

泰康中证 500 指数增强型发起式
证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：恒丰银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
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	54
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	54
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	54

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	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	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
§ 8 基金份额持有人信息	57
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
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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
§ 12 备查文件目录	64
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 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	泰康中证 500 指数增强发起	
基金主代码	018116	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 17 日	
基金管理人	泰康基金管理有限公司	
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,074,372.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泰康中证 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	018116	018117
报告期末下属分级基金的份额总额	15,523,458.50 份	4,550,913.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对中证 500 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。指数化被动投资策略参照标的指数的成份券、备选成份券及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。量化增强投资策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。根据模型结果基金管理人结合市场环境进行组合投资。在正常的市场情况下，本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体组成及权重。

	本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将持续追踪 A 股市场和港股市场的相对估值和市场情况，适时调整组合中港股通标的股票的投资比例。当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 本基金可投资存托凭证，在控制风险的前提下，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择具有比较优势的存托凭证进行投资。出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。本基金通过对资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素的研究，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资。在股指期货投资上，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金本着谨慎原则适度参与国债期货投资，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。 本基金投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。对于证券公司短期公司债券，本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、债券收益率等要素，确定投资决策。本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，并适当控制债券投资组合整体的久期，防范流动性风险。 本基金在参与融资业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模。本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基

	金、债券型基金与货币市场基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康基金管理有限公司	恒丰银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	梁明
	联系电话	010-89620366	021-63890689
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	liangming@hfbank.com.cn
客户服务电话		4001895522	95395
传真		010-89620100	021-63890708
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	济南市历下区泺源大街 8 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	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦 16 楼
邮政编码		100033	200023
法定代表人		金志刚	辛树人

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	泰康中证 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C
本期已实现收益	147,058.18	39,809.00
本期利润	1,003,378.05	369,787.87
加权平均基金份 额本期利润	0.0545	0.0511
本期加权平均净 值利润率	5.24%	4.95%
本期基金份额净 值增长率	5.57%	5.35%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1,472,620.26	394,954.96
期末可供分配基 金份额利润	0.0949	0.0868
期末基金资产净 值	17,049,053.59	4,960,742.29
期末基金份额净 值	1.0983	1.0901
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	9.83%	9.01%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰康中证 500 指数增强发起 A

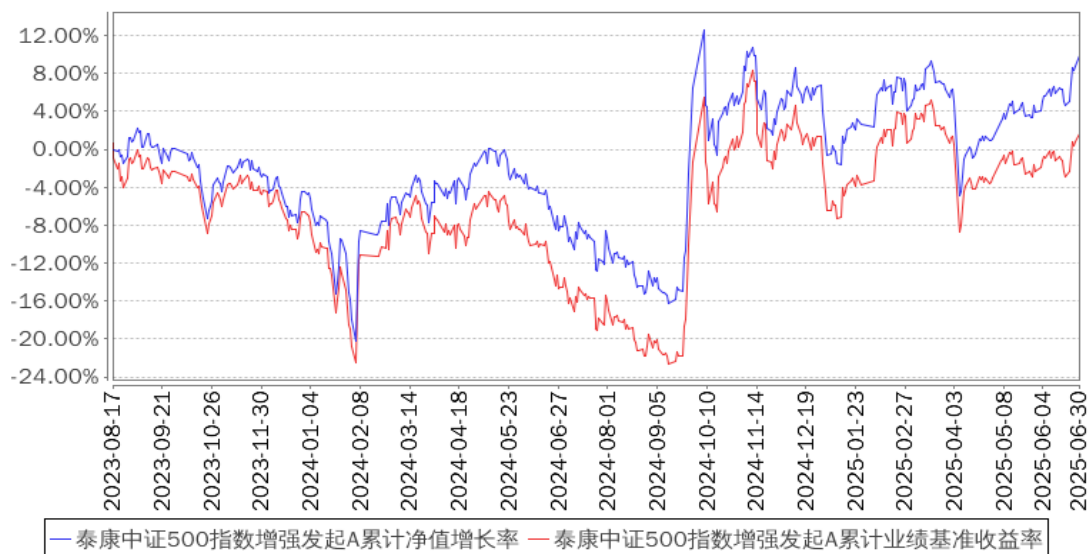
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.67%	0.74%	4.09%	0.75%	1.58%	-0.01%
过去三个月	4.10%	1.47%	0.97%	1.43%	3.13%	0.04%
过去六个月	5.57%	1.27%	3.21%	1.29%	2.36%	-0.02%
过去一年	19.52%	1.57%	18.83%	1.64%	0.69%	-0.07%
自基金合同生效起至今	9.83%	1.43%	1.63%	1.48%	8.20%	-0.05%

