

泰康沪深 300 交易型开放式指数 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 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 8 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 8 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	64
7.1 期末基金资产组合情况.....	64
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	64
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	77
7.7 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.....	77
7.8 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.....	77
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	78
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
7.12 投资组合报告附注.....	78
§8 基金份额持有人信息.....	81
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	81
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	82
§9 开放式基金份额变动.....	83
§10 重大事件揭示.....	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
10.4 基金投资策略的改变.....	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	84
10.8 其他重大事件.....	86

§11 影响投资者决策的其他重要信息	91
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	91
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	91
§12 备查文件目录	92
12.1 备查文件目录.....	92
12.2 存放地点.....	92
12.3 查阅方式.....	92

§ 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	946,899,814.00 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 年 3 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。</p> <p>本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，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。</p>

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,046,960,701.75
本期利润	197,718,644.27
加权平均基金份额本期利润	0.1979
本期加权平均净值利润率	3.68%
本期基金份额净值增长率	1.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	1,209,718,734.60
期末可供分配基金份额利润	1.2776
期末基金资产净值	5,096,880,292.38
期末基金份额净值	5.3827
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	31.12%

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。

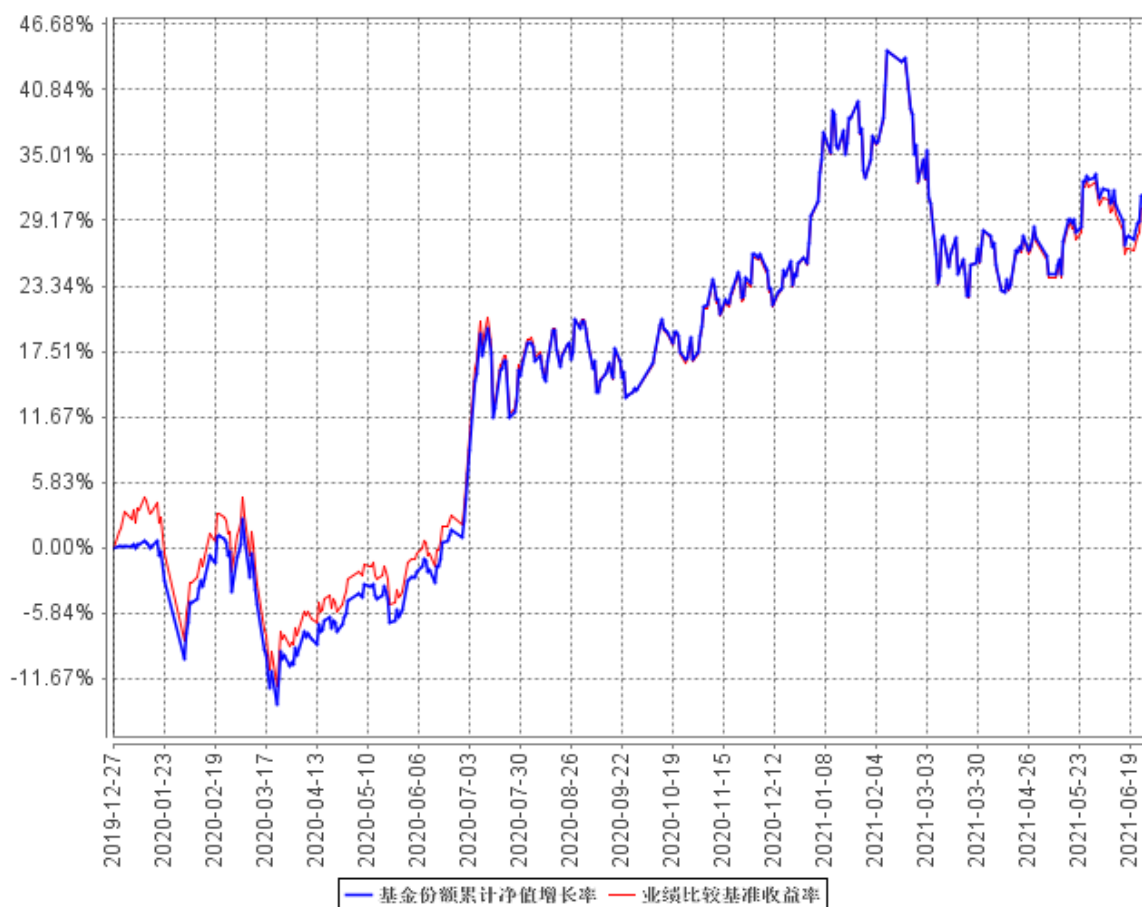
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.45%	0.81%	-2.02%	0.80%	0.57%	0.01%
过去三个月	4.52%	0.98%	3.48%	0.98%	1.04%	0.00%
过去六个月	1.22%	1.31%	0.24%	1.31%	0.98%	0.00%
过去一年	28.18%	1.33%	25.46%	1.33%	2.72%	0.00%
自基金合同生效起至今	31.12%	1.37%	29.76%	1.39%	1.36%	-0.02%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 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。

§ 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 2021 年 6 月 30 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、泰康合润混合型证券投资基金、泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康浩泽混合型证券投资基金、泰康安泽中短债债券型证券投资基金、泰康福泽积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 共 56 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，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。现任公募事业部量化投资总监。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 27 日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2021 年上半年经济延续复苏的格局，并呈现出稳中加固的态势。1 季度，各项经济数据在低基数的影响下表现较强，如果与 19 年相比，则出口延续了高景气度，房地产投资韧性较强，消费在冬季疫情的影响下有一定波折，3 月的 PMI 数据显示制造业或有所好转，货币政策保持相对稳定，实体经济的融资需求延续强劲，大宗商品价格在国际疫情恢复、全球复苏预期的带动下有较为明显的上行，通胀预期发酵，PPI 上行较快，CPI 保持稳定，人民币受到美元阶段性走强的影响，从升值转为震荡。2 季度，各项经济指标同比数据，由于基数效应而有所下滑，如果同 2019 年相比，则呈现出较为平稳的走势。经济内部延续了结构分化的特征，出口延续了较高景气，但零售的恢复力度仍然偏弱。投资内部也有所分化，制造业处于缓慢恢复中，上游价格

带来的利润挤压仍需关注；地产的韧性较强，但基建由于政府投资意愿偏弱，而表现较为一般。在供给约束下，PPI 表现很强，但 CPI 由于需求偏平稳，向上的压力不大。融资需求受到表外多重因素的制约，增速有所走低。

权益市场方面，春节之后受到美债利率大幅上行等因素的影响，风险偏好显著下降，股票市场经历了较大幅调整，部分优质成长股在经历了前期下跌之后已经到了可以获得合意回报的区间。进入 2 季度，市场对全年经济强复苏的预期有所降温，投资、消费和金融数据都指向需求边际走弱，大宗商品涨幅也在 2 季度放缓，风险偏好在本期显著回升。从大盘和板块上来看，上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，中小板指上涨 3.66%，创业板指上涨 17.22%。其中，基础化工、钢铁、电力设备及新能源等板块表现相对较好，国防军工、家电、非银行金融等行业表现不佳。

具体投资上，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，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购和赎回。报告期内，沪深 300 指数呈先上行后下行、继而盘整震荡的走势。

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 5.3827 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.22%；同期业绩比较基准增长率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济可能保持相对平稳的格局，总量上变化不会很大，结构上的特点更为突出。总量方面，建筑业可能面临一定的下行压力，但总体可控，有望在政策逆周期调节、以及结构性宽松的支持下所对冲，总体波动不大。结构方面，制造业成本的压制难以消退，消费和服务业面临疫情的负面影响也很难消除，可能都会呈现出在波折中缓慢恢复的局面。政策方面的结构性特征将更为显著，对地产和平台的结构性紧信用持续，但对制造业、小微企业、绿色金融等相关的宽信用加大，货币政策也致力于缓解经济的结构性问题，总体基调是在稳健中注重结构性，保持流动性合理充裕。

权益市场方面，国内超预期全面降准营造了温和的流动性环境，叠加美就业恢复偏慢加大了联储对通胀继续上行的容忍度，整体利好成长，而前期成长回调明显。下半场具有较高景气度的行业、新潮新消费等，预计将获得资金持续青睐，A 股结构牛行情还将延续。

管理人将继续紧跟市场，控制跟踪误差，通过精细化投资管理，力求为投资者带来更好的投资体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有公募估值小组，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	35,028,603.09	28,544,831.79
结算备付金		24,584,479.27	127,635,925.45
存出保证金		8,428,874.07	21,116,276.26
交易性金融资产	6.4.7.2	5,034,539,948.35	7,066,598,647.45
其中：股票投资		5,030,876,199.73	7,061,577,647.45
基金投资		-	-
债券投资		3,663,748.62	5,021,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,377,926.40	2,841,675.76
应收利息	6.4.7.5	216,221.58	307,940.37
应收股利		576,329.90	110.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,104,752,382.66	7,247,045,407.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		631,709.93	750,831.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,682,146.88	2,646,319.97
应付托管费		210,268.36	330,790.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	570,188.99	774,964.12
应交税费		70,892.14	386,033.78

