

泰康沪深 300 交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	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	12
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	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18

6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	109
8.1 期末基金资产组合情况	109
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	109
8.3 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	111
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	120
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	122
8.6 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	122
8.7 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	123
8.8 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	123
8.9 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	123
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	123
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	123
8.12 投资组合报告附注	123
§9 基金份额持有人信息	125
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	125
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构	125
9.3 期末上市基金前十名持有人	125
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	126
9.5 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的情况	126
§10 开放式基金份额变动	127
§11 重大事件揭示	128
11.1 基金份额持有人大会决议	128
11.2 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	128
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	128

11.4 基金投资策略的改变	128
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	128
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	128
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	128
11.8 其他重大事件	130
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	134
12.1 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	134
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	134
§13 备查文件目录.....	135
13.1 备查文件目录	135
13.2 存放地点	135
13.3 查阅方式	135

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	泰康 300
基金主代码	515380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 27 日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,360,899,814.00 份
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020-03-23

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。
投资策略	本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎

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

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		泰康资产管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	张燕
	联系电话	010-58753683	0755-83199084
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	95555
传真		010-57818785	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		段国圣	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	928,887,763.17	890,463.67
本期利润	2,128,784,960.69	4,080,249.67
加权平均基金份额本期利润	0.9292	0.0006
本期加权平均净值利润率	27.44%	0.06%
本期基金份额净值增长率	29.46%	0.06%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	749,546,053.55	890,463.67
期末可供分配基金份额利润	0.5508	0.0001
期末基金资产净值	7,236,931,353.89	7,164,684,868.67
期末基金份额净值	5.3178	1.0006
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	29.54%	0.06%

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。

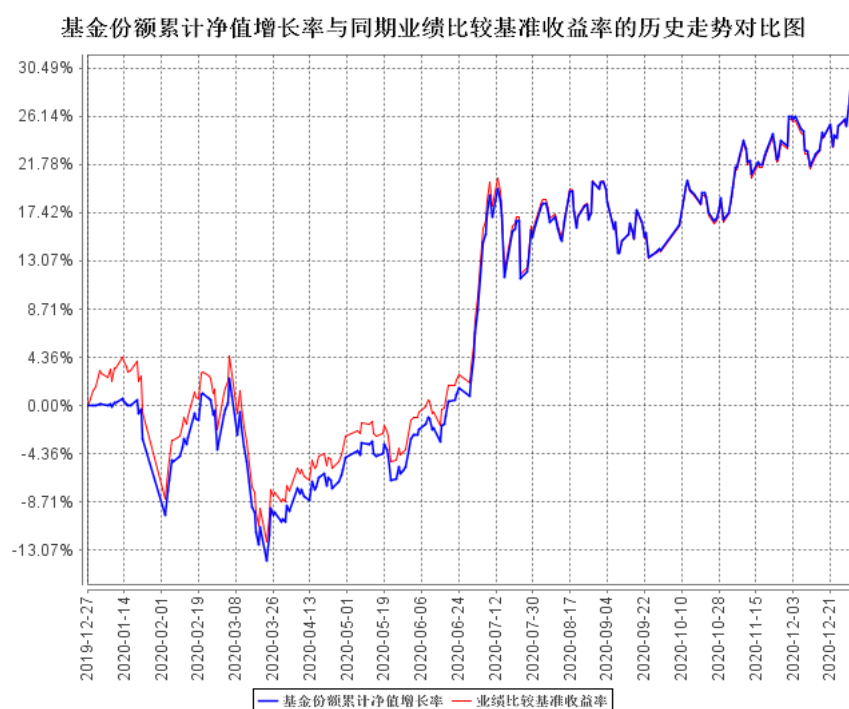
（4）本基金以 2020 年 2 月 12 日为折算日，进行了基金份额折算，折算情况参见《关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》及《关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.58%	0.99%	13.60%	0.99%	-0.02%	0.00%
过去六个月	26.64%	1.35%	25.15%	1.35%	1.49%	0.00%
过去一年	29.46%	1.40%	27.21%	1.43%	2.25%	-0.03%
自基金合同生效起至今	29.54%	1.39%	29.44%	1.43%	0.10%	-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

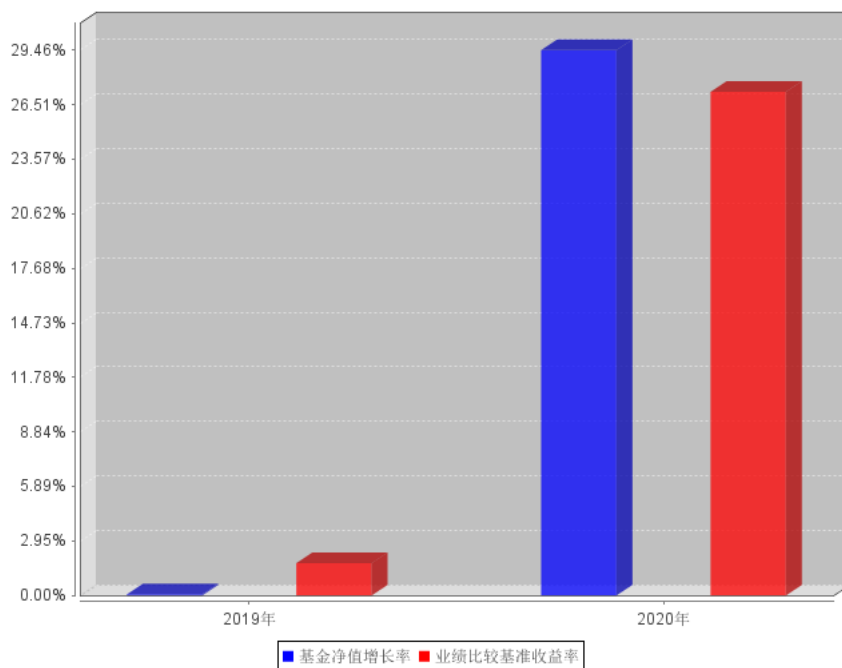


注：1、本基金基金合同于 2019 年 12 月 27 日生效。

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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于2019年12月27日，2019年度净值增长率的计算期间为2019年12月27日至2019年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2019年12月27日)至报告期截止日(2020年12月31日)未进行利润分配。

§ 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

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2020 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 22000 亿元。除管理泰康保险集团委托的资金外，泰康资产受托管理的第三方资产总规模突破 12000 亿元，另类投资管理规模超过 4400 亿元，退休金管理规模超过 5200 亿元，其中企业年金管理规模超过 3400 亿元。

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。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、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、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康

安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金、泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金、泰康创新成长混合型证券投资基金、泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势企业混合型证券投资基金、泰康品质生活混合型证券投资基金共 52 只证券投资基金。

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	2019 年 12 月 27 日	-	13	魏军于 2019 年 5 月加入泰康资产，现任公募事业部投资部量化投资总监。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。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。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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的披露日期。

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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规

行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易制度和流程,并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源,保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 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。

本报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行了分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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,2020 年经济经受到疫情的冲击,呈现出“V”型复苏的走势。一季度,疫情带来了较大的冲击,经济被按下暂停键,但随着国内疫情控制得当、复工复产顺利推进、以及政

策的合理对冲，二季度开始经济明显复苏，GDP 到四季度已经回升到 6.5%，略高于疫情前水平。对复苏贡献最大的是出口，中国具有完备的产业链和生产优势，迅速在全球市场扩张份额，并且同时带动了出口产业链相关制造业的发展。此外，基建和地产表现稳健，零售的复苏任重道远。金融环境方面，CPI 在食品和非食品的共振下持续下行，PPI 从底部回升，汇率有所升值，社融有序扩张。

权益市场方面，2020 年一季度新冠肺炎对海外经济体的影响超出之前的预期，由于外需的不确定性以及防控海外病例倒灌的影响，中国经济活动尚未企稳复苏，虽然短期权益市场的盈利下调风险还需要释放，但中长期而言中国经济相比全球其他经济体依然有韧性，宽松的政策环境也对冲了部分风险偏好的下降。进入二季度，随着新冠肺炎疫情在中国得到了有效的控制，4、5 月份的数据显示中国经济韧性强于预期，中国庞大的消费市场和在全球产业链中不断上升的地位为后续的复苏提供了持续的动力，权益市场也探底回升。下半年，资金面和政策面维持宽松友好，全球疫情和国际关系又有复杂变数，市场在多重因素的影响下处于弱平衡状态，呈现出震荡上涨格局。从大盘和板块上来看，全年上证综指上涨 13.87%、沪深 300 上涨 27.21%、中小板指上涨 43.91%、创业板指上涨 64.96%，其中，电力设备及新能源、食品饮料、消费者服务等板块表现相对较好，通信、房地产、综合金融等行业表现不佳。

投资操作方面，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内跟踪误差主要来自基金份额的申赎和指数成分股定期调整。报告期内，沪深 300 指数在新冠疫情初期下跌较多，随后指数呈震荡上行态势，投资者风险偏好提升，全年指数录得涨幅超 27%。我们长期看好核心宽基指数表现，基金将紧跟市场、以控制跟踪误差为基础，通过精细化投资管理，参与转融通证券出借、大宗交易、可转债投资、股票打新等，力求为投资者带来更好的投资体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康沪深 300ETF 基金份额净值为 5.3178 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.46%；同期业绩比较基准增长率为 27.21%。

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 2021 年，宏观上，当前国内经济仍持续复苏，企业融资需求旺盛，国内经济活力逐步恢复，预计全年将录得同比较高增长。政策上，当前国内宽松货币政策及信用政策呈现边际收紧趋势，但收紧的力度及幅度仍较为温和。估值上，当前 A 股整体估值处于历史高位，但结构性特征明显，资金抱团股票估值处于历史高位，而中小盘股票估值仍处于历史较低水平，市场风格和估值分化明显。

权益市场方面，从海内外情况来看，持续复苏的经济和不断修复的企业盈利将对 A 股市场形成有力的支撑，而持续收紧的政策和较高的估值可能压制 A 股大幅上涨，预计 A 股结构牛行情还将延续，沪深 300、中证 500 等核心宽基指数具有相对估值优势，具有较高的配置价值。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；建立可供投资的基础库和禁投库，并适时对个券进行维护更新，通过信息技术建立完善投资交易监控系统；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；内部监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司公募业务风险控制委员会。

4.7 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，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募估值小组成员均具有相关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，并经托管银行复核确认。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22842 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“泰康沪深 300ETF”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度和 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰康沪深 300ETF 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度和 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰康沪深 300ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。

强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	泰康沪深 300ETF 的基金管理人泰康资产管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰康沪深 300ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰康沪深 300ETF、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督泰康沪深 300ETF 的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估

	计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对泰康沪深 300ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致泰康沪深 300ETF 不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张 勇	周 祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	28,544,831.79	10,970,000.90
结算备付金		127,635,925.45	-
存出保证金		21,116,276.26	-
交易性金融资产	7.4.7.2	7,066,598,647.45	152,824,405.00
其中：股票投资		7,061,577,647.45	152,824,405.00
基金投资		-	-
债券投资		5,021,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	7,000,000,000.00
应收证券清算款		2,841,675.76	-
应收利息	7.4.7.5	307,940.37	1,264,995.43
应收股利		110.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	2,105.41
资产总计		7,247,045,407.08	7,165,061,506.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		750,831.58	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,646,319.97	313,865.06
应付托管费		330,790.01	39,233.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	774,964.12	-
应交税费		386,033.78	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	5,225,113.73	23,539.88
负债合计		10,114,053.19	376,638.07
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	5,586,691,815.36	7,160,604,619.00
未分配利润	7.4.7.10	1,650,239,538.53	4,080,249.67
所有者权益合计		7,236,931,353.89	7,164,684,868.67
负债和所有者权益总计		7,247,045,407.08	7,165,061,506.74

注：(1)报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.3178 元，基金份额总额 1,360,899,814.00 份。

(2) 股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 利润表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		2,175,929,223.54	4,456,887.74
1.利息收入		20,647,498.91	1,264,995.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,898,064.15	701,316.40
债券利息收入		3,663.49	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,718,250.39	563,679.03
证券出借利息收入		9,027,520.88	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		951,836,744.78	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	746,209,999.06	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,535,722.71	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	42,492,113.59	-
股利收益	7.4.7.16	159,598,909.42	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,199,897,197.52	3,189,786.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	3,547,782.33	2,106.31
减: 二、费用		47,144,262.85	376,638.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	30,929,552.11	313,865.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,866,194.02	39,233.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	9,565,049.58	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		185,483.99	-
7. 其他费用	7.4.7.20	2,597,983.15	23,539.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,128,784,960.69	4,080,249.67
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,128,784,960.69	4,080,249.67

