现金作为认购佣金。

例：续上例，假设该投资者以基金份额的方式支付认购佣金，则投资者最终可得的净认购份额计算如下：

$$\text{认购份额} = (10,000 \times 14.94) / 1.00 + (20,000 \times 4.50) / 1.00 = 239,400 \text{ 份}$$

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 239,400 \times 0.8\% = 1,915 \text{ 元 (保留至整数位)}$$

$$\text{净认购份额} = 239,400 - 1,915 / 1.00 = 237,485 \text{ 份。}$$

即该投资者最终可认购得到 237,485 份基金份额。

## 6、认购确认

基金合同生效后，投资者可通过其办理网下股票认购的销售机构或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

## 三、投资者的开户

投资人认购本基金时需具有上海证券账户，具体指上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

### (一) 如投资人需新开立上海证券账户，则应注意：

1、上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证 A500 指数成份券或备选成份券中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证 A500 指数成份券或备选成份券中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

2、开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少提前 2 个工

作日办理开户手续。

**(二) 如投资人已开立上海证券账户，则应注意：**

1、如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的发售代理机构，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的发售代理机构。

2、当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在进行认购前至少提前 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

**(三) 账户使用注意事项**

使用专用交易单元的机构投资人无需办理指定交易。

已购买过由泰康基金管理有限公司担任登记结算机构的基金的投资者，其拥有的泰康基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

## 四、网上现金认购的程序

1、业务办理时间：2024 年 9 月 13 日至 2024 年 9 月 23 日（周六、周日和节假日不受理）9:30—11:30 和 13:00—15:00。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，我司将作出相应调整并及时公告。

**2、认购手续：**

投资者通过发售代理机构办理认购。

(1) 开立上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户，办理指定交易在发售代理机构。

(2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，网上现金认购申请提交后投资人可以在当日接受认购申报的时段内撤销认购申请，申请一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以上海证券交易所和发售代理机构的相关规定为准。

## 五、网下现金认购的程序

**(一) 直销机构**

1、业务办理时间：2024年9月10日至2024年9月23日（周六、周日和节假日

不受理) 9:00—11:30和13:00—17:00。

## 2、认购手续

投资者须先开立上海A股账户或上海证券投资基金账户，然后到本公司直销中心提供下列资料办理基金的认购手续（具体以直销中心规定为准）：

(1) 个人投资者办理基金网下现金认购申请时需提交下列材料：

- 1) 投资者签字的《ETF网下认购申请表(个人)》；
- 2) 上海证券交易所A股账户卡复印件或上海证券交易所证券投资基金账户卡复印件；
- 3) 签署《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金投资风险揭示书》；
- 4) 投资者有效身份证件复印件；
- 5) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

无泰康基金管理有限公司开放式基金账户的投资者还需提交：

- 6) 填妥并由本人签字的《账户业务申请表(个人)》；
- 7) 投资者本人银行储蓄卡复印件；
- 8) 投资者本人签署的《投资者风险承受能力调查问卷(个人)》；
- 9) 签署《个人客户税收居民身份声明文件》；
- 10) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

(2) 机构及产品投资者办理基金网下现金认购申请时需提交下列材料：

- 1) 填妥并加盖单位公章的《ETF网下认购申请表(机构及产品)》；
- 2) 加盖单位公章的上海证券交易所A股账户卡复印件或上海证券交易所证券投资基金账户卡复印件；
- 3) 签署《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金投资风险揭示书》；
- 4) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

无泰康基金管理有限公司开放式基金账户的投资者资料还需提交：

- 5) 填妥并加盖单位公章的《账户业务申请表(机构)》或《账户业务申请表(产品)》；
- 6) 加盖单位公章的营业执照复印件（经有关金融监管部门批准设立的金融机构还需提供加盖公章的相关资质证明文件的复印件）；事业法人、社会团体或其他组织提供加盖单位公章的民政部门或主管部门颁发的注册登记证书复印件；