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	4,706,883.98	5,225,113.73
负债合计		7,872,090.28	10,114,053.19
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,887,161,557.78	5,586,691,815.36
未分配利润	6.4.7.10	1,209,718,734.60	1,650,239,538.53
所有者权益合计		5,096,880,292.38	7,236,931,353.89
负债和所有者权益总计		5,104,752,382.66	7,247,045,407.08

注：(1) 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.3827 元，基金份额总额 946,899,814.00 份。

(2) 股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.2 利润表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		216,411,739.04	206,488,638.35
1.利息收入		6,034,013.25	11,388,602.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	688,027.10	554,740.17
债券利息收入		1,868.35	1,781.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	9,716,245.73
证券出借利息收入		5,344,117.80	1,103,448.41
其他利息收入		-	12,386.27
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,052,644,108.34	-3,463,986.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,003,336,062.09	-92,692,261.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,635,448.44	-678,770.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	13,803,498.06	15,103,052.92
股利收益	6.4.7.16	33,869,099.75	74,803,992.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-849,242,057.48	198,310,985.34

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,975,674.93	253,037.75
减：二、费用		18,693,094.77	21,512,803.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,677,044.39	13,847,442.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,334,630.58	1,730,930.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,672,561.05	4,702,169.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		68,935.51	64,997.47
7. 其他费用	6.4.7.20	939,923.24	1,167,263.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		197,718,644.27	184,975,834.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		197,718,644.27	184,975,834.95

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	5,586,691,815.36	1,650,239,538.53	7,236,931,353.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	197,718,644.27	197,718,644.27
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）	-1,699,530,257.58	-638,239,448.20	-2,337,769,705.78
其中：1. 基金申购款	3,502,510,183.17	1,089,125,798.61	4,591,635,981.78
2. 基金赎回款	-5,202,040,440.75	-1,727,365,246.81	-6,929,405,687.56
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）	3,887,161,557.78	1,209,718,734.60	5,096,880,292.38
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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）	-	184,975,834.95	184,975,834.95
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）	229,067,121.79	-19,642,217.37	209,424,904.42
其中：1. 基金申购款	1,477,852,398.07	-104,794,687.61	1,373,057,710.46
2. 基金赎回款	-1,248,785,276.28	85,152,470.24	-1,163,632,806.04
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）	7,389,671,740.79	169,413,867.25	7,559,085,608.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

6.4 报表附注

6.4.1 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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	35,028,603.09

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：	35,028,603.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,678,126,842.31	5,030,876,199.73	352,749,357.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,663,748.62	91,048.62
	银行间市场	-	-
	合计	3,663,748.62	91,048.62
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,681,699,542.31	5,034,539,948.35	352,840,406.04

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	54,792,600.00	-	-	
-股指期货	54,792,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	54,792,600.00	-	-	

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 2021 年 6 月 30 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
IF2109	沪深300期货2109 合约	36	55,797,120.00	1,004,520.00
总额合计				1,004,520.00
减：可抵销期货暂收款				1,004,520.00
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	6,862.16
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	12,590.24
应收债券利息	275.95
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	195,713.33
其他	779.90
合计	216,221.58

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	570,188.99

银行间市场应付交易费用	-
合计	570,188.99

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	133,891.13
指数使用费	374,468.87
可退替代款	700.74
应付替代款	4,197,823.24
合计	4,706,883.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,360,899,814.00	5,586,691,815.36
本期申购	853,200,000.00	3,502,510,183.17
本期赎回(以“-”号填列)	-1,267,200,000.00	-5,202,040,440.75
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	946,899,814.00	3,887,161,557.78

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	749,546,053.55	900,693,484.98	1,650,239,538.53
本期利润	1,046,960,701.75	-849,242,057.48	197,718,644.27
本期基金份额交易产生的变动数	-339,662,051.22	-298,577,396.98	-638,239,448.20
其中：基金申购款	1,073,039,217.04	16,086,581.57	1,089,125,798.61
基金赎回款	-1,412,701,268.26	-314,663,978.55	-1,727,365,246.81

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,456,844,704.08	-247,125,969.48	1,209,718,734.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入	121,488.76	
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	554,697.34	
其他	11,841.00	
合计	688,027.10	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	541,823,327.01	
股票投资收益——赎回差价收入	461,512,735.08	
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	1,003,336,062.09	

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额	3,462,934,460.94	
减：卖出股票成本总额	2,921,111,133.93	
买卖股票差价收入	541,823,327.01	

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
赎回基金份额对价总额	6,929,405,687.56	
减：现金支付赎回款总额	2,903,770,526.56	
减：赎回股票成本总额	3,564,122,425.92	
赎回差价收入	461,512,735.08	

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	1,635,448.44
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	1,635,448.44

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,045,639.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,408,200.00
减：应收利息总额	1,990.68
买卖债券差价收入	1,635,448.44

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	13,803,498.06

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	33,869,099.75
其中：证券出借权益补偿收入	5,155,548.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	33,869,099.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-841,829,294.48
——股票投资	-841,920,343.10
——债券投资	91,048.62
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-7,412,763.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-7,412,763.00
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	-849,242,057.48

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,975,674.93
合计	6,975,674.93

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,672,561.05

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	5,672,561.05

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 计算发布费	24,795.19
指数使用费	800,778.35
银行费用	5,253.76
其他	-
合计	939,923.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、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 基金联接基金	本基金的联接基金

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,677,044.39	13,847,442.67
其中：支付销售机构的客户维护费	31,352.60	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,334,630.58	1,730,930.33

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间，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。

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

本报告期及上年度可比期间，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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	12,445,986.00	1.3144%	18,618,486.00	1.3681%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	35,028,603.09	121,488.76	24,608,008.02	104,724.07

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。

6.4.10.7 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，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2021年6月30日，本基金持有2,910,412股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币136,508,459.40元，估值总额为人民币157,715,226.28元，占基金资产净值的比例为3.09%（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%)。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	网下新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	网下新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定期流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	网下新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	网下新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
000063	中兴通讯	2021年1月25日	2021年7月26日	大宗交易流通受限	31.17	32.46	440,000	13,714,800.00	14,282,400.00	-
600745	闻泰科技	2021年4月29日	2021年11月1日	大宗交易流通受限	81.78	91.38	83,000	6,787,740.00	7,584,540.00	-

600352	浙江龙盛	2021年2月9日	2021年8月10日	大宗交易流通受限	14.78	13.58	430,000	6,355,400.00	5,839,400.00	-
601360	三六零	2021年5月27日	2021年11月29日	大宗交易流通受限	11.32	11.66	500,000	5,660,000.00	5,830,000.00	-
002555	三七互娱	2021年3月8日	2021年9月9日	大宗交易流通受限	28.94	23.07	210,000	6,077,400.00	4,844,700.00	-
002602	世纪华通	2021年3月18日	2021年9月22日	大宗交易流通受限	7.35	6.24	640,000	4,704,000.00	3,993,600.00	-
002607	中公教育	2021年2月2日	2021年8月3日	大宗交易流通受限	37.10	20.09	115,000	4,266,500.00	2,310,350.00	-
688696	极米科技	2021年2月23日	2021年9月3日	新股锁定期流通受限	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	新股锁定期流通受限	2.87	4.75	135,282	388,259.34	642,589.50	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定期流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定期流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-

				限						
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	新股 锁定 期流 通受 限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	新股 锁定 期流 通受 限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股 锁定 期流 通受 限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股 锁定 期流 通受 限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股 锁定 期流 通受 限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股 锁定 期流 通受 限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股 锁定 期流 通受 限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股 锁定 期流 通受 限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股 锁定 期流	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

			日	通受限							
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定期流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定期流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定期流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定期流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-	
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定期流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-	
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-	
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定期流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定期流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-	
300986	志特新材	2021年4月	2021年11	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	

		21 日	月 1 日	期流 通受 限						
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 锁定 期流 通受 限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股 锁定 期流 通受 限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股 锁定 期流 通受 限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股 锁定 期流 通受 限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股 锁定 期流 通受 限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 锁定 期流 通受 限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股 锁定 期流 通受 限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖 智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 锁定 期流 通受 限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣	2021	2021	新股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

	股份	年 4 月 2 日	年 10 月 13 日	锁定 期流 通受 限						
300972	万辰 生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股 锁定 期流 通受 限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐 环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股 锁定 期流 通受 限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 锁定 期流 通受 限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	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
113049	长汽 转债	2021 年 6 月 11 日	2021 年 7 月 8 日	配债 流通 受限	100.00	100.00	1,570	157,000.00	157,000.00	-
113050	南银 转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	配债 流通 受限	100.00	100.00	18,630	1,863,000.00	1,863,000.00	-
113050	南银 转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	网下 新债 流通 受限	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-
123117	健帆 转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	配债 流通 受限	100.00	100.00	1,160	116,000.00	116,000.00	-
127038	国微 转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	配债 流通 受限	100.00	100.00	2,709	270,900.00	270,900.00	-

			日							
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

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票，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票，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票数量的 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票，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票不适用《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。

