

泰康中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18

6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	74
§10 开放式基金份额变动.....	75
§ 11 重大事件揭示.....	76
11.1 基金份额持有人大会决议.....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76

11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§13 备查文件目录.....	88
13.1 备查文件目录	88
13.2 存放地点	88
13.3 查阅方式	88

§ 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	17,042,672.00 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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,222,342.17	135,314.34
本期利润	9,715,040.07	893,747.02
加权平均基金份额本期利润	0.6367	0.0093
本期加权平均净值利润率	18.51%	0.45%
本期基金份额净值增长率	17.33%	0.49%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	9,766,260.51	-104,988.63
期末可供分配基金份额利润	0.5730	-0.0026
期末基金资产净值	64,307,860.02	131,988,594.82
期末基金份额净值	3.7733	3.2159
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	17.91%	0.49%

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

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

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

（4）本基金以 2020 年 10 月 15 日为折算日，进行了基金份额折算，折算情况参见《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》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结果的公告》。

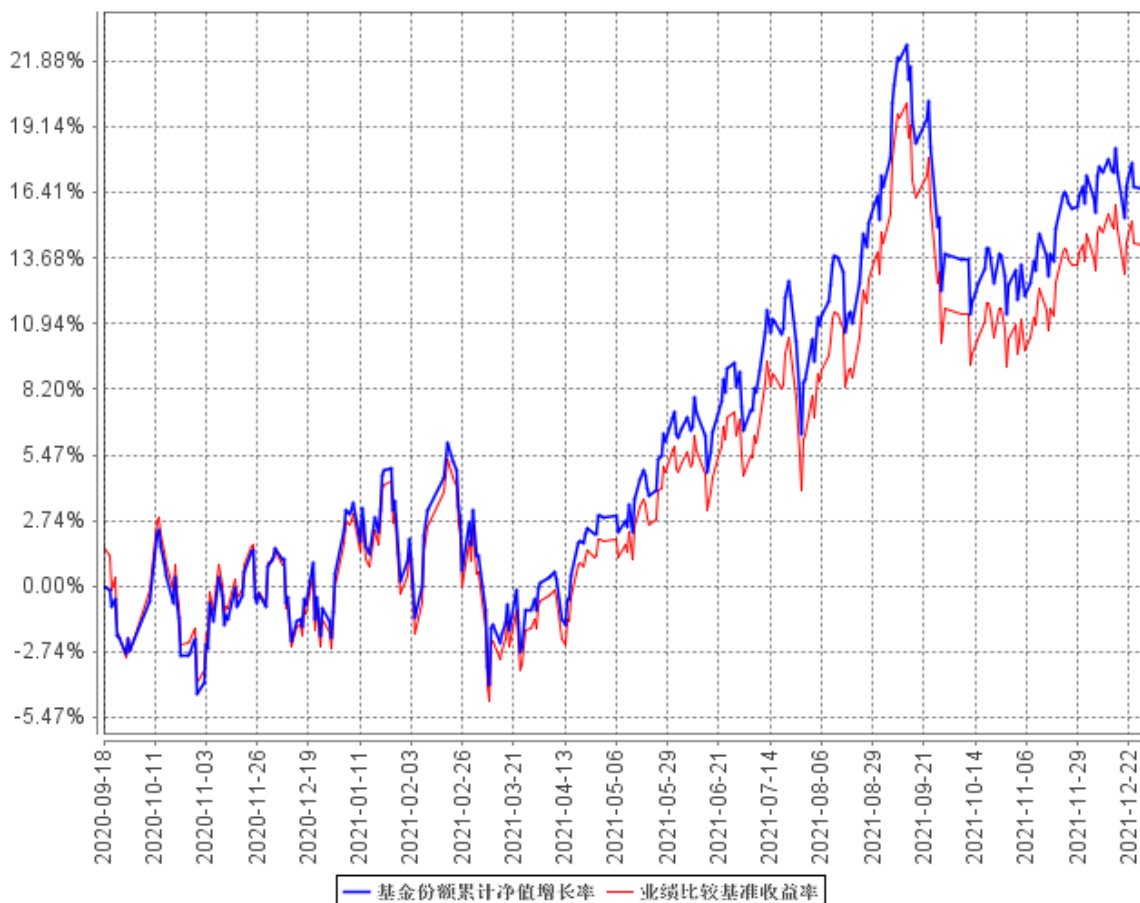
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.60%	0.75%	3.60%	0.76%	0.00%	-0.01%
过去六个月	8.28%	0.95%	8.10%	0.96%	0.18%	-0.01%
过去一年	17.33%	0.96%	15.58%	0.97%	1.75%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.91%	0.99%	15.59%	1.02%	2.32%	-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