注: 本基金合同生效日为 2019 年 12 月 27 日, 上年度可比期间是指自基金合同生效日 2019 年 12 月 27 日至 2019 年 12 月 31 日止期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	7,160,604,619.00	4,080,249.67	7,164,684,868.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,128,784,960.69	2,128,784,960.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,573,912,803.64	-482,625,671.83	-2,056,538,475.47
其中: 1.基金申购款	3,956,949,795.96	298,442,932.28	4,255,392,728.24
2. 基金赎回款	-5,530,862,599.60	-781,068,604.11	-6,311,931,203.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少)	-	-	-

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	5,586,691,815.36	1,650,239,538.53	7,236,931,353.89
项目	上年度可比期间 2019年12月27日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	7,160,604,619.00	-	7,160,604,619.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,080,249.67	4,080,249.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	7,160,604,619.00	4,080,249.67	7,164,684,868.67

注:本基金合同生效日为2019年12月27日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2019年12月27日至2019年12月31日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>段国圣</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1824 号《关于准予泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

7,158,504,619.00 元(含募集股票市值),业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1900636 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,160,604,619.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,100,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》,本基金以 2020 年 2 月 12 日为折算日,进行了基金份额折算,折算前基金份额总额为 7,160,604,619.00 份,折算后基金份额总额为 1,744,299,814.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]65 号核准,本基金 1,744,299,814.00 份基金份额于 2020 年 3 月 23 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,还可投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(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)、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定,本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司以本基金为目标 ETF,募集成立了泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“泰康沪深 300ETF 联接基金”)。泰康沪深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度和 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度和 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年度和 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制

等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1. 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	28,544,831.79	10,970,000.90
定期存款	—	—
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	—	—
合计：	28,544,831.79	10,970,000.90

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,866,907,946.93	7,061,577,647.45	1,194,669,700.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,021,000.00	5,021,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,021,000.00	5,021,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,871,928,946.93	7,066,598,647.45	1,194,669,700.52
项目		上年度末 2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		149,634,619.00	152,824,405.00	3,189,786.00
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		149,634,619.00	152,824,405.00	3,189,786.00

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	160,427,757.00	-	-	
-股指期货	160,427,757.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	160,427,757.00	-	-	
项目	上年度末 2019年12月31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	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资。在当日无负债结算制度下，结算备付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。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2102	沪深300期货2102 合约	30	46,893,600.00	1,491,660.00
IF2103	沪深300期货2103 合约	78	121,951,440.00	6,925,623.00
总额合计				8,417,283.00
减：可抵销期货暂收款				8,417,283.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,000,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,000,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,176.05	701,316.40
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	72,302.25	-
应收债券利息	370.64	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	563,679.03
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	225,668.26	-
其他	423.17	-
合计	307,940.37	1,264,995.43

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
其他应收款	-	2,105.41
待摊费用	-	-
合计	-	2,105.41

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	774,964.12	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	774,964.12	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 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	-	-
预提费用	148,797.81	-
指数使用费	630,953.51	23,539.88
可退替代款	15,266.66	-
应付替代款	4,430,095.75	-
合计	5,225,113.73	23,539.88

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,160,604,619.00	7,160,604,619.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
2020 年 2 月 12 日 基金拆分/份额折算前	7,160,604,619.00	7,160,604,619.00
基金拆分/份额折算变动份额	-5,416,304,805.00	-
本期申购	963,900,000.00	3,956,949,795.96
本期赎回(以“-”号填列)	-1,347,300,000.00	-5,530,862,599.60
本期末	1,360,899,814.00	5,586,691,815.36

注：1. 申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2019 年 11 月 15 日至 2019 年 12 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 7,158,504,619.00 元(含募集股票市值)。根据《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购基金资金产生的利息收入 2,102,106.31 元，其中 2,100,000.00 元为注册登记机构实际记录结转基金份额金额，折合 2,100,000.00 份基金份额。根据《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，本基金以 2020 年 2 月 12 日为折算日，进行了基金份额折算，折算前基金份额总额为 7,160,604,619.00 份，折算后基金份额总额为 1,744,299,814.00 份。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	890,463.67	3,189,786.00	4,080,249.67
本期利润	928,887,763.17	1,199,897,197.52	2,128,784,960.69
本期基金份额交易产生的变动数	-180,232,173.29	-302,393,498.54	-482,625,671.83
其中：基金申购款	87,603,530.10	210,839,402.18	298,442,932.28
基金赎回款	-267,835,703.39	-513,232,900.72	-781,068,604.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	749,546,053.55	900,693,484.98	1,650,239,538.53

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月27日(基金合同生效日)至2019年12月31日
活期存款利息收入	244,740.78	701,316.40
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,632,514.34	-
其他	20,809.03	-
合计	1,898,064.15	701,316.40

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月27日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	481,572,258.82	-
股票投资收益——赎回差价收入	264,637,740.24	-
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	746,209,999.06	-

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年12月27日(基金合 同生效日)至2019年12月31日
卖出股票成交总额	4,172,378,391.17	-
减：卖出股票成本总额	3,690,806,132.35	-
买卖股票差价收入	481,572,258.82	-

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年12月27日(基金 合同生效日)至2019年12月 31日
赎回基金份额对价总额	6,311,931,203.71	-
减：现金支付赎回款总额	2,426,748,511.71	-
减：赎回股票成本总额	3,620,544,951.76	-
赎回差价收入	264,637,740.24	-

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年12月27日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	3,535,722.71	-
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	3,535,722.71	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年12月27日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	107,598,741.64	-
减:卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	104,002,805.14	-
减:应收利息总额	60,213.79	-
买卖债券差价收入	3,535,722.71	-

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日,本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日,本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效 日)至 2019 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	42,492,113.59	-

7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生 效日)至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	159,598,909.42	-
其中:证券出借权益补偿收 入	13,516,038.94	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	159,598,909.42	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合 同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,191,479,914.52	3,189,786.00
——股票投资	1,191,479,914.52	3,189,786.00
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	8,417,283.00	—
——权证投资	—	—
——股指期货投资	8,417,283.00	—
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	1,199,897,197.52	3,189,786.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合 同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—	—
其他	471.77	2,106.31
替代损益	3,547,310.56	—
合计	3,547,782.33	2,106.31

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生
----	--------------------------------------	-----------------------------------

	日	效日)至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	9,565,049.58	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	9,565,049.58	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同 生效日)至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	110,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
其他	39,197.81	-
指数使用费	2,319,716.42	23,539.88
银行费用	9,068.92	-
合计	2,597,983.15	23,539.88

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资	本基金的联接基金

基金联接基金	
--------	--

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	30,929,552.11	313,865.06
其中：支付销售机构的客户维护费	40,318.47	9.16

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,866,194.02	39,233.13

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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**

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，本基金未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。

7.4.10.4.2 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

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，本基金未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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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
泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	18,618,486.00	1.3681%	—	—

7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	28,544,831.79	244,740.78	10,970,000.90	701,316.40

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间 2019 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有 4,456,845 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 170,616,565.78 元，估值总额为人民币 195,878,337.75 元，占基金资产净值的比例为 2.71%（2019 年 12 月 31 日，未持有招商银行的 A 股普通股）。

7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600919	江苏银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	增发流通受限	4.59	5.46	1,275,300	5,853,627.00	6,963,138.00	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	网下新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	网下新股流通受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定期流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
605277	新亚电	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	网下新股流通	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-

	子	日	日	受限						
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	网下新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	网下新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
601012	隆基股份	2020年12月16日	2021年6月17日	大宗交易流通受限	72.49	84.33	660,000	47,843,400.00	55,657,800.00	-
000661	长春高新	2020年12月23日	2021年6月24日	大宗交易流通受限	418.86	414.85	70,000	29,320,200.00	29,039,500.00	-
600588	用友网络	2020年7月9日	2021年1月11日	大宗交易流通受限	48.70	43.00	373,000	18,165,100.00	16,039,000.00	-
000538	云南白药	2020年11月24日	2021年5月25日	大宗交易流通受限	90.00	107.96	100,000	9,000,000.00	10,796,000.00	-
603501	韦尔股份	2020年9月14日	2021年3月15日	大宗交易流通受限	175.00	218.10	48,000	8,400,000.00	10,468,800.00	-
300676	华大基因	2020年12月16日	2021年6月17日	大宗交易流通受限	123.12	119.49	60,000	7,387,200.00	7,169,400.00	-
601788	光大证券	2020年9月3日	2021年3月4日	大宗交易流通受限	20.63	17.92	300,000	6,189,000.00	5,376,000.00	-
601360	三六零	2020年7月6日	2021年1月7日	大宗交易流通受限	17.45	15.56	240,000	4,188,000.00	3,734,400.00	-
002558	巨人网络	2020年11月5日	2021年5月6日	大宗交易流通	16.55	16.87	150,000	2,482,500.00	2,530,500.00	-

	络		日	受限						
600989	宝丰能源	2020年11月4日	2021年5月6日	大宗交易流通受限	9.60	11.09	210,000	2,016,000.00	2,328,900.00	-
601995	中金公司	2020年10月22日	2021年5月6日	新锁定流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新锁定流通受限	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
688017	绿的谐波	2020年8月21日	2021年3月1日	新锁定流通受限	35.06	137.81	4,138	145,078.28	570,257.78	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2021年1月8日	新锁定流通受限	16.21	43.90	11,020	178,634.20	483,778.00	-
688508	芯朋微	2020年7月15日	2021年1月22日	新锁定流通受限	28.30	91.91	3,729	105,530.70	342,732.39	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新锁定流通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
688286	敏芯股份	2020年7月31日	2021年2月10日	新锁定流通受限	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
688229	博睿数据	2020年8月7日	2021年2月18日	新锁定流通受限	65.82	101.25	1,643	108,142.26	166,353.75	-

				限						
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300871	回盛生	2020年8月13日	2021年2月24日	新 股 锁 定 期 流	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-

	物		日	通 受 限						
300894	火星人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 6 月 30 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300873	海晨股份	2020 年 8 月 14 日	2021 年 3 月 2 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 30 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼	2020 年 9 月	2021 年 3	新 股 锁 定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-

	测试	9 日	月 16 日	期 流 通 受 限						
300913	兆龙互连	2020 年 11 月 27 日	2021 年 6 月 7 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300864	南大环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿	2020	2021	新 股	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-

	田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	锁定流通受限						
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新锁定流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月5日	新锁定流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新锁定流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新锁定流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新锁定流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020年12月15日	2021年1月15日	配债流通受限	100.00	100.00	46,050	4,605,000.00	4,605,000.00	-
113616	韦尔转债	2020年12月29日	2021年1月22日	配债流通受限	100.00	100.00	4,160	416,000.00	416,000.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》

以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金可作为特定投资者，所认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:张)	期末估值总额
2020091600001725	601788	光大证券	2020年9月16日	2021年3月17日	18.52	115,000	2,129,800.00
2020110600000520	002558	巨人网络	2020年11月6日	2021年5月7日	17.43	35,000	610,050.00
2020111700001180	603501	韦尔股份	2020年11月17日	2021年5月18日	231.10	11,000	2,542,100.00
2020120400001378	601186	中国铁建	2020年12月4日	2021年1月4日	7.90	64,700	511,130.00
2020120400003314	002594	比亚迪	2020年12月4日	2021年1月4日	194.30	51,000	9,909,300.00
2020120400003512	603993	洛阳钼业	2020年12月4日	2021年1月4日	6.25	167,600	1,047,500.00
2020120400003514	600690	海尔智家	2020年12月4日	2021年1月4日	29.21	24,900	727,329.00
2020120400003646	601318	中国	2020	2021	86.98	183,800	15,986,924.00

		平安	年 12 月 4 日	年 1 月 4 日			
2020120400004090	000768	中 航 西 飞	2020 年 12 月 4 日	2021 年 1 月 4 日	36.68	50,000	1,834,000.00
2020120700000521	002558	巨 人 网 络	2020 年 12 月 7 日	2021 年 6 月 7 日	17.43	20,000	348,600.00
2020121800000832	000002	万 科 A	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	28.70	107,900	3,096,730.00
2020121800000839	000001	平 安 银 行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	19.34	130,200	2,518,068.00
2020121800000928	000338	潍 柴 动 力	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	15.79	380,000	6,000,200.00
2020121800001114	000768	中 航 西 飞	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	36.68	10,000	366,800.00
2020121800001117	000776	广 发 证 券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	16.28	66,700	1,085,876.00
2020121800001148	000786	北 新 建 材	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	40.05	10,000	400,500.00
2020121800001251	002001	新 和 成	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	33.68	10,000	336,800.00
2020121800001260	002007	华 兰 生 物	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	42.24	10,000	422,400.00
2020121800001263	002007	华 兰 生 物	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	42.24	10,000	422,400.00