6、根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本 93,340,000.00 股为基数，向全体股东每股派发现金红利 0.08 元（含税），每股派送红股 0.50 股。除权除息日为 2021 年 6 月 4 日，本基金所持有的冠中生态获得转增股 108 股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	临时停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	665,100	5,464,275.48	3,717,909.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
1	000001	平安银行	2021年7月1日 -2021年7月14日	22.62	573,600	12,974,832.00
2	000002	万科 A	2021年7月2日	23.81	406,700	9,683,527.00

			-2021 年 7 月 13 日			
3	000066	中国长城	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	14.60	103,000	1,503,800.00
4	000100	TCL 科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.65	74,500	569,925.00
5	000157	中联重科	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日	9.24	71,000	656,040.00
6	000166	申万宏源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	4.68	503,400	2,355,912.00
7	000338	潍柴动力	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日	17.87	240,800	4,303,096.00
8	000538	云南白药	2021 年 7 月 27 日 -2021 年 7 月 27 日	115.72	10,000	1,157,200.00
9	000568	泸州老窖	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 7 日	235.94	40,000	9,437,600.00
10	000625	长安汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	26.28	132,000	3,468,960.00
11	000651	格力电器	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	52.10	282,000	14,692,200.00
12	000703	恒逸石化	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	11.95	130,000	1,553,500.00
13	000708	中信特钢	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	20.84	50,500	1,052,420.00
14	000725	京东方 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	6.24	1,666,800	10,400,832.00
15	000768	中航西飞	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	26.28	78,900	2,073,492.00
16	000776	广发证券	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 9 日	15.14	173,500	2,626,790.00

17	000783	长江证券	2021年7月2日 -2021年7月13日	7.32	227,900	1,668,228.00
18	000786	北新建材	2021年7月1日 -2021年7月8日	39.25	20,000	785,000.00
19	000800	一汽解放	2021年7月6日 -2021年7月14日	10.82	55,200	597,264.00
20	000858	五粮液	2021年7月9日 -2021年7月9日	297.89	27,100	8,072,819.00
21	000860	顺鑫农业	2021年7月2日 -2021年7月15日	42.18	30,500	1,286,490.00
22	000876	新希望	2021年7月1日 -2021年7月13日	14.67	102,900	1,509,543.00
23	000895	双汇发展	2021年7月2日 -2021年7月13日	31.80	82,900	2,636,220.00
24	000938	紫光股份	2021年7月13日 -2021年7月13日	21.88	10,000	218,800.00
25	000963	华东医药	2021年7月1日 -2021年7月1日	46.01	47,800	2,199,278.00
26	000977	浪潮信息	2021年7月1日 -2021年7月13日	28.13	60,300	1,696,239.00
27	001979	招商蛇口	2021年7月1日 -2021年7月13日	10.95	98,100	1,074,195.00
28	002001	新和成	2021年7月1日 -2021年7月27日	28.68	22,400	642,432.00
29	002007	华兰生物	2021年7月1日 -2021年7月13日	36.68	59,000	2,164,120.00
30	002008	大族激光	2021年7月2日 -2021年7月7日	40.39	34,800	1,405,572.00
31	002024	苏宁易购	2021年7月6日 -2021年7月6日	5.59	216,000	1,207,440.00

			日			
32	002027	分众传媒	2021年7月13日-2021年7月13日	9.41	106,100	998,401.00
33	002032	苏泊尔	2021年7月1日-2021年7月1日	63.79	10,000	637,900.00
34	002044	美年健康	2021年7月9日-2021年7月9日	9.11	37,200	338,892.00
35	002049	紫光国微	2021年7月27日-2021年7月27日	154.19	10,000	1,541,900.00
36	002050	三花智控	2021年7月1日-2021年7月14日	23.98	14,100	338,118.00
37	002120	韵达股份	2021年7月9日-2021年7月9日	13.53	10,000	135,300.00
38	002129	中环股份	2021年7月1日-2021年7月1日	38.60	20,000	772,000.00
39	002142	宁波银行	2021年7月9日-2021年7月13日	38.97	211,300	8,234,361.00
40	002153	石基信息	2021年7月1日-2021年7月1日	23.51	18,300	430,233.00
41	002157	正邦科技	2021年7月5日-2021年7月9日	11.95	91,900	1,098,205.00
42	002202	金风科技	2021年7月1日-2021年7月14日	12.16	161,600	1,965,056.00
43	002230	科大讯飞	2021年7月1日-2021年7月5日	67.58	10,000	675,800.00
44	002236	大华股份	2021年7月5日-2021年7月6日	21.10	103,400	2,181,740.00
45	002241	歌尔股份	2021年7月6日-2021年7月13日	42.74	142,600	6,094,724.00
46	002252	上海莱士	2021年7月1日	7.49	120,100	899,549.00

			-2021年7月13日			
47	002271	东方雨虹	2021年7月1日 -2021年7月14日	55.32	20,000	1,106,400.00
48	002304	洋河股份	2021年7月1日 -2021年7月1日	207.20	10,000	2,072,000.00
49	002311	海大集团	2021年7月1日 -2021年7月9日	81.60	48,600	3,965,760.00
50	002352	顺丰控股	2021年7月1日 -2021年7月14日	67.70	107,700	7,291,290.00
51	002371	北方华创	2021年7月1日 -2021年7月1日	277.38	10,000	2,773,800.00
52	002384	东山精密	2021年7月27日 -2021年7月27日	20.84	20,000	416,800.00
53	002410	广联达	2021年7月1日 -2021年7月6日	68.20	24,300	1,657,260.00
54	002414	高德红外	2021年7月1日 -2021年7月9日	27.58	55,100	1,519,658.00
55	002415	海康威视	2021年7月1日 -2021年7月14日	64.50	276,100	17,808,450.00
56	002456	欧菲光	2021年7月1日 -2021年7月6日	8.88	94,800	841,824.00
57	002460	赣锋锂业	2021年7月27日 -2021年7月27日	121.09	15,000	1,816,350.00
58	002463	沪电股份	2021年7月7日 -2021年7月27日	15.47	71,600	1,107,652.00
59	002475	立讯精密	2021年7月1日 -2021年7月13日	46.00	284,700	13,096,200.00
60	002493	荣盛石化	2021年7月27日 -2021年7月27日	17.27	20,000	345,400.00

61	002508	老板电器	2021年7月8日 -2021年7月12日	46.50	23,000	1,069,500.00
62	002555	三七互娱	2021年7月1日 -2021年7月1日	24.02	20,000	480,400.00
63	002594	比亚迪	2021年7月1日 -2021年7月21日	251.00	50,000	12,550,000.00
64	002600	领益智造	2021年7月2日 -2021年7月5日	9.19	166,900	1,533,811.00
65	002601	龙麟佰利	2021年7月5日 -2021年7月9日	34.58	46,600	1,611,428.00
66	002624	完美世界	2021年7月6日 -2021年7月6日	23.91	14,100	337,131.00
67	002673	西部证券	2021年7月1日 -2021年7月9日	8.25	104,100	858,825.00
68	002714	牧原股份	2021年7月5日 -2021年7月27日	60.82	136,200	8,283,684.00
69	002736	国信证券	2021年7月1日 -2021年7月1日	10.75	154,000	1,655,500.00
70	002739	万达电影	2021年7月1日 -2021年7月14日	15.79	31,300	494,227.00
71	002773	康弘药业	2021年7月27日 -2021年7月27日	23.13	20,000	462,600.00
72	002812	恩捷股份	2021年7月7日 -2021年7月7日	234.10	10,000	2,341,000.00
73	002841	视源股份	2021年7月1日 -2021年7月1日	124.29	10,000	1,242,900.00
74	002916	深南电路	2021年7月2日 -2021年7月2日	111.13	10,000	1,111,300.00
75	002939	长城证券	2021年7月6日 -2021年7月13日	11.13	55,400	616,602.00

			日			
76	300003	乐普医疗	2021年7月1日 -2021年7月8日	32.12	68,900	2,213,068.00
77	300014	亿纬锂能	2021年7月1日 -2021年7月27日	103.93	57,100	5,934,403.00
78	300015	爱尔眼科	2021年7月2日 -2021年7月14日	70.98	59,155	4,198,821.90
79	300033	同花顺	2021年7月1日 -2021年7月1日	112.78	10,000	1,127,800.00
80	300124	汇川技术	2021年7月14日 -2021年7月14日	74.26	91,700	6,809,642.00
81	300136	信维通信	2021年7月2日 -2021年7月6日	30.88	10,500	324,240.00
82	300142	沃森生物	2021年7月14日 -2021年7月27日	61.70	30,000	1,851,000.00
83	300144	宋城演艺	2021年7月1日 -2021年7月1日	16.80	54,500	915,600.00
84	300274	阳光电源	2021年7月2日 -2021年7月28日	115.06	23,700	2,726,922.00
85	300347	泰格医药	2021年7月2日 -2021年7月2日	193.30	10,000	1,933,000.00
86	300408	三环集团	2021年7月1日 -2021年7月6日	42.42	41,900	1,777,398.00
87	300413	芒果超媒	2021年7月2日 -2021年7月14日	68.60	42,200	2,894,920.00
88	300433	蓝思科技	2021年7月7日 -2021年7月7日	29.41	10,000	294,100.00
89	300450	先导智能	2021年7月27日 -2021年7月27日	60.14	10,000	601,400.00
90	300601	康泰生物	2021年7月7日	149.00	10,000	1,490,000.00

