

泰康沪深 300 交易型开放式指数
证券投资基金
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 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。

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 10 月 26 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 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	泰康 300
交易代码	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
报告期末基金份额总额	840,699,814.00 份
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</p>

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	90,874,010.14
2. 本期利润	-266,633,452.74
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3145
4. 期末基金资产净值	4,261,366,080.81
5. 期末基金份额净值	5.0688

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）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

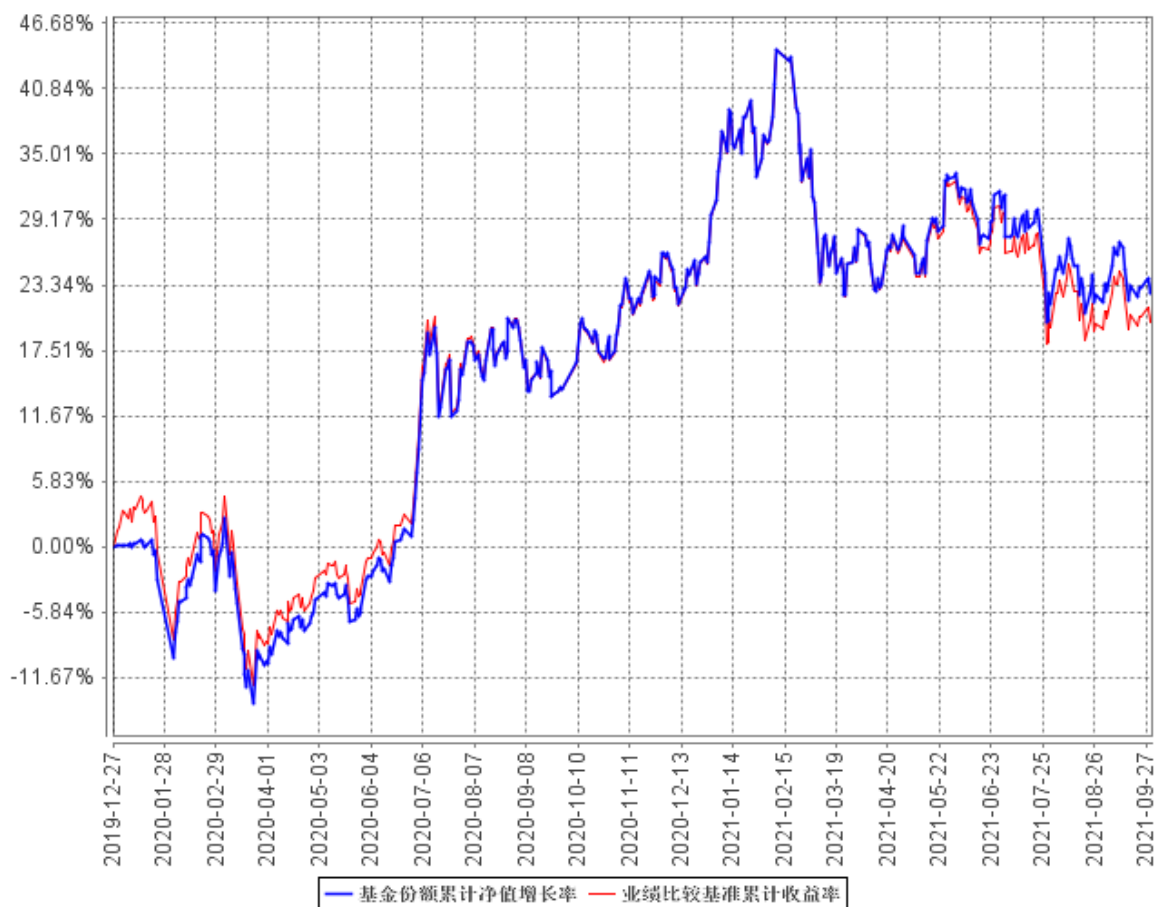
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	①—③	②—④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	-5.83%	1.20%	-6.85%	1.20%	1.02%	0.00%
过去六个月	-1.57%	1.10%	-3.60%	1.10%	2.03%	0.00%
过去一年	8.26%	1.21%	6.08%	1.21%	2.18%	0.00%
自基金合同生效起至今	23.47%	1.34%	20.87%	1.37%	2.60%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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，没有出现本基金管理人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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度经济下行压力有所加大，内需和出口走势分化。出口在中国供应链优势下，增速一直维持高位，但内需下滑较为明显，主要体现在受疫情影响严重的消费、以及受调控政策影响的地产销售和地产投资。基建和制造业相对较为稳定，但制造业在需求下行、成本压力抬升的背景下，盈利开始承压。在能源双控的背景下，不少上游价格持续上涨，带动 PPI 向上超预期，CPI 则继续处于低位相对平稳的走势中。在这一环境下，实体的融资需求继续偏弱，叠加地产行业的政策限制，社融增速有所下行。

