

泰康中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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.....	13
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 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§ 7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
7.7 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.....	62
7.8 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.....	62
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.....	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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情况.....	65
§ 9 开放式基金份额变动.....	66
§ 10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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.....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§ 12 备查文件目录.....	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 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	14,642,672.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 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	<p>本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-5,770,963.99
本期利润	-6,102,539.70
加权平均基金份额本期利润	-0.4036
本期加权平均净值利润率	-12.32%
本期基金份额净值增长率	-11.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	2,269,619.68
期末可供分配基金份额利润	0.1550
期末基金资产净值	49,130,508.18
期末基金份额净值	3.3553
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	4.85%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

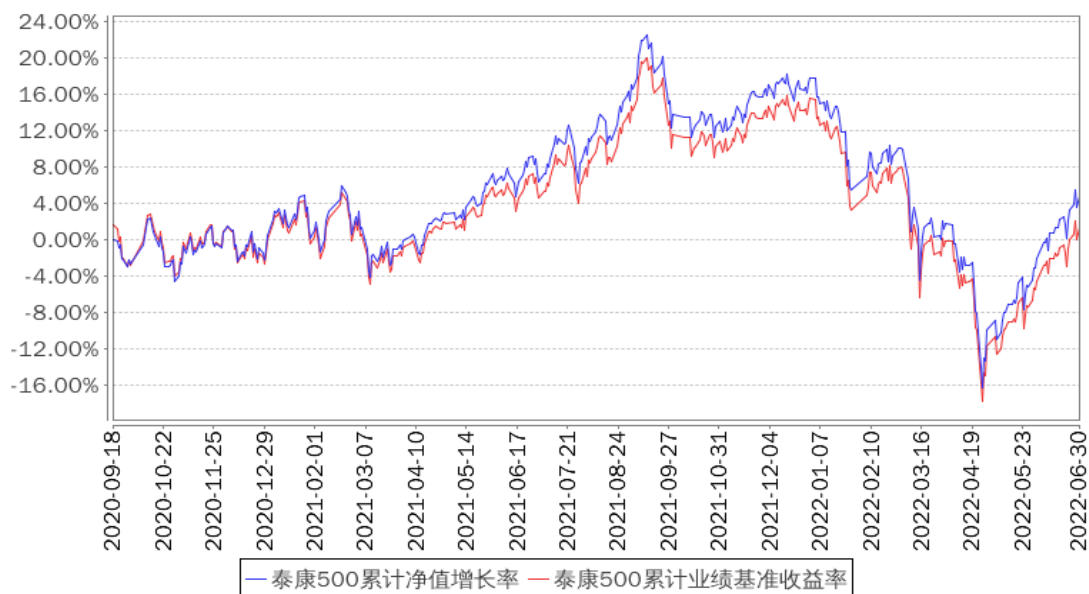
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.11%	1.10%	7.10%	1.10%	1.01%	0.00%
过去三个月	3.62%	1.75%	2.04%	1.75%	1.58%	0.00%
过去六个月	-11.08%	1.63%	-12.30%	1.63%	1.22%	0.00%

过去一年	-3.71%	1.32%	-5.20%	1.33%	1.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.85%	1.20%	1.37%	1.21%	3.48%	-0.01%

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

泰康500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。

§ 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。

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 2022 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、泰康裕泰债券型证券投资基金、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证券投资基金、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基金中基金（FOF）、泰康研究精选股票型发起式证券投资基金、泰康沪港深成长混合型证券投资基金、泰康医疗健康股票型发起式证券投资基金、泰康招享混合型证券投资基金，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 年	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。2022 年 8 月 1 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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，2022 年上半年受到疫情较大扰动，经济的表现一波三折。1-2 月宏观表现较为稳健，但 3 月份开始疫情在全国散发，部分地区经历了静默，经济活动明显受限。随着疫情逐步得控，5-6 月经济走出低谷。政策也加大了调节力度，包括较大规模的留抵退税安排、债券发行前置、流动性宽松、地产因城施策放松等。各部门的经济活动也因此有所分化，居民消费和收入等受到一定的影响，投资活动中房地产较弱，基建和制造业则有一定表现，出口则由于国内供应链的恢复而明显复苏。物价方面，海外通胀居高不下，国内 PPI 同比下行，CPI 中食品 and 核心 CPI 表现分化。

权益市场方面，一季度，自 2021 年 12 月高点起，市场逐步经历了估值过高交易拥挤，国内

经济下行，俄乌战争导致的滞涨，美联储加息等多重风险冲击，市场估值风险初步释放，稳增长政策方向得以确定。二季度市场波动较大，四月份基于对未来经济的不确定性引发了市场大幅下跌，各种资金充分出清；五月份起，一方面国内受疫情影响的经济开始修复，稳增长政策力度较强，修复了市场的风险偏好，另一方面，海外衰退预期逐步增强，美联储加息风险放缓，国内估值压力大幅缓解。从大盘和板块上来看，上证综指下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，中小板指下跌 11.56%，创业板指下跌 15.41%。其中，煤炭、消费者服务、交通运输等板块表现相对较好，综合金融、传媒、电子等行业表现不佳。

