

泰康中证 500 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.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	65

§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	泰康 500
基金主代码	515530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 18 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	13,042,672.00 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 11 月 9 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。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。</p> <p>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。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。</p>
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证 500 指数，业绩比较基准为中证 500 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、

	<p>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	5,476,676.36
本期利润	6,280,749.39
加权平均基金份额本期利润	0.3520
本期加权平均净值利润率	10.75%
本期基金份额净值增长率	8.36%
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	3,709,343.50
期末可供分配基金份额利润	0.2844
期末基金资产净值	45,449,757.94
期末基金份额净值	3.4847
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	8.89%

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) 本基金合同生效日为2020年9月18日，截止报告期末本基金未满一年。

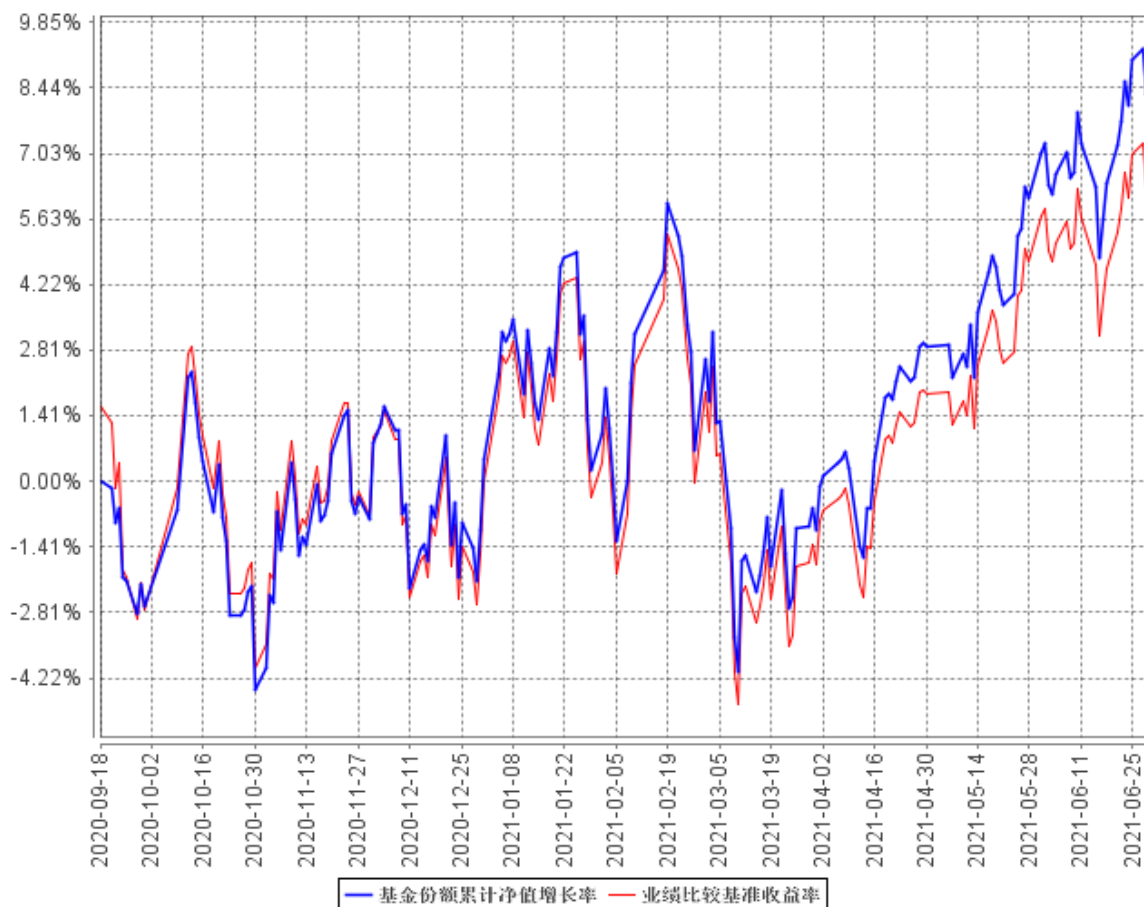
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.72%	0.73%	1.18%	0.73%	0.54%	0.00%
过去三个月	10.03%	0.68%	8.86%	0.68%	1.17%	0.00%
过去六个月	8.36%	0.99%	6.93%	0.99%	1.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.89%	1.02%	6.93%	1.05%	1.96%	-0.03%

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 2020 年 09 月 18 日生效，截止报告期末本基金未满一年。

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

§ 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	2020 年 9 月 18 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，中证 500 指数震荡回调，3 月中旬以后后市呈现出较强的成长风格，指数取得较好表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康中证 500ETF 基金份额净值为 3.4847 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.36%；同期业绩比较基准增长率为 6.93%。

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

本报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2021 年 6 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

§ 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：泰康中证 500 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	1,552,306.20	1,406,489.13
结算备付金		1,051,175.58	2,251,500.13
存出保证金		457,035.27	608,251.15
交易性金融资产	6.4.7.2	42,726,336.80	128,174,580.91
其中：股票投资		42,726,336.80	128,174,580.91
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		13,057.10	348,860.96
应收利息	6.4.7.5	733.46	1,469.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		45,800,644.41	132,791,151.92
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		2,464.30	77,974.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,574.60	46,082.98
应付托管费		1,696.85	5,760.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,683.72	74,665.57
应交税费		10,517.13	0.03

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	310,949.87	598,073.91
负债合计		350,886.47	802,557.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,740,414.44	131,348,709.72
未分配利润	6.4.7.10	3,709,343.50	639,885.10
所有者权益合计		45,449,757.94	131,988,594.82
负债和所有者权益总计		45,800,644.41	132,791,151.92

注：（1）报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.4847 元，基金份额总额 13,042,672.00 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：泰康中证 500 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
一、收入		6,746,944.31
1.利息收入		14,373.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,362.53
债券利息收入		11.39
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,604,725.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,805,575.74
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	9,567.74
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	427,145.63
股利收益	6.4.7.16	362,436.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	804,073.03
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	323,771.68
减:二、费用		466,194.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	117,659.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,707.45
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	155,812.74
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		1,537.74
7. 其他费用	6.4.7.20	176,477.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,280,749.39
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,280,749.39