- 7) 加盖单位公章的指定银行账户的开立证明文件复印件；
- 8) 填妥并加盖单位公章及法定代表人签章的《基金业务授权委托书》；
- 9) 加盖单位公章的单位法定代表人以及授权经办人的有效身份证件复印件；
- 10) 《印鉴卡》；
- 11) 签署并加盖单位公章的《远程委托服务协议书》（如开通远程交易）；
- 12) 《证券期货投资者适当性管理办法》第八条规定的（一）（二）（三）类投资者提交填妥并加盖单位公章《专业投资者信息采集表》，其他投资者提交《投资者风险承受能力调查问卷（机构）》；
- 13) 填妥并加盖公章及法定代表人/授权代表签章的《机构客户税收居民身份声明文件》和《控制人税收居民身份声明文件》（如有）；
- 14) 机构投资者股权或控制权的相关信息，主要包括：注册证书、存续证明文件、公司章程等可以验证投资者身份的文件；股东或董事会成员登记信息，主要包括：董事会、高级管理层和股东名单、各股东持股数量以及持股类型等；产品投资者提供拥有产品份额超过25%的持有人证明文件、投资经理证明文件等；
- 15) 产品投资者还应提供加盖单位公章的产品成立、备案证明文件等资料的复印件；
- 16) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

3、在认购期内，将足额认购资金汇入本公司指定的直销资金专户：

泰康基金管理有限公司直销账户信息：

户名：泰康基金管理有限公司

开户银行：平安银行北京神华支行

账号：19017575850093

联行号：307100003027

投资者所填写的票据在汇款用途中必须注明购买的基金名称和基金代码，并确保认购期间每日17：00前到账。

4、注意事项：

（1）若投资人的认购资金在认购申请当日17：00之前未到本公司指定的直销资金账户且未能提供有效划款凭证，则当日提交的申请视为无效；

（2）投资人汇款时，可提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息，

包括汇款人和用途栏内容；

(3) 为了确保客户资金及时准确的入账，建议投资人将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至本公司直销中心，传真号码：010-57697399。

(4) 投资者若未按上述规定划付款项，造成认购无效的，泰康基金管理公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。

## (二) 发售代理机构

1、业务办理时间：2024年9月10日至2024年9月23日（周六、周日和节假日不受理）9:30—11:30和13:00—15:00，具体时间以各发售代理机构的规定为准。

### 2、认购手续

(1) 开立上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户，办理指定交易在发售代理机构。

(2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网下现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体认购手续以各发售代理机构的规定为准。

## 六、网下股票认购的程序

### (一) 在本公司直销机构办理网下股票认购

1、业务办理时间：2024年9月10日至2024年9月23日（周六、周日和节假日不受理）9:00~11:30和13:00~17:00。

2、投资者在本公司直销机构办理网下股票认购所需资料如下（具体以直销中心规定为准）：

(1) 个人投资者办理基金网下股票认购申请时需提交下列材料：

1) 投资者签字的《ETF网下认购申请表(个人)》；

2) 上海证券交易所A股账户卡复印件，如以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份券或备选成份券进行认购的，还需提供深圳证券交易所A股账户卡复印件；

3) 签署《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金投资风险揭示书》；

- 4) 投资者有效身份证件复印件;
- 5) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

无泰康基金管理有限公司开放式基金账户的投资者还需提交:

- 6) 填妥并由本人签字的《账户业务申请表(个人)》;
- 7) 投资者本人银行储蓄卡复印件;
- 8) 投资者本人签署的《投资者风险承受能力调查问卷(个人)》;
- 9) 签署《个人客户税收居民身份声明文件》;
- 10) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

(2) 机构及产品投资者办理基金网下股票认购申请时须提交下列材料:

- 1) 填妥并加盖单位公章的《ETF网下认购申请表(机构及产品)》;
- 2) 加盖单位公章的上海证券交易所A股账户卡复印件, 如以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份券或备选成份券进行认购的, 还需提供深圳证券交易所A股账户卡复印件;

- 3) 签署《泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金投资风险揭示书》;
- 4) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

无泰康基金管理有限公司开放式基金账户的投资者资料还需提交:

- 5) 填妥并加盖单位公章的《账户业务申请表(机构)》或《账户业务申请表(产品)》;
- 6) 加盖单位公章的营业执照复印件(经有关金融监管部门批准设立的金融机构还需提供加盖公章的相关资质证明文件的复印件); 事业法人、社会团体或其他组织提供加盖单位公章的民政部门或主管部门颁发的注册登记证书复印件;
- 7) 加盖单位公章的指定银行账户的开立证明文件复印件;
- 8) 填妥并加盖单位公章及法定代表人签章的《基金业务授权委托书》;
- 9) 加盖单位公章的单位法定代表人以及授权经办人的有效身份证件复印件;
- 10) 《印鉴卡》;
- 11) 签署并加盖单位公章的《远程委托服务协议》(如开通远程交易);
- 12) 《证券期货投资者适当性管理办法》第八条规定的(一)(二)(三)类投资者提交填妥并加盖单位公章《专业投资者信息采集表》, 其他投资者提交《投资者风险承受能力调查问卷(机构)》;