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，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、指数成分股调整。报告期内，跟踪指数先大幅下跌后有所反弹，整体大幅下跌，我们认为宽基指数配置价值仍然较高，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。

4.4.2 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 3.3553 元，本报告期基金份额净值增长率为 -11.08%；同期业绩比较基准增长率为 -12.30%。

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 年下半年，宏观经济有望呈现复苏的态势，但幅度不会太强，总体上是斜率偏慢、存在阻力的复苏。阻力主要来源于两个方面，一是随着海外衰退压力逐步加大，外需下滑对出口的影响需要关注；二是房地产部门对于经济的影响。但在常态化防控、疫情总体可控的背景下，下半年消费、服务业等有望逐步缓慢恢复；此外，逆周期政策也将逐步落地见效，前期集中发行的专项债预计将逐步形成实物工作量，流动性宽松也对总体融资需求有所呵护。

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。展望下半年，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 2022 年 3 月 21 日至 2022 年 5 月 23 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,469,855.69	1,249,959.27
结算备付金		1,270,855.48	1,409,486.34
存出保证金		381,457.71	447,894.35
交易性金融资产	6.4.7.2	45,700,650.58	61,357,881.62
其中：股票投资		45,700,650.58	61,357,881.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,206.22
资产总计		50,822,819.46	64,466,427.80
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		1,048,040.11	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		15,806.77	18,278.98
应付托管费		1,975.85	2,284.88
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	2,999.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	626,488.55	135,004.06
负债合计		1,692,311.28	158,567.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	46,860,888.50	54,541,599.51
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,269,619.68	9,766,260.51
净资产合计		49,130,508.18	64,307,860.02
负债和净资产总计		50,822,819.46	64,466,427.80

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.3553 元，基金份额总额 14,642,672.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,872,663.90	6,746,944.31
1. 利息收入		16,002.80	14,373.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,002.80	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）		-5,853,136.05	5,604,725.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,062,351.10	4,805,575.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,026.91	9,567.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-296,762.76	427,145.63
股利收益	6.4.7.19	503,950.90	362,436.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-331,575.71	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）	6.4.7.21	296,045.06	323,771.68
减：二、营业总支出		229,875.80	466,194.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	98,413.95	117,659.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,301.80	14,707.45
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	1,537.74
8. 其他费用	6.4.7.23	119,160.05	332,290.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,102,539.70	6,280,749.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,102,539.70	6,280,749.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,102,539.70	6,280,749.39

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	54,541,599.51	-	9,766,260.51	64,307,860.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产 (基金净值)	54,541,599.51	-	9,766,260.51	64,307,860.02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-7,680,711.01	-	-7,496,640.83	-15,177,351.84
(一)、综合收益总额	-	-	-6,102,539.70	-6,102,539.70
(二)、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)	-7,680,711.01	-	-1,394,101.13	-9,074,812.14
其中: 1. 基金申购款	69,126,399.29	-	-1,521,298.59	67,605,100.70
2. 基金赎回款	-76,807,110.30	-	127,197.46	-76,679,912.84
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	46,860,888.50	-	2,269,619.68	49,130,508.18
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	131,348,709.72	-	639,885.10	131,988,594.82
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	131,348,709.72	-	639,885.10	131,988,594.82
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-89,608,295.28	-	3,069,458.40	-86,538,836.88
(一)、综合收益总额	-	-	6,280,749.39	6,280,749.39
(二)、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

(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	41,740,414.44	-	3,709,343.50	45,449,757.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康中证 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

（a）金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

（1）金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表

中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

(b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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；对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

(c) 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由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投资收益。

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扣除相关交易费用及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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证券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。

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。

(d) 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。

以摊余成本计量的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。

(e) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 1,249,959.27 元、1,409,486.34 元、447,894.35 元和 1,206.22 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 1,250,347.13 元、1,410,285.56 元、447,913.49 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 61,357,881.62 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 61,357,881.62 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 18,278.98 元、2,284.88 元、15,838.80 元和 119,165.26 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 18,278.98 元、2,284.88 元、15,838.80 元和 119,165.26 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(f) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

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。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。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,469,855.69
等于：本金	3,469,563.21
加：应计利息	292.48
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,469,855.69

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,856,295.71	-	45,700,650.58	844,354.87
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	44,856,295.71	-	45,700,650.58	844,354.87