2020121800001285	002032	苏 泊 尔	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	77.99	10,000	779,900.00
2020121800001292	002044	美 年 健康	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	11.33	10,000	113,300.00
2020121800001310	000977	浪 潮 信息	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	26.88	10,000	268,800.00
2020121800001480	002236	大 华 股份	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	19.89	10,000	198,900.00
2020121800001544	002352	顺 丰 控股	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	88.23	10,000	882,300.00
2020121800001550	002352	顺 丰 控股	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	88.23	29,400	2,593,962.00
2020121800001571	002384	东 山 精密	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	26.00	10,000	260,000.00
2020121800001602	002415	海 康 威视	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	48.51	26,700	1,295,217.00
2020121800001657	002475	立 讯 精密	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	56.12	10,000	561,200.00
2020121800001723	002601	龙 蟒 佰利	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	30.77	10,000	307,700.00
2020121800001786	002739	万 达 电影	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	18.08	10,000	180,800.00

2020121800001811	002812	恩捷股份	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	141.78	18,000	2,552,040.00
2020121800001840	600018	上港集团	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.57	35,300	161,321.00
2020121800001847	600760	中航沈飞	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	78.18	10,000	781,800.00
2020121800001874	601988	中国银行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	3.18	10,000	31,800.00
2020121800001909	601229	上海银行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	7.84	10,000	78,400.00
2020121800001950	600332	白云山	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	29.25	10,000	292,500.00
2020121800001958	600369	西南证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	5.38	26,000	139,880.00
2020121800001966	601600	中国铝业	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	3.63	69,900	253,737.00
2020121800001976	601600	中国铝业	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	3.63	32,400	117,612.00
2020121800002008	600519	贵州茅台	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	1,998.00	10,900	21,778,200.00
2020121800002052	601108	财通证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.65	10,000	126,500.00

2020121800002093	600276	恒 瑞 医药	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	111.46	12,000	1,337,520.00
2020121800002120	600050	中 国 联通	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.46	33,900	151,194.00
2020121800002141	601933	永 辉 超市	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	7.18	17,300	124,214.00
2020121800002197	600436	片 仔 癪	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	267.51	10,000	2,675,100.00
2020121800002233	601990	南 京 证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.27	10,000	122,700.00
2020121800002247	600918	中 泰 证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	18.50	20,000	370,000.00
2020121800002257	603833	欧 派 家居	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	134.50	10,000	1,345,000.00
2020121800002272	600352	浙 江 龙盛	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	13.62	11,400	155,268.00
2020121800002284	601319	中 国 人保	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	6.57	10,000	65,700.00
2020121800002330	600011	华 能 国际	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.48	38,500	172,480.00
2020121800002364	601998	中 信 银行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	5.11	31,300	159,943.00

2020121800002412	600763	通策医疗	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	276.52	10,000	2,765,200.00
2020121800002426	601633	长城汽车	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	37.81	30,300	1,145,643.00
2020121800002436	601633	长城汽车	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	37.81	50,000	1,890,500.00
2020121800002447	601919	中海控股	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.21	59,200	722,832.00
2020121800002482	600000	浦发银行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	9.68	10,000	96,800.00
2020121800002496	600085	同仁堂	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	23.90	10,000	239,000.00
2020121800002507	600900	长江电力	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	19.16	200,000	3,832,000.00
2020121800002515	600900	长江电力	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	19.16	200,000	3,832,000.00
2020121800002537	601800	中国交建	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	7.26	16,200	117,612.00
2020121800002552	601766	中国中车	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	5.31	29,300	155,583.00
2020121800002608	600271	航天信息	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.60	10,000	126,000.00

2020121800002623	600585	海 螺 水泥	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	51.62	10,000	516,200.00
2020121800002624	600340	华 夏 幸福	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.93	11,500	148,695.00
2020121800002692	601877	正 泰 电器	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	39.16	10,000	391,600.00
2020121800002765	600115	东 方 航空	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.68	26,800	125,424.00
2020121800002783	600705	中 航 资本	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.38	73,700	322,806.00
2020121800002821	601066	中 信 建投	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	42.00	18,900	793,800.00
2020121800002839	600487	亨 通 光电	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	13.99	22,200	310,578.00
2020121800002850	600390	五 矿 资本	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	6.98	10,000	69,800.00
2020121800002877	601989	中 国 重工	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.19	136,200	570,678.00
2020121800002921	601808	中 海 油服	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.77	10,000	127,700.00
2020121800002950	600016	民 生 银行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	5.20	30,700	159,640.00

2020121800002989	601288	农 业 银 行	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	3.14	28,600	89,804.00
2020121800003018	601111	中 国 国 航	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	7.49	11,800	88,382.00
2020121800003030	600637	东 方 明 珠	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	8.94	15,300	136,782.00
2020121800003043	600150	中 国 船 舶	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	17.69	12,700	224,663.00
2020121800003063	600208	新 湖 中 宝	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	3.10	103,400	320,540.00
2020121800003075	600547	山 东 黄 金	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	23.62	10,000	236,200.00
2020121800003085	603019	中 科 曙 光	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	34.23	10,000	342,300.00
2020121800003100	603993	洛 阳 钼 业	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	6.25	36,100	225,625.00
2020121800003115	603993	洛 阳 钼 业	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	6.25	130,000	812,500.00
2020121800003182	603156	养 元 饮 品	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	25.84	10,000	258,400.00
2020121800003228	601108	财 通 证 券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.65	20,000	253,000.00

2020121800003234	600703	三 安 光电	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	27.01	44,600	1,204,646.00
2020121800003239	600010	包 钢 股份	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	1.17	548,800	642,096.00
2020121800003241	601633	长 城 汽车	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	37.81	15,900	601,179.00
2020121800003244	601066	中 信 建投	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	42.00	20,000	840,000.00
2020121800006355	000860	顺 鑫 农业	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	72.54	10,000	725,400.00
2020121800006393	600118	中 国 卫星	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	32.18	20,000	643,600.00
2020121800006395	600369	西 南 证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	5.38	31,500	169,470.00
2020121800006633	000768	中 航 西飞	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	36.68	10,000	366,800.00
2020121800007363	600340	华 夏 幸福	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.93	30,100	389,193.00
2020121800007803	601857	中 国 石油	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.15	82,200	341,130.00
2020121800007805	600115	东 方 航空	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.68	181,200	848,016.00

2020121800007807	000661	长 春 高新	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	448.91	10,000	4,489,100.00
2020121800007809	601117	中 国 化学	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	5.87	42,700	250,649.00
2020121800007811	002371	北 方 华创	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	180.74	10,000	1,807,400.00
2020121800007813	600104	上 汽 集团	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	24.44	20,300	496,132.00
2020121800007815	600050	中 国 联通	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.46	72,200	322,012.00
2020121800007817	600848	上 海 临港	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	20.02	15,700	314,314.00
2020121800007819	600637	东 方 明珠	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	8.94	35,300	315,582.00
2020121800007821	600332	白 云 山	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	29.25	10,100	295,425.00
2020122100000764	000002	万 科 A	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	28.70	120,000	3,444,000.00
2020122100000823	000166	申 万 宏源	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	5.28	225,300	1,189,584.00
2020122100000879	000568	泸 州 老窖	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	226.16	10,200	2,306,832.00

2020122100000895	000651	格 力 电 器	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	61.94	173,600	10,752,784.00
2020122100000917	000723	美 锦 能 源	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	6.68	35,100	234,468.00
2020122100000981	000858	五 粮 液	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	291.85	35,400	10,331,490.00
2020122100001075	002027	分 众 传 媒	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	9.87	790,000	7,797,300.00
2020122100001087	002049	紫 光 国 微	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	133.81	16,500	2,207,865.00
2020122100001221	002311	海 大 集 团	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	65.50	17,000	1,113,500.00
2020122100001298	002475	立 讯 精 密	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	56.12	19,400	1,088,728.00
2020122100001341	002600	领 益 智 造	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	11.99	219,100	2,627,009.00
2020122100001383	002916	深 南 电 路	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	108.06	10,000	1,080,600.00
2020122100001402	600998	九 州 通	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	18.16	14,400	261,504.00
2020122100001412	600161	天 坛 生 物	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	41.70	10,000	417,000.00

2020122100001453	600584	长 电 科技	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	42.57	27,300	1,162,161.00
2020122100001683	601919	中 远 海控	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	12.21	28,700	350,427.00
2020122100001758	601888	中 国 中免	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	282.45	10,000	2,824,500.00
2020122100001774	600176	中 国 巨石	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	19.96	48,000	958,080.00
2020122100001785	600522	中 天 科技	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	10.84	23,700	256,908.00
2020122100001842	601838	成 都 银行	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	10.67	50,000	533,500.00
2020122100001931	600177	雅 戈 尔	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	7.19	10,000	71,900.00
2020122100001969	601066	中 信 建投	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	42.00	10,500	441,000.00
2020122100002005	601989	中 国 重工	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	4.19	240,100	1,006,019.00
2020122100002020	601989	中 国 重工	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	4.19	43,700	183,103.00
2020122100002049	600837	海 通 证券	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	12.86	242,200	3,114,692.00

2020122100002085	601288	农 业 银 行	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	3.14	367,800	1,154,892.00
2020122100002130	601872	招 商 轮 船	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	5.65	157,700	891,005.00
2020122100002188	603019	中 科 曙 光	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	34.23	29,200	999,516.00
2020122100002232	601618	中 国 中 冶	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	2.73	34,400	93,912.00
2020122100002253	601618	中 国 中 冶	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	2.73	139,100	379,743.00
2020122100002265	601989	中 国 重 工	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	4.19	196,300	822,497.00
2020122100004765	601377	兴 业 证 券	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	8.68	29,300	254,324.00
2020122100004769	601688	华 泰 证 券	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	18.01	50,000	900,500.00
2020122100004803	601360	三 六 零	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 18 日	15.71	35,000	549,850.00
2020122100005127	600352	浙 江 龙 盛	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	13.62	50,000	681,000.00
2020122100005283	600489	中 金 黄 金	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	8.81	10,000	88,100.00

2020122100005285	600332	白 云 山	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	29.25	20,000	585,000.00
2020122100005287	600104	上 汽 集团	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	24.44	24,400	596,336.00
2020122100005289	601138	工 业 富联	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	13.69	10,000	136,900.00
2020122100005291	600276	恒 瑞 医药	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	111.46	20,000	2,229,200.00
2020122100005293	002252	上 海 莱士	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	7.40	42,300	313,020.00
2020122100005295	002008	大 族 激光	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	42.75	11,000	470,250.00
2020122100005297	600050	中 国 联通	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	4.46	14,600	65,116.00
2020122100005299	600271	航 天 信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	12.60	10,000	126,000.00
2020122100005301	600208	新 湖 中宝	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	3.10	10,900	33,790.00
2020122200001003	300015	爱 尔 眼科	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	74.89	50,000	3,744,500.00
2020122200001103	000001	平 安 银行	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	19.34	500,000	9,670,000.00

2020122200001112	000002	万科 A	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	28.70	182,700	5,243,490.00
2020122200001242	000157	中 联 重 科	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	9.90	353,500	3,499,650.00
2020122200001440	000627	天 茂 集 团	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.87	55,100	268,337.00
2020122200001474	000671	阳 光 城	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	6.52	34,200	222,984.00
2020122200001877	002050	三 花 智 控	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	24.65	10,000	246,500.00
2020122200001999	002146	荣 盛 发 展	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	6.53	30,300	197,859.00
2020122200002007	002153	石 基 信 息	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	31.09	10,000	310,900.00
2020122200002196	002304	洋 河 股 份	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	235.99	46,700	11,020,733.00
2020122200002382	002475	立 讯 精 密	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	56.12	30,000	1,683,600.00
2020122200002491	002607	中 公 教 育	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	35.13	10,000	351,300.00
2020122200002602	002939	长 城 证 券	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	12.87	13,400	172,458.00

2020122200002613	601377	兴 业 证券	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	8.68	10,000	86,800.00
2020122200002750	600655	豫 园 股份	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	8.89	27,900	248,031.00
2020122200002791	601328	交 通 银行	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.48	14,900	66,752.00
2020122200002945	601933	永 辉 超市	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	7.18	30,700	220,426.00
2020122200003085	601198	东 兴 证券	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	13.32	21,700	289,044.00
2020122200003207	600025	华 能 水电	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.46	32,000	142,720.00
2020122200003296	600011	华 能 国际	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.48	10,000	44,800.00
2020122200003306	601998	中 信 银行	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	5.11	24,000	122,640.00
2020122200003378	600482	中 国 动力	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	17.92	10,000	179,200.00
2020122200003455	600900	长 江 电力	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	19.16	60,400	1,157,264.00
2020122200003967	601066	中 信 建投	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	42.00	24,800	1,041,600.00