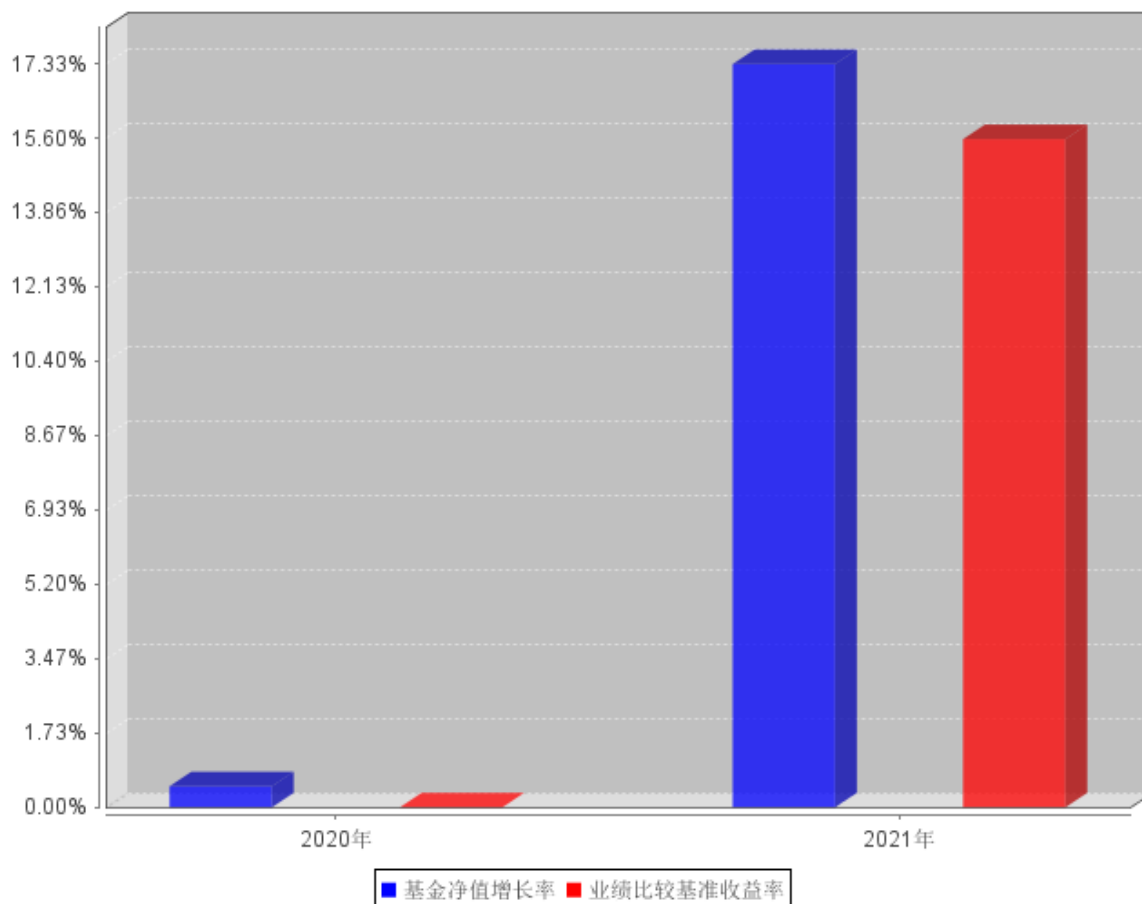


注：1、本基金基金合同于 2020 年 09 月 18 日生效。

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

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于2020年09月18日，2020年度净值增长率的计算期间为2020年09月18日至2020年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2020年9月18日)至报告期截止日(2021年12月31日)未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2021 年 12 月 31 日，公司管理资产总规模超过 27000 亿元，其中受托管理的第三方资产总规模近 17000 亿元，另类投资管理规模超 5000 亿元，养老金管理规模超 6400 亿元。根据人社部公开数据，2021 年三季度末，泰康资产受托管理的企业年金规模超 4100 亿元，位于市场前列。

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 12 月 31 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康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)、泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、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、泰康优势精选三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康国证公共卫生与健康交易型开放式指数证券投资基金、泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金、泰康研究精选股票型发起式证券投资基金，共 63 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	-	14	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。2021年12月6日至今担任泰康国证公共卫生与健康交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中的披露日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理

的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2021 年是经济内生动能逐步减缓的一年，经济从疫后的复苏期逐步进入到下行压力显性化的阶段。宏观政策的定调在结构性改革，GDP 由于基数原因达成目标的难度较小，宏观经济的长期改革得以有效推进。在年中前后逐步推行的诸如“三条红线”、“双碳”、“双减”等政策，有效地推进了经济中长期结构性问题的改革，但也给短期经济增长带来压力；叠加全年疫情影响始终存在，经济下行压力逐步加大。21 年经济的亮点在于出口和制造业投资，中国制造的优势在全球一枝独秀。物价方面，由于双碳的约束和海外供给共振，PPI 一路上行，但 CPI 表现疲弱。

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。3 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。4 季度，随着经济从“内外需双强”转为“外需单强”的格局，局部增长的亮点仍存，对应权益市场仍有结构性的机会。从大盘和板块上来看，上证综指上涨 4.8%，沪深 300 下跌 5.2%，中小板指下跌 4.62%，创业板指上涨 12.02%。其中，电力设备及新能源、基础化工、有色金属等板块表现相对较好，家电、非银行金融、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，中证 500 指数先涨后跌，继而震荡上行，波动性有所加大。

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 3.7733 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.33%；同期业绩比较基准增长率为 15.58%。

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 2022 年，宏观经济有望从底部逐步恢复，可能是稳增长政策逐步落地见效的过程。政策上可能更多体现为在长效机制的框架下的陆续边际放松和纠偏，力度不会很大，但在基建、地产等多个领域都会有一定程度的对冲，叠加制造业的景气，宏观经济有望见到社融率先企稳回升、工业和投资指标逐步企稳的过程。出口面临海外供需两方面较大的不确定性，但压力可能更多体现在下半年，上半年预计维持韧性，叠加政策靠前发力，经济动能有望在 1-2 季度缓慢恢复。

权益市场方面，受到疫情反复的影响，宏观经济面临一定增速压力；稳增长的背景下，预计流动性将持续保持宽松；从估值上看，目前 A 股市场的估值处于中位数偏上的位置，属合理状态。展望 2022 年，权益市场预计震荡向上，价值和成长风格收益将更加均衡。

投资上，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募估值小组成员均具有相关工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债

登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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 8 月 12 日及 2021 年 8 月 19 日至 2021 年 9 月 24 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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 20953 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“泰康中证 500ETF”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰康中证 500ETF 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰康中证 500ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。

其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰康中证 500ETF 的基金管理人泰康资产管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰康中证 500ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰康中证 500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰康中证 500ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能对泰康中证 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰康中证 500ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张 勇 周 祎
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,249,959.27	1,406,489.13
结算备付金		1,409,486.34	2,251,500.13
存出保证金		447,894.35	608,251.15
交易性金融资产	7.4.7.2	61,357,881.62	128,174,580.91
其中：股票投资		61,357,881.62	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	348,860.96
应收利息	7.4.7.5	1,206.22	1,469.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		64,466,427.80	132,791,151.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	77,974.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		18,278.98	46,082.98
应付托管费		2,284.88	5,760.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,838.80	74,665.57
应交税费		2,999.86	0.03

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	119,165.26	598,073.91
负债合计		158,567.78	802,557.10
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	54,541,599.51	131,348,709.72
未分配利润	7.4.7.10	9,766,260.51	639,885.10
所有者权益合计		64,307,860.02	131,988,594.82
负债和所有者权益总计		64,466,427.80	132,791,151.92

注：（1）报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.7733 元，基金份额总额 17,042,672.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 利润表

会计主体：泰康中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		10,548,509.03	1,560,961.79
1.利息收入		31,645.44	95,194.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	31,634.05	42,373.62
债券利息收入		11.39	42.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	52,778.81
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,603,535.13	672,204.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,270,334.20	554,938.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,567.74	64,441.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	796,893.20	19,668.83
股利收益	7.4.7.16	526,739.99	33,156.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	492,697.90	758,432.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	420,630.56	35,129.24
减:二、费用		833,468.96	667,214.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	212,666.21	227,597.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	26,583.23	28,449.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	278,983.64	321,770.46
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,868.83	116.69
7. 其他费用	7.4.7.20	312,367.05	89,280.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		9,715,040.07	893,747.02
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		9,715,040.07	893,747.02

注: 本基金合同生效日为 2020 年 9 月 18 日, 上年度可比期间是指自基金合同生效日 2020 年 9 月 18 日至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泰康中证 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	9,715,040.07	9,715,040.07
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)	-76,807,110.21	-588,664.66	-77,395,774.87
其中: 1.基金申购款	168,975,642.61	16,214,184.96	185,189,827.57
2. 基金赎回款	-245,782,752.82	-16,802,849.62	-262,585,602.44
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)	54,541,599.51	9,766,260.51	64,307,860.02
项目	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	243,999,138.00	-	243,999,138.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	893,747.02	893,747.02
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)	-112,650,428.28	-253,861.92	-112,904,290.20
其中: 1. 基金申购款	94,728,769.30	95,041.32	94,823,810.62
2. 基金赎回款	-207,379,197.58	-348,903.24	-207,728,100.82
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)	131,348,709.72	639,885.10	131,988,594.82

注: 本基金合同生效日为 2020 年 9 月 18 日, 上年度可比期间是指自基金合同生效日 2020 年 9 月 18 日至 2020 年 12 月 31 日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康中证 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。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1. 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,249,959.27	1,406,489.13
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：	1,249,959.27	1,406,489.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,192,911.04	61,357,881.62	1,164,970.58
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		60,192,911.04	61,357,881.62	1,164,970.58
项目	上年度末 2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		127,537,628.23	128,174,580.91	636,952.68
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		127,537,628.23	128,174,580.91	636,952.68