注: 本基金合同生效日为 2020 年 9 月 18 日, 无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泰康中证 500 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)	131,348,709.72	639,885.10	131,988,594.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,280,749.39	6,280,749.39
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)	-89,608,295.28	-3,211,290.99	-92,819,586.27
其中: 1. 基金申购款	64,005,925.22	1,403,479.25	65,409,404.47
2. 基金赎回款	-153,614,220.50	-4,614,770.24	-158,228,990.74
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）	41,740,414.44	3,709,343.50	45,449,757.94

注：本基金合同生效日为 2020 年 9 月 18 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 段国圣	_____ 金志刚	_____ 李俊佑
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康中证 500 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[2020]1284 号《关于准予泰康中证 500 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《泰康中证 500 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 243,998,555.00 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 2000722 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 243,999,138.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 583.00 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《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康中证 500 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《关于泰康中证 500 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 10 月 15 日为折算日，进行了基金份额折算，折算前基金份额总额为 243,999,138.00 份，折算后基金份额总额为 76,242,672.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]357 号核准，本基金 76,242,672.00 份基金份额于 2020 年 11 月 9 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《泰康中证 500 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、政府支持机构债券、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:中证 500 指数收益率。

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》、《泰康中证 500 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	1,552,306.20
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：	1,552,306.20

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	41,224,711.09	42,726,336.80	1,501,625.71
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	41,224,711.09	42,726,336.80	1,501,625.71

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			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,605,920.00	-	-	
-股指期货	2,605,920.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,605,920.00	-	-	

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
IC2109	中证500期货2109 合约	2	2,666,800.00	60,880.00
总额合计				60,880.00
减：可抵销期货暂收款				60,880.00
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	152.24
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	543.62
应收债券利息	-
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	-
其他	37.60
合计	733.46

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	11,683.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,683.72

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	104,138.35
指数使用费	35,000.00

可退替代款	-
应付替代款	171,811.52
合计	310,949.87

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	41,042,672.00	131,348,709.72
本期申购	20,000,000.00	64,005,925.22
本期赎回(以“-”号填列)	-48,000,000.00	-153,614,220.50
- 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	13,042,672.00	41,740,414.44

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	-104,988.63	744,873.73	639,885.10
本期利润	5,476,676.36	804,073.03	6,280,749.39
本期基金份额交易产生的变动数	-1,359,233.57	-1,852,057.42	-3,211,290.99
其中：基金申购款	2,542,875.64	-1,139,396.39	1,403,479.25
基金赎回款	-3,902,109.21	-712,661.03	-4,614,770.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,012,454.16	-303,110.66	3,709,343.50

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	2,623.40
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	10,760.79
其他	978.34
合计	14,362.53

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	2,710,352.37
股票投资收益——赎回差价收入	2,095,223.37
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	4,805,575.74

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	101,439,728.28
减：卖出股票成本总额	98,729,375.91
买卖股票差价收入	2,710,352.37

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	158,228,990.74
减：现金支付赎回款总额	86,549,872.74
减：赎回股票成本总额	69,583,894.63
赎回差价收入	2,095,223.37

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	9,567.74
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	9,567.74

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	164,383.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	154,739.09
减：应收利息总额	76.56
买卖债券差价收入	9,567.74

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	427,145.63

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	362,436.57

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	362,436.57

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	864,673.03
——股票投资	864,673.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-60,600.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-60,600.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	804,073.03

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	323,771.68
合计	323,771.68

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	155,812.74
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	155,812.74

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	19,835.79
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	70,000.00
银行费用	2,338.97
合计	176,477.32

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

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，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
当期发生的基金应支付的管理费	117,659.67
其中：支付销售机构的客户维护费	932.86

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
当期发生的基金应支付的托管费	14,707.45

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，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，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，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**

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金份额。

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

本报告期末及上年度末，本基金管理人之外的其他关联方未运用自有资金投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,552,306.20	2,623.40

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。

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，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

本报告期，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
600460	士兰微	2021年6月30日	临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	5,500	175,109.03	309,925.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	临时停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	20,700	72,035.87	63,135.00	-

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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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	1,552,306.20	-	-	-	1,552,306.20
结算备付金	1,051,175.58	-	-	-	1,051,175.58
存出保证金	83,683.27	-	-	373,352.00	457,035.27

交易性金融资产	-	-	-	42,726,336.80	42,726,336.80
应收证券清算款	-	-	-	13,057.10	13,057.10
应收利息	-	-	-	733.46	733.46
资产总计	2,687,165.05	-	-	43,113,479.36	45,800,644.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	62,147.83	62,147.83
应付管理人报酬	-	-	-	13,574.60	13,574.60
应付托管费	-	-	-	1,696.85	1,696.85
应付交易费用	-	-	-	11,683.72	11,683.72
应交税费	-	-	-	10,517.13	10,517.13
其他负债	-	-	-	251,266.34	251,266.34
负债总计	-	-	-	350,886.47	350,886.47
利率敏感度缺口	2,687,165.05	-	-	42,762,592.89	45,449,757.94
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	1,406,489.13	-	-	-	1,406,489.13
结算备付金	2,251,500.13	-	-	-	2,251,500.13
存出保证金	83,133.55	-	-	525,117.60	608,251.15
交易性金融资产	-	-	-	128,174,580.91	128,174,580.91
应收证券清算款	-	-	-	348,860.96	348,860.96
应收利息	-	-	-	1,469.64	1,469.64
资产总计	3,741,122.81	-	-	129,050,029.11	132,791,151.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	77,974.24	77,974.24
应付管理人报酬	-	-	-	46,082.98	46,082.98
应付托管费	-	-	-	5,760.37	5,760.37
应付交易费用	-	-	-	74,665.57	74,665.57
应交税费	-	-	-	0.03	0.03
其他负债	-	-	-	598,073.91	598,073.91
负债总计	-	-	-	802,557.10	802,557.10
利率敏感度缺口	3,741,122.81	-	-	128,247,472.01	131,988,594.82

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%	0.00	0.00
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金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	42,726,336.80	94.01	128,174,580.91	97.11
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	42,726,336.80	94.01	128,174,580.91	97.11

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%	1,331,098.79	6,598,392.05
业绩比较基准中的权益指数 下降 5%	-1,331,098.79	-6,598,392.05	