13) 填妥并加盖公章及法定代表人/授权代表签章的《机构客户税收居民身份声明文件》和《控制人税收居民身份声明文件》(如有);

14) 机构投资者股权或控制权的相关信息, 主要包括: 注册证书、存续证明文件、公司章程等可以验证投资者身份的文件; 股东或董事会成员登记信息, 主要包括: 董事会、高级管理层和股东名单、各股东持股数量以及持股类型等; 产品投资者提供拥有产品份额超过25%的持有人证明文件、投资经理证明文件等;

15) 产品投资者还应提供加盖单位公章的产品成立、备案证明文件等资料的复印件;

16) 法律法规、自律规则和销售机构要求提供的其它材料。

### 3、在直销机构办理网下股票认购的程序

(1) 开立上海证券交易所A股账户。

如投资者需要使用中证A500指数成份券中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回, 则应开立上海证券交易所A股账户; 如投资者需要使用中证A500指数成份券中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购, 则还应开立深圳证券交易所A股账户。

(2) 在A股账户中备足符合要求的认购股票。

(3) 投资者填写认购委托单。登记机构将在募集结束后办理用以认购的股票的冻结业务, 届时如投资者用以认购的股票的可用数量不足, 则投资者的该笔股票认购申请无效。

具体认购程序以本公司直销机构的规定为准。

### (二) 在发售代理机构办理网下股票认购的程序

1、业务办理时间: 2024年9月10日至2024年9月23日(周六、周日和节假日不受理) 9:30-17:00, 具体时间以各发售代理机构的规定为准。

### 2、在发售代理机构办理网下股票认购的程序

(1) 开立上海证券交易所A股账户或深圳证券交易所A股账户。

如投资者需要使用中证A500指数成份券中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回, 则应开立上海证券交易所A股账户; 如投资者需要使用中证A500指数成份券中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认

购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

(2) 在A股账户中备足符合要求的认购股票。

(3) 投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

具体认购程序以各发售代理机构的规定为准。

### 3、特别提示

投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

## 七、清算与交割

### 1、网上现金认购的清算交收

T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

### 2、网下现金认购的清算交收

T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将汇总的认购款项及其利息划往基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资人所有。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所网上定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金募集专户。

### 3、网下股票认购的清算交收

通过发售代理机构进行网下股票认购的，发售代理机构将股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人。发售期最后一日日终，基金管理人初步确认各成份券的有效认购数量。基金发售期结束后，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的，

基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记结算机构根据基金管理人确认的认购申请股票数据，按照交易所和登记结算机构的规则和流程，最终将投资者申请认购的股票过户到本基金的证券账户。

#### 4、募集资金利息与募集股票权益的处理方式

募集期间的认购资金存入专用账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集期间的认购股票按照交易所和登记结算机构的规则和流程办理冻结与过户，最终将投资人申请认购的股票过户至基金证券账户。

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，其中利息转份额以登记结算机构的记录为准；通过发售代理机构进行网上现金认购和网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额；在网下股票认购的冻结期间，沪市股票和深市股票产生的权益根据中国证券登记结算有限责任公司的业务规则进行处理。

5、本基金权益登记由登记结算机构在发售结束后完成过户登记。

6、基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 八、本次募集基金的验资与基金合同的生效

### 1、基金备案和基金合同生效

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

### 2、基金合同不能生效时募集资金及股票的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息；对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，按照交易所和登记结算机构的规则予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任；登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；

(3) 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

## 九、本次募集当事人及中介机构

### (一) 基金管理人

名称：泰康基金管理有限公司

成立日期：2021 年 10 月 12 日

住所：北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302

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

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监许可【2021】2839 号

法定代表人：金志刚

组织形式：其他有限责任公司

注册资本：12000 万元

联系电话：010-89620088

联系人：何纬

股权结构：泰康资产管理有限责任公司占公司注册资本的 80%；嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.3%；嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.4%；嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.4%；嘉兴显泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.4%；嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 2.5%。

## （二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83077987

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

## （三）销售机构

### 1、发售协调人

中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

联系人：王一通

客服电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

### 2、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理。  
具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

### 3、网下现金和网下股票发售直销机构

名称：泰康基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街156号3层1-10内302

办公地址：北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦3层、5层

法定代表人：金志刚

全国统一客户服务电话：4001895522

传真：010-89620100

联系人：曲晨

电话：010-89620091

网站：[www.tkfunds.com.cn](http://www.tkfunds.com.cn)