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	2,470,400.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,470,400.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,470,400.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2209	中证 500期 货2209 合约	2.00	2,545,600.00	75,200.00
合计				75,200.00
减：可抵销期货暂收款				75,200.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备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。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期末，本基金无计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本报告期末，本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	16,091.42
其中：交易所市场	16,091.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,343.16
应付指数使用费	3,413.25
应退替代款	271,765.02
可退替代款	225,875.70
合计	626,488.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,042,672.00	54,541,599.51
本期申购	21,600,000.00	69,126,399.29
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-76,807,110.30
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	14,642,672.00	46,860,888.50

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	10,933,360.15	-1,167,099.64	9,766,260.51
本期利润	-5,770,963.99	-331,575.71	-6,102,539.70
本期基金份额交易产生的变动数	-1,221,410.25	-172,690.88	-1,394,101.13
其中：基金申购款	9,062,735.81	-10,584,034.40	-1,521,298.59
基金赎回款	-10,284,146.06	10,411,343.52	127,197.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,940,985.91	-1,671,366.23	2,269,619.68

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	活期存款利息收入	
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		10,861.81
其他		260.45
合计		16,002.80

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,185,613.88
股票投资收益——赎回差价收入	-1,876,737.22
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	-6,062,351.10

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	49,368,325.77
减：卖出股票成本总额	53,470,327.03
减：交易费用	83,612.62
买卖股票差价收入	-4,185,613.88

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	76,679,912.84
减：现金支付赎回款总额	39,619,858.84
减：赎回股票成本总额	38,936,791.22
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,876,737.22

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,024.33
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	2,026.91

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,127.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,100.00
减：应计利息总额	2.58
减：交易费用	0.69
买卖债券差价收入	2,024.33

6.4.7.16 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。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-296,762.76

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	503,950.90
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	503,950.90

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-320,615.71
股票投资	-320,615.71
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-10,960.00
权证投资	-
期货投资	-10,960.00
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	-331,575.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	296,045.06
合计	296,045.06

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。

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期，本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	1,403.64
指数使用费	38,413.25
其他	24,795.19
合计	119,160.05

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

本报告期基金管理人成立控股子公司泰康基金管理有限公司。

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(“招商银行”)	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

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	98,413.95	117,659.67
其中：支付销售机构的客户维护费	14,581.48	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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	12,301.80	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固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固有资金投资本基金。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	3,469,855.69	4,880.54	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

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，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(2022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2022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
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项停牌	9.60	2022年7月14日	9.99	8,700	81,407.68	83,520.00	-

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2022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 2022 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 2022 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。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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	上年度末
--------	-----	------

	2022 年 6 月 30 日	2021 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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，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 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 2022 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 2022

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 2022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	3,469,855.69	-	-	-	3,469,855.69
结算备付金	1,270,855.48	-	-	-	1,270,855.48
存出保证金	381,457.71	-	-	-	381,457.71
交易性金融资产	-	-	-	45,700,650.58	45,700,650.58
资产总计	5,122,168.88	-	-	45,700,650.58	50,822,819.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,806.77	15,806.77
应付托管费	-	-	-	1,975.85	1,975.85
应付清算款	-	-	-	1,048,040.11	1,048,040.11

其他负债	-	-	-	626,488.55	626,488.55
负债总计	-	-	-	1,692,311.28	1,692,311.28
利率敏感度缺口	5,122,168.88	-	-	44,008,339.30	49,130,508.18
上年度末 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
其他资产	-	-	-	1,206.22	1,206.22
资产总计	2,698,215.16	-	-	61,768,212.64	64,466,427.80
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	18,278.98	-
应付托管费	-	-	-	2,284.88	-
应交税费	-	-	-	2,999.86	-
其他负债	-	-	-	135,004.06	-
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

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率下调 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。本基金本期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 2022年6月30日		上年度末 2021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	45,700,650.58	93.02	61,357,881.62	95.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	45,700,650.58	93.02	61,357,881.62	95.41

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		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准中的权益指数上涨 5%	1,998,830.83	1,679,403.42

业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-1,998,830.83	-1,679,403.42
-------------------	---------------	---------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	45,617,130.58	61,245,019.58
第二层次	-	112,862.04
第三层次	83,520.00	-
合计	45,700,650.58	61,357,881.62

6.4.14.2.2 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2022 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 67,605,100.70 元(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间：65,409,404.47 元)，其中包括以股票支付的申购款 28,992,470.00 元和以现金支付的申购款 38,612,630.70 元(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间：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)。