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 42,353,276.80 元，属于第二层次的余额为 373,060.00 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 127,926,593.12 元，第二层次 247,987.79 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 65,409,404.47 元，其中包括以股票支付的申购款 29,430,421.00 元和以现金支付的申购款 35,978,983.47 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	42,726,336.80	93.29
	其中：股票	42,726,336.80	93.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,603,481.78	5.68
8	其他各项资产	470,825.83	1.03
9	合计	45,800,644.41	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 0.00 元，占期末资产净值比例为 0.00%

（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	420,117.00	0.92
B	采矿业	1,487,931.20	3.27
C	制造业	27,044,704.75	59.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,032,447.91	2.27
E	建筑业	789,829.00	1.74
F	批发和零售业	1,454,919.00	3.20
G	交通运输、仓储和邮政业	827,561.60	1.82
H	住宿和餐饮业	231,580.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,553,076.34	7.82

J	金融业	2,501,816.60	5.50
K	房地产业	1,397,280.00	3.07
L	租赁和商务服务业	563,903.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	112,352.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	361,521.00	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27,366.40	0.06
Q	卫生和社会工作	114,900.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	429,026.00	0.94
S	综合	376,005.00	0.83
	合计	42,726,336.80	94.01

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

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	002709	天赐材料	4,000	426,320.00	0.94
2	000799	酒鬼酒	1,600	408,960.00	0.90
3	603486	科沃斯	1,600	364,928.00	0.80
4	600089	特变电工	25,900	332,815.00	0.73
5	000009	中国宝安	18,000	328,860.00	0.72
6	002340	格林美	33,400	312,290.00	0.69
7	600460	士兰微	5,500	309,925.00	0.68
8	002074	国轩高科	7,100	309,276.00	0.68
9	300285	国瓷材料	5,600	273,000.00	0.60
10	601233	桐昆股份	11,200	269,808.00	0.59
11	300207	欣旺达	7,700	250,712.00	0.55
12	002185	华天科技	15,300	235,467.00	0.52
13	300316	晶盛机电	4,500	227,250.00	0.50
14	600885	宏发股份	3,600	225,720.00	0.50
15	601636	旗滨集团	11,300	209,728.00	0.46

16	600733	北汽蓝谷	14,900	200,852.00	0.44
17	300037	新宙邦	2,000	200,200.00	0.44
18	300146	汤臣倍健	5,900	194,110.00	0.43
19	300253	卫宁健康	11,900	193,613.00	0.43
20	603737	三棵树	1,080	190,080.00	0.42
21	002625	光启技术	9,010	187,498.10	0.41
22	002223	鱼跃医疗	4,900	186,837.00	0.41
23	600884	杉杉股份	8,000	186,560.00	0.41
24	002648	卫星石化	4,740	185,760.60	0.41
25	601127	小康股份	2,700	180,009.00	0.40
26	600219	南山铝业	50,000	180,000.00	0.40
27	002353	杰瑞股份	4,000	178,800.00	0.39
28	600779	水井坊	1,400	176,890.00	0.39
29	002138	顺络电子	4,500	174,465.00	0.38
30	000547	航天发展	9,000	169,830.00	0.37
31	688002	睿创微纳	1,700	169,711.00	0.37
32	603589	口子窖	2,500	169,225.00	0.37
33	688099	晶晨股份	1,500	168,300.00	0.37
34	002797	第一创业	23,500	167,790.00	0.37
35	603893	瑞芯微	1,200	167,352.00	0.37
36	300699	光威复材	2,200	167,090.00	0.37
37	600704	物产中大	21,200	166,844.00	0.37
38	000988	华工科技	7,000	164,640.00	0.36
39	002444	巨星科技	4,800	163,584.00	0.36
40	002212	天融信	8,242	162,944.34	0.36
41	601099	太平洋	47,600	161,364.00	0.36
42	002422	科伦药业	8,000	159,600.00	0.35
43	603444	吉比特	300	159,000.00	0.35
44	601168	西部矿业	13,300	158,669.00	0.35
45	002385	大北农	23,050	156,740.00	0.34
46	600739	辽宁成大	7,500	156,075.00	0.34
47	000807	云铝股份	13,100	155,890.00	0.34
48	000961	中南建设	26,200	155,104.00	0.34
49	300308	中际旭创	4,000	154,080.00	0.34
50	000636	风华高科	5,000	151,100.00	0.33
51	002439	启明星辰	5,200	150,852.00	0.33
52	600862	中航高科	4,900	150,822.00	0.33
53	601117	中国化学	17,200	150,672.00	0.33
54	000830	鲁西化工	8,000	149,840.00	0.33

55	600392	盛和资源	8,600	149,296.00	0.33
56	600754	锦江酒店	2,600	148,070.00	0.33
57	002078	太阳纸业	11,000	146,850.00	0.32
58	002030	达安基因	6,860	145,706.40	0.32
59	600699	均胜电子	5,700	145,464.00	0.32
60	600486	扬农化工	1,300	145,301.00	0.32
61	002250	联化科技	5,200	145,080.00	0.32
62	002180	纳思达	4,500	144,900.00	0.32
63	600068	葛洲坝	19,300	144,557.00	0.32
64	600315	上海家化	2,400	144,336.00	0.32
65	600563	法拉电子	900	142,524.00	0.31
66	300088	长信科技	17,100	141,246.00	0.31
67	000630	铜陵有色	51,400	139,808.00	0.31
68	002507	涪陵榨菜	3,700	139,342.00	0.31
69	603605	珀莱雅	700	137,697.00	0.30
70	002013	中航机电	13,600	136,952.00	0.30
71	600201	生物股份	7,847	136,930.15	0.30
72	000039	中集集团	7,400	134,532.00	0.30
73	002075	沙钢股份	12,300	134,193.00	0.30
74	002127	南极电商	13,700	133,849.00	0.29
75	300001	特锐德	4,400	132,484.00	0.29
76	300223	北京君正	1,300	131,196.00	0.29
77	000513	丽珠集团	2,600	130,052.00	0.29
78	002028	思源电气	4,200	129,318.00	0.28
79	600177	雅戈尔	19,400	127,846.00	0.28
80	601997	贵阳银行	17,800	127,448.00	0.28
81	002511	中顺洁柔	4,600	126,730.00	0.28
82	601005	重庆钢铁	46,900	125,223.00	0.28
83	002273	水晶光电	8,500	124,865.00	0.27
84	000021	深科技	6,500	124,410.00	0.27
85	002299	圣农发展	5,200	124,176.00	0.27
86	002092	中泰化学	12,000	123,240.00	0.27
87	002080	中材科技	4,700	122,999.00	0.27
88	600549	厦门钨业	5,900	122,897.00	0.27
89	002603	以岭药业	4,200	122,472.00	0.27
90	002465	海格通信	12,900	122,034.00	0.27
91	000050	深天马 A	8,600	121,948.00	0.27
92	600171	上海贝岭	4,000	121,720.00	0.27
93	600988	赤峰黄金	8,100	121,419.00	0.27