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	2,836,160.00	-	-	
-股指期货	2,836,160.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,836,160.00	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31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	3,629,360.00	-	-	
-股指期货	3,629,360.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	

合计	3,629,360.00	-	-
----	--------------	---	---

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12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2203	中证500期货2203 合约	2	2,922,320.00	86,160.00
总额合计				86,160.00
减：可抵销期货暂收款				86,160.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	387.86	202.66
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	799.22	1,225.84
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	19.14	41.14
合计	1,206.22	1,469.64

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	15,838.80	74,665.57
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,838.80	74,665.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	80,000.00	47,240.44
指数使用费	35,000.00	35,000.00
可退替代款	2,409.60	1,744.80
应付替代款	1,755.66	514,088.67
合计	119,165.26	598,073.91

7.4.7.9 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12月31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	52,800,000.00	168,975,642.61
本期赎回(以“-”号填列)	-76,800,000.00	-245,782,752.82

- 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	17,042,672.00	54,541,599.51

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-104,988.63	744,873.73	639,885.10
本期利润	9,222,342.17	492,697.90	9,715,040.07
本期基金份额交易产生的变动数	1,816,006.61	-2,404,671.27	-588,664.66
其中：基金申购款	19,784,198.63	-3,570,013.67	16,214,184.96
基金赎回款	-17,968,192.02	1,165,342.40	-16,802,849.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,933,360.15	-1,167,099.64	9,766,260.51

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	6,839.28	16,344.60
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	23,492.66	25,797.25
其他	1,302.11	231.77
合计	31,634.05	42,373.62

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价	4,422,093.63	71,298.13

收入		
股票投资收益——赎回差价收入	3,848,240.57	483,639.95
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	8,270,334.20	554,938.08

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合 同生效日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	171,763,929.62	150,426,153.16
减：卖出股票成本总额	167,341,835.99	150,354,855.03
买卖股票差价收入	4,422,093.63	71,298.13

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
赎回基金份额对价总额	262,585,602.44	207,728,100.82
减：现金支付赎回款总额	142,186,496.44	115,759,169.82
减：赎回股票成本总额	116,550,865.43	91,485,291.05
赎回差价收入	3,848,240.57	483,639.95

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生 效日)至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	9,567.74	64,441.54
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	64,441.54

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	164,383.39	358,785.24
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	154,739.09	294,300.00
减：应收利息总额	76.56	43.70
买卖债券差价收入	9,567.74	64,441.54

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日,本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日,本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间收益金额 2020年9月18日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	796,893.20	19,668.83

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	526,739.99	33,156.47
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	526,739.99	33,156.47

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	528,017.90	636,952.68
——股票投资	528,017.90	636,952.68
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-35,320.00	121,480.00
——权证投资	-	-
——股指期货投资	-35,320.00	121,480.00
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	492,697.90	758,432.68

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	420,630.56	-29,825.38
其他	-	64,954.62

合计	420,630.56	35,129.24
----	------------	-----------

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	278,983.64	321,770.46
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	278,983.64	321,770.46

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
指数使用费	108,195.35	39,945.65
银行费用	4,171.70	1,694.74
其他	50,000.00	7,640.44
合计	312,367.05	89,280.83

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	212,666.21	227,597.12
其中：支付销售机构的客户维护费	7,959.96	2,015.57

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% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,583.23	28,449.67

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，基金管理人未运用自有资金投资本基金份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,249,959.27	6,839.28	1,406,489.13	16,344.60

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期，本基金无利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	网下新股流通受限	16.53	16.53	268	4,430.04	4,430.04	-

注：1、截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

2、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》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，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%。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。

3、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。

4、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。

5、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。

6、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，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002683	宏大爆破	2021 年 12 月 20 日	临时停牌	30.12	2022 年 1 月 4 日	31.00	3,600	106,300.72	108,432.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止, 本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31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。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	1,249,959.27	-	-	-	1,249,959.27
结算备付金	1,409,486.34	-	-	-	1,409,486.34
存出保证金	38,769.55	-	-	409,124.80	447,894.35
交易性金融资产	-	-	-	61,357,881.62	61,357,881.62
应收利息	-	-	-	1,206.22	1,206.22
资产总计	2,698,215.16	-	-	61,768,212.64	64,466,427.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	18,278.98	18,278.98
应付托管费	-	-	-	2,284.88	2,284.88
应付交易费用	-	-	-	15,838.80	15,838.80
应交税费	-	-	-	2,999.86	2,999.86
其他负债	-	-	-	119,165.26	119,165.26
负债总计	-	-	-	158,567.78	158,567.78
利率敏感度缺口	2,698,215.16	-	-	61,609,644.86	64,307,860.02
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	61,357,881.62	95.41	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	61,357,881.62	95.41	128,174,580.91	97.11

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附件 7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 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%	1,679,403.42	0.00
业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-1,679,403.42	0.00	

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层次的余额为 61,245,019.58 元,属于第二层次的余额为 112,862.04 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 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 185,189,827.57 元(2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间:94,823,810.62 元),其中包括以股票支付的申购款 84,304,461.00 元和以现金支付的申购款 100,885,366.57 元(2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间:其中包括以股票支付的申购款 40,817,644.88 元和以现金支付的申购款 54,006,165.74 元)。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(4)除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	61,357,881.62	95.18
	其中：股票	61,357,881.62	95.18
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	2,659,445.61	4.13
8	其他各项资产	449,100.57	0.70
9	合计	64,466,427.80	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。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	681,684.20	1.06
B	采矿业	2,362,311.60	3.67
C	制造业	37,091,296.62	57.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,297,656.82	3.57
E	建筑业	1,165,491.00	1.81
F	批发和零售业	1,896,755.00	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	1,434,610.20	2.23
H	住宿和餐饮业	362,437.00	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,191,888.14	8.07

J	金融业	4,412,418.00	6.86
K	房地产业	1,599,591.00	2.49
L	租赁和商务服务业	751,093.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	216,316.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	528,292.00	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	127,566.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	793,042.00	1.23
S	综合	441,003.00	0.69
	合计	61,353,451.58	95.41

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,430.04	0.01
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	-	-
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	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,430.04	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002340	格林美	41,800	432,630.00	0.67
2	600522	中天科技	23,200	393,472.00	0.61
3	000733	振华科技	3,100	385,268.00	0.60
4	000723	美锦能源	22,400	363,552.00	0.57
5	601615	明阳智能	13,700	357,570.00	0.56
6	600157	永泰能源	194,100	353,262.00	0.55
7	600399	抚顺特钢	13,800	341,826.00	0.53
8	600885	宏发股份	4,500	335,880.00	0.52
9	600884	杉杉股份	10,100	330,977.00	0.51
10	000009	中国宝安	22,500	324,675.00	0.50
11	002384	东山精密	11,900	322,490.00	0.50
12	300751	迈为股份	500	321,150.00	0.50
13	601117	中国化学	26,700	320,400.00	0.50
14	601555	东吴证券	35,200	311,872.00	0.48
15	002013	中航机电	17,000	309,060.00	0.48
16	002385	大北农	28,950	303,685.50	0.47
17	300285	国瓷材料	7,000	297,990.00	0.46
18	002268	卫士通	5,200	290,888.00	0.45
19	605358	立昂微	2,400	288,024.00	0.45
20	688099	晶晨股份	2,200	286,440.00	0.45
21	300088	长信科技	21,400	284,192.00	0.44
22	300037	新宙邦	2,500	282,500.00	0.44
23	600563	法拉电子	1,200	278,880.00	0.43
24	600765	中航重机	5,500	277,695.00	0.43
25	688005	容百科技	2,300	265,834.00	0.41
26	600298	安琪酵母	4,400	265,584.00	0.41
27	600256	广汇能源	40,200	262,908.00	0.41
28	002180	纳思达	5,500	262,680.00	0.41
29	600862	中航高科	7,300	261,048.00	0.41
30	002028	思源电气	5,300	260,813.00	0.41