泰康中证 500 指数增强发起 C

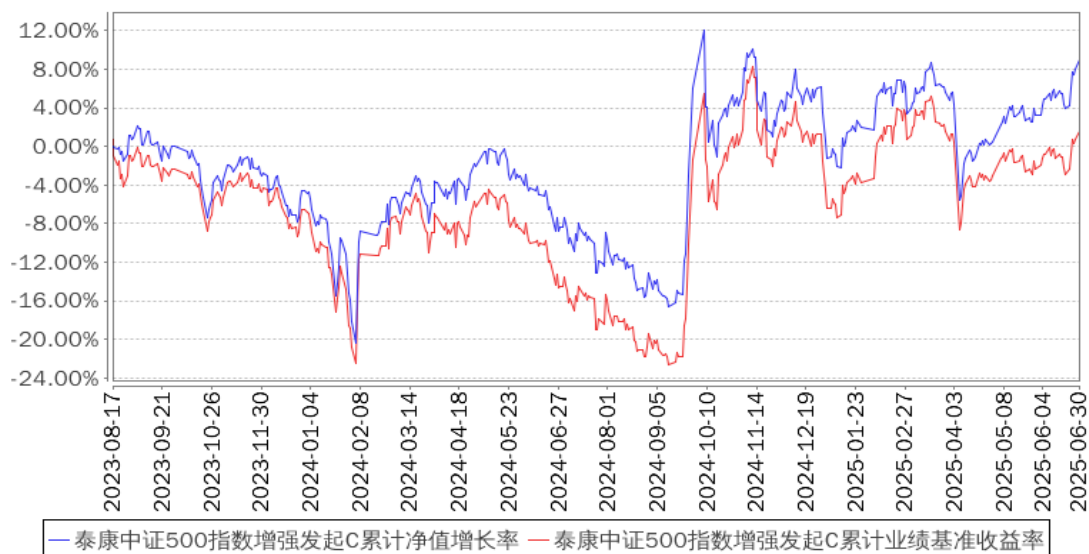
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.63%	0.74%	4.09%	0.75%	1.54%	-0.01%
过去三个月	4.01%	1.47%	0.97%	1.43%	3.04%	0.04%
过去六个月	5.35%	1.27%	3.21%	1.29%	2.14%	-0.02%
过去一年	19.05%	1.57%	18.83%	1.64%	0.22%	-0.07%
自基金合同生效起至今	9.01%	1.43%	1.63%	1.48%	7.38%	-0.05%

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

泰康中证500指数增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康中证500指数增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2023 年 08 月 17 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021 年 9 月 1 日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021 年 10 月 12 日，泰康基金完成工商注册。2022 年 11 月 18 日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为 1.2 亿元人民币。截至 2025 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 85 只证券投资基金。产品已形成包括货币、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 及养老目标基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列。泰康基金主动与被动业务双轮发展，旗下基金覆盖沪深 300、中证 500、中证 A500 等重要宽基指数，及半导体、智能电车、碳中和、医疗健康、大消费等细分行业，为投资者提供了丰富多元的投资选择。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁帅	本基金基金经理	2025 年 2 月 7 日	-	7 年	袁帅，硕士研究生。2018 年 6 月加入泰康公募，现任泰康基金量化基金经理。2023 年 8 月 17 日至 2025 年 1 月 26 日担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理。2024 年 6 月 7 日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 7 日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 6 月 30 日至今担任泰康上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

魏军	本基金基金经理、 量化投资部负责人	2023 年 8 月 17 日	2025 年 2 月 7 日	17 年	魏军，博士研究生。2019 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人、量化基金经理。曾历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理等职务。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 27 日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 6 日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 8 月 1 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022 年 9 月 27 日至 2023 年 2 月 17 日担任泰康中证新能源动力电池指数型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 14 日至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 2025 年 2 月 7 日担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 26 日至 2025 年 2 月 7 日担任泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 11 月 3 日至 2024 年 10 月 12 日担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 31 日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2024 年 3 月 15 日至今担任泰康中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 29 日担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 9 月 27 日至今担任泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 10 月 29 日至今担任泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2025 年 1 月 17 日至今担任泰康中证红利低波动
----	----------------------	-----------------	----------------	------	--

					交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
袁帅	本基金基金经理助理	2023 年 8 月 17 日	2025 年 1 月 26 日	7 年	袁帅，硕士研究生。2018 年 6 月加入泰康公募，现任泰康基金量化基金经理。2023 年 8 月 17 日至 2025 年 1 月 26 日担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理。2024 年 6 月 7 日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 7 日至今担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 2 月 7 日至今担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 6 月 30 日至今担任泰康上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

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

宏观经济方面，2025 年上半年延续了此前结构分化的特征，但部分领域的韧性好于预期，宏观经济预期有所改善。结构分化体现在，出口和制造业继续支撑经济，但地产在年初的小阳春之后明显降温。消费在以旧换新的支撑下，表现较好。相对于现实层面的数据，预期的改善更为明显，科技领域突破、出口在关税冲击下仍然保持韧性等，增强了宏观信心。

权益市场方面，2025 年上半年整体先跌后涨。从大盘指数整体表现上来看，上半年上证指数上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%，恒生综合指数上涨 20.18%，恒生科技上涨 18.68%。申万一级行业表现来看，有色金属、银行、国防军工、传媒、通信等行业表现相对较好，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等行业表现相对落后。

投资操作方面，在本期，本基金采用量化投资的方法，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值为 1.0983 元，本报告期基金 A 份额净值增长率为 5.57%；截至本报告期末本基金 C 份额净值为 1.0901 元，本报告期基金 C 份额净值增长率为 5.35%；同期业绩比较基准增长率为 3.21%。