(2) 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	45,700,650.58	89.92
	其中：股票	45,700,650.58	89.92
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	4,740,711.17	9.33
8	其他各项资产	381,457.71	0.75
9	合计	50,822,819.46	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	424,309.60	0.86
B	采矿业	2,002,430.80	4.08
C	制造业	27,215,615.94	55.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,379,260.25	2.81
E	建筑业	569,730.00	1.16
F	批发和零售业	1,735,154.80	3.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,177,128.30	2.40
H	住宿和餐饮业	94,240.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,384,591.40	6.89
J	金融业	4,021,315.15	8.18
K	房地产业	1,085,742.00	2.21
L	租赁和商务服务业	561,362.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	575,136.00	1.17

N	水利、环境和公共设施管理业	337,283.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	108,850.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	640,413.00	1.30
S	综合	334,069.00	0.68
	合计	45,646,631.24	92.91

7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,892.54	0.08
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	36,892.54	0.08

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	18,200	420,420.00	0.86
2	601615	明阳智能	11,200	378,560.00	0.77
3	600256	广汇能源	30,600	322,524.00	0.66
4	300769	德方纳米	700	286,076.00	0.58

5	300012	华测检测	12,100	280,841.00	0.57
6	600096	云天化	8,600	270,728.00	0.55
7	002180	纳思达	5,300	268,286.00	0.55
8	002497	雅化集团	8,100	264,465.00	0.54
9	002407	多氟多	5,400	264,114.00	0.54
10	002240	盛新锂能	4,300	259,548.00	0.53
11	300390	天华超净	2,900	253,460.00	0.52
12	000009	中国宝安	18,100	244,169.00	0.50
13	002384	东山精密	10,300	236,179.00	0.48
14	600157	永泰能源	148,100	235,479.00	0.48
15	300073	当升科技	2,600	234,884.00	0.48
16	600885	宏发股份	5,580	233,523.00	0.48
17	600141	兴发集团	5,200	228,748.00	0.47
18	300285	国瓷材料	6,000	215,520.00	0.44
19	002756	永兴材料	1,400	213,094.00	0.43
20	600392	盛和资源	9,300	210,180.00	0.43
21	603613	国联股份	2,365	209,539.00	0.43
22	600418	江淮汽车	11,600	199,056.00	0.41
23	000983	山西焦煤	14,500	194,155.00	0.40
24	300037	新宙邦	3,680	193,420.80	0.39
25	600399	抚顺特钢	10,600	189,740.00	0.39
26	600765	中航重机	5,860	188,574.80	0.38
27	300363	博腾股份	2,400	187,176.00	0.38
28	600233	圆通速递	9,100	185,549.00	0.38
29	601555	东吴证券	26,700	185,031.00	0.38
30	002385	大北农	23,650	184,706.50	0.38
31	600563	法拉电子	900	184,644.00	0.38
32	688122	西部超导	2,000	184,400.00	0.38
33	601058	赛轮轮胎	16,300	183,701.00	0.37
34	600487	亨通光电	12,600	183,204.00	0.37
35	600499	科达制造	8,800	181,632.00	0.37
36	600732	爱旭股份	5,500	181,610.00	0.37
37	002268	卫士通	4,200	180,222.00	0.37
38	300144	宋城演艺	11,700	179,595.00	0.37
39	603077	和邦生物	41,200	175,512.00	0.36
40	002353	杰瑞股份	4,300	173,290.00	0.35
41	688180	君实生物	2,300	173,282.00	0.35
42	000519	中兵红箭	5,900	171,985.00	0.35
43	601108	财通证券	21,700	170,779.00	0.35
44	603456	九洲药业	3,300	170,610.00	0.35
45	000630	铜陵有色	52,100	169,846.00	0.35
46	000988	华工科技	7,100	164,507.00	0.33