31	600141	兴发集团	6,800	257,584.00	0.40
32	300253	卫宁健康	15,000	251,400.00	0.39
33	300363	博腾股份	2,800	250,460.00	0.39
34	600487	亨通光电	16,500	249,480.00	0.39
35	002185	华天科技	19,600	249,116.00	0.39
36	603456	九洲药业	4,400	247,544.00	0.38
37	000988	华工科技	8,800	245,168.00	0.38
38	600392	盛和资源	12,300	241,326.00	0.38
39	601636	旗滨集团	14,100	241,110.00	0.37
40	600754	锦江酒店	4,000	234,400.00	0.36
41	300058	蓝色光标	21,800	233,914.00	0.36
42	600418	江淮汽车	13,400	233,160.00	0.36
43	300699	光威复材	2,700	228,096.00	0.35
44	300223	北京君正	1,700	227,800.00	0.35
45	601168	西部矿业	16,700	227,287.00	0.35
46	603613	国联股份	2,100	225,750.00	0.35
47	000630	铜陵有色	64,400	224,112.00	0.35
48	688065	凯赛生物	1,200	221,136.00	0.34
49	603589	口子窖	3,100	219,697.00	0.34
50	603267	鸿远电子	1,200	215,328.00	0.33
51	600516	方大炭素	19,900	215,318.00	0.33
52	002797	第一创业	29,400	215,208.00	0.33
53	000998	隆平高科	9,200	213,992.00	0.33
54	002138	顺络电子	5,600	213,808.00	0.33
55	300136	信维通信	8,400	212,688.00	0.33
56	600486	扬农化工	1,600	209,920.00	0.33
57	300763	锦浪科技	900	208,395.00	0.32
58	601077	渝农商行	54,100	208,285.00	0.32
59	300308	中际旭创	4,900	208,250.00	0.32
60	600038	中直股份	2,590	207,977.00	0.32
61	600875	东方电气	9,700	207,774.00	0.32
62	300724	捷佳伟创	1,800	205,740.00	0.32
63	000728	国元证券	26,700	205,590.00	0.32
64	603893	瑞芯微	1,500	205,350.00	0.32
65	002409	雅克科技	2,500	202,925.00	0.32
66	601689	拓普集团	3,800	201,400.00	0.31
67	002080	中材科技	5,900	200,718.00	0.31
68	002223	鱼跃医疗	5,300	200,340.00	0.31
69	600233	圆通速递	12,000	200,160.00	0.31

70	002353	杰瑞股份	5,000	200,000.00	0.31
71	300146	汤臣倍健	7,400	199,504.00	0.31
72	002212	天融信	10,342	198,256.14	0.31
73	300474	景嘉微	1,300	197,860.00	0.31
74	000519	中兵红箭	7,300	194,691.00	0.30
75	300418	昆仑万维	8,400	194,460.00	0.30
76	688208	道通科技	2,400	190,560.00	0.30
77	002673	西部证券	23,400	188,838.00	0.29
78	603605	珀莱雅	900	187,479.00	0.29
79	600733	北汽蓝谷	18,700	187,374.00	0.29
80	000547	航天发展	11,200	187,040.00	0.29
81	600705	中航产融	46,800	185,796.00	0.29
82	002439	启明星辰	6,500	185,445.00	0.29
83	000932	华菱钢铁	36,288	185,431.68	0.29
84	600482	中国动力	9,400	185,180.00	0.29
85	000636	风华高科	6,200	184,760.00	0.29
86	600699	均胜电子	8,400	184,548.00	0.29
87	600529	山东药玻	4,200	184,380.00	0.29
88	603077	和邦生物	53,900	183,799.00	0.29
89	000039	中集集团	10,700	183,612.00	0.29
90	600188	兖矿能源	7,800	183,534.00	0.29
91	600739	辽宁成大	9,400	183,488.00	0.29
92	000807	云铝股份	16,400	183,188.00	0.28
93	002444	巨星科技	6,000	183,060.00	0.28
94	300296	利亚德	17,800	182,450.00	0.28
95	688002	睿创微纳	2,300	180,711.00	0.28
96	000739	普洛药业	5,100	178,959.00	0.28
97	002507	涪陵榨菜	4,700	177,660.00	0.28
98	002465	海格通信	16,100	175,812.00	0.27
99	002030	达安基因	8,660	173,719.60	0.27
100	600988	赤峰黄金	11,600	172,840.00	0.27
101	000738	航发控制	5,700	172,596.00	0.27
102	000960	锡业股份	8,800	171,864.00	0.27
103	601016	节能风电	26,300	171,213.00	0.27
104	688521	芯原股份	2,200	170,192.00	0.26
105	600637	东方明珠	17,900	169,155.00	0.26
106	600521	华海药业	7,800	168,948.00	0.26
107	603444	吉比特	400	168,740.00	0.26
108	002273	水晶光电	9,700	168,683.00	0.26

109	600549	厦门钨业	7,400	167,462.00	0.26
110	600177	雅戈尔	24,200	166,738.00	0.26
111	002985	北摩高科	1,380	166,234.80	0.26
112	600732	爱旭股份	7,100	165,856.00	0.26
113	002557	洽洽食品	2,700	165,672.00	0.26
114	601198	东兴证券	14,100	163,983.00	0.25
115	002078	太阳纸业	14,100	162,009.00	0.25
116	600704	物产中大	27,300	161,616.00	0.25
117	603127	昭衍新药	1,400	161,602.00	0.25
118	600201	生物股份	9,847	160,998.45	0.25
119	300383	光环新网	10,800	160,272.00	0.25
120	600642	申能股份	21,500	158,455.00	0.25
121	601128	常熟银行	23,900	157,979.00	0.25
122	002156	通富微电	8,100	157,383.00	0.24
123	300357	我武生物	2,743	157,173.90	0.24
124	002299	圣农发展	6,500	157,105.00	0.24
125	600879	航天电子	19,000	156,560.00	0.24
126	600497	驰宏锌锗	31,200	155,688.00	0.24
127	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.24
128	600369	西南证券	29,000	153,410.00	0.24
129	000830	鲁西化工	10,000	152,600.00	0.24
130	600027	华电国际	28,500	152,475.00	0.24
131	603290	斯达半导	400	152,400.00	0.24
132	300618	寒锐钴业	1,900	152,342.00	0.24
133	600160	巨化股份	11,800	152,338.00	0.24
134	002508	老板电器	4,200	151,284.00	0.24
135	600039	四川路桥	12,500	150,500.00	0.23
136	002739	万达电影	9,700	150,156.00	0.23
137	600372	中航电子	6,700	150,013.00	0.23
138	002092	中泰化学	15,700	149,778.00	0.23
139	000623	吉林敖东	8,100	149,607.00	0.23
140	600316	洪都航空	3,800	148,428.00	0.23
141	000983	山西焦煤	17,900	148,033.00	0.23
142	600580	卧龙电驱	8,000	146,320.00	0.23
143	000629	攀钢钒钛	37,500	145,875.00	0.23
144	603198	迎驾贡酒	2,100	145,845.00	0.23
145	601997	贵阳银行	22,400	145,824.00	0.23
146	300115	长盈精密	7,340	145,625.60	0.23
147	002131	利欧股份	59,000	145,140.00	0.23