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，“反内卷”政策如何推行，成为最大看点。宏观经济或能继续维持平稳运行的特征，出口存在一定的向下压力、但韧性犹存；财政力度或边际退坡，但如果反内卷政策能提振市场预期、有效平衡部分行业的供需格局，则有利于通缩预期的缓解。外部环境处于缓和期，为国内提供了良好的发展环境。

展望后市操作方面，继续以多因子选股框架为核心，以事件驱动策略为辅，并通过 AI 模型进一步加强选股策略表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、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合规守信情况声明

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

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

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,280,217.94	5,249,813.16
结算备付金		404,065.34	177,303.69
存出保证金		138,619.20	136,209.60
交易性金融资产	6.4.7.2	19,678,508.50	31,728,736.00
其中：股票投资		19,678,508.50	31,728,736.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,258.68	71,937.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		23,503,669.66	37,363,999.73
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		-	-
应付赎回款		1,441,644.73	2,566,918.79

应付管理人报酬		19,085.36	33,275.59
应付托管费		2,290.22	3,993.04
应付销售服务费		2,090.76	3,935.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3,354.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	28,762.71	8,000.00
负债合计		1,493,873.78	2,619,478.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	20,074,372.44	33,448,747.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,935,423.44	1,295,773.65
净资产合计		22,009,795.88	34,744,521.56
负债和净资产总计		23,503,669.66	37,363,999.73

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 20,074,372.44 份，其中泰康中证 500 指数增强发起 A 基金份额总额 15,523,458.50 份，基金份额净值 1.0983 元；泰康中证 500 指数增强发起 C 基金份额总额 4,550,913.94 份，基金份额净值 1.0901 元。

6.2 利润表

会计主体：泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,566,583.20	-1,355,759.36
1. 利息收入		8,172.74	17,712.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,172.74	17,712.69
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）		348,084.76	-1,358,409.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	75,777.41	-2,359,725.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,012.68	212.90
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	22,462.21	313,299.21
股利收益	6.4.7.19	247,832.46	687,803.72
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	1,186,298.74	-15,069.72
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	24,026.96	7.49
减：二、营业总支出		193,417.28	456,872.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	133,128.87	308,201.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,975.36	36,984.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,937.56	52,875.19
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		212.78	1,128.79
8. 其他费用	6.4.7.23	29,162.71	57,683.08
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,373,165.92	-1,812,632.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,373,165.92	-1,812,632.24
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		1,373,165.92	-1,812,632.24

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	33,448,747.91	-	1,295,773.65	34,744,521.56

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	33,448,747.91	-	1,295,773.65	34,744,521.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,374,375.47	-	639,649.79	-12,734,725.68
(一)、综合收益总额	-	-	1,373,165.92	1,373,165.92
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-13,374,375.47	-	-733,516.13	-14,107,891.60
其中：1. 基金申购款	3,492,798.44	-	167,025.93	3,659,824.37
2. 基金赎回款	-16,867,173.91	-	-900,542.06	-17,767,715.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	20,074,372.44	-	1,935,423.44	22,009,795.88
项目	上年度可比期间			
	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	74,993,196.98	-	-3,419,442.38	71,573,754.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	74,993,196.98	-	-3,419,442.38	71,573,754.60

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-22,612,963.60	-	-892,472.65	-23,505,436.25
(一)、综合收益总额	-	-	-1,812,632.24	-1,812,632.24
(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)	-22,612,963.60	-	920,159.59	-21,692,804.01
其中：1. 基金申购款	4,413,220.33	-	-245,065.10	4,168,155.23
2. 基金赎回款	-27,026,183.93	-	1,165,224.69	-25,860,959.24
(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	52,380,233.38	-	-4,311,915.03	48,068,318.35

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：

<u>金志刚</u>	<u>金志刚</u>	<u>李俊佑</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2023〕369 号《关于准予泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由泰康基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份券及其备选成份券，其他非指数成份券（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证、港股通标的股票）、股指期货、国债期货、债券资产（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金以标的指数（中证 500 指数）成份券及备选成份券为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份券和备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 1 月 1 日至 2025 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》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对证券投资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。

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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,363,783.87
等于：本金	1,363,612.05
加：应计利息	171.82
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	1,916,434.07
等于：本金	1,916,366.75
加：应计利息	67.32
减：坏账准备	-
合计	3,280,217.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		18,967,534.56	-	19,678,508.50	710,973.94
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		18,967,534.56	-	19,678,508.50	710,973.94

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 2025 年 6 月 30 日
----	------------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	1,095,760.00	-	-	
其中： 股指期货投资	1,095,760.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,095,760.00	-	-	

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
IC2509	IC2509	1.00	1,155,160.00	59,400.00
合计				59,400.00
减：可抵销期货暂收款				59,400.00
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 2025 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	28,762.71
合计	28,762.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康中证 500 指数增强发起 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,451,193.55	23,451,193.55
本期申购	3,023,169.92	3,023,169.92
本期赎回（以“-”号填列）	-10,950,904.97	-10,950,904.97
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	15,523,458.50	15,523,458.50

泰康中证 500 指数增强发起 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,997,554.36	9,997,554.36
本期申购	469,628.52	469,628.52
本期赎回（以“-”号填列）	-5,916,268.94	-5,916,268.94
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	4,550,913.94	4,550,913.94