			-2021 年 7 月 7 日			
91	300677	英科医疗	2021 年 7 月 13 日-2021 年 7 月 13 日	124.80	12,500	1,560,000.00
92	600000	浦发银行	2021 年 7 月 7 日-2021 年 7 月 7 日	10.00	125,200	1,252,000.00
93	600009	上海机场	2021 年 7 月 9 日-2021 年 7 月 12 日	48.13	57,400	2,762,662.00
94	600011	华能国际	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 13 日	4.22	214,200	903,924.00
95	600015	华夏银行	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 14 日	6.19	250,500	1,550,595.00
96	600016	民生银行	2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 7 日	4.41	155,900	687,519.00
97	600018	上港集团	2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 8 日	4.77	10,000	47,700.00
98	600019	宝钢股份	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 1 日	7.64	341,100	2,606,004.00
99	600025	华能水电	2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 5 日	5.79	45,100	261,129.00
100	600028	中国石化	2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 8 日	4.36	190,100	828,836.00
101	600029	南方航空	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 2 日	6.02	10,000	60,200.00
102	600030	中信证券	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 8 日	24.94	447,300	11,155,662.00
103	600031	三一重工	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 13 日	29.07	319,500	9,287,865.00
104	600036	招商银行	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 1 日	54.19	275,500	14,929,345.00

105	600050	中国联通	2021年7月1日 -2021年7月13日	4.32	935,500	4,041,360.00
106	600061	国投资本	2021年7月6日 -2021年7月8日	8.49	37,000	314,130.00
107	600085	同仁堂	2021年7月2日 -2021年7月5日	40.85	30,500	1,245,925.00
108	600104	上汽集团	2021年7月1日 -2021年7月14日	21.97	196,300	4,312,711.00
109	600109	国金证券	2021年7月2日 -2021年7月14日	12.69	142,500	1,808,325.00
110	600111	北方稀土	2021年7月1日 -2021年7月21日	20.70	127,700	2,643,390.00
111	600115	中国东航	2021年7月5日 -2021年7月14日	5.08	264,300	1,342,644.00
112	600118	中国卫星	2021年7月2日 -2021年7月8日	29.26	27,500	804,650.00
113	600150	中国船舶	2021年7月6日 -2021年7月13日	16.51	76,000	1,254,760.00
114	600161	天坛生物	2021年7月8日 -2021年7月13日	34.25	10,000	342,500.00
115	600176	中国巨石	2021年7月1日 -2021年7月1日	15.51	40,000	620,400.00
116	600196	复星医药	2021年7月1日 -2021年7月27日	72.13	70,800	5,106,804.00
117	600233	圆通速递	2021年7月1日 -2021年7月5日	10.01	71,400	714,714.00
118	600299	安迪苏	2021年7月7日 -2021年7月7日	11.96	16,100	192,556.00
119	600309	万华化学	2021年7月1日 -2021年7月2日	108.82	92,500	10,065,850.00

			日			
120	600340	华夏幸福	2021年7月5日 -2021年7月5日	5.24	11,400	59,736.00
121	600346	恒力石化	2021年7月1日 -2021年7月13日	26.24	124,600	3,269,504.00
122	600362	江西铜业	2021年7月5日 -2021年7月13日	22.38	57,300	1,282,374.00
123	600383	金地集团	2021年7月9日 -2021年7月9日	10.24	50,800	520,192.00
124	600406	国电南瑞	2021年7月1日 -2021年7月14日	23.24	115,720	2,689,332.80
125	600436	片仔癀	2021年7月5日 -2021年7月8日	448.30	10,000	4,483,000.00
126	600438	通威股份	2021年7月1日 -2021年7月27日	43.27	50,000	2,163,500.00
127	600482	中国动力	2021年7月5日 -2021年7月6日	17.42	38,300	667,186.00
128	600489	中金黄金	2021年7月6日 -2021年7月14日	8.62	114,000	982,680.00
129	600521	华海药业	2021年7月1日 -2021年7月2日	20.88	51,700	1,079,496.00
130	600547	山东黄金	2021年7月6日 -2021年7月7日	19.22	106,800	2,052,696.00
131	600570	恒生电子	2021年7月7日 -2021年7月7日	93.25	46,600	4,345,450.00
132	600584	长电科技	2021年7月2日 -2021年7月9日	37.68	73,100	2,754,408.00
133	600588	用友网络	2021年7月1日 -2021年7月1日	33.26	20,000	665,200.00
134	600600	青岛啤酒	2021年7月5日	115.65	20,000	2,313,000.00

			-2021年7月13日			
135	600606	绿地控股	2021年7月1日 -2021年7月2日	5.45	175,800	958,110.00
136	600655	豫园股份	2021年7月5日 -2021年7月8日	11.59	90,800	1,052,372.00
137	600690	海尔智家	2021年7月7日 -2021年7月9日	25.91	20,000	518,200.00
138	600703	三安光电	2021年7月1日 -2021年7月13日	32.05	155,100	4,970,955.00
139	600705	中航资本	2021年7月1日 -2021年7月2日	3.87	81,200	314,244.00
140	600741	华域汽车	2021年7月2日 -2021年7月14日	26.27	77,000	2,022,790.00
141	600745	闻泰科技	2021年7月27日 -2021年7月27日	96.90	10,000	969,000.00
142	600760	中航沈飞	2021年7月27日 -2021年7月27日	60.30	10,000	603,000.00
143	600763	通策医疗	2021年7月1日 -2021年7月1日	411.00	10,000	4,110,000.00
144	600795	国电电力	2021年7月6日 -2021年7月6日	2.43	588,600	1,430,298.00
145	600809	山西汾酒	2021年7月1日 -2021年7月1日	448.00	20,600	9,228,800.00
146	600848	上海临港	2021年7月6日 -2021年7月27日	17.90	56,900	1,018,510.00
147	600872	中炬高新	2021年7月2日 -2021年7月2日	42.02	10,000	420,200.00
148	600886	国投电力	2021年7月5日 -2021年7月5日	9.61	12,300	118,203.00

149	600893	航发动力	2021年7月7日 -2021年7月27日	53.19	24,400	1,297,836.00
150	600900	长江电力	2021年7月7日 -2021年7月13日	20.64	211,500	4,365,360.00
151	600926	杭州银行	2021年7月1日 -2021年7月13日	14.75	174,900	2,579,775.00
152	600999	招商证券	2021年7月7日 -2021年7月13日	19.02	91,600	1,742,232.00
153	601009	南京银行	2021年7月6日 -2021年7月6日	10.52	50,900	535,468.00
154	601012	隆基股份	2021年7月7日 -2021年7月27日	88.84	145,400	12,917,336.00
155	601021	春秋航空	2021年7月2日 -2021年7月7日	56.90	20,000	1,138,000.00
156	601066	中信建投	2021年7月12日 -2021年7月12日	31.43	20,000	628,600.00
157	601100	恒立液压	2021年7月7日 -2021年7月13日	85.92	22,300	1,916,016.00
158	601111	中国国航	2021年7月2日 -2021年7月13日	7.78	176,500	1,373,170.00
159	601155	新城控股	2021年7月9日 -2021年7月9日	41.60	50,600	2,104,960.00
160	601162	天风证券	2021年7月1日 -2021年7月13日	4.86	222,400	1,080,864.00
161	601166	兴业银行	2021年7月14日 -2021年7月14日	20.55	859,500	17,662,725.00
162	601169	北京银行	2021年7月1日 -2021年7月1日	4.87	76,300	371,581.00
163	601225	陕西煤业	2021年7月1日 -2021年7月7日	11.85	51,800	613,830.00

			日			
164	601231	环旭电子	2021年7月1日 -2021年7月6日	16.81	35,800	601,798.00
165	601236	红塔证券	2021年7月6日 -2021年7月8日	13.56	22,300	302,388.00
166	601238	广汽集团	2021年7月1日 -2021年7月5日	12.95	127,900	1,656,305.00
167	601288	农业银行	2021年7月14日 -2021年7月14日	3.03	17,900	54,237.00
168	601319	中国人保	2021年7月5日 -2021年7月9日	5.93	138,300	820,119.00
169	601328	交通银行	2021年7月14日 -2021年7月14日	4.90	10,200	49,980.00
170	601377	兴业证券	2021年7月5日 -2021年7月9日	9.66	129,600	1,251,936.00
171	601390	中国中铁	2021年7月1日 -2021年7月6日	5.24	322,100	1,687,804.00
172	601398	工商银行	2021年7月5日 -2021年7月5日	5.17	125,700	649,869.00
173	601555	东吴证券	2021年7月1日 -2021年7月13日	8.34	184,200	1,536,228.00
174	601600	中国铝业	2021年7月1日 -2021年7月9日	5.30	224,500	1,189,850.00
175	601601	中国太保	2021年7月1日 -2021年7月13日	28.97	49,500	1,434,015.00
176	601607	上海医药	2021年7月6日 -2021年7月6日	21.13	10,000	211,300.00
177	601618	中国中冶	2021年7月6日 -2021年7月6日	2.98	78,200	233,036.00
178	601628	中国人寿	2021年7月6日	33.89	24,700	837,083.00