94	300168	万达信息	8,300	121,180.00	0.27
95	000739	普洛药业	4,100	120,540.00	0.27
96	600536	中国软件	2,100	119,553.00	0.26
97	600867	通化东宝	10,000	119,400.00	0.26
98	300009	安科生物	8,000	119,200.00	0.26
99	000825	太钢不锈	15,900	119,091.00	0.26
100	600516	方大炭素	16,000	119,040.00	0.26
101	300482	万孚生物	1,840	119,029.60	0.26
102	000983	山西焦煤	14,300	118,833.00	0.26
103	000998	隆平高科	7,400	118,696.00	0.26
104	600066	宇通客车	9,500	118,655.00	0.26
105	601128	常熟银行	19,100	118,420.00	0.26
106	300618	寒锐钴业	1,500	118,260.00	0.26
107	600637	东方明珠	14,300	117,117.00	0.26
108	601689	拓普集团	3,100	116,033.00	0.26
109	600316	洪都航空	3,000	115,440.00	0.25
110	300244	迪安诊断	3,000	114,900.00	0.25
111	600418	江淮汽车	9,200	114,356.00	0.25
112	600879	航天电子	15,200	114,304.00	0.25
113	300463	迈克生物	2,700	113,643.00	0.25
114	002152	广电运通	8,700	113,361.00	0.25
115	688208	道通科技	1,300	113,087.00	0.25
116	600369	西南证券	23,200	112,984.00	0.25
117	600487	亨通光电	9,900	112,860.00	0.25
118	600827	百联股份	5,600	112,840.00	0.25
119	000750	国海证券	26,600	112,784.00	0.25
120	000932	华菱钢铁	17,088	112,780.80	0.25
121	000723	美锦能源	14,900	112,644.00	0.25
122	300070	碧水源	15,400	112,574.00	0.25
123	000960	锡业股份	7,000	112,210.00	0.25
124	600529	山东药玻	3,300	112,035.00	0.25
125	300357	我武生物	1,743	111,761.16	0.25
126	300271	华宇软件	5,800	111,650.00	0.25
127	600380	健康元	8,115	111,418.95	0.25
128	300296	利亚德	14,200	111,044.00	0.24
129	600166	福田汽车	32,100	110,745.00	0.24
130	002156	通富微电	4,600	110,584.00	0.24
131	000975	银泰黄金	11,620	110,506.20	0.24
132	600038	中直股份	2,090	110,226.60	0.24

133	002373	千方科技	6,600	110,220.00	0.24
134	002131	利欧股份	47,100	110,214.00	0.24
135	601615	明阳智能	6,800	110,092.00	0.24
136	600909	华安证券	19,660	109,506.20	0.24
137	002572	索菲亚	4,500	108,900.00	0.24
138	300383	光环新网	7,500	107,925.00	0.24
139	002690	美亚光电	1,900	105,944.00	0.23
140	002926	华西证券	11,000	105,930.00	0.23
141	600642	申能股份	17,200	105,608.00	0.23
142	601198	东兴证券	9,600	104,928.00	0.23
143	002065	东华软件	13,100	103,883.00	0.23
144	601866	中远海发	27,700	103,875.00	0.23
145	300115	长盈精密	5,040	103,824.00	0.23
146	002294	信立泰	3,100	101,990.00	0.22
147	600271	航天信息	7,800	101,634.00	0.22
148	002500	山西证券	15,100	101,321.00	0.22
149	000623	吉林敖东	6,500	100,685.00	0.22
150	603638	艾迪精密	2,340	100,315.80	0.22
151	603156	养元饮品	3,500	100,030.00	0.22
152	600998	九州通	6,500	99,905.00	0.22
153	600895	张江高科	5,400	98,658.00	0.22
154	600415	小商品城	19,100	98,365.00	0.22
155	000012	南玻 A	9,600	98,304.00	0.22
156	601699	潞安环能	8,300	98,023.00	0.22
157	300474	景嘉微	1,000	97,920.00	0.22
158	600153	建发股份	12,000	97,200.00	0.21
159	603290	斯达半导	300	96,000.00	0.21
160	600188	兖州煤业	6,200	95,232.00	0.21
161	300630	普利制药	1,800	94,320.00	0.21
162	600256	广汇能源	28,300	94,239.00	0.21
163	600707	彩虹股份	10,000	94,100.00	0.21
164	600390	五矿资本	15,700	93,886.00	0.21
165	600667	太极实业	10,300	93,730.00	0.21
166	300418	昆仑万维	5,700	93,366.00	0.21
167	600535	天士力	6,300	93,303.00	0.21
168	300024	机器人	8,728	93,127.76	0.20
169	600060	海信视像	5,500	92,950.00	0.20
170	002372	伟星新材	4,487	92,746.29	0.20
171	600008	首创环保	30,700	92,407.00	0.20