47	000783	长江证券	27,400	162,482.00	0.33
48	002507	涪陵榨菜	4,700	162,244.00	0.33
49	688099	晶晨股份	1,600	161,600.00	0.33
50	002797	第一创业	25,200	161,532.00	0.33
51	600298	安琪酵母	3,300	160,875.00	0.33
52	300724	捷佳伟创	1,800	160,830.00	0.33
53	002028	思源电气	4,500	160,470.00	0.33
54	600486	扬农化工	1,200	159,936.00	0.33
55	002056	横店东磁	6,000	159,720.00	0.33
56	600862	中航高科	5,600	157,360.00	0.32
57	002625	光启技术	9,100	157,157.00	0.32
58	300146	汤臣倍健	7,200	155,880.00	0.32
59	601077	渝农商行	41,300	152,810.00	0.31
60	603345	安井食品	900	151,083.00	0.31
61	601168	西部矿业	12,700	150,241.00	0.31
62	002185	华天科技	15,900	149,142.00	0.30
63	000932	华菱钢铁	29,288	149,075.92	0.30
64	002078	太阳纸业	12,100	148,951.00	0.30
65	000830	鲁西化工	8,600	148,694.00	0.30
66	601696	中银证券	11,100	147,630.00	0.30
67	601162	天风证券	46,200	146,916.00	0.30
68	688777	中控技术	2,000	145,520.00	0.30
69	002326	永太科技	4,400	144,892.00	0.29
70	002603	以岭药业	5,940	144,342.00	0.29
71	600988	赤峰黄金	8,900	141,955.00	0.29
72	603589	口子窖	2,400	140,664.00	0.29
73	002422	科伦药业	7,500	140,250.00	0.29
74	605117	德业股份	500	139,945.00	0.28
75	601128	常熟银行	18,300	139,812.00	0.28
76	603517	绝味食品	2,400	138,768.00	0.28
77	002624	完美世界	9,600	137,952.00	0.28
78	000831	五矿稀土	4,400	137,500.00	0.28
79	601636	旗滨集团	10,700	136,425.00	0.28
80	300088	长信科技	18,300	135,786.00	0.28
81	603605	珀莱雅	820	135,447.60	0.28
82	300699	光威复材	2,300	135,401.00	0.28
83	600039	四川路桥	12,800	134,784.00	0.27
84	600109	国金证券	14,900	134,100.00	0.27
85	600521	华海药业	5,900	133,930.00	0.27
86	601607	上海医药	7,400	133,792.00	0.27
87	002138	顺络电子	4,900	133,525.00	0.27
88	002572	索菲亚	4,800	132,000.00	0.27

89	600348	华阳股份	8,500	131,410.00	0.27
90	002557	洽洽食品	2,300	130,939.00	0.27
91	603026	石大胜华	900	130,815.00	0.27
92	002673	西部证券	20,000	130,800.00	0.27
93	600153	建发股份	9,900	129,393.00	0.26
94	000738	航发控制	4,600	129,260.00	0.26
95	300676	华大基因	1,800	129,060.00	0.26
96	000807	云铝股份	13,000	128,440.00	0.26
97	600546	山煤国际	6,600	128,436.00	0.26
98	000970	中科三环	6,805	127,797.90	0.26
99	000039	中集集团	9,200	127,420.00	0.26
100	603939	益丰药房	2,400	126,792.00	0.26
101	000999	华润三九	2,800	126,000.00	0.26
102	000960	锡业股份	7,500	125,775.00	0.26
103	688390	固德威	400	125,204.00	0.25
104	002030	达安基因	7,260	124,799.40	0.25
105	601872	招商轮船	21,600	124,416.00	0.25
106	000998	隆平高科	7,400	123,284.00	0.25
107	600549	厦门钨业	5,700	123,234.00	0.25
108	600705	中航产融	35,600	123,176.00	0.25
109	600497	驰宏锌锗	23,700	123,003.00	0.25
110	600177	雅戈尔	18,500	122,655.00	0.25
111	601990	南京证券	14,700	122,598.00	0.25
112	002508	老板电器	3,400	122,502.00	0.25
113	000629	攀钢钒钛	32,100	121,980.00	0.25
114	000728	国元证券	19,600	121,912.00	0.25
115	600875	东方电气	7,400	121,730.00	0.25
116	000975	银泰黄金	12,420	120,970.80	0.25
117	603267	鸿远电子	900	120,897.00	0.25
118	002273	水晶光电	9,800	118,678.00	0.24
119	600160	巨化股份	9,000	118,350.00	0.24
120	002465	海格通信	13,000	118,170.00	0.24
121	601699	潞安环能	8,000	116,960.00	0.24
122	600859	王府井	4,500	116,910.00	0.24
123	300357	我武生物	2,243	116,703.29	0.24
124	603444	吉比特	300	116,400.00	0.24
125	600516	方大炭素	15,300	116,280.00	0.24
126	300558	贝达药业	1,900	115,520.00	0.24
127	300418	昆仑万维	7,200	115,200.00	0.23
128	600143	金发科技	12,100	115,192.00	0.23
129	300058	蓝色光标	17,600	114,928.00	0.23
130	002739	万达电影	8,400	114,660.00	0.23