			-2021 年 7 月 6 日			
179	601633	长城汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 27 日	43.59	50,000	2,179,500.00
180	601668	中国建筑	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	4.65	216,900	1,008,585.00
181	601669	中国电建	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.87	407,700	1,577,799.00
182	601696	中银证券	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 14 日	20.59	48,600	1,000,674.00
183	601727	上海电气	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	4.24	304,200	1,289,808.00
184	601788	光大证券	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 27 日	17.89	70,600	1,263,034.00
185	601799	星宇股份	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	225.72	10,000	2,257,200.00
186	601800	中国交建	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 9 日	6.48	50,700	328,536.00
187	601808	中海油服	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	14.36	29,800	427,928.00
188	601816	京沪高铁	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	5.29	218,800	1,157,452.00
189	601857	中国石油	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 12 日	5.29	579,600	3,066,084.00
190	601872	招商轮船	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	4.62	182,800	844,536.00
191	601877	正泰电器	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 9 日	33.38	43,600	1,455,368.00
192	601878	浙商证券	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 6 日	13.08	91,600	1,198,128.00

193	601888	中国中免	2021年7月5日 -2021年7月7日	300.10	57,400	17,225,740.00
194	601901	方正证券	2021年7月1日 -2021年7月7日	9.36	239,900	2,245,464.00
195	601919	中远海控	2021年7月1日 -2021年7月27日	30.54	172,400	5,265,096.00
196	601985	中国核电	2021年7月8日 -2021年7月8日	5.06	10,000	50,600.00
197	601988	中国银行	2021年7月6日 -2021年7月6日	3.08	819,700	2,524,676.00
198	601989	中国重工	2021年7月7日 -2021年7月7日	4.12	37,800	155,736.00
199	601990	南京证券	2021年7月1日 -2021年7月2日	10.52	35,400	372,408.00
200	601995	中金公司	2021年7月13日 -2021年7月13日	61.50	10,000	615,000.00
201	603019	中科曙光	2021年7月9日 -2021年7月9日	27.61	11,100	306,471.00
202	603259	药明康德	2021年7月1日 -2021年7月1日	156.59	20,000	3,131,800.00
203	603369	今世缘	2021年7月1日 -2021年7月14日	54.16	36,800	1,993,088.00
204	603659	璞泰来	2021年7月14日 -2021年7月14日	136.60	12,300	1,680,180.00
205	603799	华友钴业	2021年7月6日 -2021年7月27日	114.20	35,000	3,997,000.00
206	603806	福斯特	2021年7月14日 -2021年7月14日	105.13	20,000	2,102,600.00
207	603833	欧派家居	2021年7月1日 -2021年7月1日	141.96	10,000	1,419,600.00

			日			
208	603899	晨光文具	2021年7月5日 -2021年7月5日	84.56	10,000	845,600.00
209	603939	益丰药房	2021年7月6日 -2021年7月6日	56.09	10,000	560,900.00
210	603986	兆易创新	2021年7月1日 -2021年7月5日	187.90	30,000	5,637,000.00
211	603993	洛阳钼业	2021年7月1日 -2021年7月7日	5.16	232,600	1,200,216.00
212	688008	澜起科技	2021年7月2日 -2021年7月27日	62.38	20,000	1,247,600.00
213	688012	中微公司	2021年7月6日 -2021年7月6日	165.92	10,000	1,659,200.00
214	688036	传音控股	2021年7月27日 -2021年7月27日	209.50	10,000	2,095,000.00
215	688126	沪硅产业	2021年7月28日 -2021年7月28日	29.18	20,000	583,600.00
216	688396	华润微	2021年7月13日 -2021年7月13日	91.02	15,600	1,419,912.00
合计					23,828,275	537,575,428.70

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管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，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	2,892,000.00	4,605,000.00
AAA 以下	771,748.62	416,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	3,663,748.62	5,021,000.00

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

等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日,本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,028,603.09	-	-	-	35,028,603.09
结算备付金	24,584,479.27	-	-	-	24,584,479.27
存出保证金	1,733,219.67	-	-	6,695,654.40	8,428,874.07
交易性金融资产	-	-3,663,748.62	5,568,451,628.43	5,572,115,377.05	5,572,115,377.05
应收证券清算款	-	-	-	1,377,926.40	1,377,926.40
应收利息	-	-	-	216,221.58	216,221.58
应收股利	-	-	-	576,329.90	576,329.90
其他资产	-	-	-	-537,575,428.70	-537,575,428.70
资产总计	61,346,302.03	-3,663,748.62	5,039,742,332.01	5,104,752,382.66	5,104,752,382.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,043,763.85	1,043,763.85
应付管理人报酬	-	-	-	1,682,146.88	1,682,146.88
应付托管费	-	-	-	210,268.36	210,268.36
应付交易费用	-	-	-	570,188.99	570,188.99
应交税费	-	-	-	70,892.14	70,892.14
其他负债	-	-	-	4,294,830.06	4,294,830.06
负债总计	-	-	-	7,872,090.28	7,872,090.28

利率敏感度缺口	61,346,302.03	-3,663,748.62	5,031,870,241.73	5,096,880,292.38	
上年度末 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	

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下调 0.25%	53,648.54	72,895.23
市场利率上调 0.25%	-52,739.43	-71,667.83	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	5,030,876,199.73	98.71	7,061,577,647.45	97.58
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	5,030,876,199.73	98.71	7,061,577,647.45	97.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准中的权益指数 上涨 5%	267,377,313.81	363,941,706.70
	业绩比较基准中的权益指数 下降 5%	-267,377,313.81	-363,941,706.70

6.4.14 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 2021 年 6 月 30 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 4,983,607,502.05 元，属于第二层次的余额为 50,932,446.30 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 6,905,742,190.99 元，第二层次 160,856,456.46 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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 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 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间,本基金申购基金份额的对价总额为 4,591,635,981.78 元(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间: 1,328,021,029.38 元),其中包括以股票支付的申购款 2,601,105,193.98 元和以现金支付的申购款 1,990,530,787.80 元(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间: 其中包括以股票支付的申购款 809,733,225.95 元和以现金支付的申购款 518,287,803.43 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,030,876,199.73	98.55
	其中：股票	5,030,876,199.73	98.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,663,748.62	0.07
	其中：债券	3,663,748.62	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	59,613,082.36	1.17
8	其他各项资产	10,599,351.95	0.21
9	合计	5,104,752,382.66	100.00

注：（1）本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 537,575,428.70 元，占期末资产净值比例为 10.55%

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	52,682,472.15	1.03
B	采矿业	106,216,427.84	2.08
C	制造业	2,782,248,951.52	54.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,684,886.83	1.74
E	建筑业	60,781,785.91	1.19
F	批发和零售业	36,093,100.28	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	147,051,432.65	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	164,454,814.63	3.23

J	金融业	1,186,155,487.64	23.27
K	房地产业	103,475,021.22	2.03
L	租赁和商务服务业	91,672,916.60	1.80
M	科学研究和技术服务业	71,849,120.32	1.41
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	8,997,239.00	0.18
Q	卫生和社会工作	106,774,856.70	2.09
R	文化、体育和娱乐业	20,978,252.20	0.41
S	综合	-	-
	合计	5,028,116,765.49	98.65

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,585,207.43	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	19,516.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,226.27	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,759,434.24	0.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	148,007	304,405,996.90	5.97
2	601318	中国平安	2,546,549	163,692,169.72	3.21
3	600036	招商银行	2,910,412	157,715,226.28	3.09
4	000858	五粮液	456,674	136,038,617.86	2.67
5	601012	隆基股份	1,018,247	90,461,063.48	1.77
6	000333	美的集团	1,159,839	82,777,709.43	1.62
7	600276	恒瑞医药	1,052,903	71,565,816.91	1.40
8	002415	海康威视	1,097,944	70,817,388.00	1.39
9	601166	兴业银行	3,418,283	70,245,715.65	1.38
10	601888	中国中免	229,696	68,931,769.60	1.35
11	603259	药明康德	421,648	66,025,860.32	1.30
12	300059	东方财富	1,944,226	63,751,170.54	1.25
13	000651	格力电器	1,131,692	58,961,153.20	1.16
14	600900	长江电力	2,673,357	55,178,088.48	1.08
15	002594	比亚迪	213,042	53,473,542.00	1.05
16	002475	立讯精密	1,149,495	52,876,770.00	1.04
17	600887	伊利股份	1,429,764	52,658,208.12	1.03
18	000001	平安银行	2,281,472	51,606,896.64	1.01
19	600030	中信证券	2,004,100	49,982,254.00	0.98
20	000725	京东方 A	7,963,000	49,689,120.00	0.97
21	300015	爱尔眼科	635,980	45,141,860.40	0.89
22	601398	工商银行	8,239,500	42,598,215.00	0.84
23	600031	三一重工	1,396,772	40,604,162.04	0.80
24	000568	泸州老窖	171,972	40,575,073.68	0.80
25	600309	万华化学	368,623	40,113,554.86	0.79
26	603501	韦尔股份	122,512	39,448,864.00	0.77
27	603288	海天味业	296,835	38,276,873.25	0.75
28	000002	万科 A	1,600,700	38,112,667.00	0.75
29	002714	牧原股份	618,675	37,627,813.50	0.74
30	600809	山西汾酒	81,729	36,614,592.00	0.72
31	300122	智飞生物	188,100	35,123,913.00	0.69
32	601919	中远海控	1,137,340	34,734,363.60	0.68
33	002142	宁波银行	847,308	33,019,592.76	0.65