172	002670	国盛金控	8,100	92,259.00	0.20
173	600497	驰宏锌锗	21,300	91,803.00	0.20
174	002382	蓝帆医疗	4,400	91,740.00	0.20
175	000027	深圳能源	10,000	91,700.00	0.20
176	600208	新湖中宝	30,000	91,200.00	0.20
177	000878	云南铜业	7,100	91,093.00	0.20
178	600155	华创阳安	8,500	90,950.00	0.20
179	002557	洽洽食品	2,100	90,510.00	0.20
180	603858	步长制药	4,000	89,960.00	0.20
181	002019	亿帆医药	5,200	89,700.00	0.20
182	600372	中航电子	5,400	89,370.00	0.20
183	002390	信邦制药	8,500	89,080.00	0.20
184	002221	东华能源	8,100	88,695.00	0.20
185	300251	光线传媒	8,200	88,642.00	0.20
186	600141	兴发集团	4,700	88,501.00	0.19
187	600765	中航重机	3,900	88,335.00	0.19
188	600409	三友化工	8,700	87,957.00	0.19
189	000718	苏宁环球	10,600	87,874.00	0.19
190	002174	游族网络	5,100	87,567.00	0.19
191	600498	烽火通信	4,700	87,561.00	0.19
192	002683	宏大爆破	3,100	86,087.00	0.19
193	600511	国药股份	2,600	85,956.00	0.19
194	600170	上海建工	31,100	85,836.00	0.19
195	002146	荣盛发展	15,200	85,728.00	0.19
196	002506	协鑫集成	24,600	85,608.00	0.19
197	600875	东方电气	7,800	85,566.00	0.19
198	002966	苏州银行	11,600	85,260.00	0.19
199	000401	冀东水泥	6,900	85,215.00	0.19
200	601717	郑煤机	7,300	84,899.00	0.19
201	000997	新大陆	5,100	84,609.00	0.19
202	603260	合盛硅业	1,100	84,601.00	0.19
203	300058	蓝色光标	13,900	84,095.00	0.19
204	688088	虹软科技	1,500	83,625.00	0.18
205	600258	首旅酒店	3,500	83,510.00	0.18
206	603707	健友股份	2,000	83,500.00	0.18
207	000738	航发控制	4,000	83,320.00	0.18
208	002408	齐翔腾达	6,700	83,214.00	0.18
209	688321	微芯生物	1,800	83,142.00	0.18
210	600160	巨化股份	9,400	83,096.00	0.18

211	002958	青农商行	19,400	83,032.00	0.18
212	603866	桃李面包	2,660	82,992.00	0.18
213	000686	东北证券	9,800	82,810.00	0.18
214	600801	华新水泥	4,700	82,579.00	0.18
215	300315	掌趣科技	19,200	81,600.00	0.18
216	600663	陆家嘴	6,100	81,252.00	0.18
217	002195	二三四五	39,900	80,997.00	0.18
218	300017	网宿科技	13,700	80,145.00	0.18
219	000540	中天金融	29,300	79,989.00	0.18
220	002268	卫士通	4,100	79,868.00	0.18
221	600325	华发股份	11,800	79,532.00	0.17
222	603712	七一二	2,200	79,420.00	0.17
223	600732	爱旭股份	5,700	79,344.00	0.17
224	603225	新凤鸣	3,900	79,170.00	0.17
225	000060	中金岭南	17,500	79,100.00	0.17
226	601992	金隅集团	29,100	78,279.00	0.17
227	601016	节能风电	20,900	78,166.00	0.17
228	600027	华电国际	22,700	78,088.00	0.17
229	600859	王府井	2,700	77,976.00	0.17
230	600567	山鹰国际	22,500	77,625.00	0.17
231	603927	中科软	1,800	77,310.00	0.17
232	002831	裕同科技	2,600	77,194.00	0.17
233	000158	常山北明	6,700	76,983.00	0.17
234	603077	和邦生物	36,900	76,752.00	0.17
235	600282	南钢股份	21,500	76,540.00	0.17
236	002429	兆驰股份	12,600	76,482.00	0.17
237	002595	豪迈科技	2,861	76,388.70	0.17
238	600500	中化国际	9,700	76,242.00	0.17
239	002191	劲嘉股份	7,100	75,544.00	0.17
240	600216	浙江医药	4,712	75,439.12	0.17
241	002056	横店东磁	5,800	75,400.00	0.17
242	300212	易华录	2,800	75,348.00	0.17
243	600528	中铁工业	9,300	75,330.00	0.17
244	603198	迎驾贡酒	1,700	75,310.00	0.17
245	601577	长沙银行	8,400	75,096.00	0.17
246	600737	中粮糖业	7,500	75,075.00	0.17
247	600598	北大荒	5,000	74,800.00	0.16
248	600839	四川长虹	25,700	74,787.00	0.16
249	002081	金螳螂	9,400	74,448.00	0.16

250	000898	鞍钢股份	16,700	74,315.00	0.16
251	603883	老百姓	1,400	73,752.00	0.16
252	600580	卧龙电驱	5,500	73,150.00	0.16
253	000709	河钢股份	29,700	73,062.00	0.16
254	000581	威孚高科	3,500	72,905.00	0.16
255	600728	佳都科技	9,800	72,618.00	0.16
256	002203	海亮股份	6,800	72,352.00	0.16
257	000999	华润三九	2,700	72,225.00	0.16
258	002124	天邦股份	10,280	72,062.80	0.16
259	300182	捷成股份	14,300	71,357.00	0.16
260	002281	光迅科技	2,900	71,340.00	0.16
261	600808	马钢股份	16,600	71,214.00	0.16
262	000729	燕京啤酒	9,800	70,952.00	0.16
263	002010	传化智联	9,200	70,932.00	0.16
264	002396	星网锐捷	3,300	70,455.00	0.16
265	000930	中粮科技	7,800	70,278.00	0.15
266	000488	晨鸣纸业	8,600	70,004.00	0.15
267	002387	维信诺	6,700	69,881.00	0.15
268	600820	隧道股份	13,200	69,828.00	0.15
269	002745	木林森	5,200	69,680.00	0.15
270	300166	东方国信	5,600	69,216.00	0.15
271	002004	华邦健康	11,100	68,931.00	0.15
272	000629	攀钢钒钛	30,000	68,700.00	0.15
273	002242	九阳股份	2,112	68,618.88	0.15
274	002048	宁波华翔	3,500	68,250.00	0.15
275	600755	厦门国贸	8,200	67,322.00	0.15
276	603000	人民网	3,900	67,041.00	0.15
277	600970	中材国际	7,300	66,941.00	0.15
278	002563	森马服饰	5,600	66,920.00	0.15
279	300002	神州泰岳	13,700	66,445.00	0.15
280	600803	新奥股份	4,000	66,040.00	0.15
281	600022	山东钢铁	38,100	65,532.00	0.14
282	600037	歌华有线	6,800	65,348.00	0.14
283	600398	海澜之家	9,000	65,160.00	0.14
284	000598	兴蓉环境	12,500	65,125.00	0.14
285	601106	中国一重	19,200	65,088.00	0.14
286	600881	亚泰集团	22,600	64,410.00	0.14
287	002925	盈趣科技	1,640	63,812.40	0.14
288	002002	鸿达兴业	16,100	63,273.00	0.14