2020122200004051	601989	中国重工	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.19	90,100	377,519.00
2020122200004079	600837	海通证券	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	12.86	111,600	1,435,176.00
2020122200004280	600489	中金黄金	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	8.81	48,200	424,642.00
2020122200004314	600637	东方明珠	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	8.94	25,200	225,288.00
2020122200004334	600031	三一重工	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	34.98	10,000	349,800.00
2020122200004499	603156	养元饮品	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	25.84	10,000	258,400.00
2020122200008991	601698	中国卫通	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	18.14	10,000	181,400.00
2020122200008993	600362	江西铜业	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	19.95	10,000	199,500.00
2020122200008995	600745	闻泰科技	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	99.00	10,000	990,000.00
2020122200008997	601216	君正集团	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.95	10,000	49,500.00
2020122200008999	600809	山西汾酒	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	375.29	10,000	3,752,900.00

2020122200009001	600208	新 湖 中宝	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	3.10	103,100	319,610.00
2020122200009003	002142	宁 波 银行	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	35.34	10,000	353,400.00
2020122200009005	600340	华 夏 幸福	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	12.93	10,000	129,300.00
2020122200009007	600309	万 华 化学	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	91.04	14,300	1,301,872.00
2020122200009009	600050	中 国 联通	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	4.46	33,800	150,748.00
2020122200009011	000786	北 新 建材	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	40.05	10,000	400,500.00
2020122200009013	002236	大 华 股份	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	19.89	10,000	198,900.00
2020122200009015	002271	东 方 雨虹	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	38.80	16,500	640,200.00
2020122200009419	000963	华 东 医药	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	26.56	10,000	265,600.00
2020122200009421	002129	中 环 股份	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	25.50	10,000	255,000.00
2020122200009423	601628	中 国 人寿	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	38.39	10,000	383,900.00

2020122200009425	601336	新华保险	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	57.97	10,000	579,700.00
2020122200009851	601555	东吴证券	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	9.86	68,000	670,480.00
2020122200009853	002460	赣锋锂业	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	101.20	40,000	4,048,000.00
2020122200009855	002001	新和成	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	33.68	35,600	1,199,008.00
2020122200010257	300628	亿联网络	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	73.12	10,000	731,200.00
2020122300000765	688036	传音控股	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	152.14	10,000	1,521,400.00
2020122300001180	000166	申万宏源	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	5.28	39,700	209,616.00
2020122300001572	002007	华兰生物	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	42.24	12,000	506,880.00
2020122300002084	002714	牧原股份	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	77.10	29,500	2,274,450.00
2020122300002125	600760	中航沈飞	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	78.18	10,000	781,800.00
2020122300002138	600958	东方证券	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	11.63	125,800	1,463,054.00

2020122300002151	600161	天 坛 生物	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	41.70	24,300	1,013,310.00
2020122300002203	601727	上 海 电气	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	5.40	200,000	1,080,000.00
2020122300002248	601601	中 国 太保	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	38.40	36,700	1,409,280.00
2020122300002354	601225	陕 西 煤业	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	9.34	148,800	1,389,792.00
2020122300002527	600383	金 地 集团	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	13.50	100,100	1,351,350.00
2020122300002558	601919	中 远 海控	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	12.21	65,600	800,976.00
2020122300002590	600104	上 汽 集团	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	24.44	57,500	1,405,300.00
2020122300002673	601838	成 都 银行	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	10.67	114,000	1,216,380.00
2020122300003101	603369	今 世 缘	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	57.38	10,000	573,800.00
2020122300003167	600703	三 安 光电	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	27.01	27,400	740,074.00
2020122300006502	002241	歌 尔 股份	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	37.32	30,000	1,119,600.00

2020122300006504	002241	歌 尔 股份	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	37.32	80,000	2,985,600.00
2020122300006680	600886	国 投 电力	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	8.64	19,800	171,072.00
2020122300006682	600606	绿 地 控股	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	5.83	28,600	166,738.00
2020122300006684	000977	浪 潮 信息	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	26.88	11,500	309,120.00
2020122300006686	002352	顺 丰 控股	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	88.23	10,000	882,300.00
2020122300006890	002241	歌 尔 股份	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	37.32	60,000	2,239,200.00
2020122300006892	601555	东 吴 证券	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	9.86	55,500	547,230.00
2020122300006894	601766	中 国 中车	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	5.31	260,900	1,385,379.00
2020122300006896	600085	同 仁 堂	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	23.90	10,000	239,000.00
2020122300006898	601117	中 国 化学	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	5.87	12,000	70,440.00
2020122300006900	002252	上 海 莱士	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	7.40	26,200	193,880.00

2020122300006902	600900	长 江 电 力	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	19.16	55,600	1,065,296.00
2020122300006904	600115	东 方 航 空	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	4.68	76,200	356,616.00
2020122300006906	002236	大 华 股 份	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	19.89	21,900	435,591.00
2020122300006908	600795	国 电 电 力	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 6 日	2.25	83,400	187,650.00
2020122400001953	000625	长 安 汽 车	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	21.88	16,000	350,080.00
2020122400002088	000728	国 元 证 券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	8.96	40,300	361,088.00
2020122400002182	000768	中 航 西 飞	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	36.68	16,700	612,556.00
2020122400002769	002120	韵 达 股 份	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	15.70	10,000	157,000.00
2020122400002881	002179	中 航 光 电	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	78.29	20,000	1,565,800.00
2020122400002936	002202	金 风 科 技	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	14.25	40,000	570,000.00
2020122400003018	002236	大 华 股 份	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	19.89	10,000	198,900.00

2020122400003080	002252	上海莱士	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.40	39,200	290,080.00
2020122400003172	002311	海大集团	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	65.50	10,000	655,000.00
2020122400003275	002384	东山精密	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	26.00	10,000	260,000.00
2020122400003346	002414	高德红外	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	41.75	10,000	417,500.00
2020122400003473	002475	立讯精密	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	56.12	10,000	561,200.00
2020122400003659	002601	龙蟠佰利	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	30.77	10,000	307,700.00
2020122400003792	002739	万达电影	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	18.08	10,000	180,800.00
2020122400003861	601377	兴业证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	8.68	50,200	435,736.00
2020122400003871	600760	中航沈飞	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	78.18	10,000	781,800.00
2020122400003880	600018	上港集团	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	4.57	18,700	85,459.00
2020122400004027	600161	天坛生物	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	41.70	10,000	417,000.00

2020122400004078	600369	西南 证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	5.38	37,200	200,136.00
2020122400004099	601600	中国 铝业	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	3.63	10,000	36,300.00
2020122400004273	601108	财通 证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	12.65	10,000	126,500.00
2020122400004432	601236	红塔 证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	18.59	10,200	189,618.00
2020122400004618	601990	南京 证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	12.27	18,100	222,087.00
2020122400004630	601990	南京 证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	12.27	10,000	122,700.00
2020122400004642	600352	浙江 龙盛	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	13.62	19,800	269,676.00
2020122400004695	601319	中国人保	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	6.57	13,000	85,410.00
2020122400005191	600522	中天 科技	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	10.84	10,000	108,400.00
2020122400005202	600085	同仁 堂	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	23.90	12,200	291,580.00
2020122400005266	601800	中国 交建	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.26	24,000	174,240.00

2020122400005392	601766	中 国 中 车	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	5.31	52,100	276,651.00
2020122400005484	600585	海 螺 水 泥	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	51.62	10,000	516,200.00
2020122400005521	600009	上 海 机 场	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	75.66	10,000	756,600.00
2020122400005543	600340	华 夏 幸 福	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	12.93	10,000	129,300.00
2020122400005670	601877	正 泰 电 器	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	39.16	10,000	391,600.00
2020122400005780	600115	东 方 航 空	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	4.68	43,800	204,984.00
2020122400005873	600487	亨 通 光 电	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	13.99	10,000	139,900.00
2020122400005903	600487	亨 通 光 电	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	13.99	10,000	139,900.00
2020122400005948	600390	五 矿 资 本	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	6.98	11,400	79,572.00
2020122400006158	601808	中 海 油 服	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	12.77	13,300	169,841.00
2020122400006246	600016	民 生 银 行	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	5.20	52,600	273,520.00

2020122400006337	601288	农 业 银 行	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	3.14	40,600	127,484.00
2020122400006399	601111	中 国 国 航	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.49	25,300	189,497.00
2020122400006410	601186	中 国 铁 建	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.90	41,900	331,010.00
2020122400006546	600547	山 东 黄 金	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	23.62	14,200	335,404.00
2020122400006569	600547	山 东 黄 金	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	23.62	10,000	236,200.00
2020122400006610	603019	中 科 曙 光	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	34.23	10,000	342,300.00
2020122400006737	600703	三 安 光 电	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	27.01	10,000	270,100.00
2020122400006776	600104	上 汽 集 团	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	24.44	30,000	733,200.00
2020122400012801	601111	中 国 国 航	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.49	139,700	1,046,353.00
2020122400012803	601198	东 兴 证 券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	13.32	16,500	219,780.00
2020122400012805	601933	永 辉 超 市	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.18	52,800	379,104.00

2020122500000903	000002	万科 A	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	28.70	71,200	2,043,440.00
2020122500001699	002236	大 华 股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	19.89	35,400	704,106.00
2020122500002627	601919	中 远 海控	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	12.21	117,100	1,429,791.00
2020122500002827	600585	海 螺 水泥	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	51.62	154,400	7,970,128.00
2020122500006207	600547	山 东 黄金	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	23.62	21,500	507,830.00
2020122500006209	002024	苏 宁 易购	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	7.71	126,300	973,773.00
2020122500006211	002271	东 方 雨虹	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	38.80	10,000	388,000.00
2020122500006213	600068	葛 洲 坝	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	6.58	34,300	225,694.00
2020122500006215	000625	长 安 汽车	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	21.88	70,000	1,531,600.00
2020122500006257	002714	牧 原 股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	77.10	40,000	3,084,000.00
2020122500006383	002202	金 风 科技	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	14.25	21,500	306,375.00

2020122500006505	600436	片仔癀	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	267.51	10,000	2,675,100.00
2020122500006507	601318	中国平安	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	86.98	175,200	15,238,896.00
2020122800000669	000002	万科 A	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	28.70	18,400	528,080.00
2020122800000827	000166	申万宏源	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	5.28	50,000	264,000.00
2020122800000914	002007	华兰生物	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	42.24	10,000	422,400.00
2020122800000945	002050	三花智控	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	24.65	10,000	246,500.00
2020122800000983	002120	韵达股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	15.70	10,000	157,000.00
2020122800001227	002736	国信证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	13.64	20,100	274,164.00
2020122800001257	002939	长城证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.87	23,700	305,019.00
2020122800001259	002939	长城证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.87	31,500	405,405.00
2020122800001285	601988	中国银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	3.18	1,000,000	3,180,000.00

2020122800001309	601988	中国 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	3.18	538,400	1,712,112.00
2020122800001314	600845	宝信 软件	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	68.98	10,000	689,800.00
2020122800001335	601600	中国 铝业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	3.63	21,400	77,682.00
2020122800001345	601328	交通 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.48	506,400	2,268,672.00
2020122800001367	601328	交通 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.48	1,000,000	4,480,000.00
2020122800001379	601328	交通 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.48	500,000	2,240,000.00
2020122800001458	601933	永辉 超市	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.18	47,400	340,332.00
2020122800001473	601933	永辉 超市	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.18	43,100	309,458.00
2020122800001519	600352	浙江 龙盛	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	13.62	19,700	268,314.00
2020122800001672	601800	中国 交建	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.26	19,400	140,844.00
2020122800001685	601766	中国 中车	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	5.31	12,600	66,906.00

2020122800001696	603899	晨 光 文具	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	88.56	10,000	885,600.00
2020122800001845	601808	中 海 油服	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.77	10,000	127,700.00
2020122800001857	600487	亨 通 光电	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	13.99	10,000	139,900.00
2020122800001869	601939	建 设 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	6.28	493,200	3,097,296.00
2020122800001944	601216	君 正 集团	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.95	58,000	287,100.00
2020122800004071	600795	国 电 电力	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	2.25	95,400	214,650.00
2020122800004073	601901	方 正 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	10.37	114,000	1,182,180.00
2020122800004075	601377	兴 业 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.68	69,900	606,732.00
2020122800004077	600522	中 天 科技	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	10.84	70,000	758,800.00
2020122800004079	601818	光 大 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	3.99	248,000	989,520.00
2020122800004081	601009	南 京 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.08	124,000	1,001,920.00