34	600436	片仔癀	70,700	31,694,810.00	0.62
35	601328	交通银行	6,455,600	31,632,440.00	0.62
36	601899	紫金矿业	3,247,500	31,468,275.00	0.62
37	002304	洋河股份	142,000	29,422,400.00	0.58
38	002812	恩捷股份	125,500	29,379,550.00	0.58
39	002352	顺丰控股	428,677	29,021,432.90	0.57
40	002230	科大讯飞	418,300	28,268,714.00	0.55
41	300014	亿纬锂能	266,191	27,665,230.63	0.54
42	300274	阳光电源	240,000	27,614,400.00	0.54
43	600000	浦发银行	2,759,672	27,596,720.00	0.54
44	600438	通威股份	635,600	27,502,412.00	0.54
45	300124	汇川技术	363,495	26,993,138.70	0.53
46	600837	海通证券	2,269,300	26,096,950.00	0.51
47	000661	长春高新	66,400	25,696,800.00	0.50
48	000100	TCL 科技	3,298,100	25,230,465.00	0.50
49	601816	京沪高铁	4,615,200	24,414,408.00	0.48
50	002241	歌尔股份	562,368	24,035,608.32	0.47
51	300347	泰格医药	123,401	23,853,413.30	0.47
52	000063	中兴通讯	726,100	23,789,503.00	0.47
53	603986	兆易创新	125,282	23,540,487.80	0.46
54	601601	中国太保	803,800	23,286,086.00	0.46
55	600585	海螺水泥	564,959	23,191,566.95	0.46
56	600690	海尔智家	890,420	23,070,782.20	0.45
57	002271	东方雨虹	415,164	22,966,872.48	0.45
58	601668	中国建筑	4,927,700	22,913,805.00	0.45
59	002460	赣锋锂业	188,899	22,873,779.91	0.45
60	603799	华友钴业	199,476	22,780,159.20	0.45
61	002027	分众传媒	2,416,700	22,741,147.00	0.45
62	300142	沃森生物	367,876	22,697,949.20	0.45
63	600016	民生银行	5,005,500	22,074,255.00	0.43
64	600763	通策医疗	52,350	21,515,850.00	0.42
65	601288	农业银行	6,756,500	20,472,195.00	0.40
66	600196	复星医药	283,500	20,448,855.00	0.40
67	600048	保利地产	1,690,683	20,355,823.32	0.40
68	600703	三安光电	631,600	20,242,780.00	0.40
69	000338	潍柴动力	1,115,600	19,935,772.00	0.39
70	600919	江苏银行	2,775,600	19,706,760.00	0.39
71	002129	中环股份	499,396	19,276,685.60	0.38
72	601229	上海银行	2,340,234	19,189,918.80	0.38

73	601688	华泰证券	1,210,000	19,118,000.00	0.38
74	600050	中国联通	4,377,500	18,910,800.00	0.37
75	600660	福耀玻璃	329,745	18,416,258.25	0.36
76	600570	恒生电子	196,157	18,291,640.25	0.36
77	601211	国泰君安	1,060,200	18,171,828.00	0.36
78	600104	上汽集团	824,900	18,123,053.00	0.36
79	601766	中国中车	2,856,530	17,367,702.40	0.34
80	688111	金山办公	43,600	17,213,280.00	0.34
81	601169	北京银行	3,483,700	16,965,619.00	0.33
82	600999	招商证券	871,780	16,581,255.60	0.33
83	002371	北方华创	57,935	16,070,010.30	0.32
84	600019	宝钢股份	2,093,100	15,991,284.00	0.31
85	002311	海大集团	195,290	15,935,664.00	0.31
86	002049	紫光国微	100,000	15,419,000.00	0.30
87	601988	中国银行	4,952,200	15,252,776.00	0.30
88	002410	广联达	223,253	15,225,854.60	0.30
89	601088	中国神华	776,600	15,159,232.00	0.30
90	600406	国电南瑞	652,200	15,157,128.00	0.30
91	300498	温氏股份	1,047,645	15,054,658.65	0.30
92	601818	光大银行	3,891,100	14,708,358.00	0.29
93	300601	康泰生物	96,775	14,419,475.00	0.28
94	000625	长安汽车	533,464	14,019,433.92	0.28
95	000538	云南白药	120,165	13,905,493.80	0.27
96	600745	闻泰科技	146,617	13,749,027.30	0.27
97	600028	中国石化	3,148,220	13,726,239.20	0.27
98	600893	航发动力	251,200	13,361,328.00	0.26
99	300450	先导智能	220,500	13,260,870.00	0.26
100	601628	中国人寿	390,800	13,244,212.00	0.26
101	600346	恒力石化	495,700	13,007,168.00	0.26
102	002821	凯莱英	34,500	12,854,700.00	0.25
103	601658	邮储银行	2,555,400	12,828,108.00	0.25
104	600588	用友网络	383,924	12,769,312.24	0.25
105	601390	中国中铁	2,391,500	12,531,460.00	0.25
106	601633	长城汽车	287,000	12,510,330.00	0.25
107	300595	欧普康视	120,108	12,437,183.40	0.24
108	601009	南京银行	1,177,923	12,391,749.96	0.24
109	002493	荣盛石化	712,885	12,311,523.95	0.24
110	601377	兴业证券	1,257,600	12,148,416.00	0.24
111	601857	中国石油	2,285,400	12,089,766.00	0.24

112	688036	传音控股	56,900	11,920,550.00	0.23
113	300413	芒果超媒	167,011	11,456,954.60	0.22
114	600132	重庆啤酒	56,500	11,184,175.00	0.22
115	601225	陕西煤业	940,700	11,147,295.00	0.22
116	600584	长电科技	292,278	11,013,035.04	0.22
117	002601	龙蟠佰利	316,220	10,934,887.60	0.21
118	600009	上海机场	226,845	10,918,049.85	0.21
119	300408	三环集团	256,533	10,882,129.86	0.21
120	600426	华鲁恒升	348,700	10,792,265.00	0.21
121	600111	北方稀土	511,400	10,585,980.00	0.21
122	601100	恒立液压	122,988	10,567,128.96	0.21
123	601939	建设银行	1,582,300	10,522,295.00	0.21
124	000776	广发证券	694,700	10,517,758.00	0.21
125	688012	中微公司	63,200	10,486,144.00	0.21
126	002001	新和成	362,700	10,402,236.00	0.20
127	603882	金域医学	65,000	10,385,050.00	0.20
128	000895	双汇发展	325,500	10,350,900.00	0.20
129	300433	蓝思科技	351,486	10,337,203.26	0.20
130	600926	杭州银行	697,400	10,286,650.00	0.20
131	002179	中航光电	129,377	10,223,370.54	0.20
132	002050	三花智控	421,510	10,107,809.80	0.20
133	000166	申万宏源	2,123,600	9,938,448.00	0.19
134	600958	东方证券	983,100	9,821,169.00	0.19
135	600741	华域汽车	371,170	9,750,635.90	0.19
136	002841	视源股份	78,400	9,744,336.00	0.19
137	600600	青岛啤酒	83,032	9,602,650.80	0.19
138	300003	乐普医疗	296,600	9,526,792.00	0.19
139	002007	华兰生物	258,487	9,481,303.16	0.19
140	000963	华东医药	205,600	9,459,656.00	0.19
141	000786	北新建材	238,218	9,350,056.50	0.18
142	000157	中联重科	998,900	9,229,836.00	0.18
143	601006	大秦铁路	1,395,901	9,185,028.58	0.18
144	603806	福斯特	86,500	9,093,745.00	0.18
145	601901	方正证券	969,300	9,072,648.00	0.18
146	601336	新华保险	196,300	9,012,133.00	0.18
147	601799	星宇股份	39,900	9,006,228.00	0.18
148	002607	中公教育	435,100	8,997,239.00	0.18
149	600029	南方航空	1,494,100	8,994,482.00	0.18
150	600015	华夏银行	1,451,200	8,982,928.00	0.18