4、网下现金和网下股票发售代理机构（排序不分先后）

（1）中国银河证券股份有限公司（不参与网下股票认购）

客服电话：95551 或 4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（2）中信建投证券股份有限公司（不参与网下股票认购）

客服电话：4008-888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（3）招商证券股份有限公司（不参与网下股票认购）

客服电话：95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（4）中信证券股份有限公司

客服电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（5）中信证券（山东）有限责任公司

客服电话：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

（6）中信证券华南股份有限公司

客服电话：95396

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

（7）广发证券股份有限公司（不参与网下股票认购）

客服电话：95575

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

（8）长江证券股份有限公司（不参与网下股票认购）

客服电话：95579/4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(9) 中国中金财富证券有限公司（不参与网下股票认购）

客服电话：95532/400-600-8008

网址：www.china-invs.cn

(10) 国投证券股份有限公司

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

(11) 中泰证券股份有限公司

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

5、基金管理人可选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。

#### **(四) 登记结算机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：010-50938931

传真：010-50938907

联系人：徐一文

#### **(五) 出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：安冬、陆奇

联系人：陆奇

#### **(六) 审计基金财产的会计师事务所**

### 1、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：左艳霞、贾君宇

联系电话：010-85085000

传真：010-85085111

### 2、验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：左艳霞、贾君宇

联系电话：010-85085000

传真：010-85085111

联系人：左艳霞

## 十、网下股票认购清单

本基金募集期间，网下股票认购名单如下表所示，但是募集期结束前已公告的将被调出份额发售公告成份券的不得用于认购本基金，将被调入指数成份券的将纳入认购清单可以认购本基金。基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间停牌、价格波动异常、估值调整或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。如果投资者用以认购的中证 A500 指数成份券和已公告的备选成份券个股规模超过该成份券在标的指数的构成比例，基金管理人有权不经公告，对超过构成比例的部分予以拒绝。

如遇指数成份券调整，则最终确认可接受股票认购的清单以最终调整公告

的成份券清单为准。

证券代码	证券简称	证券代码	证券简称
000001	平安银行	300999	金龙鱼
000002	万科 A	301236	软通动力
000009	中国宝安	301558	三态股份
000034	神州数码	600000	浦发银行
000035	中国天楹	600004	白云机场
000039	中集集团	600007	中国国贸
000063	中兴通讯	600008	首创环保
000066	中国长城	600009	上海机场
000069	华侨城 A	600010	包钢股份
000100	TCL 科技	600011	华能国际
000157	中联重科	600018	上港集团
000301	东方盛虹	600019	宝钢股份
000333	美的集团	600026	中远海能
000338	潍柴动力	600027	华电国际
000400	许继电气	600028	中国石化
000408	藏格矿业	600029	南方航空
000423	东阿阿胶	600030	中信证券
000425	徐工机械	600031	三一重工
000519	中兵红箭	600036	招商银行
000538	云南白药	600038	中直股份
000547	航天发展	600039	四川路桥
000568	泸州老窖	600048	保利发展
000591	太阳能	600050	中国联通
000617	中油资本	600066	宇通客车
000623	吉林敖东	600085	同仁堂
000625	长安汽车	600089	特变电工
000629	钒钛股份	600096	云天化
000630	铜陵有色	600104	上汽集团
000651	格力电器	600111	北方稀土
000661	长春高新	600115	中国东航
000683	远兴能源	600118	中国卫星
000690	宝新能源	600129	太极集团
000708	中信特钢	600131	国网信通
000725	京东方 A	600141	兴发集团
000733	振华科技	600143	金发科技
000738	航发控制	600150	中国船舶
000768	中航西飞	600153	建发股份
000786	北新建材	600157	永泰能源
000792	盐湖股份	600160	巨化股份
000807	云铝股份	600161	天坛生物