148	002249	大洋电机	16,500	145,035.00	0.23
149	002373	千方科技	9,700	145,015.00	0.23
150	300017	网宿科技	21,300	142,497.00	0.22
151	002936	郑州银行	45,080	142,452.80	0.22
152	000961	中南建设	34,300	142,002.00	0.22
153	002422	科伦药业	7,500	141,975.00	0.22
154	002603	以岭药业	7,240	141,904.00	0.22
155	600118	中国卫星	5,200	141,180.00	0.22
156	000825	太钢不锈	19,900	140,096.00	0.22
157	600170	上海建工	38,800	139,680.00	0.22
158	000887	中鼎股份	6,400	139,584.00	0.22
159	000050	深天马 A	10,700	139,314.00	0.22
160	300070	碧水源	19,300	138,767.00	0.22
161	603218	日月股份	4,200	138,390.00	0.22
162	000400	许继电气	5,300	138,330.00	0.22
163	600166	福田汽车	40,200	138,288.00	0.22
164	600803	新奥股份	7,500	137,700.00	0.21
165	600867	通化东宝	12,500	137,000.00	0.21
166	000750	国海证券	33,300	136,863.00	0.21
167	002506	协鑫集成	35,900	136,420.00	0.21
168	002191	劲嘉股份	9,000	136,170.00	0.21
169	600153	建发股份	15,000	136,050.00	0.21
170	002926	华西证券	13,800	135,930.00	0.21
171	002372	伟星新材	5,587	135,875.84	0.21
172	300168	万达信息	10,400	135,408.00	0.21
173	600859	王府井	5,000	135,000.00	0.21
174	000027	深圳能源	16,600	134,460.00	0.21
175	300001	特锐德	5,400	134,298.00	0.21
176	002056	横店东磁	7,100	133,977.00	0.21
177	002266	浙富控股	18,800	133,856.00	0.21
178	603707	健友股份	3,180	133,560.00	0.21
179	600909	华安证券	24,660	133,410.60	0.21
180	600236	桂冠电力	20,700	132,894.00	0.21
181	000513	丽珠集团	3,300	132,693.00	0.21
182	002002	鸿达兴业	21,800	132,108.00	0.21
183	600066	宇通客车	11,900	131,138.00	0.20
184	300251	光线传媒	10,200	131,070.00	0.20
185	002065	东华软件	16,800	131,040.00	0.20
186	600008	首创环保	38,400	130,944.00	0.20

187	300009	安科生物	10,000	130,900.00	0.20
188	000997	新大陆	7,200	130,464.00	0.20
189	000021	深科技	8,200	129,888.00	0.20
190	600271	航天信息	9,700	129,883.00	0.20
191	600536	中国软件	2,600	129,818.00	0.20
192	688006	杭可科技	1,200	129,096.00	0.20
193	002152	广电运通	10,800	128,520.00	0.20
194	002408	齐翔腾达	12,240	128,520.00	0.20
195	600171	上海贝岭	5,000	128,300.00	0.20
196	600258	首旅酒店	4,900	128,037.00	0.20
197	002203	海亮股份	10,300	128,029.00	0.20
198	300244	迪安诊断	3,800	127,566.00	0.20
199	000975	银泰黄金	14,520	127,485.60	0.20
200	002221	东华能源	10,100	127,159.00	0.20
201	300630	普利制药	2,300	126,592.00	0.20
202	000656	金科股份	28,000	125,440.00	0.20
203	600535	天士力	7,900	125,215.00	0.19
204	603156	养元饮品	4,400	125,004.00	0.19
205	600348	华阳股份	10,500	124,425.00	0.19
206	002572	索菲亚	5,600	124,320.00	0.19
207	002500	山西证券	18,800	124,080.00	0.19
208	300212	易华录	3,500	123,725.00	0.19
209	300026	红日药业	15,700	122,931.00	0.19
210	601005	重庆钢铁	58,600	122,474.00	0.19
211	300024	机器人	10,928	122,065.76	0.19
212	600315	上海家化	3,000	121,230.00	0.19
213	600998	九州通	8,200	120,704.00	0.19
214	603568	伟明环保	3,300	120,549.00	0.19
215	000012	南玻 A	12,000	119,160.00	0.19
216	000878	云南铜业	8,900	118,993.00	0.19
217	000970	中科三环	7,400	118,770.00	0.18
218	601699	潞安环能	10,500	118,755.00	0.18
219	002127	南极电商	17,200	118,680.00	0.18
220	000537	广宇发展	4,900	118,090.00	0.18
221	002745	木林森	7,800	118,014.00	0.18
222	002195	二三四五	50,100	117,234.00	0.18
223	300315	掌趣科技	24,100	117,126.00	0.18
224	603712	七一二	2,700	116,910.00	0.18
225	002250	联化科技	6,500	116,805.00	0.18

226	601872	招商轮船	28,400	116,440.00	0.18
227	000999	华润三九	3,400	116,416.00	0.18
228	600415	小商品城	24,000	116,400.00	0.18
229	600673	东阳光	13,100	116,328.00	0.18
230	002511	中顺洁柔	6,900	115,299.00	0.18
231	002019	亿帆医药	6,500	114,530.00	0.18
232	300182	捷成股份	18,000	113,940.00	0.18
233	600801	华新水泥	5,900	113,870.00	0.18
234	300463	迈克生物	3,900	113,841.00	0.18
235	000690	宝新能源	19,000	112,480.00	0.17
236	600863	内蒙华电	28,500	112,290.00	0.17
237	002153	石基信息	3,900	112,086.00	0.17
238	600208	新湖中宝	37,500	111,750.00	0.17
239	002831	裕同科技	3,300	111,177.00	0.17
240	600970	中材国际	9,700	110,871.00	0.17
241	000060	中金岭南	22,300	109,493.00	0.17
242	600517	国网英大	14,900	108,621.00	0.17
243	002683	宏大爆破	3,600	108,432.00	0.17
244	000686	东北证券	12,300	107,994.00	0.17
245	300482	万孚生物	2,740	107,901.20	0.17
246	601778	晶科科技	12,600	107,478.00	0.17
247	600380	健康元	8,315	106,764.60	0.17
248	600839	四川长虹	32,200	106,582.00	0.17
249	002505	鹏都农牧	27,900	106,578.00	0.17
250	002294	信立泰	3,900	106,548.00	0.17
251	000930	中粮科技	9,800	106,526.00	0.17
252	601866	中远海发	32,700	106,275.00	0.17
253	600498	烽火通信	5,900	106,082.00	0.16
254	600155	华创阳安	10,600	105,576.00	0.16
255	603858	步长制药	5,000	105,450.00	0.16
256	002939	长城证券	8,100	104,895.00	0.16
257	600390	五矿资本	19,700	104,804.00	0.16
258	600667	太极实业	12,900	104,232.00	0.16
259	000729	燕京啤酒	12,300	104,181.00	0.16
260	600511	国药股份	3,300	104,049.00	0.16
261	002701	奥瑞金	14,800	103,600.00	0.16
262	601992	金隅集团	36,400	103,376.00	0.16
263	600718	东软集团	7,600	103,056.00	0.16
264	000401	冀东水泥	8,600	102,856.00	0.16