289	601456	国联证券	4,100	63,140.00	0.14
290	600811	东方集团	20,700	63,135.00	0.14
291	600039	四川路桥	10,000	62,700.00	0.14
292	603885	吉祥航空	4,100	62,566.00	0.14
293	000883	湖北能源	13,600	62,424.00	0.14
294	601880	辽港股份	36,500	62,415.00	0.14
295	688029	南微医学	200	62,338.00	0.14
296	600348	华阳股份	8,400	62,328.00	0.14
297	000778	新兴铸管	16,700	62,124.00	0.14
298	600597	光明乳业	4,300	61,963.00	0.14
299	600782	新钢股份	11,100	61,938.00	0.14
300	000690	宝新能源	12,100	61,831.00	0.14
301	000887	中鼎股份	5,100	61,608.00	0.14
302	002867	周大生	3,100	61,287.00	0.13
303	600260	凯乐科技	6,900	61,272.00	0.13
304	002249	大洋电机	11,600	60,900.00	0.13
305	002701	奥瑞金	11,800	60,652.00	0.13
306	601118	海南橡胶	11,900	60,571.00	0.13
307	600126	杭钢股份	11,800	60,534.00	0.13
308	002705	新宝股份	2,300	60,375.00	0.13
309	600908	无锡银行	10,400	60,320.00	0.13
310	600410	华胜天成	7,700	59,752.00	0.13
311	600967	内蒙一机	5,900	59,708.00	0.13
312	600026	中远海能	9,690	59,690.40	0.13
313	600645	中源协和	2,600	59,670.00	0.13
314	600718	东软集团	6,100	59,658.00	0.13
315	002183	怡亚通	10,400	59,592.00	0.13
316	002085	万丰奥威	10,600	59,360.00	0.13
317	603568	伟明环保	2,600	59,358.00	0.13
318	601179	中国西电	14,400	59,328.00	0.13
319	000528	柳工	7,200	59,040.00	0.13
320	600985	淮北矿业	4,800	58,608.00	0.13
321	002110	三钢闽光	8,600	57,964.00	0.13
322	600572	康恩贝	13,000	57,720.00	0.13
323	603650	彤程新材	1,200	57,720.00	0.13
324	000877	天山股份	4,400	57,332.00	0.13
325	600167	联美控股	6,400	57,152.00	0.13
326	002985	北摩高科	580	56,550.00	0.12
327	000970	中科三环	5,900	56,345.00	0.12

328	600446	金证股份	3,900	56,316.00	0.12
329	601200	上海环境	4,700	56,259.00	0.12
330	300072	三聚环保	9,800	56,252.00	0.12
331	002128	露天煤业	5,400	56,214.00	0.12
332	600329	中新药业	2,000	56,180.00	0.12
333	002368	太极股份	2,800	56,168.00	0.12
334	000402	金融街	8,300	56,025.00	0.12
335	000990	诚志股份	4,400	56,012.00	0.12
336	000089	深圳机场	7,200	55,944.00	0.12
337	002266	浙富控股	11,200	55,888.00	0.12
338	600064	南京高科	6,000	55,740.00	0.12
339	601598	中国外运	11,000	55,550.00	0.12
340	600517	国网英大	8,000	54,480.00	0.12
341	600158	中体产业	4,700	53,627.00	0.12
342	300026	红日药业	12,600	53,550.00	0.12
343	000400	许继电气	4,200	53,172.00	0.12
344	003035	南网能源	5,300	52,682.00	0.12
345	000519	中兵红箭	4,900	52,528.00	0.12
346	600120	浙江东方	12,130	51,916.40	0.11
347	601718	际华集团	18,300	51,606.00	0.11
348	601975	招商南油	24,100	51,574.00	0.11
349	001914	招商积余	3,000	51,540.00	0.11
350	300376	易事特	6,400	51,456.00	0.11
351	600195	中牧股份	4,300	51,428.00	0.11
352	002233	塔牌集团	5,000	51,400.00	0.11
353	000959	首钢股份	9,100	51,142.00	0.11
354	600507	方大特钢	7,500	50,850.00	0.11
355	000685	中山公用	6,200	50,592.00	0.11
356	600307	酒钢宏兴	21,800	50,576.00	0.11
357	600376	首开股份	9,000	50,400.00	0.11
358	000090	天健集团	9,100	50,323.00	0.11
359	601333	广深铁路	23,700	50,244.00	0.11
360	002505	鹏都农牧	22,200	49,728.00	0.11
361	601000	唐山港	20,600	49,646.00	0.11
362	002440	闰土股份	5,600	49,560.00	0.11
363	600435	北方导航	6,200	49,228.00	0.11
364	000559	万向钱潮	9,200	48,852.00	0.11
365	002839	张家港行	8,900	48,416.00	0.11
366	600804	鹏博士	10,000	48,400.00	0.11