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 500 指数增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,071,629.25	-1,123,266.75	948,362.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,071,629.25	-1,123,266.75	948,362.50
本期利润	147,058.18	856,319.87	1,003,378.05
本期基金份额交易产生的变动数	-746,067.17	319,921.71	-426,145.46
其中：基金申购款	274,179.08	-130,195.17	143,983.91
基金赎回款	-1,020,246.25	450,116.88	-570,129.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,472,620.26	52,974.83	1,525,595.09

泰康中证 500 指数增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	823,856.09	-476,444.94	347,411.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	823,856.09	-476,444.94	347,411.15
本期利润	39,809.00	329,978.87	369,787.87
本期基金份额交易产生的变动数	-468,710.13	161,339.46	-307,370.67
其中：基金申购款	39,881.44	-16,839.42	23,042.02
基金赎回款	-508,591.57	178,178.88	-330,412.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	394,954.96	14,873.39	409,828.35

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,043.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,793.41
结算备付金利息收入	2,335.84
其他	0.08
合计	8,172.74

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	75,777.41
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	75,777.41

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	70,679,127.59
减：卖出股票成本总额	70,535,298.71
减：交易费用	68,051.47

买卖股票差价收入	75,777.41
----------	-----------

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,012.10
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	2,012.68

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,812.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,800.00
减：应计利息总额	0.58
减：交易费用	0.31
买卖债券差价收入	2,012.10

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	22,462.21

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	247,832.46
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	247,832.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,107,698.74
股票投资	1,107,698.74
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	78,600.00
权证投资	-
期货投资	78,600.00
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	1,186,298.74

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	23.10
基金转换费收入	3.86
其他	24,000.00
合计	24,026.96

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	3,967.52
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	29,162.71

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
恒丰银行股份有限公司（“恒丰银行”）	基金托管人
泰康人寿保险有限责任公司（“泰康人寿”）	与基金管理人同受最终控股母公司控制、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	133, 128. 87	308, 201. 66
其中：应支付销售机构的客户维护费	37, 991. 65	126, 619. 17
应支付基金管理人的净管理费	95, 137. 22	181, 582. 49

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

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	15, 975. 36	36, 984. 16

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

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.12% / 当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰康中证 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C	合计
泰康基金管理有限公司	-	2, 043. 77	2, 043. 77
合计	-	2, 043. 77	2, 043. 77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C	合计
泰康基金管理有限公司	-	380. 91	380. 91
合计	-	380. 91	380. 91

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰康中证 500 指数增强发起 A

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
泰康资产管理有限责任公司	9,902,805.28	63.7925	9,902,805.28	42.2273

份额单位：份

泰康中证 500 指数增强发起 C

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
泰康资产管理有限责任公司	100,028.33	2.1980	100,028.33	1.0005

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

恒丰银行	1,363,783.87	4,043.41	2,248,926.70	11,132.09
------	--------------	----------	--------------	-----------

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（2025 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

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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 2025 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2025 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 2025 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,280,217.94	-	-	-	3,280,217.94
结算备付金	404,065.34	-	-	-	404,065.34
存出保证金	138,619.20	-	-	-	138,619.20
交易性金融资产	-	-	-	19,678,508.50	19,678,508.50
应收申购款	-	-	-	2,258.68	2,258.68
资产总计	3,822,902.48	-	-	19,680,767.18	23,503,669.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,441,644.73	1,441,644.73
应付管理人报酬	-	-	-	19,085.36	19,085.36
应付托管费	-	-	-	2,290.22	2,290.22
应付销售服务费	-	-	-	2,090.76	2,090.76
其他负债	-	-	-	28,762.71	28,762.71
负债总计	-	-	-	1,493,873.78	1,493,873.78
利率敏感度缺口	3,822,902.48	-	-	18,186,893.40	22,009,795.88
上年度末 2024 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	5,249,813.16	-	-	-	5,249,813.16
结算备付金	177,303.69	-	-	-	177,303.69
存出保证金	136,209.60	-	-	-	136,209.60
交易性金融资产	-	-	-	31,728,736.00	31,728,736.00
应收申购款	-	-	-	71,937.28	71,937.28
资产总计	5,563,326.45	-	-	31,800,673.28	37,363,999.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,566,918.79	2,566,918.79
应付管理人报酬	-	-	-	33,275.59	33,275.59
应付托管费	-	-	-	3,993.04	3,993.04
应付销售服务费	-	-	-	3,935.97	3,935.97
应交税费	-	-	-	3,354.78	3,354.78
其他负债	-	-	-	8,000.00	8,000.00
负债总计	-	-	-	2,619,478.17	2,619,478.17

利率敏感度缺口	5,563,326.45	-	-	29,181,195.11	34,744,521.56
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 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均以人民币计价，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 500 指数）成份券及备选成份券为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份券和备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	19,678,508.50	89.41	31,728,736.00	91.32
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	19,678,508.50	89.41	31,728,736.00	91.32

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	1,134,855.96	1,886,100.99
	业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-1,134,855.96	-1,886,100.99

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	19,678,508.50	31,728,736.00
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	19,678,508.50	31,728,736.00