265	600500	中化国际	12,000	102,720.00	0.16
266	600728	佳都科技	12,300	102,459.00	0.16
267	600895	张江高科	6,800	102,408.00	0.16
268	002430	杭氧股份	3,400	102,034.00	0.16
269	600764	中国海防	2,500	101,650.00	0.16
270	300376	易事特	10,100	101,505.00	0.16
271	600158	中体产业	6,700	101,304.00	0.16
272	002382	蓝帆医疗	6,200	100,998.00	0.16
273	600216	浙江医药	5,912	100,976.96	0.16
274	002004	华邦健康	13,800	99,912.00	0.16
275	600282	南钢股份	26,900	99,530.00	0.15
276	603225	新风鸣	6,700	99,495.00	0.15
277	002128	电投能源	6,700	99,495.00	0.15
278	002532	天山铝业	12,200	99,430.00	0.15
279	601179	中国西电	17,900	99,345.00	0.15
280	002595	豪迈科技	3,561	98,853.36	0.15
281	002966	苏州银行	14,600	98,842.00	0.15
282	000598	兴蓉环境	15,600	98,592.00	0.15
283	002670	国盛金控	10,200	97,920.00	0.15
284	300072	三聚环保	12,300	97,539.00	0.15
285	002174	游族网络	6,400	97,536.00	0.15
286	600985	淮北矿业	8,700	97,266.00	0.15
287	000540	中天金融	36,800	97,152.00	0.15
288	002396	星网锐捷	4,100	96,637.00	0.15
289	002368	太极股份	3,500	96,390.00	0.15
290	603866	桃李面包	3,360	95,424.00	0.15
291	600528	中铁工业	11,600	95,236.00	0.15
292	002048	宁波华翔	4,400	95,172.00	0.15
293	000581	威孚高科	4,400	94,776.00	0.15
294	600297	广汇汽车	35,400	94,518.00	0.15
295	600409	三友化工	10,800	93,960.00	0.15
296	601228	广州港	28,200	93,906.00	0.15
297	603638	艾迪精密	2,940	93,844.80	0.15
298	002958	青农商行	24,200	93,412.00	0.15
299	600827	百联股份	7,000	93,310.00	0.15
300	002925	盈趣科技	2,740	93,242.20	0.14
301	002010	传化智联	10,700	93,090.00	0.14
302	600755	厦门国贸	12,900	93,009.00	0.14
303	600060	海信视像	6,900	92,805.00	0.14

304	600567	山鹰国际	28,200	92,778.00	0.14
305	601717	郑煤机	8,000	92,720.00	0.14
306	600131	国网信通	4,200	91,770.00	0.14
307	300271	华宇软件	7,200	91,440.00	0.14
308	000709	河钢股份	37,100	91,266.00	0.14
309	603885	吉祥航空	5,100	90,525.00	0.14
310	000778	新兴铸管	20,900	90,497.00	0.14
311	600598	北大荒	6,200	90,272.00	0.14
312	002183	怡亚通	13,600	90,032.00	0.14
313	002690	美亚光电	2,400	89,904.00	0.14
314	002075	沙钢股份	15,400	89,782.00	0.14
315	600325	华发股份	14,800	89,096.00	0.14
316	000883	湖北能源	17,000	89,080.00	0.14
317	603883	老百姓	1,800	88,884.00	0.14
318	600820	隧道股份	16,500	88,770.00	0.14
319	600021	上海电力	6,901	88,470.82	0.14
320	600967	内蒙一机	7,400	88,430.00	0.14
321	600782	新钢股份	16,700	88,176.00	0.14
322	600507	方大特钢	11,300	88,140.00	0.14
323	601456	国联证券	6,300	88,011.00	0.14
324	600566	济川药业	3,100	87,854.00	0.14
325	600737	中粮糖业	9,300	87,420.00	0.14
326	000990	诚志股份	5,500	87,010.00	0.14
327	002281	光迅科技	3,700	86,173.00	0.13
328	600022	山东钢铁	47,900	85,741.00	0.13
329	002434	万里扬	5,800	85,492.00	0.13
330	000987	越秀金控	9,800	85,260.00	0.13
331	600707	彩虹股份	12,500	85,250.00	0.13
332	601880	辽港股份	49,200	85,116.00	0.13
333	688029	南微医学	400	85,068.00	0.13
334	603927	中科软	3,100	84,816.00	0.13
335	600663	陆家嘴	7,700	83,622.00	0.13
336	600435	北方导航	7,800	83,304.00	0.13
337	601106	中国一重	23,900	83,172.00	0.13
338	601577	长沙银行	10,600	82,786.00	0.13
339	002146	荣盛发展	19,000	82,650.00	0.13
340	002124	天邦股份	12,780	82,303.20	0.13
341	600446	金证股份	5,700	81,624.00	0.13
342	600572	康恩贝	16,300	81,500.00	0.13

343	603650	彤程新材	1,600	80,512.00	0.13
344	688088	虹软科技	1,800	79,308.00	0.12
345	601118	海南橡胶	15,000	79,200.00	0.12
346	600259	广晟有色	1,600	78,784.00	0.12
347	002390	信邦制药	10,600	78,652.00	0.12
348	600329	中新药业	2,500	78,525.00	0.12
349	000898	鞍钢股份	20,900	78,375.00	0.12
350	600811	东方集团	26,000	78,260.00	0.12
351	000877	天山股份	5,100	78,081.00	0.12
352	000488	晨鸣纸业	10,700	77,468.00	0.12
353	002429	兆驰股份	15,900	77,274.00	0.12
354	002233	塔牌集团	7,300	77,234.00	0.12
355	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.12
356	688321	微芯生物	2,200	77,022.00	0.12
357	600597	光明乳业	5,300	76,956.00	0.12
358	600808	马钢股份	20,800	76,752.00	0.12
359	002440	闰土股份	8,000	76,720.00	0.12
360	603228	景旺电子	2,200	75,966.00	0.12
361	002155	湖南黄金	7,300	75,628.00	0.12
362	300166	东方国信	7,000	75,600.00	0.12
363	001914	招商积余	3,700	74,962.00	0.12
364	601200	上海环境	5,900	74,281.00	0.12
365	002416	爱施德	6,500	73,970.00	0.12
366	600037	歌华有线	8,500	73,780.00	0.11
367	600908	无锡银行	13,000	73,710.00	0.11
368	002085	万丰奥威	13,400	73,566.00	0.11
369	000559	万向钱潮	11,500	73,255.00	0.11
370	600398	海澜之家	11,400	73,074.00	0.11
371	600373	中文传媒	5,900	72,924.00	0.11
372	002110	三钢闽光	10,700	72,760.00	0.11
373	600906	财达证券	5,700	72,732.00	0.11
374	600026	中远海能	12,190	72,164.80	0.11
375	600167	联美控股	8,000	72,080.00	0.11
376	002705	新宝股份	2,900	71,630.00	0.11
377	600546	山煤国际	8,700	71,427.00	0.11
378	601000	唐山港	25,900	71,225.00	0.11
379	002081	金螳螂	11,700	71,136.00	0.11
380	600064	南京高科	7,600	70,984.00	0.11
381	601991	大唐发电	21,600	69,984.00	0.11