权益市场方面，进入三季度，消费、地产、基建、信贷等数据逐月低于预期，确认我国经济动能趋缓；制造业投资回暖是为数不多的亮点，但上游资源涨价和短缺对中游制造业构成了阶段性冲击。从大盘和板块上来看，上证综指下跌 0.64%，沪深 300 下跌 6.85%，中小板指下跌 4.98%，创业板指下跌 6.69%。其中，煤炭、有色金属、钢铁等板块表现相对较好，食品饮料、医药、消费者服务等行业表现不佳。

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 指数窄幅震荡。展望后市，我们对认为宽基指数配置价值逐渐增加，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，参与转融通证券出借、大宗交易、可转债投资、股票打新等，力求为投资者带来更好的投资体验。

4.5 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 5.0688 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.83%；同期业绩比较基准增长率为 -6.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,216,336,992.86	98.51
	其中：股票	4,216,336,992.86	98.51
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	53,811,239.03	1.26
8	其他资产	10,030,181.76	0.23
9	合计	4,280,178,413.65	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 497,694,509.00 元，占期末资产净值比例为 11.68%。

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	45,746,182.65	1.07
B	采矿业	104,856,691.52	2.46
C	制造业	2,305,367,530.81	54.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,507,036.65	2.24
E	建筑业	67,635,927.11	1.59

F	批发和零售业	26,666,644.90	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	122,852,412.38	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,736,618.63	3.33
J	金融业	987,794,699.66	23.18
K	房地产业	91,885,949.43	2.16
L	租赁和商务服务业	69,766,692.00	1.64
M	科学研究和技术服务业	81,263,178.40	1.91
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	4,611,404.00	0.11
Q	卫生和社会工作	55,010,384.00	1.29
R	文化、体育和娱乐业	14,180,956.85	0.33
S	综合	-	-
	合计	4,214,882,308.99	98.91

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,332,470.08	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,352.71	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,864.45	0.00
J	金融业	-	-
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	11,484.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	28,275.90	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	1,453,909.08	0.03

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	133,509	244,321,470.00	5.73
2	600036	招商银行	2,620,812	132,219,965.40	3.10
3	601318	中国平安	2,293,453	110,911,387.08	2.60
4	000858	五粮液	411,433	90,264,285.87	2.12
5	601012	隆基股份	916,547	75,596,796.56	1.77
6	000333	美的集团	1,045,439	72,762,554.40	1.71
7	300059	东方财富	1,750,746	60,173,140.02	1.41
8	603259	药明康德	379,648	58,010,214.40	1.36
9	601166	兴业银行	3,079,583	56,356,368.90	1.32
10	002415	海康威视	988,559	54,370,745.00	1.28

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688425	铁建重工	135,282	692,643.84	0.02
2	688305	科德数控	1,496	104,375.92	0.00
3	300979	华利集团	925	79,402.00	0.00
4	688217	睿昂基因	1,040	64,043.20	0.00
5	688468	科美诊断	3,919	63,918.89	0.00

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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
IF2110	沪深 300 期货 2110 合约	2	2,919,720.00	-34,470.00	-
IF2112	沪深 300 期货 2112 合约	31	44,987,820.00	-172,449.51	-
公允价值变动总额合计(元)					-206,919.51
股指期货投资本期收益(元)					-1,863,200.49
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1,211,439.51

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.2 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

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。

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人民银行的行政处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,713,825.88
2	应收证券清算款	3,143,433.34
3	应收股利	6,510.00
4	应收利息	166,412.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,030,181.76

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002415	海康威视	13,535,500.00	0.32	转融通证券出借
2	600036	招商银行	10,806,390.00	0.25	转融通证券出借
3	601012	隆基股份	7,035,544.00	0.17	转融通证券出借
4	603259	药明康德	1,528,000.00	0.04	转融通证券出借
5	000333	美的集团	1,162,320.00	0.03	转融通证券出借
6	601318	中国平安	967,200.00	0.02	转融通证券出借
7	300059	东方财富	343,700.00	0.01	转融通证券出借
8	601166	兴业银行	237,900.00	0.01	转融通证券出借

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688425	铁建重工	692,643.84	0.02	新股锁定期流通受限
2	688305	科德数控	104,375.92	0.00	新股锁定期流通受限
3	300979	华利集团	79,402.00	0.00	新股锁定期流通受限
4	688217	睿昂基因	64,043.20	0.00	新股锁定期流通受限
5	688468	科美诊断	63,918.89	0.00	新股锁定期流通受限

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	946,899,814.00
报告期期间基金总申购份额	364,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	470,700,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	840,699,814.00

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20210701~20210930	628,349,466.00	-	-	628,349,466.00	74.74%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 9 备查文件目录

9.1 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》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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 10 月 27 日