2020122800004083	601618	中 国 中冶	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	2.73	383,000	1,045,590.00
2020122800004085	601555	东 吴 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	9.86	28,300	279,038.00
2020122800004087	601800	中 国 交建	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.26	116,100	842,886.00
2020122800004089	603019	中 科 曙光	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	34.23	12,200	417,606.00
2020122800004091	600900	长 江 电力	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	19.16	50,000	958,000.00
2020122800004093	601998	中 信 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	5.11	181,600	927,976.00
2020122800004095	601919	中 远 海控	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.21	81,100	990,231.00
2020122800004097	601766	中 国 中车	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	5.31	93,000	493,830.00
2020122800004099	601800	中 国 交建	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.26	50,200	364,452.00
2020122800004101	600369	西 南 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	5.38	53,200	286,216.00
2020122800004103	002024	苏 宁 易购	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.71	12,300	94,833.00

2020122800004105	600795	国 电 电力	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	2.25	10,800	24,300.00
2020122800004107	600886	国 投 电力	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.64	45,900	396,576.00
2020122800004109	601229	上 海 银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.84	127,000	995,680.00
2020122800004113	000069	华 侨 城 A	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.09	200,000	1,418,000.00
2020122800004169	600340	华 夏 幸福	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.93	10,000	129,300.00
2020122800004171	002236	大 华 股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	19.89	10,000	198,900.00
2020122800004173	601990	南 京 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.27	17,700	217,179.00
2020122800004175	603156	养 元 饮品	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	25.84	10,000	258,400.00
2020122800004177	600655	豫 园 股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.89	10,800	96,012.00
2020122800004283	000858	五 粮 液	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	291.85	115,000	33,562,750.00
2020122800004285	000651	格 力 电器	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	61.94	200,000	12,388,000.00

2020122800004287	601236	红 塔 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	18.59	18,300	340,197.00
2020122800004289	601211	国 泰 君安	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	17.53	56,000	981,680.00
2020122800004291	601198	东 兴 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	13.32	65,000	865,800.00
2020122800004293	601138	工 业 富联	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	13.69	74,000	1,013,060.00
2020122800004295	601088	中 国 神华	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	18.01	54,000	972,540.00
2020122800004297	601696	中 银 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	27.68	18,500	512,080.00
2020122800004299	600018	上 港 集团	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.57	206,000	941,420.00
2020122800004301	600019	宝 钢 股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	5.95	164,000	975,800.00
2020122800004303	600104	上 汽 集团	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	24.44	42,000	1,026,480.00
2020122800004305	600406	国 电 南瑞	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	26.57	45,000	1,195,650.00
2020122800004307	600705	中 航 资本	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.38	69,000	302,220.00

2020122800004309	600309	万 华 化学	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	91.04	12,000	1,092,480.00
2020122800004311	600025	华 能 水电	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.46	67,200	299,712.00
2020122800004313	601377	兴 业 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.68	65,000	564,200.00
2020122800004315	600050	中 国 联通	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	4.46	214,000	954,440.00
2020122800004317	600958	东 方 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	11.63	91,000	1,058,330.00
2020122800004319	600482	中 国 动力	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	17.92	40,000	716,800.00
2020122800004321	600489	中 金 黄金	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.81	41,700	367,377.00
2020122800004323	000728	国 元 证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	8.96	55,900	500,864.00
2020122800004325	000708	中 信 特钢	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	21.79	37,900	825,841.00
2020122800004327	002252	上 海 莱士	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.40	26,700	197,580.00
2020122800004329	002146	荣 盛 发展	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	6.53	103,200	673,896.00

2020122800004331	002601	龙 蟒 佰利	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	30.77	31,000	953,870.00
2020122800004333	600271	航 天 信息	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	12.60	17,100	215,460.00
2020122800004335	600177	雅 戈 尔	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	7.19	61,200	440,028.00
2020122800004337	002050	三 花 智控	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	24.65	45,000	1,109,250.00
2020122800004339	600004	白 云 机场	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	14.13	60,100	849,213.00
2020122800004341	000977	浪 潮 信息	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	26.88	36,000	967,680.00
2020122800004343	000895	双 汇 发展	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	46.94	22,000	1,032,680.00
2020122800004345	002008	大 族 激光	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	42.75	27,000	1,154,250.00
2020122800005395	002120	韵 达 股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	15.70	31,800	499,260.00
2020122800005941	002714	牧 原 股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	77.10	54,000	4,163,400.00
2020122800007129	601600	中 国 铝业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 11 日	3.63	105,000	381,150.00

2020122900000626	688008	澜 起 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	82.88	10,000	828,800.00
2020122900000628	688012	中 微 公司	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	157.59	10,000	1,575,900.00
2020122900000630	688009	中 国 通号	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	5.86	186,200	1,091,132.00
2020122900000691	000001	平 安 银行	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	19.34	56,800	1,098,512.00
2020122900000726	000166	申 万 宏源	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	5.28	10,000	52,800.00
2020122900000729	000333	美 的 集团	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	98.44	356,500	35,093,860.00
2020122900000772	000627	天 茂 集团	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	4.87	69,600	338,952.00
2020122900000773	000627	天 茂 集团	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	4.87	19,500	94,965.00
2020122900000787	000656	金 科 股份	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.09	25,600	181,504.00
2020122900000790	000671	阳 光 城	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	6.52	49,900	325,348.00
2020122900000795	000708	中 信 特钢	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	21.79	10,000	217,900.00

2020122900000804	000723	美 锦 能源	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	6.68	112,800	753,504.00
2020122900000813	000728	国 元 证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	8.96	23,800	213,248.00
2020122900000818	000728	国 元 证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	8.96	70,800	634,368.00
2020122900000851	000860	顺 鑫 农业	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	72.54	10,000	725,400.00
2020122900000876	000977	浪 潮 信息	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	26.88	16,800	451,584.00
2020122900000888	002001	新 和 成	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	33.68	10,300	346,904.00
2020122900000903	002024	苏 宁 易购	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.71	56,900	438,699.00
2020122900000913	002044	美 年 健康	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	11.33	17,600	199,408.00
2020122900000916	002050	三 花 智控	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	24.65	10,000	246,500.00
2020122900000926	002001	新 和 成	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	33.68	12,800	431,104.00
2020122900000941	000961	中 南 建设	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	8.83	27,100	239,293.00

2020122900000964	002120	韵达股份	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	15.70	10,000	157,000.00
2020122900000965	002120	韵达股份	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	15.70	11,200	175,840.00
2020122900001030	002236	大华股份	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	19.89	15,000	298,350.00
2020122900001036	002271	东方雨虹	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	38.80	12,900	500,520.00
2020122900001050	002352	顺丰控股	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	88.23	10,000	882,300.00
2020122900001098	002463	沪电股份	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	18.79	19,500	366,405.00
2020122900001114	002508	老板电器	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	40.78	10,000	407,800.00
2020122900001143	002601	龙蟠佰利	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	30.77	10,000	307,700.00
2020122900001159	002673	西部证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	10.14	89,200	904,488.00
2020122900001172	002739	万达电影	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	18.08	11,200	202,496.00
2020122900001181	002773	康弘药业	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	48.15	10,000	481,500.00

2020122900001228	600998	九州通	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	18.16	10,000	181,600.00
2020122900001329	600369	西南证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	5.38	30,900	166,242.00
2020122900001357	601600	中国铝业	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	3.63	21,400	77,682.00
2020122900001386	601600	中国铝业	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	3.63	104,200	378,246.00
2020122900001404	600118	中国卫星	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	32.18	10,000	321,800.00
2020122900001466	600028	中国石化	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	4.03	32,000	128,960.00
2020122900001515	600741	华域汽车	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	28.82	35,200	1,014,464.00
2020122900001557	600848	上海临港	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	20.02	12,000	240,240.00
2020122900001580	600050	中国联通	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	4.46	124,200	553,932.00
2020122900001635	600299	安迪苏	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	11.51	21,600	248,616.00
2020122900001645	601933	永辉超市	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.18	47,400	340,332.00

2020122900001651	601933	永 辉 超市	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.18	37,000	265,660.00
2020122900001655	600690	海 尔 智家	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	29.21	10,000	292,100.00
2020122900001659	601555	东 吴 证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	9.86	29,900	294,814.00
2020122900001677	601236	红 塔 证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	18.59	23,000	427,570.00
2020122900001678	600061	国 投 资本	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.83	10,000	138,300.00
2020122900001687	600061	国 投 资本	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.83	20,600	284,898.00
2020122900001744	600872	中 炬 高新	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	66.65	10,000	666,500.00
2020122900001785	600918	中 泰 证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	18.50	10,000	185,000.00
2020122900001802	600352	浙 江 龙盛	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.62	19,700	268,314.00
2020122900001810	600352	浙 江 龙盛	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.62	49,200	670,104.00
2020122900001903	601319	中 国 人保	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	6.57	34,100	224,037.00

2020122900001915	600011	华 能 国际	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	4.48	45,700	204,736.00
2020122900002065	600522	中 天 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	10.84	43,100	467,204.00
2020122900002101	601800	中 国 交建	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.26	19,200	139,392.00
2020122900002121	601800	中 国 交建	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.26	10,000	72,600.00
2020122900002244	601766	中 国 中车	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	5.31	12,600	66,906.00
2020122900002255	600271	航 天 信息	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	12.60	14,800	186,480.00
2020122900002281	601816	京 沪 高铁	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	5.66	58,400	330,544.00
2020122900002358	601877	正 泰 电器	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	39.16	11,900	466,004.00
2020122900002371	601360	三 六 零	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	15.71	10,000	157,100.00
2020122900002379	601360	三 六 零	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	15.71	10,000	157,100.00
2020122900002417	600177	雅 戈 尔	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.19	40,800	293,352.00

2020122900002540	600705	中航资本	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	4.38	61,300	268,494.00
2020122900002585	600487	亨通光电	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.99	14,400	201,456.00
2020122900002602	600487	亨通光电	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.99	12,500	174,875.00
2020122900002610	600390	五矿资本	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	6.98	21,600	150,768.00
2020122900002839	600489	中金黄金	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	8.81	40,800	359,448.00
2020122900002856	601111	中国国航	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.49	39,800	298,102.00
2020122900002869	600637	东方明珠	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	8.94	20,400	182,376.00
2020122900002905	601186	中国铁建	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.90	10,000	79,000.00
2020122900002938	601138	工业富联	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	13.69	26,800	366,892.00
2020122900002956	600150	中国船舶	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	17.69	35,200	622,688.00
2020122900002969	600498	烽火通信	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	24.08	33,500	806,680.00

2020122900002978	600208	新 湖 中宝	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	3.10	95,700	296,670.00
2020122900003017	603019	中 科 曙光	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	34.23	10,000	342,300.00
2020122900005685	002001	新 和 成	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	33.68	13,700	461,416.00
2020122900005751	002202	金 风 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	14.25	138,400	1,972,200.00
2020122900006071	600177	雅 戈 尔	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	7.19	75,700	544,283.00
2020122900006073	600655	豫 园 股份	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	8.89	44,700	397,383.00
2020122900006289	000860	顺 鑫 农业	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	72.54	10,000	725,400.00
2020122900006291	000876	新 希 望	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	22.40	10,000	224,000.00
2020122900006293	002157	正 邦 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	17.04	20,000	340,800.00
2020122900006295	600196	复 星 医药	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	53.99	10,000	539,900.00
2020122900006297	601021	春 秋 航空	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	55.43	10,000	554,300.00

2020122900006299	601878	浙 商 证券	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	15.30	10,000	153,000.00
2020122900006301	603369	今 世 缘	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	57.38	10,000	573,800.00
2020122900006303	603799	华 友 钴业	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 12 日	79.30	10,000	793,000.00
2020123000001099	000001	平 安 银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	19.34	17,900	346,186.00
2020123000001273	000166	申 万 宏源	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	5.28	329,600	1,740,288.00
2020123000001454	000625	长 安 汽车	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	21.88	80,000	1,750,400.00
2020123000001518	000708	中 信 特钢	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	21.79	16,800	366,072.00
2020123000001729	000895	双 汇 发展	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	46.94	21,000	985,740.00
2020123000002363	002352	顺 丰 控股	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	88.23	73,100	6,449,613.00
2020123000002610	002508	老 板 电器	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	40.78	10,000	407,800.00
2020123000002711	002607	中 公 教育	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	35.13	29,200	1,025,796.00