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	19,678,508.50	83.73
	其中：股票	19,678,508.50	83.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,684,283.28	15.68
8	其他各项资产	140,877.88	0.60
9	合计	23,503,669.66	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	-	-
B	采矿业	395,313.50	1.80
C	制造业	11,286,438.20	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	422,093.00	1.92
E	建筑业	119,262.00	0.54
F	批发和零售业	885,233.00	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	296,671.00	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,627,490.00	7.39
J	金融业	1,396,979.80	6.35
K	房地产业	128,965.00	0.59
L	租赁和商务服务业	76,257.00	0.35
M	科学研究和技术	-	-

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	110,264.00	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	377,074.00	1.71
S	综合	5,815.00	0.03
	合计	17,127,855.50	77.82

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	88,466.00	0.40
C	制造业	1,667,353.00	7.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,837.00	0.02
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	6,535.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	26,114.00	0.12
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	388,782.00	1.77
J	金融业	148,170.00	0.67
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	9,842.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	117,726.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	92,828.00	0.42
S	综合	—	—
	合计	2,550,653.00	11.59

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	300476	胜宏科技	2,400	322,512.00	1.47
2	000988	华工科技	4,700	220,947.00	1.00
3	300803	指南针	2,580	208,102.80	0.95
4	002340	格林美	27,500	174,625.00	0.79
5	688608	恒玄科技	500	173,990.00	0.79
6	688213	思特威	1,700	173,774.00	0.79
7	300017	网宿科技	16,100	172,592.00	0.78
8	300251	光线传媒	8,500	172,295.00	0.78
9	300207	欣旺达	8,500	170,510.00	0.77
10	600487	亨通光电	11,000	168,300.00	0.76
11	601168	西部矿业	10,100	167,963.00	0.76
12	002273	水晶光电	8,300	165,751.00	0.75
13	603228	景旺电子	3,900	163,176.00	0.74
14	300454	深信服	1,700	160,106.00	0.73
15	300395	菲利华	3,100	158,410.00	0.72
16	688122	西部超导	3,000	155,640.00	0.71
17	002410	广联达	11,600	155,556.00	0.71
18	600352	浙江龙盛	15,200	154,432.00	0.70
19	600885	宏发股份	6,900	153,939.00	0.70
20	600862	中航高科	5,900	153,872.00	0.70
21	300627	华测导航	4,380	153,300.00	0.70
22	600109	国金证券	17,400	152,598.00	0.69
23	000783	长江证券	22,000	152,460.00	0.69
24	002138	顺络电子	5,400	151,848.00	0.69
25	000733	振华科技	3,000	150,150.00	0.68
26	002821	凯莱英	1,700	150,025.00	0.68
27	002414	高德红外	14,600	149,650.00	0.68
28	300496	中科创达	2,600	148,772.00	0.68
29	002532	天山铝业	17,800	147,918.00	0.67
30	605589	圣泉集团	5,300	147,075.00	0.67
31	000034	神州数码	3,900	146,796.00	0.67
32	002078	太阳纸业	10,900	146,714.00	0.67
33	600143	金发科技	14,200	146,402.00	0.67
34	000750	国海证券	35,300	145,436.00	0.66
35	688188	柏楚电子	1,100	144,826.00	0.66
36	600298	安琪酵母	4,100	144,197.00	0.66
37	001696	宗申动力	6,400	143,680.00	0.65
38	300699	光威复材	4,500	142,515.00	0.65
39	000878	云南铜业	11,200	142,464.00	0.65

40	002223	鱼跃医疗	4,000	142,400.00	0.65
41	601216	君正集团	25,700	141,864.00	0.64
42	000960	锡业股份	9,200	140,760.00	0.64
43	000009	中国宝安	15,800	140,304.00	0.64
44	002353	杰瑞股份	4,000	140,000.00	0.64
45	600909	华安证券	24,000	139,920.00	0.64
46	688249	晶合集成	6,900	139,863.00	0.64
47	600873	梅花生物	13,000	138,970.00	0.63
48	002624	完美世界	9,100	138,047.00	0.63
49	300623	捷捷微电	4,600	137,080.00	0.62
50	600699	均胜电子	7,800	136,032.00	0.62
51	600038	中直股份	3,500	135,835.00	0.62
52	601233	桐昆股份	12,800	135,680.00	0.62
53	000932	华菱钢铁	30,500	134,200.00	0.61
54	000623	吉林敖东	7,900	133,905.00	0.61
55	600685	中船防务	4,900	133,231.00	0.61
56	688183	生益电子	2,600	133,120.00	0.60
57	600704	物产中大	25,200	132,804.00	0.60
58	000893	亚钾国际	4,400	132,616.00	0.60
59	600497	驰宏锌锗	25,000	132,250.00	0.60
60	000887	中鼎股份	7,500	131,925.00	0.60
61	002409	雅克科技	2,400	131,256.00	0.60
62	301165	锐捷网络	2,120	130,295.20	0.59
63	603939	益丰药房	5,300	129,691.00	0.59
64	600398	海澜之家	18,600	129,456.00	0.59
65	000528	柳 工	13,400	128,774.00	0.59
66	603338	浙江鼎力	2,700	127,980.00	0.58
67	000060	中金岭南	27,900	127,782.00	0.58
68	688582	芯动联科	1,900	127,680.00	0.58
69	600166	福田汽车	47,100	127,641.00	0.58
70	603379	三美股份	2,600	125,112.00	0.57
71	603816	顾家家居	4,900	125,048.00	0.57
72	600998	九州通	24,100	123,874.00	0.56
73	002244	滨江集团	12,700	123,825.00	0.56
74	003031	中瓷电子	2,300	122,383.00	0.56
75	000987	越秀资本	17,800	122,108.00	0.55
76	000050	深天马 A	14,300	121,836.00	0.55
77	603893	瑞芯微	800	121,488.00	0.55
78	603529	爱玛科技	3,500	120,400.00	0.55
79	000423	东阿阿胶	2,300	120,290.00	0.55
80	002056	横店东磁	8,500	120,275.00	0.55
81	601456	国联民生	11,600	120,060.00	0.55
82	600582	天地科技	20,000	119,800.00	0.54