367	600643	爱建集团	6,800	47,464.00	0.10
368	300133	华策影视	8,000	47,360.00	0.10
369	603228	景旺电子	1,800	47,160.00	0.10
370	600673	东阳光	10,500	47,145.00	0.10
371	601860	紫金银行	12,800	46,464.00	0.10
372	600373	中文传媒	4,700	46,342.00	0.10
373	601991	大唐发电	17,400	45,936.00	0.10
374	002155	湖南黄金	5,900	45,725.00	0.10
375	300741	华宝股份	900	45,648.00	0.10
376	000758	中色股份	9,600	45,600.00	0.10
377	000967	盈峰环境	6,600	45,342.00	0.10
378	002038	双鹭药业	4,300	45,279.00	0.10
379	601608	中信重工	12,100	45,254.00	0.10
380	002936	郑州银行	12,300	45,141.00	0.10
381	600266	城建发展	9,500	45,030.00	0.10
382	600056	中国医药	3,700	44,955.00	0.10
383	600582	天地科技	11,500	44,850.00	0.10
384	000563	陕国投 A	13,900	44,758.00	0.10
385	600388	龙净环保	5,200	44,304.00	0.10
386	601098	中南传媒	5,000	44,100.00	0.10
387	601958	金钼股份	6,800	44,064.00	0.10
388	300113	顺网科技	3,400	43,996.00	0.10
389	000681	视觉中国	3,400	43,962.00	0.10
390	600259	广晟有色	1,300	43,953.00	0.10
391	600131	国网信通	3,300	43,692.00	0.10
392	600928	西安银行	9,300	43,338.00	0.10
393	600095	湘财股份	3,700	43,327.00	0.10
394	600901	江苏租赁	8,300	43,160.00	0.09
395	002416	爱施德	4,300	43,129.00	0.09
396	003022	联泓新科	1,400	42,980.00	0.09
397	600062	华润双鹤	3,600	42,876.00	0.09
398	600959	江苏有线	14,000	42,700.00	0.09
399	300180	华峰超纤	8,600	42,570.00	0.09
400	600764	中国海防	1,500	42,450.00	0.09
401	600094	大名城	11,200	42,224.00	0.09
402	600649	城投控股	8,800	41,888.00	0.09
403	002458	益生股份	4,200	41,874.00	0.09
404	000415	渤海租赁	17,300	41,866.00	0.09
405	002399	海普瑞	2,600	41,418.00	0.09

406	600776	东方通信	3,319	41,155.60	0.09
407	600006	东风汽车	5,600	40,880.00	0.09
408	300257	开山股份	2,800	40,236.00	0.09
409	600556	天下秀	3,800	40,128.00	0.09
410	600717	天津港	10,160	39,827.20	0.09
411	601611	中国核建	5,500	39,710.00	0.09
412	600633	浙数文化	5,500	39,490.00	0.09
413	600546	山煤国际	5,500	39,490.00	0.09
414	000717	韶钢松山	8,500	39,015.00	0.09
415	002317	众生药业	4,500	38,745.00	0.09
416	600729	重庆百货	1,400	38,430.00	0.08
417	600648	外高桥	2,600	38,428.00	0.08
418	002434	万里扬	4,700	38,117.00	0.08
419	601928	凤凰传媒	5,300	37,842.00	0.08
420	000028	国药一致	1,000	37,840.00	0.08
421	600863	内蒙华电	16,200	37,746.00	0.08
422	000078	海王生物	11,500	37,490.00	0.08
423	000501	鄂武商 A	3,200	37,440.00	0.08
424	603355	莱克电气	600	37,338.00	0.08
425	600021	上海电力	5,401	37,320.91	0.08
426	002375	亚厦股份	4,700	37,224.00	0.08
427	000062	深圳华强	2,200	37,202.00	0.08
428	601828	美凯龙	3,100	37,200.00	0.08
429	600968	海油发展	14,100	36,519.00	0.08
430	002244	滨江集团	8,700	36,453.00	0.08
431	002424	贵州百灵	4,900	36,064.00	0.08
432	600835	上海机电	2,200	35,750.00	0.08
433	605358	立昂微	300	34,674.00	0.08
434	600623	华谊集团	3,900	34,359.00	0.08
435	600377	宁沪高速	3,500	34,160.00	0.08
436	000869	张裕 A	900	33,426.00	0.07
437	600312	平高电气	5,700	33,288.00	0.07
438	600339	中油工程	11,700	33,228.00	0.07
439	600787	中储股份	6,200	33,046.00	0.07
440	002468	申通快递	4,300	32,766.00	0.07
441	002583	海能达	6,500	32,760.00	0.07
442	600639	浦东金桥	2,400	32,760.00	0.07
443	000031	大悦城	9,000	32,400.00	0.07
444	600566	济川药业	1,800	32,220.00	0.07

445	000826	启迪环境	6,000	32,100.00	0.07
446	600823	世茂股份	7,900	31,916.00	0.07
447	601778	晶科科技	5,800	31,668.00	0.07
448	601969	海南矿业	2,700	31,401.00	0.07
449	002815	崇达技术	2,500	31,200.00	0.07
450	600466	蓝光发展	10,500	30,975.00	0.07
451	601298	青岛港	4,900	30,282.00	0.07
452	603317	天味食品	1,028	30,254.04	0.07
453	002532	天山铝业	3,600	30,204.00	0.07
454	000156	华数传媒	3,900	30,069.00	0.07
455	603888	新华网	1,400	29,638.00	0.07
456	603708	家家悦	1,700	29,529.00	0.06
457	002635	安洁科技	2,000	29,260.00	0.06
458	000937	冀中能源	7,400	29,082.00	0.06
459	000553	安道麦 A	3,100	28,737.00	0.06
460	000813	德展健康	6,300	28,602.00	0.06
461	002948	青岛银行	5,700	28,329.00	0.06
462	300010	豆神教育	4,900	27,783.00	0.06
463	601228	广州港	8,700	27,666.00	0.06
464	002302	西部建设	3,500	27,650.00	0.06
465	603377	东方时尚	2,560	27,366.40	0.06
466	001872	招商港口	1,600	27,072.00	0.06
467	600350	山东高速	4,400	27,060.00	0.06
468	600640	号百控股	2,200	26,818.00	0.06
469	600871	石化油服	13,400	26,398.00	0.06
470	601139	深圳燃气	4,000	26,240.00	0.06
471	000061	农产品	4,700	25,944.00	0.06
472	603515	欧普照明	1,000	25,670.00	0.06
473	000046	泛海控股	10,900	25,070.00	0.06
474	603379	三美股份	1,300	24,323.00	0.05
475	603056	德邦股份	2,200	24,178.00	0.05
476	601568	北元集团	2,800	23,968.00	0.05
477	002653	海思科	1,100	23,672.00	0.05
478	603786	科博达	300	22,650.00	0.05
479	002901	大博医疗	300	21,867.00	0.05
480	002419	天虹股份	3,300	21,648.00	0.05
481	601003	柳钢股份	3,600	21,240.00	0.05
482	601512	中新集团	2,100	20,916.00	0.05
483	603983	丸美股份	400	20,844.00	0.05