000818	航锦科技	600166	福田汽车
000830	鲁西化工	600167	联美控股
000831	中国稀土	600170	上海建工
000858	五 粮 液	600176	中国巨石
000878	云南铜业	600177	雅戈尔
000887	中鼎股份	600183	生益科技
000932	华菱钢铁	600188	兖矿能源
000933	神火股份	600196	复星医药
000938	紫光股份	600219	南山铝业
000960	锡业股份	600233	圆通速递
000963	华东医药	600256	广汇能源
000967	盈峰环境	600258	首旅酒店
000975	银泰黄金	600276	恒瑞医药
000977	浪潮信息	600309	万华化学
000988	华工科技	600316	洪都航空
000998	隆平高科	600323	瀚蓝环境
000999	华润三九	600325	华发股份
001914	招商积余	600332	白云山
001979	招商蛇口	600346	恒力石化
002001	新和成	600352	浙江龙盛
002007	华兰生物	600362	江西铜业
002008	大族激光	600372	中航机载
002025	航天电器	600392	盛和资源
002027	分众传媒	600398	海澜之家
002028	思源电气	600399	抚顺特钢
002044	美年健康	600406	国电南瑞
002049	紫光国微	600415	小商品城
002050	三花智控	600418	江淮汽车
002064	华峰化学	600426	华鲁恒升
002065	东华软件	600436	片仔癀
002074	国轩高科	600438	通威股份
002078	太阳纸业	600460	士兰微
002080	中材科技	600482	中国动力
002081	金螳螂	600486	扬农化工
002085	万丰奥威	600489	中金黄金
002091	江苏国泰	600497	驰宏锌锗
002120	韵达股份	600498	烽火通信
002123	梦网科技	600499	科达制造
002129	TCL 中环	600515	海南机场
002131	利欧股份	600516	方大炭素
002138	顺络电子	600519	贵州茅台
002145	中核钛白	600521	华海药业
002151	北斗星通	600529	山东药玻

002152	广电运通	600535	天士力
002156	通富微电	600547	山东黄金
002176	江特电机	600549	厦门钨业
002179	中航光电	600563	法拉电子
002180	纳思达	600570	恒生电子
002185	华天科技	600584	长电科技
002192	融捷股份	600585	海螺水泥
002195	岩山科技	600588	用友网络
002202	金风科技	600637	东方明珠
002212	天融信	600655	豫园股份
002223	鱼跃医疗	600660	福耀玻璃
002230	科大讯飞	600667	太极实业
002236	大华股份	600674	川投能源
002240	盛新锂能	600690	海尔智家
002241	歌尔股份	600699	均胜电子
002245	蔚蓝锂芯	600704	物产中大
002252	上海莱士	600741	华域汽车
002266	浙富控股	600745	闻泰科技
002268	电科网安	600754	锦江酒店
002271	东方雨虹	600755	厦门国贸
002273	水晶光电	600760	中航沈飞
002281	光迅科技	600763	通策医疗
002292	奥飞娱乐	600765	中航重机
002294	信立泰	600771	广誉远
002304	洋河股份	600795	国电电力
002312	川发龙蟒	600803	新奥股份
002340	格林美	600816	建元信托
002352	顺丰控股	600820	隧道股份
002353	杰瑞股份	600839	四川长虹
002368	太极股份	600845	宝信软件
002371	北方华创	600859	王府井
002372	伟星新材	600862	中航高科
002384	东山精密	600867	通化东宝
002389	航天彩虹	600879	航天电子
002396	星网锐捷	600884	杉杉股份
002405	四维图新	600885	宏发股份
002407	多氟多	600886	国投电力
002409	雅克科技	600887	伊利股份
002410	广联达	600893	航发动力
002414	高德红外	600895	张江高科
002415	海康威视	600900	长江电力
002422	科伦药业	600905	三峡能源
002432	九安医疗	600919	江苏银行

002436	兴森科技	600938	中国海油
002439	启明星辰	600941	中国移动
002444	巨星科技	600959	江苏有线
002456	欧菲光	600988	赤峰黄金
002459	晶澳科技	600989	宝丰能源
002460	赣锋锂业	600998	九州通
002463	沪电股份	601006	大秦铁路
002465	海格通信	601012	隆基绿能
002466	天齐锂业	601021	春秋航空
002472	双环传动	601058	赛轮轮胎
002475	立讯精密	601088	中国神华
002493	荣盛石化	601100	恒立液压
002497	雅化集团	601111	中国国航
002508	老板电器	601117	中国化学
002511	中顺洁柔	601155	新城控股
002517	恺英网络	601166	兴业银行
002532	天山铝业	601168	西部矿业
002541	鸿路钢构	601186	中国铁建
002544	普天科技	601216	君正集团
002555	三七互娱	601225	陕西煤业
002558	巨人网络	601233	桐昆股份
002572	索菲亚	601238	广汽集团
002594	比亚迪	601288	农业银行
002601	龙佰集团	601318	中国平安
002602	世纪华通	601319	中国人保
002603	以岭药业	601328	交通银行
002607	中公教育	601360	三六零
002624	完美世界	601390	中国中铁
002625	光启技术	601398	工商银行
002648	卫星化学	601600	中国铝业
002709	天赐材料	601601	中国太保
002714	牧原股份	601607	上海医药
002738	中矿资源	601615	明阳智能
002739	万达电影	601618	中国中冶
002756	永兴材料	601628	中国人寿
002791	坚朗五金	601633	长城汽车
002812	恩捷股份	601636	旗滨集团
002821	凯莱英	601658	邮储银行
002831	裕同科技	601668	中国建筑
002841	视源股份	601669	中国电建
002916	深南电路	601677	明泰铝业
002920	德赛西威	601689	拓普集团
002938	鹏鼎控股	601727	上海电气