83	600970	中材国际	13,900	119,262.00	0.54
84	600380	健康元	10,800	119,124.00	0.54
85	600535	天士力	7,600	118,940.00	0.54
86	600739	辽宁成大	10,800	118,800.00	0.54
87	600282	南钢股份	27,900	117,180.00	0.53
88	600131	国网信通	6,600	116,820.00	0.53
89	600511	国药股份	4,000	116,640.00	0.53
90	601991	大唐发电	36,700	116,339.00	0.53
91	600132	重庆啤酒	2,100	115,710.00	0.53
92	688278	特宝生物	1,600	115,376.00	0.52
93	600707	彩虹股份	17,800	114,988.00	0.52
94	002430	杭氧股份	5,900	114,578.00	0.52
95	600959	江苏有线	33,300	114,552.00	0.52
96	002153	石基信息	13,200	114,312.00	0.52
97	600517	国网英大	22,300	113,730.00	0.52
98	000709	河钢股份	52,500	113,400.00	0.52
99	000027	深圳能源	17,600	112,288.00	0.51
100	600528	中铁工业	15,200	112,176.00	0.51
101	603858	步长制药	6,900	112,056.00	0.51
102	601568	北元集团	26,800	111,220.00	0.51
103	300888	稳健医疗	2,700	110,970.00	0.50
104	688475	萤石网络	3,500	110,320.00	0.50
105	002266	浙富控股	35,800	110,264.00	0.50
106	603225	新凤鸣	10,300	109,695.00	0.50
107	603565	中谷物流	11,400	108,870.00	0.49
108	300573	兴齐眼药	2,100	108,759.00	0.49
109	600056	中国医药	10,500	108,570.00	0.49
110	600062	华润双鹤	5,800	108,228.00	0.49
111	688425	铁建重工	26,500	108,120.00	0.49
112	601598	中国外运	21,600	106,488.00	0.48
113	003022	联泓新科	6,700	106,061.00	0.48
114	601019	山东出版	10,900	103,223.00	0.47
115	000959	首钢股份	30,300	103,020.00	0.47
116	300140	节能环保	16,600	102,422.00	0.47
117	601921	浙版传媒	12,600	101,556.00	0.46
118	600299	安迪苏	10,500	101,325.00	0.46
119	600637	东方明珠	13,500	100,845.00	0.46
120	601158	重庆水务	20,500	95,120.00	0.43
121	600578	京能电力	20,600	92,494.00	0.42
122	600312	平高电气	5,900	90,801.00	0.41
123	600985	淮北矿业	8,000	90,720.00	0.41
124	601665	齐鲁银行	14,100	89,112.00	0.40
125	000429	粤高速 A	6,100	81,313.00	0.37

126	000415	渤海租赁	22,900	76,257.00	0.35
127	600583	海油工程	13,400	73,164.00	0.33
128	300383	光环新网	4,400	62,920.00	0.29
129	600498	烽火通信	2,300	48,369.00	0.22
130	000937	冀中能源	5,500	31,625.00	0.14
131	600988	赤峰黄金	1,000	24,880.00	0.11
132	688099	晶晨股份	200	14,202.00	0.06
133	688002	睿创微纳	200	13,944.00	0.06
134	002472	双环传动	400	13,396.00	0.06
135	603341	龙旗科技	300	12,189.00	0.06
136	002508	老板电器	600	11,406.00	0.05
137	300037	新宙邦	300	10,560.00	0.05
138	300339	润和软件	200	10,166.00	0.05
139	002130	沃尔核材	400	9,528.00	0.04
140	300679	电连技术	200	9,076.00	0.04
141	000062	深圳华强	300	8,058.00	0.04
142	300458	全志科技	200	7,938.00	0.04
143	300748	金力永磁	300	7,152.00	0.03
144	002966	苏州银行	800	7,024.00	0.03
145	002155	湖南黄金	390	6,961.50	0.03
146	600764	中国海防	200	6,800.00	0.03
147	000729	燕京啤酒	500	6,465.00	0.03
148	601555	东吴证券	700	6,125.00	0.03
149	001389	广合科技	100	5,877.00	0.03
150	000537	中绿电	700	5,852.00	0.03
151	600673	东阳光	500	5,815.00	0.03
152	600895	张江高科	200	5,140.00	0.02