484	600657	信达地产	5,900	20,532.00	0.05
485	000537	广宇发展	3,900	20,397.00	0.04
486	601869	长飞光纤	800	19,488.00	0.04
487	601801	皖新传媒	4,100	19,352.00	0.04
488	601187	厦门银行	2,000	18,960.00	0.04
489	002946	新乳业	1,200	18,180.00	0.04
490	603719	良品铺子	400	18,000.00	0.04
491	600917	重庆燃气	2,200	17,974.00	0.04
492	000732	泰禾集团	7,000	15,120.00	0.03
493	600903	贵州燃气	1,600	14,720.00	0.03
494	603868	飞科电器	300	12,618.00	0.03
495	002818	富森美	1,000	12,060.00	0.03
496	002423	中粮资本	1,300	11,765.00	0.03
497	600956	新天绿能	1,000	11,710.00	0.03
498	603256	宏和科技	1,200	10,968.00	0.02
499	601068	中铝国际	2,200	7,590.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300274	阳光电源	1,135,213.91	0.86
2	002791	坚朗五金	610,410.00	0.46
3	300285	国瓷材料	601,283.00	0.46
4	300012	华测检测	556,611.00	0.42
5	002074	国轩高科	547,344.00	0.41
6	002709	天赐材料	538,776.00	0.41
7	603345	安井食品	499,741.00	0.38
8	002340	格林美	457,438.00	0.35
9	002507	涪陵榨菜	417,618.00	0.32
10	000799	酒鬼酒	404,096.00	0.31
11	300618	寒锐钴业	392,291.00	0.30

12	002353	杰瑞股份	384,622.00	0.29
13	300496	中科创达	360,456.00	0.27
14	000547	航天发展	359,752.00	0.27
15	002185	华天科技	342,607.70	0.26
16	300207	欣旺达	331,875.00	0.25
17	300146	汤臣倍健	331,535.00	0.25
18	002625	光启技术	330,598.00	0.25
19	002385	大北农	324,059.00	0.25
20	002920	德赛西威	315,567.00	0.24

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	300274	阳光电源	3,202,902.00	2.43
2	300012	华测检测	1,679,878.63	1.27
3	300496	中科创达	1,284,340.00	0.97
4	002074	国轩高科	1,189,158.00	0.90
5	300285	国瓷材料	1,175,612.00	0.89
6	002791	坚朗五金	1,128,026.60	0.85
7	002709	天赐材料	1,114,799.50	0.84
8	300595	欧普康视	1,083,536.00	0.82
9	002568	百润股份	978,764.00	0.74
10	002340	格林美	910,979.00	0.69
11	000547	航天发展	891,980.20	0.68
12	300207	欣旺达	830,897.15	0.63
13	002507	涪陵榨菜	829,177.00	0.63
14	002185	华天科技	827,606.00	0.63
15	002385	大北农	761,586.00	0.58
16	002353	杰瑞股份	734,627.00	0.56
17	002625	光启技术	714,579.00	0.54
18	002920	德赛西威	697,316.00	0.53
19	002078	太阳纸业	683,852.00	0.52

20	300316	晶盛机电	676,350.00	0.51
----	--------	------	------------	------

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	52,569,932.40
卖出股票收入（成交）总额	101,439,728.28

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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
IC2109	中证 500 期货 2109 合约	2	2,666,800.00	60,880.00	-
公允价值变动总额合计（元）					60,880.00
股指期货投资本期收益（元）					427,145.63
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-60,600.00

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

国轩高科股份有限公司因未及时披露公司重大事项等原因在本报告编制前一年内受到江苏证监局的责令整改通知。

酒鬼酒股份有限公司因未及时披露公司重大事项等原因在本报告编制前一年内受到深交所的行政处罚。

基金投资该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	457,035.27
2	应收证券清算款	13,057.10
3	应收股利	-
4	应收利息	733.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	470,825.83

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	600460	士兰微	309,925.00	0.68	停牌流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
580	22,487.37	5,922,648.00	45.41%	7,120,024.00	54.59%

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	东方证券股份有限公司	1,838,234.00	14.09%
2	中信建投证券股份有限公司	1,440,146.00	11.04%
3	华泰证券股份有限公司	1,354,100.00	10.38%
4	广发证券股份有限公司	1,287,168.00	9.87%
5	吴毅鹏	403,100.00	3.09%
6	陈志伟	294,800.00	2.26%
7	王洁人	260,000.00	1.99%
8	虞鹏荣	191,000.00	1.46%
9	杜娟	166,278.00	1.27%
10	袁玲	156,239.00	1.20%
11	宋会敏	156,239.00	1.20%

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（2020年9月18日）基金份额总额	243,999,138.00
本报告期期初基金份额总额	41,042,672.00
本报告期基金总申购份额	20,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	13,042,672.00

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	75,940,714.62	49.49%	19,844.49	49.03%	-
中信建投	4	43,075,250.89	28.07%	11,256.24	27.81%	-
中信证券	2	27,856,274.36	18.15%	7,583.63	18.74%	-
申万宏源	4	5,041,709.30	3.29%	1,370.58	3.39%	-
开源证券	2	1,079,654.00	0.70%	295.44	0.73%	-
光大证券	4	449,953.69	0.29%	122.88	0.30%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

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	24,569.99	15.72%	-	-	-	-
申万宏源	131,704.05	84.28%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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
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	《中国证券报》;《上海证券	2021年2月8日

	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	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	
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管理人网站	2021年3月19日
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	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时	2021年5月17日

	日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
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	《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21日
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29日
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	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时	2021年6月30日

	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	报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
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	20210225~20210301	3,494,973.00	20,297,127.00	21,953,866.00	1,838,234.00	14.09%
	2	20210304~20210406	3,494,973.00	20,297,127.00	21,953,866.00	1,838,234.00	14.09%
	3	20210408~20210617	3,494,973.00	20,297,127.00	21,953,866.00	1,838,234.00	14.09%
	4	20210623~20210623	3,494,973.00	20,297,127.00	21,953,866.00	1,838,234.00	14.09%
	5	20210625~20210625	3,494,973.00	20,297,127.00	21,953,866.00	1,838,234.00	14.09%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时,基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险,以及当管理人确认大额申购与大额赎回时,可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康中证 500 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