151	002236	大华股份	422,659	8,918,104.90	0.17
152	600143	金发科技	424,800	8,861,328.00	0.17
153	601989	中国重工	2,148,404	8,851,424.48	0.17
154	601155	新城控股	212,101	8,823,401.60	0.17
155	600176	中国巨石	565,696	8,773,944.96	0.17
156	601138	工业富联	702,500	8,718,025.00	0.17
157	000768	中航西飞	326,086	8,569,540.08	0.17
158	603993	洛阳钼业	1,658,000	8,555,280.00	0.17
159	601877	正泰电器	253,350	8,456,823.00	0.17
160	600760	中航沈飞	138,380	8,344,314.00	0.16
161	600352	浙江龙盛	611,100	8,327,714.00	0.16
162	600010	包钢股份	5,368,300	8,320,865.00	0.16
163	601788	光大证券	458,900	8,209,721.00	0.16
164	001979	招商蛇口	744,658	8,154,005.10	0.16
165	600547	山东黄金	424,212	8,153,354.64	0.16
166	300529	健帆生物	94,403	8,152,643.08	0.16
167	601600	中国铝业	1,536,700	8,144,510.00	0.16
168	002008	大族激光	201,111	8,122,873.29	0.16
169	601186	中国铁建	1,082,100	8,040,003.00	0.16
170	603369	今世缘	147,618	7,994,990.88	0.16
171	688169	石头科技	6,300	7,944,300.00	0.16
172	002202	金风科技	651,164	7,918,154.24	0.16
173	601916	浙商银行	1,967,000	7,808,990.00	0.15
174	000876	新希望	528,608	7,754,679.36	0.15
175	003816	中国广核	2,770,101	7,396,169.67	0.15
176	000938	紫光股份	336,599	7,364,786.12	0.14
177	603899	晨光文具	86,942	7,351,815.52	0.14
178	002555	三七互娱	313,800	7,337,976.00	0.14
179	002736	国信证券	677,256	7,280,502.00	0.14
180	601066	中信建投	229,100	7,200,613.00	0.14
181	600109	国金证券	567,300	7,199,037.00	0.14
182	000069	华侨城 A	963,200	7,166,208.00	0.14
183	600989	宝丰能源	516,900	7,071,192.00	0.14
184	300136	信维通信	228,086	7,043,295.68	0.14
185	000425	徐工机械	1,105,400	7,041,398.00	0.14
186	600150	中国船舶	422,200	6,970,522.00	0.14
187	601669	中国电建	1,793,733	6,941,746.71	0.14
188	603160	汇顶科技	53,495	6,934,556.85	0.14
189	603659	璞泰来	49,579	6,772,491.40	0.13

190	000977	浪潮信息	239,728	6,743,548.64	0.13
191	600795	国电电力	2,771,600	6,734,988.00	0.13
192	002384	东山精密	321,600	6,702,144.00	0.13
193	688008	澜起科技	107,100	6,680,898.00	0.13
194	000783	长江证券	910,600	6,665,592.00	0.13
195	601238	广汽集团	511,900	6,629,105.00	0.13
196	603019	中科曙光	239,040	6,599,894.40	0.13
197	600085	同仁堂	161,153	6,583,100.05	0.13
198	000596	古井贡酒	27,300	6,538,350.00	0.13
199	600079	人福医药	230,900	6,527,543.00	0.13
200	002624	完美世界	272,704	6,520,352.64	0.13
201	601838	成都银行	511,000	6,459,040.00	0.13
202	300677	英科医疗	51,400	6,414,720.00	0.13
203	600183	生益科技	270,000	6,320,700.00	0.12
204	600886	国投电力	657,188	6,315,576.68	0.12
205	300558	贝达药业	57,900	6,267,096.00	0.12
206	601985	中国核电	1,235,400	6,251,124.00	0.12
207	000703	恒逸石化	521,140	6,227,623.00	0.12
208	601108	财通证券	590,900	6,198,541.00	0.12
209	300144	宋城演艺	368,617	6,192,765.60	0.12
210	002600	领益智造	666,200	6,122,378.00	0.12
211	603833	欧派家居	43,080	6,115,636.80	0.12
212	002414	高德红外	220,502	6,081,445.16	0.12
213	601555	东吴证券	728,440	6,075,189.60	0.12
214	603517	绝味食品	72,000	6,068,880.00	0.12
215	000066	中国长城	414,600	6,053,160.00	0.12
216	601360	三六零	512,200	5,978,962.00	0.12
217	002252	上海莱士	792,200	5,933,578.00	0.12
218	002044	美年健康	645,300	5,878,683.00	0.12
219	002938	鹏鼎控股	162,989	5,848,045.32	0.11
220	300676	华大基因	49,100	5,823,260.00	0.11
221	601077	渝农商行	1,455,500	5,807,445.00	0.11
222	600522	中天科技	575,600	5,756,000.00	0.11
223	300033	同花顺	50,915	5,742,193.70	0.11
224	000728	国元证券	717,880	5,721,503.60	0.11
225	601607	上海医药	270,058	5,706,325.54	0.11
226	688396	华润微	62,300	5,670,546.00	0.11
227	600332	白云山	164,400	5,564,940.00	0.11
228	002602	世纪华通	878,000	5,521,560.00	0.11

229	600161	天坛生物	161,180	5,520,415.00	0.11
230	600872	中炬高新	131,300	5,517,226.00	0.11
231	600362	江西铜业	245,100	5,485,338.00	0.11
232	601111	中国国航	704,414	5,480,340.92	0.11
233	600383	金地集团	529,716	5,424,291.84	0.11
234	601800	中国交建	828,815	5,370,721.20	0.11
235	600115	中国东航	1,051,500	5,341,620.00	0.10
236	600845	宝信软件	104,920	5,340,428.00	0.10
237	300628	亿联网络	63,139	5,291,048.20	0.10
238	002508	老板电器	111,600	5,189,400.00	0.10
239	002916	深南电路	46,427	5,159,432.51	0.10
240	000860	顺鑫农业	121,700	5,133,306.00	0.10
241	600061	国投资本	602,449	5,114,792.01	0.10
242	601727	上海电气	1,206,190	5,114,245.60	0.10
243	601618	中国中冶	1,672,500	4,984,050.00	0.10
244	601162	天风证券	1,018,300	4,948,938.00	0.10
245	000708	中信特钢	236,600	4,930,744.00	0.10
246	002024	苏宁易购	881,100	4,925,349.00	0.10
247	601021	春秋航空	86,300	4,910,470.00	0.10
248	600705	中航资本	1,259,500	4,874,265.00	0.10
249	601878	浙商证券	365,700	4,783,356.00	0.09
250	688363	华熙生物	17,200	4,779,192.00	0.09
251	603939	益丰药房	84,070	4,715,486.30	0.09
252	600606	绿地控股	857,300	4,672,285.00	0.09
253	601990	南京证券	434,600	4,571,992.00	0.09
254	002456	欧菲光	506,100	4,494,168.00	0.09
255	002157	正邦科技	369,900	4,420,305.00	0.09
256	002463	沪电股份	284,100	4,395,027.00	0.09
257	600011	华能国际	1,031,200	4,351,664.00	0.09
258	000656	金科股份	749,464	4,339,396.56	0.09
259	600521	华海药业	204,900	4,278,312.00	0.08
260	601933	永辉超市	897,828	4,246,726.44	0.08
261	600655	豫园股份	364,400	4,223,396.00	0.08
262	603392	万泰生物	15,840	4,105,411.20	0.08
263	600118	中国卫星	139,300	4,075,918.00	0.08
264	601216	君正集团	797,300	4,058,257.00	0.08
265	601696	中银证券	196,400	4,043,876.00	0.08
266	600848	上海临港	224,060	4,010,674.00	0.08
267	600489	中金黄金	453,700	3,910,894.00	0.08