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	688256	寒武纪	200	120,300.00	0.55
2	601218	吉鑫科技	25,700	105,627.00	0.48
3	603259	药明康德	1,400	97,370.00	0.44
4	002782	可立克	7,400	96,052.00	0.44
5	601600	中国铝业	13,600	95,744.00	0.44
6	600728	佳都科技	17,500	95,375.00	0.43
7	000725	京东方 A	23,900	95,361.00	0.43
8	601002	晋亿实业	19,300	95,149.00	0.43
9	002206	海利得	18,600	95,046.00	0.43
10	601766	中国中车	13,300	93,632.00	0.43
11	002249	大洋电机	14,200	93,436.00	0.42

12	603466	风语筑	9,200	92,828.00	0.42
13	601126	四方股份	5,700	92,739.00	0.42
14	000001	平安银行	7,500	90,525.00	0.41
15	600050	中国联通	16,900	90,246.00	0.41
16	600219	南山铝业	23,500	90,005.00	0.41
17	000425	徐工机械	11,500	89,355.00	0.41
18	000100	TCL 科技	20,300	87,899.00	0.40
19	601857	中国石油	9,600	82,080.00	0.37
20	601211	国泰海通	2,000	38,320.00	0.17
21	000333	美的集团	500	36,100.00	0.16
22	688685	迈信林	600	33,510.00	0.15
23	300602	飞荣达	800	16,968.00	0.08
24	300083	创世纪	2,000	16,440.00	0.07
25	002315	焦点科技	300	13,707.00	0.06
26	603501	豪威集团	100	12,765.00	0.06
27	002925	盈趣科技	700	12,586.00	0.06
28	688484	南芯科技	300	11,865.00	0.05
29	300236	上海新阳	300	11,640.00	0.05
30	603025	大豪科技	800	11,216.00	0.05
31	688209	英集芯	600	11,082.00	0.05
32	300229	拓尔思	600	11,064.00	0.05
33	688327	云从科技	800	11,032.00	0.05
34	600750	江中药业	500	10,915.00	0.05
35	603043	广州酒家	700	10,906.00	0.05
36	301171	易点天下	400	10,692.00	0.05
37	301215	中汽股份	1,700	10,540.00	0.05
38	300628	亿联网络	300	10,428.00	0.05
39	688076	诺泰生物	280	10,421.60	0.05
40	002475	立讯精密	300	10,407.00	0.05
41	600055	万东医疗	600	10,368.00	0.05
42	002920	德赛西威	100	10,213.00	0.05
43	600552	凯盛科技	900	10,170.00	0.05
44	002747	埃斯顿	500	10,120.00	0.05
45	300418	昆仑万维	300	10,089.00	0.05
46	600057	厦门象屿	1,400	9,842.00	0.04
47	300759	康龙化成	400	9,816.00	0.04
48	002466	天齐锂业	300	9,612.00	0.04
49	002241	歌尔股份	400	9,328.00	0.04
50	002895	川恒股份	400	9,024.00	0.04
51	600233	圆通速递	700	9,023.00	0.04
52	002979	雷赛智能	200	8,856.00	0.04
53	603236	移远通信	100	8,580.00	0.04
54	600111	北方稀土	300	7,470.00	0.03

55	605117	德业股份	140	7,372.40	0.03
56	688252	天德钰	300	7,314.00	0.03
57	000935	四川双马	400	7,288.00	0.03
58	300777	中简科技	200	7,250.00	0.03
59	601688	华泰证券	400	7,124.00	0.03
60	002093	国脉科技	600	7,098.00	0.03
61	002597	金禾实业	300	7,065.00	0.03
62	002402	和而泰	300	6,951.00	0.03
63	002648	卫星化学	400	6,932.00	0.03
64	600482	中国动力	300	6,921.00	0.03
65	605020	永和股份	300	6,912.00	0.03
66	601881	中国银河	400	6,860.00	0.03
67	300443	金雷股份	300	6,780.00	0.03
68	603195	公牛集团	140	6,755.00	0.03
69	600584	长电科技	200	6,738.00	0.03
70	002396	星网锐捷	300	6,735.00	0.03
71	002947	恒铭达	200	6,638.00	0.03
72	002258	利尔化学	600	6,624.00	0.03
73	301078	孩子王	500	6,535.00	0.03
74	600150	中国船舶	200	6,508.00	0.03
75	600989	宝丰能源	400	6,456.00	0.03
76	603662	柯力传感	100	6,393.00	0.03
77	600547	山东黄金	200	6,386.00	0.03
78	002001	新 和 成	300	6,381.00	0.03
79	603766	隆鑫通用	500	6,380.00	0.03
80	002324	普利特	600	6,378.00	0.03
81	601311	骆驼股份	700	6,321.00	0.03
82	603920	世运电路	200	6,102.00	0.03
83	601989	中国重工	1,300	6,032.00	0.03
84	002611	东方精工	500	6,030.00	0.03
85	601919	中远海控	400	6,016.00	0.03
86	002311	海大集团	100	5,859.00	0.03
87	600160	巨化股份	200	5,736.00	0.03
88	600206	有研新材	300	5,733.00	0.03
89	600490	鹏欣资源	1,300	5,707.00	0.03
90	600176	中国巨石	500	5,700.00	0.03
91	601083	锦江航运	500	5,555.00	0.03
92	000089	深圳机场	800	5,520.00	0.03
93	600063	皖维高新	1,200	5,496.00	0.02
94	600186	莲花控股	900	5,400.00	0.02
95	000686	东北证券	700	5,341.00	0.02
96	300926	博俊科技	200	5,294.00	0.02
97	001301	尚太科技	100	4,876.00	0.02