131	300136	信维通信	6,800	114,580.00	0.23
132	002506	协鑫集成	30,700	114,204.00	0.23
133	603127	昭衍新药	1,000	113,800.00	0.23
134	002092	中泰化学	14,600	113,296.00	0.23
135	601997	贵阳银行	19,500	113,295.00	0.23
136	600482	中国动力	7,200	113,112.00	0.23
137	000636	风华高科	6,000	112,740.00	0.23
138	000547	航天发展	9,400	112,236.00	0.23
139	300308	中际旭创	3,600	111,780.00	0.23
140	002409	雅克科技	2,000	111,020.00	0.23
141	002223	鱼跃医疗	4,300	110,338.00	0.22
142	002294	信立泰	3,900	109,590.00	0.22
143	300244	迪安诊断	3,500	108,850.00	0.22
144	600170	上海建工	35,600	107,868.00	0.22
145	002372	伟星新材	4,487	107,867.48	0.22
146	002156	通富微电	7,000	107,800.00	0.22
147	002299	圣农发展	5,600	107,408.00	0.22
148	300253	卫宁健康	12,200	107,116.00	0.22
149	601577	长沙银行	13,400	106,262.00	0.22
150	600704	物产中大	20,700	106,191.00	0.22
151	300474	景嘉微	1,550	106,004.50	0.22
152	300296	利亚德	14,400	105,120.00	0.21
153	000513	丽珠集团	2,900	105,009.00	0.21
154	600739	辽宁成大	7,200	104,976.00	0.21
155	603198	迎驾贡酒	1,600	104,224.00	0.21
156	600079	人福医药	6,500	104,000.00	0.21
157	000750	国海证券	28,500	103,455.00	0.21
158	002408	齐翔腾达	12,740	103,321.40	0.21
159	002683	广东宏大	3,700	102,971.00	0.21
160	600536	中国软件	2,530	102,692.70	0.21
161	600415	小商品城	18,300	101,931.00	0.21
162	000878	云南铜业	8,900	101,371.00	0.21
163	600372	中航电子	5,200	100,828.00	0.21
164	600699	均胜电子	6,400	100,544.00	0.20
165	000887	中鼎股份	5,500	100,320.00	0.20
166	002065	东华软件	15,800	99,856.00	0.20
167	002439	启明星辰	5,000	99,650.00	0.20
168	688185	康希诺	500	99,540.00	0.20
169	300832	新产业	2,200	99,242.00	0.20
170	600315	上海家化	2,300	98,325.00	0.20
171	300017	网宿科技	18,300	98,088.00	0.20
172	600637	东方明珠	13,700	97,955.00	0.20

173	300383	光环新网	9,400	97,948.00	0.20
174	002936	郑州银行	36,380	97,862.20	0.20
175	300026	红日药业	12,700	97,790.00	0.20
176	000623	吉林敖东	6,600	97,416.00	0.20
177	002203	海亮股份	8,400	97,020.00	0.20
178	000729	燕京啤酒	10,000	96,600.00	0.20
179	600867	通化东宝	9,300	96,162.00	0.20
180	600985	淮北矿业	6,600	96,096.00	0.20
181	600056	中国医药	6,480	96,033.60	0.20
182	000400	许继电气	5,000	96,000.00	0.20
182	601016	节能风电	20,000	96,000.00	0.20
184	600236	桂冠电力	15,700	95,613.00	0.19
185	601198	东兴证券	10,700	95,230.00	0.19
186	600171	上海贝岭	3,800	95,114.00	0.19
187	600026	中远海能	9,190	94,932.70	0.19
188	600258	首旅酒店	3,800	94,240.00	0.19
189	600879	航天电子	14,500	94,105.00	0.19
190	002958	青农商行	28,300	93,956.00	0.19
191	002430	杭氧股份	3,000	93,780.00	0.19
192	601717	郑煤机	6,500	93,665.00	0.19
193	600642	申能股份	16,400	93,152.00	0.19
194	600380	健康元	7,515	92,810.25	0.19
195	300618	寒锐钴业	1,600	92,672.00	0.19
196	002131	利欧股份	47,700	92,538.00	0.19
197	002444	巨星科技	4,900	92,316.00	0.19
198	002373	千方科技	8,300	92,296.00	0.19
199	002183	怡亚通	12,800	92,288.00	0.19
200	000050	深天马 A	9,200	91,724.00	0.19
201	002195	二三四五	40,600	91,350.00	0.19
202	000739	普洛药业	4,400	90,816.00	0.18
203	300001	特锐德	5,200	90,012.00	0.18
204	600038	中直股份	1,990	89,948.00	0.18
205	600673	东阳光	10,000	89,900.00	0.18
206	600529	山东药玻	3,200	89,440.00	0.18
207	600820	隧道股份	14,600	89,352.00	0.18
208	002985	北摩高科	1,504	88,104.32	0.18
209	300024	机器人	8,728	87,978.24	0.18
210	600580	卧龙电驱	6,100	87,962.00	0.18
211	002926	华西证券	11,200	87,808.00	0.18
212	600801	华新水泥	4,500	87,795.00	0.18
213	000825	太钢不锈	16,100	87,745.00	0.18
214	600369	西南证券	22,100	87,737.00	0.18