382	000528	柳工	9,000	69,390.00	0.11
383	600195	中牧股份	5,300	69,271.00	0.11
384	603000	人民网	4,800	69,216.00	0.11
385	601611	中国核建	6,900	68,793.00	0.11
386	601718	际华集团	23,000	68,540.00	0.11
387	000685	中山公用	7,700	68,145.00	0.11
388	002038	双鹭药业	6,300	68,103.00	0.11
389	601608	中信重工	15,200	67,792.00	0.11
390	300133	华策影视	10,000	67,700.00	0.11
391	002867	周大生	3,800	67,564.00	0.11
392	000158	常山北明	9,700	67,124.00	0.10
393	000090	天健集团	11,400	66,918.00	0.10
394	002387	维信诺	7,200	66,816.00	0.10
395	000959	首钢股份	11,600	66,468.00	0.10
396	600120	浙江东方	15,030	66,432.60	0.10
397	601333	广深铁路	29,600	66,304.00	0.10
398	000758	中色股份	12,100	66,066.00	0.10
399	000089	深圳机场	9,000	65,880.00	0.10
400	003022	联泓新科	1,800	65,592.00	0.10
401	600582	天地科技	14,500	63,510.00	0.10
402	600376	首开股份	11,200	63,392.00	0.10
403	000415	渤海租赁	21,600	62,856.00	0.10
404	000718	苏宁环球	13,200	62,172.00	0.10
405	600062	华润双鹤	4,600	61,502.00	0.10
406	601598	中国外运	13,700	61,376.00	0.10
407	601975	招商南油	30,300	60,903.00	0.09
408	000967	盈峰环境	8,300	60,839.00	0.09
409	002242	九阳股份	2,612	60,598.40	0.09
410	600126	杭钢股份	11,800	60,534.00	0.09
411	601098	中南传媒	6,300	60,291.00	0.09
412	600307	酒钢宏兴	27,300	60,060.00	0.09
413	000402	金融街	10,500	59,430.00	0.09
414	600556	天下秀	4,800	59,280.00	0.09
415	688289	圣湘生物	1,000	59,000.00	0.09
416	002458	益生股份	5,200	58,812.00	0.09
417	601958	金钼股份	8,400	57,540.00	0.09
418	600643	爱建集团	8,500	57,460.00	0.09
419	600959	江苏有线	17,400	57,246.00	0.09
420	002399	海普瑞	3,300	56,430.00	0.09

421	300257	开山股份	3,500	55,580.00	0.09
422	000563	陕国投 A	17,200	55,556.00	0.09
423	600056	中国医药	4,700	55,507.00	0.09
424	003035	南网能源	6,600	54,714.00	0.09
425	601928	凤凰传媒	6,700	54,203.00	0.08
426	002563	森马服饰	7,000	54,110.00	0.08
427	601860	紫金银行	16,000	53,600.00	0.08
428	600901	江苏租赁	10,500	53,445.00	0.08
429	603317	天味食品	1,988	53,298.28	0.08
430	600266	城建发展	11,800	53,100.00	0.08
431	600717	天津港	12,660	53,045.40	0.08
432	300741	华宝股份	1,100	52,635.00	0.08
433	002815	崇达技术	3,100	52,235.00	0.08
434	600968	海油发展	17,700	51,861.00	0.08
435	000937	冀中能源	9,300	51,243.00	0.08
436	002244	滨江集团	10,900	50,794.00	0.08
437	600095	湘财股份	5,000	50,600.00	0.08
438	000717	韶钢松山	10,600	50,350.00	0.08
439	600928	西安银行	11,600	49,880.00	0.08
440	002423	中粮资本	6,100	49,410.00	0.08
441	000062	深圳华强	2,800	48,244.00	0.08
442	002468	申通快递	5,300	48,177.00	0.07
443	000028	国药一致	1,300	48,074.00	0.07
444	600787	中储股份	7,700	48,048.00	0.07
445	600006	东风汽车	7,000	47,670.00	0.07
446	600776	东方通信	4,119	47,409.69	0.07
447	002424	贵州百灵	6,200	47,120.00	0.07
448	600729	重庆百货	1,800	46,836.00	0.07
449	600623	华谊集团	5,000	45,500.00	0.07
450	600649	城投控股	11,000	45,210.00	0.07
451	600339	中油工程	14,600	44,968.00	0.07
452	300869	康泰医学	1,100	44,605.00	0.07
453	600835	上海机电	2,800	44,576.00	0.07
454	002375	亚厦股份	5,900	44,191.00	0.07
455	601139	深圳燃气	5,000	44,150.00	0.07
456	600648	外高桥	3,300	43,659.00	0.07
457	600299	安迪苏	3,500	43,120.00	0.07
458	601969	海南矿业	3,500	42,035.00	0.07
459	000031	大悦城	11,200	41,776.00	0.06

460	000156	华数传媒	4,900	41,454.00	0.06
461	002653	海思科	1,900	38,760.00	0.06
462	600639	浦东金桥	3,000	38,310.00	0.06
463	000869	张裕 A	1,200	38,232.00	0.06
464	600871	石化油服	17,700	37,878.00	0.06
465	600377	宁沪高速	4,300	37,066.00	0.06
466	603379	三美股份	1,600	36,448.00	0.06
467	601828	美凯龙	4,100	36,121.00	0.06
468	601869	长飞光纤	1,100	36,014.00	0.06
469	002302	西部建设	4,400	35,332.00	0.05
470	601298	青岛港	6,200	35,278.00	0.05
471	603708	家家悦	2,100	34,944.00	0.05
472	000046	泛海控股	18,100	34,028.00	0.05
473	001872	招商港口	2,000	33,900.00	0.05
474	002948	青岛银行	7,200	33,336.00	0.05
475	601156	东航物流	1,500	32,820.00	0.05
476	002945	华林证券	2,400	32,784.00	0.05
477	600823	世茂股份	9,800	32,144.00	0.05
478	603786	科博达	400	32,120.00	0.05
479	000553	安道麦 A	3,800	32,072.00	0.05
480	001203	大中矿业	2,000	30,160.00	0.05
481	603719	良品铺子	700	29,729.00	0.05
482	603355	莱克电气	1,000	29,320.00	0.05
483	601568	北元集团	3,500	28,455.00	0.04
484	600350	山东高速	5,500	28,380.00	0.04
485	600657	信达地产	7,500	27,975.00	0.04
486	603056	德邦股份	2,700	27,621.00	0.04
487	600466	蓝光发展	13,300	27,132.00	0.04
488	603515	欧普照明	1,300	26,988.00	0.04
489	601665	齐鲁银行	4,400	24,552.00	0.04
490	002946	新乳业	1,500	23,910.00	0.04
491	600917	重庆燃气	2,800	23,492.00	0.04
492	601003	柳钢股份	4,500	23,490.00	0.04
493	600956	新天绿能	1,200	20,652.00	0.03
494	002901	大博医疗	400	20,248.00	0.03
495	600903	贵州燃气	2,000	19,360.00	0.03
496	603868	飞科电器	400	17,368.00	0.03
497	601187	厦门银行	2,500	17,250.00	0.03
498	603983	丸美股份	500	15,935.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	001234	泰慕士	268	4,430.04	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动**8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002709	天赐材料	1,925,140.00	1.46
2	002340	格林美	1,506,101.00	1.14
3	002074	国轩高科	1,457,484.00	1.10
4	300285	国瓷材料	1,367,499.00	1.04
5	000009	中国宝安	1,327,569.00	1.01
6	000799	酒鬼酒	1,140,043.00	0.86
7	300274	阳光电源	1,135,213.91	0.86
8	300207	欣旺达	989,567.00	0.75
9	300316	晶盛机电	924,583.00	0.70
10	002353	杰瑞股份	920,409.03	0.70
11	000988	华工科技	889,072.00	0.67
12	002185	华天科技	885,462.70	0.67
13	300037	新宙邦	882,886.00	0.67
14	300474	景嘉微	870,510.30	0.66
15	002385	大北农	837,089.00	0.63
16	300223	北京君正	828,028.00	0.63
17	000547	航天发展	818,968.00	0.62
18	300146	汤臣倍健	791,759.00	0.60
19	000932	华菱钢铁	779,136.24	0.59
20	002625	光启技术	776,152.60	0.59