2020123000002801	002736	国 信 证券	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	13.64	189,000	2,577,960.00
2020123000002826	002812	恩 捷 股份	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	141.78	15,000	2,126,700.00
2020123000003110	601398	工 商 银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	4.99	500,000	2,495,000.00
2020123000003127	601398	工 商 银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	4.99	1,000,000	4,990,000.00
2020123000003168	601888	中 国 中免	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	282.45	10,000	2,824,500.00
2020123000003185	600104	上 汽 集团	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	24.44	80,400	1,964,976.00
2020123000003370	600487	亨 通 光电	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	13.99	24,100	337,159.00
2020123000003396	600837	海 通 证券	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	12.86	207,500	2,668,450.00
2020123000003490	601186	中 国 铁建	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	7.90	80,000	632,000.00
2020123000003552	600547	山 东 黄金	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	23.62	24,700	583,414.00
2020123000003585	600498	烽 火 通信	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	24.08	17,500	421,400.00

2020123000003596	601319	中 国 人保	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	6.57	43,200	283,824.00
2020123000006339	600177	雅 戈 尔	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	7.19	10,700	76,933.00
2020123000006341	601211	国 泰 君安	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	17.53	67,700	1,186,781.00
2020123000006343	603259	药 明 康德	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	134.72	13,000	1,751,360.00
2020123000006351	002460	赣 锋 锂业	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	101.20	17,000	1,720,400.00
2020123000006799	600176	中 国 巨石	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	19.96	50,000	998,000.00
2020123000006801	002236	大 华 股份	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	19.89	10,000	198,900.00
2020123000006803	600340	华 夏 幸福	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	12.93	10,000	129,300.00
2020123000006805	600655	豫 园 股份	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	8.89	36,500	324,485.00
2020123000006959	601318	中 国 平安	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	86.98	143,200	12,455,536.00
2020123100000333	000069	华 侨 城 A	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	7.09	10,000	70,900.00

2020123100000371	000100	TCL 科技	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	7.08	110,000	778,800.00
2020123100000415	002001	新 和 成	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	33.68	10,000	336,800.00
2020123100000469	002271	东 方 雨虹	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	38.80	79,600	3,088,480.00
2020123100000523	002673	西 部 证券	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	10.14	28,300	286,962.00
2020123100000536	002493	荣 盛 石化	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	27.61	146,400	4,042,104.00
2020123100000562	600998	九 州 通	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	18.16	10,000	181,600.00
2020123100000595	601901	方 正 证券	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	10.37	100,000	1,037,000.00
2020123100000609	600061	国 投 资本	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	13.83	10,000	138,300.00
2020123100000632	600918	中 泰 证券	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	18.50	25,000	462,500.00
2020123100000693	600309	万 华 化学	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	91.04	20,600	1,875,424.00
2020123100000854	600703	三 安 光电	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	27.01	19,800	534,798.00

2020123100000865	600010	包 钢 股份	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	1.17	400,000	468,000.00
2020123100000895	600010	包 钢 股份	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	1.17	700,300	819,351.00
2020123100000902	601901	方 正 证券	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	10.37	83,600	866,932.00
2020123100003896	000768	中 航 西飞	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	36.68	17,500	641,900.00
2020123100003898	002153	石 基 信息	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	31.09	10,000	310,900.00
2020123100003900	601318	中 国 平安	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	86.98	186,800	16,247,864.00
2020123100003902	600009	上 海 机场	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 14 日	75.66	10,000	756,600.00
合计						31,864,700	609,531,576.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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行招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；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。

7.4.13.2.1 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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。

7.4.13.2.2 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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。

7.4.13.2.3 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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。

7.4.13.2.4 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	4,605,000.00	0.00
AAA 以下	416,000.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	5,021,000.00	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。

7.4.13.2.5 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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。

7.4.13.2.6 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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。

7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 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该比例限制)。

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 7.4.12。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 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	28,544,831.79	-	-	-	28,544,831.79
结算备付金	127,635,925.45	-	-	-	127,635,925.45
存出保证金	854,871.46	-	-	20,261,404.80	21,116,276.26
交易性金融资产	-	-5,021,000.00	7,061,577,647.45	7,066,598,647.45	
应收证券清算款	-	-	-	2,841,675.76	2,841,675.76
应收利息	-	-	-	307,940.37	307,940.37
应收股利	-	-	-	110.00	110.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	157,035,628.70	-5,021,000.00	7,084,988,778.38	7,247,045,407.08	
负债					
应付证券清算款	-	-	-	750,831.58	750,831.58
应付管理人报酬	-	-	-	2,646,319.97	2,646,319.97
应付托管费	-	-	-	330,790.01	330,790.01
应付交易费用	-	-	-	774,964.12	774,964.12
应交税费	-	-	-	386,033.78	386,033.78
其他负债	-	-	-	5,225,113.73	5,225,113.73
负债总计	-	-	-	10,114,053.19	10,114,053.19

利率敏感度缺口	157,035,628.70	-	5,021,000.00	7,074,874,725.19	7,236,931,353.89
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,970,000.90	-	-	-	10,970,000.90
交易性金融资产	-	-	-	152,824,405.00	152,824,405.00
买入返售金融资产	7,000,000,000.00	-	-	-	7,000,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,264,995.43	1,264,995.43
其他资产	-	-	-	2,105.41	2,105.41
资产总计	7,010,970,000.90	-	-	154,091,505.84	7,165,061,506.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	313,865.06	313,865.06
应付托管费	-	-	-	39,233.13	39,233.13
其他负债	-	-	-	23,539.88	23,539.88
负债总计	-	-	-	376,638.07	376,638.07
利率敏感度缺口	7,010,970,000.90	-	-	153,714,867.77	7,164,684,868.67

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。

7.4.13.4.1.2 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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下调 0.25%	72,895.23	0.00
	市场利率上调 0.25%	-71,667.83	0.00

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上

精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	7,061,577,647.45	97.58	152,824,405.00	2.13
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	7,061,577,647.45	97.58	152,824,405.00	2.13

7.4.13.4.3.2 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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	363,941,706.70	—
	业绩比较基准中的权益指数下降 5%	-363,941,706.70	—

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金成立未滿一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 6,905,742,190.99 元，属于第二层次的余额为 160,856,456.46 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 150,173,458.00 元，第二层次 2,650,947.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 4,255,392,728.24 元(2019 年 12 月 27 日

至 2019 年 12 月 31 日止期间：0.00 元)，其中包括以股票支付的申购款 2,586,259,483.17 元和以现金支付的申购款 1,669,133,245.07 元(2019 年 12 月 27 日至 2019 年 12 月 31 日止期间：其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 0.00 元)。

(3)除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	7,061,577,647.45	97.44
	其中：股票	7,061,577,647.45	97.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,021,000.00	0.07
	其中：债券	5,021,000.00	0.07
	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	156,180,757.24	2.16
8	其他各项资产	24,266,002.39	0.33
9	合计	7,247,045,407.08	100.00

注：（1）本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 609,531,576.00 元，占期末资产净值比例为 8.42%

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	81,236,724.95	1.12
B	采矿业	155,041,654.64	2.14
C	制造业	3,699,859,779.08	51.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	117,934,933.26	1.63
E	建筑业	108,630,450.94	1.50
F	批发和零售业	50,557,540.24	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	186,287,156.13	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	218,913,361.70	3.02

J	金融业	1,872,266,454.79	25.87
K	房地产业	205,304,680.09	2.84
L	租赁和商务服务业	135,925,868.40	1.88
M	科学研究和技术服务业	70,943,887.04	0.98
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	8,550,642.00	0.12
Q	卫生和社会工作	108,410,542.57	1.50
R	文化、体育和娱乐业	34,328,518.74	0.47
S	综合	—	—
	合计	7,054,192,194.57	97.47

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	3,030,331.38	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,431,198.88	0.02
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,057,358.92	0.01
J	金融业	1,714,383.21	0.02
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
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	48,261.27	0.00
S	综合	—	—
	合计	7,385,452.88	0.10

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

8.3 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

8.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	181,207	362,051,586.00	5.00
2	601318	中国平安	3,900,688	339,281,842.24	4.69
3	000858	五粮液	698,242	203,781,927.70	2.82
4	600036	招商银行	4,456,845	195,878,337.75	2.71
5	000333	美的集团	1,769,395	174,179,243.80	2.41
6	600276	恒瑞医药	1,343,506	149,747,178.76	2.07
7	601166	兴业银行	5,235,583	109,266,617.21	1.51
8	000651	格力电器	1,732,233	107,294,512.02	1.48
9	601888	中国中免	351,952	99,408,842.40	1.37
10	600887	伊利股份	2,190,171	97,177,887.27	1.34
11	600030	中信证券	3,065,600	90,128,640.00	1.25
12	002475	立讯精密	1,509,195	84,696,023.40	1.17
13	601012	隆基股份	950,919	82,480,531.80	1.14
14	300059	东方财富	2,480,072	76,882,232.00	1.06
15	600031	三一重工	2,137,272	74,761,774.56	1.03
16	000002	万科A	2,450,500	70,329,350.00	0.97
17	603288	海天味业	350,632	70,315,741.28	0.97
18	000001	平安银行	3,491,000	67,515,940.00	0.93
19	002415	海康威视	1,346,327	65,310,322.77	0.90
20	002594	比亚迪	326,742	63,485,970.60	0.88
21	601398	工商银行	12,620,900	62,978,291.00	0.87
22	600900	长江电力	3,275,557	62,759,672.12	0.87
23	603259	药明康德	461,457	62,167,487.04	0.86
24	000568	泸州老窖	263,472	59,586,827.52	0.82
25	000725	京东方A	9,755,700	58,534,200.00	0.81
26	002352	顺丰控股	657,177	57,982,726.71	0.80
27	002714	牧原股份	674,152	51,977,119.20	0.72
28	600309	万华化学	565,143	51,450,618.72	0.71
29	002304	洋河股份	217,700	51,375,023.00	0.71

30	601601	中国太保	1,232,900	47,343,360.00	0.65
31	600809	山西汾酒	125,229	46,997,191.41	0.65
32	601899	紫金矿业	4,950,200	45,987,358.00	0.64
33	000661	长春高新	106,200	45,290,042.00	0.63
34	600585	海螺水泥	864,000	44,599,680.00	0.62
35	300015	爱尔眼科	593,513	44,448,188.57	0.61
36	601328	交通银行	9,885,500	44,287,040.00	0.61
37	600048	保利地产	2,584,983	40,894,431.06	0.57
38	600000	浦发银行	4,223,272	40,881,272.96	0.56
39	600016	民生银行	7,660,700	39,835,640.00	0.55
40	600690	海尔智家	1,362,020	39,784,604.20	0.55
41	002142	宁波银行	1,081,408	38,216,958.72	0.53
42	601688	华泰证券	2,115,500	38,100,155.00	0.53
43	601668	中国建筑	7,556,300	37,554,811.00	0.52
44	600438	通威股份	971,200	37,332,928.00	0.52
45	002027	分众传媒	3,699,800	36,517,026.00	0.50
46	000100	TCL 科技	5,055,000	35,789,400.00	0.49
47	600837	海通证券	2,779,900	35,749,514.00	0.49
48	603501	韦尔股份	155,581	35,330,769.10	0.49
49	300124	汇川技术	370,730	34,589,109.00	0.48
50	300122	智飞生物	229,700	33,974,927.00	0.47
51	300014	亿纬锂能	407,784	33,234,396.00	0.46
52	000063	中兴通讯	971,500	32,690,975.00	0.45
53	601288	农业银行	10,337,900	32,461,006.00	0.45
54	600570	恒生电子	300,481	31,520,456.90	0.44
55	600999	招商证券	1,336,680	31,198,111.20	0.43
56	600104	上汽集团	1,260,500	30,806,620.00	0.43
57	300347	泰格医药	189,300	30,592,773.00	0.42
58	002241	歌尔股份	816,279	30,463,532.28	0.42
59	300498	温氏股份	1,605,025	29,259,605.75	0.40
60	600436	片仔癀	108,400	28,998,084.00	0.40
61	601211	国泰君安	1,624,000	28,468,720.00	0.39
62	601229	上海银行	3,582,834	28,089,418.56	0.39
63	002460	赣锋锂业	274,999	27,829,898.80	0.38
64	000338	潍柴动力	1,726,300	27,258,277.00	0.38
65	002410	广联达	341,653	26,901,757.22	0.37
66	600009	上海机场	347,045	26,257,424.70	0.36
67	002230	科大讯飞	633,900	25,907,493.00	0.36
68	601169	北京银行	5,334,700	25,819,948.00	0.36