215	000060	中金岭南	19,600	87,416.00	0.18
216	002500	山西证券	15,200	87,248.00	0.18
217	600166	福田汽车	30,700	86,881.00	0.18
218	600848	上海临港	6,400	86,784.00	0.18
219	603568	伟明环保	2,600	86,762.00	0.18
220	000027	深圳能源	13,500	86,535.00	0.18
221	600325	华发股份	11,300	85,541.00	0.17
222	601005	重庆钢铁	44,700	85,377.00	0.17
223	600909	华安证券	18,760	85,358.00	0.17
224	600027	华电国际	21,700	85,281.00	0.17
225	002250	联化科技	5,200	85,124.00	0.17
226	600008	首创环保	29,300	84,970.00	0.17
227	600316	洪都航空	2,800	84,672.00	0.17
228	002212	天融信	8,342	84,671.30	0.17
229	300070	碧水源	16,200	84,402.00	0.17
230	688256	寒武纪	1,300	84,110.00	0.17
231	002670	国盛金控	8,700	83,520.00	0.17
232	300251	光线传媒	8,800	83,336.00	0.17
233	002249	大洋电机	13,400	82,276.00	0.17
234	300677	英科医疗	3,240	82,166.40	0.17
235	000961	中南建设	26,900	82,045.00	0.17
236	300009	安科生物	8,100	81,891.00	0.17
237	002152	广电运通	8,800	81,576.00	0.17
238	000021	深科技	7,000	81,480.00	0.17
239	000778	新兴铸管	16,900	81,458.00	0.17
240	603218	日月股份	3,200	81,280.00	0.17
241	600271	航天信息	7,400	80,956.00	0.16
242	000997	新大陆	6,100	80,581.00	0.16
243	002244	滨江集团	9,300	80,445.00	0.16
244	600118	中国卫星	4,000	80,320.00	0.16
245	300182	捷成股份	14,600	80,300.00	0.16
246	000656	金科股份	28,000	80,080.00	0.16
247	600863	内蒙华电	21,800	79,570.00	0.16
248	300168	万达信息	8,400	79,296.00	0.16
249	002396	星网锐捷	3,500	79,240.00	0.16
250	601866	中远海发	26,400	79,200.00	0.16
251	688521	芯原股份	1,600	79,040.00	0.16
252	300482	万孚生物	1,940	78,977.40	0.16
253	600208	新湖中宝	28,600	78,936.00	0.16
254	002966	苏州银行	12,940	78,934.00	0.16
255	000401	冀东水泥	7,500	78,900.00	0.16
256	002191	劲嘉股份	7,300	78,256.00	0.16

257	603658	安图生物	1,600	78,224.00	0.16
258	688009	中国通号	17,100	77,463.00	0.16
259	002128	电投能源	5,400	77,328.00	0.16
260	603156	养元饮品	3,400	77,248.00	0.16
261	600066	宇通客车	8,900	76,985.00	0.16
262	002019	亿帆医药	5,500	76,890.00	0.16
263	002831	裕同科技	2,600	76,830.00	0.16
264	601992	金隅集团	27,700	76,729.00	0.16
265	603233	大参林	2,440	76,372.00	0.16
266	002221	东华能源	8,200	76,342.00	0.16
267	002505	鹏都农牧	22,500	76,275.00	0.16
268	000987	越秀金控	10,755	75,607.65	0.15
269	002153	石基信息	4,760	75,541.20	0.15
270	603858	步长制药	3,800	74,898.00	0.15
271	002127	南极电商	13,900	74,226.00	0.15
272	601228	广州港	20,200	74,134.00	0.15
273	600998	九州通	6,200	73,842.00	0.15
274	600390	五矿资本	15,000	73,350.00	0.15
275	600970	中材国际	7,500	72,675.00	0.15
276	002266	浙富控股	15,100	72,329.00	0.15
277	600667	太极实业	9,800	72,324.00	0.15
278	000012	南玻 A	9,700	71,974.00	0.15
279	603885	吉祥航空	4,000	71,960.00	0.15
280	000709	河钢股份	31,800	71,868.00	0.15
281	600062	华润双鹤	2,800	71,848.00	0.15
282	600528	中铁工业	8,900	71,645.00	0.15
283	002155	湖南黄金	5,900	71,626.00	0.15
284	000883	湖北能源	14,000	71,540.00	0.15
285	688002	睿创微纳	1,800	71,496.00	0.15
286	000930	中粮科技	7,900	71,416.00	0.15
287	600827	百联股份	5,400	71,334.00	0.15
288	000581	威孚高科	3,700	71,225.00	0.14
289	002939	长城证券	7,000	71,120.00	0.14
290	600839	四川长虹	24,600	70,848.00	0.14
291	600021	上海电力	6,901	70,735.25	0.14
292	600297	广汇汽车	27,000	70,470.00	0.14
293	002511	中顺洁柔	5,600	70,112.00	0.14
294	603707	健友股份	2,480	69,936.00	0.14
295	002124	天邦食品	10,380	69,753.60	0.14
296	002701	奥瑞金	13,400	69,680.00	0.14
297	600598	北大荒	4,700	69,372.00	0.14
298	000686	东北证券	9,900	69,201.00	0.14