003816	中国广核	601728	中国电信
300001	特锐德	601766	中国中车
300002	神州泰岳	601799	星宇股份
300003	乐普医疗	601800	中国交建
300012	华测检测	601816	京沪高铁
300014	亿纬锂能	601857	中国石油
300015	爱尔眼科	601866	中远海发
300017	网宿科技	601868	中国能建
300024	机器人	601872	招商轮船
300033	同花顺	601877	正泰电器
300037	新宙邦	601880	辽港股份
300054	鼎龙股份	601888	中国中免
300058	蓝色光标	601899	紫金矿业
300059	东方财富	601919	中远海控
300068	南都电源	601966	玲珑轮胎
300070	碧水源	601985	中国核电
300073	当升科技	601988	中国银行
300088	长信科技	601989	中国重工
300118	东方日升	603000	人民网
300122	智飞生物	603019	中科曙光
300124	汇川技术	603077	和邦生物
300133	华策影视	603129	春风动力
300136	信维通信	603156	养元饮品
300142	沃森生物	603236	移远通信
300144	宋城演艺	603259	药明康德
300182	捷成股份	603260	合盛硅业
300207	欣旺达	603288	海天味业
300212	易华录	603290	斯达半导
300223	北京君正	603392	万泰生物
300251	光线传媒	603444	吉比特
300253	卫宁健康	603456	九洲药业
300274	阳光电源	603486	科沃斯
300285	国瓷材料	603501	韦尔股份
300296	利亚德	603568	伟明环保
300308	中际旭创	603588	高能环境
300315	掌趣科技	603596	伯特利
300316	晶盛机电	603605	珀莱雅
300339	润和软件	603606	东方电缆
300346	南大光电	603613	国联股份
300347	泰格医药	603650	彤程新材
300383	光环新网	603659	璞泰来
300390	天华新能	603688	石英股份
300394	天孚通信	603737	三棵树

300395	菲利华	603799	华友钴业
300408	三环集团	603806	福斯特
300413	芒果超媒	603816	顾家家居
300418	昆仑万维	603833	欧派家居
300433	蓝思科技	603882	金域医学
300438	鹏辉能源	603885	吉祥航空
300450	先导智能	603899	晨光股份
300454	深信服	603939	益丰药房
300457	赢合科技	603986	兆易创新
300459	汤姆猫	603993	洛阳钼业
300474	景嘉微	605117	德业股份
300496	中科创达	605358	立昂微
300502	新易盛	688002	睿创微纳
300529	健帆生物	688005	容百科技
300558	贝达药业	688008	澜起科技
300567	精测电子	688009	中国通号
300568	星源材质	688012	中微公司
300573	兴齐眼药	688036	传音控股
300595	欧普康视	688041	海光信息
300601	康泰生物	688063	派能科技
300604	长川科技	688072	拓荆科技
300627	华测导航	688099	晶晨股份
300628	亿联网络	688111	金山办公
300661	圣邦股份	688122	西部超导
300676	华大基因	688126	沪硅产业
300699	光威复材	688169	石头科技
300724	捷佳伟创	688188	柏楚电子
300750	宁德时代	688223	晶科能源
300751	迈为股份	688271	联影医疗
300759	康龙化成	688303	大全能源
300760	迈瑞医疗	688390	固德威
300763	锦浪科技	688396	华润微
300769	德方纳米	688536	思瑞浦
300782	卓胜微	688598	金博股份
300832	新产业	688599	天合光能
300866	安克创新	688617	惠泰医疗
300896	爱美客	688777	中控技术
300919	中伟股份	688981	中芯国际

泰康基金管理有限公司

二零二四年九月七日