69	600588	用友网络	587,928	25,467,891.36	0.35
70	600660	福耀玻璃	504,745	24,252,997.25	0.34
71	601988	中国银行	7,577,600	24,096,768.00	0.33
72	600919	江苏银行	4,311,200	23,539,152.00	0.33
73	600196	复星医药	434,100	23,437,059.00	0.32
74	603986	兆易创新	118,544	23,412,440.00	0.32
75	601766	中国中车	4,372,530	23,218,134.30	0.32
76	601628	中国人寿	600,100	23,037,839.00	0.32
77	002271	东方雨虹	593,064	23,010,883.20	0.32
78	601818	光大银行	5,739,300	22,899,807.00	0.32
79	600893	航发动力	382,800	22,719,180.00	0.31
80	002812	恩捷股份	157,800	22,372,884.00	0.31
81	600763	通策医疗	80,150	22,163,078.00	0.31
82	600406	国电南瑞	832,400	22,116,868.00	0.31
83	600703	三安光电	806,800	21,791,668.00	0.30
84	300601	康泰生物	122,875	21,441,687.50	0.30
85	300142	沃森生物	555,776	21,430,722.56	0.30
86	601088	中国神华	1,187,600	21,388,676.00	0.30
87	600346	恒力石化	760,600	21,273,982.00	0.29
88	601919	中远海控	1,739,640	21,241,004.40	0.29
89	002049	紫光国微	152,800	20,446,168.00	0.28
90	000538	云南白药	184,265	20,368,504.00	0.28
91	002493	荣盛石化	729,453	20,140,197.33	0.28
92	603799	华友钴业	246,264	19,528,735.20	0.27
93	600028	中国石化	4,815,420	19,406,142.60	0.27
94	601390	中国中铁	3,661,700	19,297,159.00	0.27
95	600019	宝钢股份	3,207,600	19,085,220.00	0.26
96	002311	海大集团	288,347	18,886,728.50	0.26
97	300413	芒果超媒	255,611	18,531,797.50	0.26
98	000768	中航西飞	499,486	18,321,146.48	0.25
99	000876	新希望	811,808	18,184,499.20	0.25
100	600745	闻泰科技	179,688	17,789,112.00	0.25
101	000625	长安汽车	802,964	17,568,852.32	0.24
102	000895	双汇发展	374,200	17,564,948.00	0.24
103	600958	东方证券	1,502,600	17,475,238.00	0.24
104	601009	南京银行	2,160,323	17,455,409.84	0.24
105	601336	新华保险	300,100	17,396,797.00	0.24
106	000776	广发证券	1,064,200	17,325,176.00	0.24
107	600584	长电科技	403,678	17,184,572.46	0.24

108	000166	申万宏源	3,242,200	17,118,816.00	0.24
109	601377	兴业证券	1,930,000	16,752,400.00	0.23
110	002129	中环股份	656,700	16,745,850.00	0.23
111	002007	华兰生物	393,087	16,603,994.88	0.23
112	601633	长城汽车	437,300	16,534,313.00	0.23
113	600741	华域汽车	566,770	16,334,311.40	0.23
114	000157	中联重科	1,647,300	16,308,270.00	0.23
115	002371	北方华创	88,500	15,995,490.00	0.22
116	002050	三花智控	647,810	15,968,516.50	0.22
117	601100	恒立液压	141,088	15,942,944.00	0.22
118	603993	洛阳钼业	2,549,400	15,933,750.00	0.22
119	600926	杭州银行	1,066,600	15,913,672.00	0.22
120	002821	凯莱英	53,000	15,854,420.00	0.22
121	002001	新 和 成	464,500	15,644,360.00	0.22
122	002179	中航光电	198,500	15,540,565.00	0.21
123	600547	山东黄金	656,192	15,499,255.04	0.21
124	601901	方正证券	1,479,200	15,339,304.00	0.21
125	601939	建设银行	2,420,100	15,198,228.00	0.21
126	001979	招商蛇口	1,138,840	15,135,183.60	0.21
127	601877	正泰电器	385,600	15,100,096.00	0.21
128	600176	中国巨石	755,383	15,077,444.68	0.21
129	600050	中国联通	3,354,800	14,962,408.00	0.21
130	000786	北新建材	365,960	14,656,698.00	0.20
131	300408	三环集团	391,133	14,569,704.25	0.20
132	601857	中国石油	3,497,300	14,513,795.00	0.20
133	300433	蓝思科技	473,886	14,505,650.46	0.20
134	601066	中信建投	344,500	14,469,000.00	0.20
135	002555	三七互娱	456,800	14,265,864.00	0.20
136	002202	金风科技	995,264	14,182,512.00	0.20
137	600109	国金证券	871,300	14,176,051.00	0.20
138	002736	国信证券	1,035,856	14,129,075.84	0.20
139	002841	视源股份	120,300	13,838,109.00	0.19
140	601006	大秦铁路	2,141,201	13,832,158.46	0.19
141	600015	华夏银行	2,213,100	13,831,875.00	0.19
142	601989	中国重工	3,288,304	13,777,993.76	0.19
143	000860	顺鑫农业	187,700	13,615,758.00	0.19
144	688008	澜起科技	164,100	13,600,608.00	0.19
145	002601	龙蟠佰利	439,200	13,514,184.00	0.19
146	601225	陕西煤业	1,438,400	13,434,656.00	0.19

147	600872	中炬高新	201,100	13,403,315.00	0.19
148	002008	大族激光	306,642	13,108,945.50	0.18
149	601186	中国铁建	1,657,100	13,091,090.00	0.18
150	603369	今世缘	224,818	12,900,056.84	0.18
151	002236	大华股份	648,259	12,893,871.51	0.18
152	601788	光大证券	701,300	12,808,076.00	0.18
153	600352	浙江龙盛	935,100	12,736,062.00	0.18
154	603160	汇顶科技	81,595	12,692,102.25	0.18
155	600600	青岛啤酒	127,092	12,632,944.80	0.17
156	603019	中科曙光	365,440	12,509,011.20	0.17
157	002938	鹏鼎控股	249,889	12,411,986.63	0.17
158	002624	完美世界	418,850	12,356,075.00	0.17
159	300003	乐普医疗	453,600	12,328,848.00	0.17
160	688012	中微公司	77,700	12,244,743.00	0.17
161	002600	领益智造	1,011,500	12,127,885.00	0.17
162	000066	中国长城	631,800	11,997,882.00	0.17
163	003816	中国广核	4,247,001	11,976,542.82	0.17
164	603899	晨光文具	133,242	11,799,911.52	0.16
165	600760	中航沈飞	150,900	11,797,362.00	0.16
166	000783	长江证券	1,390,300	11,678,520.00	0.16
167	600183	生益科技	411,600	11,590,656.00	0.16
168	601360	三六零	732,700	11,474,717.00	0.16
169	601108	财通证券	905,000	11,448,250.00	0.16
170	000596	古井贡酒	41,800	11,369,600.00	0.16
171	601155	新城控股	325,001	11,319,784.83	0.16
172	002044	美年健康	989,100	11,206,503.00	0.15
173	002384	东山精密	430,200	11,185,200.00	0.15
174	601555	东吴证券	1,120,340	11,046,552.40	0.15
175	601985	中国核电	2,237,800	11,009,976.00	0.15
176	600383	金地集团	811,816	10,959,516.00	0.15
177	601669	中国电建	2,748,233	10,663,144.04	0.15
178	000938	紫光股份	516,719	10,566,903.55	0.15
179	000069	华侨城A	1,473,500	10,447,115.00	0.14
180	002024	苏宁易购	1,337,800	10,314,438.00	0.14
181	002456	欧菲光	778,700	10,263,266.00	0.14
182	600111	北方稀土	784,000	10,262,560.00	0.14
183	300144	宋城演艺	562,717	9,971,345.24	0.14
184	300136	信维通信	276,986	9,938,257.68	0.14
185	601878	浙商证券	649,000	9,929,700.00	0.14

186	601933	永辉超市	1,374,828	9,871,265.04	0.14
187	000977	浪潮信息	365,828	9,833,456.64	0.14
188	601138	工业富联	713,500	9,767,815.00	0.13
189	300529	健帆生物	143,900	9,759,298.00	0.13
190	600010	宝钢股份	8,212,200	9,608,274.00	0.13
191	600522	中天科技	884,700	9,590,148.00	0.13
192	600795	国电电力	4,258,400	9,581,400.00	0.13
193	002414	高德红外	228,844	9,554,237.00	0.13
194	002602	世纪华通	1,337,900	9,512,469.00	0.13
195	300033	同花顺	76,415	9,473,931.70	0.13
196	600029	南方航空	1,589,000	9,470,440.00	0.13
197	600161	天坛生物	224,700	9,369,990.00	0.13
198	601800	中国交建	1,266,315	9,193,446.90	0.13
199	000425	徐工机械	1,686,800	9,058,116.00	0.13
200	688036	传音控股	58,300	8,869,762.00	0.12
201	300676	华大基因	72,500	8,776,400.00	0.12
202	603833	欧派家居	65,080	8,753,260.00	0.12
203	600886	国投电力	1,001,388	8,651,992.32	0.12
204	601600	中国铝业	2,361,400	8,571,882.00	0.12
205	002607	中公教育	243,400	8,550,642.00	0.12
206	000703	恒逸石化	664,840	8,509,952.00	0.12
207	600705	中航资本	1,927,600	8,442,888.00	0.12
208	000728	国元证券	940,480	8,426,700.80	0.12
209	600061	国投资本	608,061	8,409,483.63	0.12
210	000963	华东医药	315,400	8,377,024.00	0.12
211	601838	成都银行	783,000	8,354,610.00	0.12
212	002463	沪电股份	436,200	8,196,198.00	0.11
213	000656	金科股份	1,153,600	8,179,024.00	0.11
214	600066	宇通客车	479,600	8,114,832.00	0.11
215	601111	中国国航	1,078,314	8,076,571.86	0.11
216	000708	中信特钢	365,200	7,957,708.00	0.11
217	601607	上海医药	414,058	7,949,913.60	0.11
218	002157	正邦科技	452,600	7,712,304.00	0.11
219	600606	绿地控股	1,319,200	7,690,936.00	0.11
220	002916	深南电路	70,927	7,664,371.62	0.11
221	600115	东方航空	1,612,000	7,544,160.00	0.10
222	600362	江西铜业	371,500	7,411,425.00	0.10
223	601162	天风证券	1,201,200	7,327,320.00	0.10
224	601021	春秋航空	132,100	7,322,303.00	0.10

225	600340	华夏幸福	563,820	7,290,192.60	0.10
226	002252	上海莱士	971,700	7,190,580.00	0.10
227	600177	雅戈尔	998,100	7,176,339.00	0.10
228	600487	亨通光电	512,120	7,164,558.80	0.10
229	603658	安图生物	49,000	7,113,820.00	0.10
230	300628	亿联网络	97,089	7,099,147.68	0.10
231	600011	华能国际	1,584,500	7,098,560.00	0.10
232	601727	上海电气	1,310,690	7,077,726.00	0.10
233	002422	科伦药业	362,700	7,050,888.00	0.10
234	601618	中国中冶	2,567,300	7,008,729.00	0.10
235	601816	京沪高铁	1,237,000	7,001,420.00	0.10
236	002508	老板电器	170,700	6,961,146.00	0.10
237	600118	中国卫星	213,700	6,876,866.00	0.10
238	601198	东兴证券	498,900	6,645,348.00	0.09
239	600637	东方明珠	737,359	6,591,989.46	0.09
240	600068	葛洲坝	999,400	6,576,052.00	0.09
241	002120	韵达股份	415,760	6,527,432.00	0.09
242	601990	南京证券	528,300	6,482,241.00	0.09
243	600369	西南证券	1,191,300	6,409,194.00	0.09
244	002773	康弘药业	133,096	6,408,572.40	0.09
245	002673	西部证券	628,100	6,368,934.00	0.09
246	600845	宝信软件	91,800	6,332,364.00	0.09
247	600489	中金黄金	698,400	6,152,904.00	0.09
248	600498	烽火通信	252,300	6,075,384.00	0.08
249	601216	君正集团	1,220,100	6,039,495.00	0.08
250	000961	中南建设	681,000	6,013,230.00	0.08
251	600004	白云机场	423,900	5,989,707.00	0.08
252	600332	白云山	202,200	5,914,350.00	0.08
253	002739	万达电影	322,200	5,825,376.00	0.08
254	601881	中国银河	464,204	5,807,192.04	0.08
255	601658	邮储银行	1,213,900	5,802,442.00	0.08
256	600018	上港集团	1,248,400	5,705,188.00	0.08
257	601998	中信银行	1,110,700	5,675,677.00	0.08
258	600390	五矿资本	809,200	5,648,216.00	0.08
259	688009	中国通号	935,700	5,483,202.00	0.08
260	601117	中国化学	893,700	5,246,019.00	0.07
261	600233	圆通速递	454,800	5,230,200.00	0.07
262	600918	中泰证券	274,513	5,078,490.50	0.07
263	002958	青农商行	993,760	5,058,238.40	0.07