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	3,202,902.00	2.43
2	002709	天赐材料	2,978,614.50	2.26
3	002074	国轩高科	2,522,331.00	1.91
4	300285	国瓷材料	1,893,178.00	1.43
5	002340	格林美	1,856,191.00	1.41
6	300207	欣旺达	1,833,395.81	1.39
7	300012	华测检测	1,679,878.63	1.27
8	300316	晶盛机电	1,618,018.00	1.23
9	000009	中国宝安	1,569,279.00	1.19
10	002625	光启技术	1,353,369.00	1.03
11	002185	华天科技	1,328,436.00	1.01
12	000547	航天发展	1,313,366.20	1.00
13	300496	中科创达	1,284,340.00	0.97
14	002353	杰瑞股份	1,226,480.00	0.93
15	002385	大北农	1,210,285.00	0.92
16	000799	酒鬼酒	1,136,933.00	0.86
17	002791	坚朗五金	1,128,026.60	0.85
18	002507	涪陵榨菜	1,100,027.00	0.83
19	000988	华工科技	1,096,924.97	0.83
20	002013	中航机电	1,085,079.27	0.82

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	131,714,865.15
卖出股票收入（成交）总额	171,763,929.62

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2203	中证 500 期货 2203 合约	2	2,922,320.00	86,160.00	-
公允价值变动总额合计(元)					86,160.00
股指期货投资本期收益(元)					796,893.20
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-35,320.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

江苏中天科技股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述等行为在本报告编制前一年内受到上海证券交易所的处罚。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	447,894.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,206.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	449,100.57

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001234	泰慕士	4,430.04	0.01	网下新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
532	32,035.10	12,898,814.00	75.69%	4,143,858.00	24.31%

9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中信建投证券股份有限公司	4,992,330.00	29.29%
2	东方证券股份有限公司	4,322,045.00	25.36%
3	广发证券股份有限公司	1,247,774.00	7.32%
4	广发期货有限公司	1,240,800.00	7.28%
5	华泰证券股份有限公司	1,049,565.00	6.16%
6	陈志伟	265,800.00	1.56%
7	王洁人	260,000.00	1.53%
8	杜娟	166,278.00	0.98%
9	虞朋荣	126,400.00	0.74%
10	靳绪玲	124,991.00	0.73%

注：期末上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	52,800,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	76,800,000.00
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	17,042,672.00

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人未出现重大人事变动。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 30,000.00 元；截至 2021 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	4	102,554,329.45	33.85%	26,798.77	33.52%	-
华泰证券	4	76,229,126.50	25.16%	19,922.86	24.92%	-
中金公司	2	30,706,873.54	10.13%	8,024.29	10.04%	-
中信证券	3	27,856,274.36	9.19%	7,583.63	9.49%	-
广发证券	2	25,410,498.29	8.39%	6,640.37	8.31%	-
申万宏源证	4	24,035,816.66	7.93%	6,553.06	8.20%	-

券						
天风证券	2	6,581,333.44	2.17%	1,793.29	2.24%	-
开源证券	2	5,696,510.60	1.88%	1,559.44	1.95%	-
安信证券	4	3,461,200.16	1.14%	950.72	1.19%	-
光大证券	4	449,953.69	0.15%	122.88	0.15%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	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 11 个交易单元，为开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元

各 1 个，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，浙商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信证券北京证券交易所交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	24,569.99	15.72%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	131,704.05	84.28%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰康资产管理有限责任公司关于修订旗下指数基金法律文件的公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日	2021 年 3 月 30 日

	告	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	
2	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
3	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
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
5	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
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
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
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	2021 年 3 月 12 日

		子披露网站及基金管理人网站	
9	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
10	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
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	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南财富(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
13	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
14	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
15	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

16	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
17	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
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
19	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
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
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
22	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
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上海利	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日	2021年7月12日

	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	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	
24	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
25	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北京新浪仓石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7月21日
26	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天风证券股份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7月21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7月26日
28	关于旗下基金开展直销电子交易系统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30日
29	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上海浦东发展银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年7月30日
30	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	2021年8月4日

		子披露网站及基金管理人网站	
31	关于直销电子交易系统开通赎回转申购业务并开展相关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8月6日
32	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泰信财富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8月12日
33	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司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9月2日
34	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9月3日
35	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创金启富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9月6日
36	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9月7日
37	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天天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9月10日

38	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上海基煜基金销售有限公司转换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9月27日
39	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创金启富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9月30日
40	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信证券华南股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年10月15日
41	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宜信普泽（北京）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10月22日
42	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10月28日
43	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泰信财富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11月18日
44	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11月19日
45	泰康资产管理有限责任公司关于旗下部分公募基金可投资北交所	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日	2021年11月20日

	股票的公告	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	
46	关于直销电子交易系统开通赎回 转申购业务并开展相关费率优惠 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 11 月 23 日
47	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国信证 券股份有限公司费率优惠活动的 公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券日 报》、《证券时报》、 中国证监会基金电 子披露网站及基金 管理人网站	2021 年 11 月 26 日
48	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宜信 普泽（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 12 月 29 日
49	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 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210225-20210301	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	2	20210304-20210406	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	3	20210408-20210617	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	4	20210623-20210623	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	5	20210625-20210625	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	6	20210720-20210720	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	7	20210728-20210729	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	8	20210813-20210813	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	9	20210817-20210818	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	10	20210928-20210928	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	11	2021220-20211231	3,494,973.00	44,053,738.00	43,226,666.00	4,322,045.00	25.36%
	12	20210813-20211231	0.00	4,150,000.00	0.00	4,150,000.00	24.35%
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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康中证 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》。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日