98	000600	建投能源	700	4,837.00	0.02
99	001339	智微智能	100	4,833.00	0.02
100	300100	双林股份	100	4,708.00	0.02
101	002881	美格智能	100	4,640.00	0.02
102	002463	沪电股份	100	4,258.00	0.02

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	002625	光启技术	543,741.00	1.56
2	002340	格林美	467,330.00	1.35
3	600352	浙江龙盛	429,558.00	1.24
4	600885	宏发股份	422,171.00	1.22
5	601216	君正集团	395,850.00	1.14
6	688213	思特威	391,927.76	1.13
7	601997	贵阳银行	380,373.00	1.09
8	300496	中科创达	378,505.00	1.09
9	000733	振华科技	377,083.00	1.09
10	600497	驰宏锌锗	372,048.00	1.07
11	002152	广电运通	368,334.00	1.06
12	600418	江淮汽车	364,500.00	1.05
13	000423	东阿阿胶	348,343.00	1.00
14	002430	杭氧股份	329,077.00	0.95
15	603379	三美股份	326,996.00	0.94
16	301301	川宁生物	325,768.00	0.94
17	000960	锡业股份	319,974.00	0.92
18	002299	圣农发展	318,473.00	0.92
19	601958	金钼股份	317,903.00	0.91
20	600764	中国海防	317,384.00	0.91

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	002625	光启技术	617,479.00	1.78
2	688777	中控技术	560,979.18	1.61
3	002558	巨人网络	556,698.00	1.60
4	002517	恺英网络	530,599.00	1.53
5	601555	东吴证券	521,799.00	1.50
6	000423	东阿阿胶	490,029.00	1.41

7	300002	神州泰岳	476,993.50	1.37
8	688213	思特威	476,631.23	1.37
9	600418	江淮汽车	455,368.00	1.31
10	300339	润和软件	442,658.00	1.27
11	002384	东山精密	442,067.00	1.27
12	000960	锡业股份	433,798.00	1.25
13	002595	豪迈科技	425,532.00	1.22
14	002867	周大生	409,263.00	1.18
15	002432	九安医疗	404,766.00	1.16
16	002152	广电运通	402,815.00	1.16
17	300144	宋城演艺	393,792.00	1.13
18	002653	海思科	392,347.00	1.13
19	301236	软通动力	391,643.00	1.13
20	600007	中国国贸	381,293.00	1.10

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	57,377,372.47
卖出股票收入（成交）总额	70,679,127.59

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是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	138,619.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,258.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,877.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
泰康中证 500 指 数 增强发起 A	173	89,730.97	9,967,541.53	64.21	5,555,916.97	35.79
泰康中证 500 指 数 增强发起 C	134	33,962.04	100,028.33	2.20	4,450,885.61	97.80
合计	296	67,818.83	10,067,569.86	50.15	10,006,802.58	49.85

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰康中证 500 指数增强发起 A	5.00	0.0000
	泰康中证 500 指数增强发起 C	2.00	0.0000
	合计	7.00	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

	合计	0
--	----	---

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,002,833.61	49.83	10,002,833.61	49.83	3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,833.61	49.83	10,002,833.61	49.83	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰康中证 500 指数增强发起 A	泰康中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日 (2023 年 8 月 17 日) 基金份额总额	62,631,367.57	44,579,077.16
本报告期期初基金份 额总额	23,451,193.55	9,997,554.36
本报告期基金总申购 份额	3,023,169.92	469,628.52
减：本报告期基金总 赎回份额	10,950,904.97	5,916,268.94
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	15,523,458.50	4,550,913.94

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 2025 年 5 月 30 日发布公告，自 2025 年 5 月 29 日起，蒋利娟担任公司副总经理，代胜伟担任公司副总经理、财务负责人，金志刚不再兼任公司财务负责人，同时，由金志刚兼任公司首席信息官，朱伟不再担任公司首席信息官。

本报告期内，本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，本基金托管人的专门基金托管部门及其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 (%)	
恒泰证券	3	128,056,500.06	100.00	24,477.77	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恒泰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(%)
恒泰证券	7,812.99	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	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（1）	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 18 日
2	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（2）	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 18 日
3	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第四季度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 21 日
4	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增华西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	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 23 日
5	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（泰康中证 500 指数增强发起 C 份额）基金产品资料概要更新	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 8 日
6	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（泰康中证 500 指数增强发起 A 份额）基金产品资料概要更新	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 8 日
7	关于泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金变更基金经理的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 8 日

		及基金管理人网站	
8	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书(2025 年第 1 次更新)	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 8 日
9	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
10	泰康基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
11	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 16 日
12	泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第一季度报告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 21 日
13	泰康基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 5 月 30 日
14	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增华宝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	《中国证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 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	20250101-20250630	10,002,833.61	0.00	0.00	10,002,833.61	49.83
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 指数增强型发起式证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金产品资料概要》

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日