264	600271	航天信息	400,304	5,043,830.40	0.07
265	601319	中国人保	766,400	5,035,248.00	0.07
266	002558	巨人网络	292,600	5,016,018.00	0.07
267	600655	豫园股份	559,800	4,976,622.00	0.07
268	000723	美锦能源	738,500	4,933,180.00	0.07
269	600998	九州通	270,460	4,911,553.60	0.07
270	601916	浙商银行	1,198,100	4,888,248.00	0.07
271	601236	红塔证券	260,500	4,842,695.00	0.07
272	600208	新湖中宝	1,536,600	4,763,460.00	0.07
273	603156	养元饮品	183,720	4,747,324.80	0.07
274	600085	同仁堂	196,800	4,703,520.00	0.06
275	002032	苏泊尔	59,600	4,648,204.00	0.06
276	601231	环旭电子	238,156	4,605,937.04	0.06
277	601238	广汽集团	336,600	4,473,414.00	0.06
278	603195	公牛集团	21,700	4,454,793.00	0.06
279	600848	上海临港	214,700	4,298,294.00	0.06
280	002939	长城证券	333,900	4,297,293.00	0.06
281	600150	中国船舶	239,300	4,233,217.00	0.06
282	600297	广汇汽车	1,453,400	4,156,724.00	0.06
283	600482	中国动力	231,100	4,141,312.00	0.06
284	002146	荣盛发展	629,100	4,108,023.00	0.06
285	601872	招商轮船	726,800	4,106,420.00	0.06
286	600027	华电国际	1,163,400	3,955,560.00	0.05
287	000671	阳光城	594,500	3,876,140.00	0.05
288	002153	石基信息	115,764	3,599,102.76	0.05
289	000627	天茂集团	716,200	3,487,894.00	0.05
290	601577	长沙银行	365,500	3,479,560.00	0.05
291	603392	万泰生物	17,200	3,466,316.00	0.05
292	601696	中银证券	110,100	3,047,568.00	0.04
293	600989	宝丰能源	268,300	3,011,010.00	0.04
294	603087	甘李药业	22,500	2,974,950.00	0.04
295	600025	华能水电	650,500	2,901,230.00	0.04
296	601698	中国卫通	159,200	2,887,888.00	0.04
297	601077	渝农商行	637,000	2,866,500.00	0.04
298	601808	中海油服	213,400	2,725,118.00	0.04
299	002945	华林证券	97,000	1,461,790.00	0.02
300	600299	安迪苏	102,900	1,184,379.00	0.02

8.3.2 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	占基金资产净值比例（%）
1	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.02
2	002468	申通快递	140,000	1,411,200.00	0.02
3	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.01
4	688017	绿的谐波	4,138	570,257.78	0.01
5	688568	中科星图	11,020	483,778.00	0.01
6	688508	芯朋微	3,729	342,732.39	0.00
7	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
8	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.00
9	688229	博睿数据	1,643	166,353.75	0.00
10	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
11	688686	奥普特	507	109,917.60	0.00
12	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
13	300894	火星人	1,579	69,816.16	0.00
14	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
15	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
16	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
17	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
18	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
19	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
20	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
21	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
22	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
23	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
24	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
25	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
26	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
27	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
28	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
29	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
30	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
31	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
32	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
33	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
34	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00

35	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
36	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
37	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
38	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
39	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
40	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
41	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
42	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
43	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
44	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
45	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
46	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
47	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
48	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
49	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
50	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
51	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
52	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	490,576,655.79	6.85
2	600519	贵州茅台	301,787,229.20	4.21
3	000651	格力电器	244,759,829.85	3.42
4	000333	美的集团	240,599,325.23	3.36
5	000858	五粮液	240,012,307.22	3.35
6	600036	招商银行	239,178,346.83	3.34
7	601166	兴业银行	160,565,044.72	2.24
8	600276	恒瑞医药	149,246,002.38	2.08
9	002475	立讯精密	127,926,364.85	1.79
10	000001	平安银行	122,799,006.53	1.71
11	000661	长春高新	122,163,500.03	1.71
12	600030	中信证券	113,274,740.87	1.58

13	002352	顺丰控股	111,764,710.46	1.56
14	002415	海康威视	107,150,113.93	1.50
15	600887	伊利股份	106,700,270.14	1.49
16	601398	工商银行	100,279,419.70	1.40
17	000725	京东方 A	99,376,294.14	1.39
18	300498	温氏股份	97,354,051.53	1.36
19	000063	中兴通讯	94,801,769.36	1.32
20	300059	东方财富	89,716,659.65	1.25

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

（2）“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.2 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	000858	五 粮 液	188,399,778.32	2.63
2	000333	美的集团	158,621,265.47	2.21
3	000651	格力电器	125,728,585.01	1.75
4	000661	长春高新	103,432,534.61	1.44
5	002475	立讯精密	92,701,703.93	1.29
6	002352	顺丰控股	84,346,489.09	1.18
7	000002	万 科 A	79,505,698.16	1.11
8	600519	贵州茅台	72,250,457.84	1.01
9	300059	东方财富	69,695,409.87	0.97
10	000001	平安银行	68,449,831.94	0.96
11	002415	海康威视	65,261,691.83	0.91
12	601012	隆基股份	58,464,355.74	0.82
13	000063	中兴通讯	56,695,213.60	0.79
14	000725	京东方 A	54,600,128.00	0.76
15	300015	爱尔眼科	52,035,405.25	0.73
16	002714	牧原股份	51,528,306.97	0.72
17	601318	中国平安	49,959,075.41	0.70
18	000568	泸州老窖	49,117,527.90	0.69
19	000876	新 希 望	48,246,522.20	0.67
20	002304	洋河股份	47,023,811.48	0.66

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

(2) “卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.3 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	10,449,262,541.67
卖出股票收入（成交）总额	4,172,378,391.17

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,021,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,021,000.00	0.07

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	46,050	4,605,000.00	0.06
2	113616	韦尔转债	4,160	416,000.00	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2102	沪深 300 期货 2102 合约	30	46,893,600.00	1,491,660.00	-
IF2103	沪深 300 期货 2103 合约	78	121,951,440.00	6,925,623.00	-
公允价值变动总额合计(元)					8,417,283.00
股指期货投资本期收益(元)					42,492,113.59
股指期货投资本期公允价值变动(元)					8,417,283.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	21,116,276.26

2	应收证券清算款	2,841,675.76
3	应收股利	110.00
4	应收利息	307,940.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,266,002.39

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	59,929,220.00	0.83	转融通证券出借
2	000858	五 粮 液	43,894,240.00	0.61	转融通证券出借
3	000333	美的集团	35,093,860.00	0.48	转融通证券出借
4	000651	格力电器	23,140,784.00	0.32	转融通证券出借
5	600519	贵州茅台	21,778,200.00	0.30	转融通证券出借
6	601888	中国中免	5,649,000.00	0.08	转融通证券出借
7	600276	恒瑞医药	3,566,720.00	0.05	转融通证券出借

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601995	中金公司	1,714,383.21	0.02	新股锁定期流通受限
2	300999	金龙鱼	1,069,545.06	0.01	新股锁定期流通受限
3	688017	绿的谐波	570,257.78	0.01	新股锁定期流通受限
4	688568	中科星图	483,778.00	0.01	新股锁定期流通受限

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,122	641,328.85	1,357,158,156.00	99.73%	3,741,658.00	0.27%

9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
招商银行股份有限公司－泰康沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	18,618,486.00	1.37%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“招商银行股份有限公司－泰康沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”持有的份额。

9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险有限责任公司－个人分红产品	808,033,466.00	59.37%
2	泰康人寿保险有限责任公司－传统保险产品	305,254,747.00	22.43%
3	泰康人寿保险有限责任公司－分红型保险产品	92,066,769.00	6.77%
4	广发证券股份有限公司	45,304,636.00	3.33%
5	国泰君安证券股份有限公司	19,788,800.00	1.45%
6	中信证券股份有限公司	12,401,107.00	0.91%
7	海通证券股份有限公司	9,858,000.00	0.72%
8	华泰证券股份有限公司	8,511,200.00	0.63%
9	友邦人寿保险有限公司－传统	5,674,000.00	0.42%
10	中信建投证券股份有限公司	5,210,442.00	0.38%
11	招商银行股份有限公司－泰康沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	18,618,486.00	1.37%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.5 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 12 月 27 日）基金份额总额	7,160,604,619.00
本报告期期初基金份额总额	7,160,604,619.00
本报告期基金总申购份额	963,900,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	1,347,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-5,416,304,805.00
本报告期期末基金份额总额	1,360,899,814.00

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

11.2 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

本报告期本基金管理人未出现重大人事变动。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资范围增加存托凭证，并相应增加存托凭证投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 110,000.00 元；截至 2020 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 2 年。

11.6 管理人、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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	4,233,474,272.36	29.15%	1,146,051.51	29.15%	—
中信建投	4	3,941,748,316.31	27.15%	1,060,622.45	26.97%	—
广发证券	2	2,528,997,844.40	17.42%	676,435.83	17.20%	—
方正证券	2	2,210,074,053.54	15.22%	606,944.54	15.44%	—
申万宏源	4	1,052,117,111.80	7.25%	288,595.92	7.34%	—
中信证券	2	297,545,829.45	2.05%	81,252.41	2.07%	—

中金公司	2	181,232,450.00	1.25%	52,434.81	1.33%	—
国信证券	2	75,741,123.65	0.52%	19,791.30	0.50%	—
华创证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
安信证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	4	—	—	—	—	—

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- （1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- （2）财务状况和经营状况良好；
- （3）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- （4）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- （5）能及时提供准确的信息资讯服务；
- （6）满足基金运作的保密要求；
- （7）符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金新增租用 6 个交易单元，为海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证

券交易所交易单元各 1 个，中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，华泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个为上年度新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	115,265,167.98	76.33%	3,309,000,000.00	23.69%	—	—
中信建投	6,961,120.23	4.61%	2,489,500,000.00	17.82%	—	—
广发证券	—	—	65,000,000.00	0.47%	—	—
方正证券	24,100,022.48	15.96%	8,105,000,000.00	58.02%	—	—
申万宏源	3,516,990.74	2.33%	—	—	—	—
中信证券	1,164,785.60	0.77%	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—

11.8 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.	泰康资产管理有限责任公司关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证	《上海证券报》；中国证监会基金电子	2020 年 3 月 12 日

	券投资基金可投资科创板股票的公告	披露网站及基金管理人网站	
2.	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 18 日
3.	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购;赎回业务公告	《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	2020 年 3 月 18 日
4.	泰康资产管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 24 日
5.	关于直销电子交易平台开展汇款交易;赎回转认购业务费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 7 月 17 日
6.	泰康资产管理有限责任公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 7 月 22 日
7.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 7 月 30 日
8.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 8 月 7 日
9.	关于提请投资者及时补充;更新身份信息资料并上传有效身份证件照片的公告	《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 8 月 18 日

10.	关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告	《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	2020 年 10 月 28 日
11.	泰康资产管理有限责任公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 11 月 4 日
12.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 11 月 19 日
13.	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在腾安基金销售（深圳）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并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 9 日
14.	关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增销售机构的公告	《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	2020 年 12 月 21 日
15.	泰康资产管理有限责任公司关于终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 23 日
16.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 29 日
17.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金	2020 年 12 月 29 日

		管理人网站	
18.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增西部证券股份有限公司为销售机构的公告	《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	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200101-20201231	4,301,290,000.00	-	3,493,256,534.00	808,033,466.00	59.37%
	2	20200101-20201231	1,700,510,000.00	-	1,395,255,253.00	305,254,747.00	22.43%
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。

注：1:报告期期间基金申购份额含转换入、基金折算调增份额；基金赎回份额含转换出、基金折算调减份额。

2:泰康资产管理有限责任公司以 2020 年 2 月 12 日为折算日对泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金进行了基金份额折算，根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.24359689，报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的机构折算后基金份额分别为 1047780866 份及 414238947 份。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 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。

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 3 月 31 日