268	600018	上港集团	815,200	3,888,504.00	0.08
269	002558	巨人网络	284,100	3,778,530.00	0.07
270	601995	中金公司	61,300	3,769,950.00	0.07
271	603195	公牛集团	18,500	3,737,000.00	0.07
272	002120	韵达股份	271,660	3,675,559.80	0.07
273	601998	中信银行	720,100	3,672,510.00	0.07
274	601872	招商轮船	760,000	3,511,200.00	0.07
275	002673	西部证券	421,500	3,477,375.00	0.07
276	601319	中国人保	585,500	3,472,015.00	0.07
277	688009	中国通号	604,600	3,440,174.00	0.07
278	688126	沪硅产业	116,800	3,408,224.00	0.07
279	603338	浙江鼎力	57,100	3,351,199.00	0.07
280	002739	万达电影	210,800	3,328,532.00	0.07
281	601881	中国银河	302,004	3,255,603.12	0.06
282	603658	安图生物	41,650	3,155,820.50	0.06
283	600233	圆通速递	297,300	2,975,973.00	0.06
284	603233	大参林	55,100	2,816,161.00	0.06
285	600482	中国动力	153,100	2,667,002.00	0.05
286	601231	环旭电子	154,456	2,596,405.36	0.05
287	002153	石基信息	105,590	2,482,420.90	0.05
288	600025	华能水电	424,400	2,457,276.00	0.05
289	002032	苏泊尔	38,400	2,449,536.00	0.05
290	002939	长城证券	219,000	2,437,470.00	0.05
291	600340	华夏幸福	461,120	2,416,268.80	0.05
292	000800	一汽解放	219,100	2,370,662.00	0.05
293	601236	红塔证券	171,100	2,320,116.00	0.05
294	002773	康弘药业	87,396	2,021,469.48	0.04
295	601808	中海油服	139,700	2,006,092.00	0.04
296	600918	中泰证券	177,813	1,923,936.66	0.04
297	601698	中国卫通	102,400	1,657,856.00	0.03
298	603087	甘李药业	14,600	1,556,068.00	0.03
299	600299	安迪苏	92,700	1,108,692.00	0.02
300	002945	华林证券	64,400	890,008.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.02
2	688425	铁建重工	135,282	642,589.50	0.01
3	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
4	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
5	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
6	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
7	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
8	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
9	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
10	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
11	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
12	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
13	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
14	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
15	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
16	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
17	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
18	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
19	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
20	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
21	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
22	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
23	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
24	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
25	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
26	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
27	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
28	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
29	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
30	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
31	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
32	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
33	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
34	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
35	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
36	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
37	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
38	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
39	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

40	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
41	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
42	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
43	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
44	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
45	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
46	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	144,555,986.35	2.00
2	000333	美的集团	104,150,638.47	1.44
3	600519	贵州茅台	71,175,613.12	0.98
4	000651	格力电器	70,277,836.08	0.97
5	002415	海康威视	61,495,172.35	0.85
6	002714	牧原股份	54,440,379.91	0.75
7	300059	东方财富	54,362,964.77	0.75
8	000001	平安银行	53,136,880.27	0.73
9	000568	泸州老窖	51,578,770.60	0.71
10	000002	万科 A	49,750,136.51	0.69
11	000725	京东方 A	48,386,277.00	0.67
12	002475	立讯精密	46,520,897.95	0.64
13	300122	智飞生物	44,742,176.00	0.62
14	002594	比亚迪	40,839,457.91	0.56
15	000063	中兴通讯	36,390,857.10	0.50
16	002352	顺丰控股	36,156,390.04	0.50
17	300015	爱尔眼科	34,556,511.08	0.48
18	002142	宁波银行	31,516,906.88	0.44
19	000100	TCL 科技	30,013,765.00	0.41
20	300124	汇川技术	29,929,252.51	0.41

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	218,959,129.38	3.03
2	000333	美的集团	163,448,566.21	2.26
3	000651	格力电器	106,971,250.77	1.48
4	300059	东方财富	85,925,878.24	1.19
5	000001	平安银行	79,383,979.77	1.10
6	002415	海康威视	77,069,322.66	1.06
7	002714	牧原股份	75,820,328.71	1.05
8	000568	泸州老窖	75,253,897.41	1.04
9	000002	万科 A	74,366,302.40	1.03
10	002594	比亚迪	68,336,587.20	0.94
11	002475	立讯精密	68,241,682.86	0.94
12	000725	京东方 A	60,289,624.48	0.83
13	002352	顺丰控股	58,323,843.14	0.81
14	300122	智飞生物	50,613,799.60	0.70
15	000063	中兴通讯	46,864,737.97	0.65
16	000100	TCL 科技	44,888,685.72	0.62
17	300014	亿纬锂能	42,912,291.48	0.59
18	300124	汇川技术	42,729,872.54	0.59
19	300015	爱尔眼科	41,796,222.64	0.58
20	002142	宁波银行	40,353,712.75	0.56

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,701,200,888.25
卖出股票收入（成交）总额	3,462,934,460.94

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,663,748.62	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,663,748.62	0.07

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	27,350	2,735,000.00	0.05
2	127036	三花转债	2,938	384,848.62	0.01
3	127038	国微转债	2,709	270,900.00	0.01
4	113049	长汽转债	1,570	157,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	1,160	116,000.00	0.00

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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
IF2109	沪深 300 期货 2109 合约	36	55,797,120.00	1,004,520.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,004,520.00
股指期货投资本期收益（元）					13,803,498.06
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-7,412,763.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.10.2 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

兴业银行股份有限公司因同业投资用途不合规等原因在本报告编制前一年内受到福建银保监局的行政处罚，因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定在本报告编制前一年内受到中国人民银行福州中心支行的行政处罚，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等行为在本报告编制前一年内受到中国人民银行的行政处罚。

招商银行股份有限公司因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺等原因在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,428,874.07
2	应收证券清算款	1,377,926.40
3	应收股利	576,329.90
4	应收利息	216,221.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,599,351.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002415	海康威视	17,808,450.00	0.35	转融通证券出借
2	601166	兴业银行	17,662,725.00	0.35	转融通证券出借
3	601888	中国中免	17,225,740.00	0.34	转融通证券出借
4	600036	招商银行	14,929,345.00	0.29	转融通证券出借
5	601012	隆基股份	12,917,336.00	0.25	转融通证券出借
6	000858	五粮液	8,072,819.00	0.16	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688696	极米科技	976,860.48	0.02	新股锁定期流通受限
2	688425	铁建重工	642,589.50	0.01	新股锁定期流通受限
3	300957	贝泰妮	214,921.88	0.00	新股锁定期流通受限
4	688499	利元亨	83,488.65	0.00	网下新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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
2,652	357,051.21	941,781,179.00	99.46%	5,118,635.00	0.54%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
招商银行股份有限公司－泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	12,445,986.00	1.31%

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。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险有限责任公司－个人分红产品	628,349,466.00	66.36%
2	泰康人寿保险有限责任公司－传统保险产品	144,042,647.00	15.21%
3	泰康人寿保险有限责任公司－分红型保险产品	90,400,269.00	9.55%
4	广发证券股份有限公司	9,901,246.00	1.05%
5	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	9,429,000.00	1.00%
6	国泰君安证券股份有限公司	7,781,286.00	0.82%
7	华泰证券股份有限公司	5,428,800.00	0.57%
8	华融证券股份有限公司	4,000,000.00	0.42%
9	中信建投证券股份有限公司融券专用证券账户	3,880,000.00	0.41%
10	招商证券股份有限公司	3,613,097.00	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	12,445,986.00	1.31%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 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	1,360,899,814.00
本报告期基金总申购份额	853,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,267,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	946,899,814.00

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金“投资策略”补充基金运作过程中，如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整情形的处理

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	2,458,379,940.25	39.97%	642,384.71	39.39%	-
中信建投	4	1,914,424,847.13	31.12%	500,250.83	30.68%	-

中信证券	2	1,213,430,644.18	19.73%	332,656.59	20.40%	-
申万宏源	4	439,346,441.73	7.14%	120,418.64	7.38%	-
中金公司	2	47,565,840.00	0.77%	13,672.53	0.84%	-
光大证券	4	40,168,883.08	0.65%	10,998.54	0.67%	-
开源证券	2	37,593,247.03	0.61%	10,314.99	0.63%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	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 4 个交易单元，为光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	9,340,303.50	51.76%	-	-	-	-
申万宏源	8,705,335.62	48.24%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2021年1月21日
2	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招商银行招赢通为销售机构并参加其费	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;	2021年1月22日

	率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
3	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北京度小满基金销售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	2021年1月22日
4	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农业银行股份有限公司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	2021年1月29日
5	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中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《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	2021年2月8日
6	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招商银行招赢通为销售机构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	2021年3月2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新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《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	2021年3月12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新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年3月16日
9	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珠海盈米基金销售有限公司最低申购金额；追加申购最低金额；赎回最低份额和持有最低限额的公告	《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	2021年3月19日

		管理人网站	
10	泰康资产管理有限责任公司关于修订旗下指数基金法律文件的公告	《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	2021年3月30日
11	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光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《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	2021年4月26日
12	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“劳动节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《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	2021年4月27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济安财富（北京）基金销售有限公司最低申购金额；追加申购最低金额；赎回最低份额和持有最低限额的公告	《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	2021年4月30日
14	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上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年5月10日
15	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港佛诞日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《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	2021年5月17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新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年5月18日
17	关于泰康资产管理有限责任公司	《中国证券报》；《上	2021年5月21日

	旗下部分开放式基金开通在北京植信基金销售有限公司定投及转换业务并参加其费率优惠活动的公告	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	
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通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年6月8日
19	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“端午节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《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	2021年6月9日
20	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光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《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	2021年6月15日
21	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中泰证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《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	2021年6月17日
22	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上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年6月18日
23	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北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年6月28日
24	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港特别行政区成立纪念日”期间不开放	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；	2021年6月29日

	申购赎回等交易类业务的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
25	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手机银行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	2021年6月30日
26	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上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《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	2021年7月12日
27	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中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《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	2021年7月15日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101~20210630	808,033,466.00	-	179,684,000.00	628,349,466.00	66.36%
	2	20210101~20210208	305,254,747.00	-	161,212,100.00	144,042,647.00	15.21%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康沪深 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》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日