299	600155	华创阳安	8,100	68,688.00	0.14
300	000598	兴蓉环境	13,400	68,474.00	0.14
301	600201	生物股份	7,447	68,214.52	0.14
302	600498	烽火通信	4,700	68,056.00	0.14
303	600409	三友化工	8,300	67,977.00	0.14
304	000690	宝新能源	15,400	67,452.00	0.14
305	600511	国药股份	2,500	66,950.00	0.14
306	300630	普利制药	1,900	66,785.00	0.14
307	300376	易事特	8,200	66,584.00	0.14
308	300888	稳健医疗	1,000	66,500.00	0.14
309	600060	海信视像	5,300	66,250.00	0.13
310	603712	七一二	2,100	66,150.00	0.13
311	600755	厦门国贸	8,800	66,000.00	0.13
312	600259	广晟有色	1,300	65,845.00	0.13
313	002002	鸿达兴业	17,700	65,667.00	0.13
314	600718	东软集团	5,700	65,607.00	0.13
315	600959	江苏有线	20,100	65,526.00	0.13
316	002745	木林森	6,700	65,459.00	0.13
317	600566	济川药业	2,400	65,184.00	0.13
318	002429	兆驰股份	16,900	64,896.00	0.13
319	600895	张江高科	5,200	64,740.00	0.13
320	600282	南钢股份	20,500	64,575.00	0.13
321	002468	申通快递	5,400	64,368.00	0.13
322	601179	中国西电	13,700	64,116.00	0.13
323	601880	辽港股份	37,700	64,090.00	0.13
324	600782	新钢股份	12,700	64,008.00	0.13
325	002532	天山铝业	9,800	63,994.00	0.13
326	002595	豪迈科技	2,861	63,914.74	0.13
327	600022	山东钢铁	36,500	63,510.00	0.13
328	688006	杭可科技	900	63,054.00	0.13
329	002390	信邦制药	9,100	62,881.00	0.13
330	600064	南京高科	5,700	62,700.00	0.13
331	601778	晶科科技	11,600	62,640.00	0.13
332	002004	华邦健康	11,200	62,496.00	0.13
333	600535	天士力	5,900	62,009.00	0.13
334	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.13
335	300463	迈克生物	3,000	61,470.00	0.13
336	000785	居然之家	13,800	61,410.00	0.12
337	300115	长盈精密	5,940	61,241.40	0.12
338	600500	中化国际	9,200	61,180.00	0.12
339	600037	歌华有线	6,500	61,035.00	0.12
340	600808	马钢股份	16,100	61,019.00	0.12

341	600216	浙江医药	4,412	60,223.80	0.12
342	600663	陆家嘴	5,800	60,088.00	0.12
343	600728	佳都科技	9,300	60,078.00	0.12
344	300166	东方国信	6,500	59,930.00	0.12
345	600567	山鹰国际	21,600	59,832.00	0.12
346	603866	桃李面包	3,584	59,315.20	0.12
347	002048	宁波华翔	3,700	59,274.00	0.12
348	688208	道通科技	1,800	59,256.00	0.12
349	688289	圣湘生物	2,000	59,220.00	0.12
350	600517	国网英大	11,400	59,166.00	0.12
351	603225	新凤鸣	5,100	58,854.00	0.12
352	000559	万向钱潮	9,900	58,806.00	0.12
353	300072	三聚环保	11,600	58,696.00	0.12
354	000937	冀中能源	7,800	58,188.00	0.12
355	600597	光明乳业	4,600	58,098.00	0.12
356	601456	国联证券	4,700	57,669.00	0.12
357	601958	金钼股份	6,500	57,460.00	0.12
358	000540	中天金融	29,600	57,128.00	0.12
359	000089	深圳机场	7,300	56,356.00	0.11
360	002281	光迅科技	3,200	56,256.00	0.11
361	002110	三钢闽光	9,200	56,028.00	0.11
362	603927	中科软	2,400	55,968.00	0.11
363	601860	紫金银行	19,500	55,965.00	0.11
364	601106	中国一重	18,200	55,874.00	0.11
365	000156	华数传媒	7,000	55,790.00	0.11
366	002368	太极股份	2,900	55,709.00	0.11
367	000959	首钢股份	11,700	55,692.00	0.11
368	600572	康恩贝	12,400	54,932.00	0.11
369	002233	塔牌集团	6,200	54,870.00	0.11
370	000898	鞍钢股份	17,000	54,740.00	0.11
371	600398	海澜之家	11,500	54,625.00	0.11
372	601118	海南橡胶	11,400	54,492.00	0.11
373	601718	际华集团	17,500	54,250.00	0.11
374	002690	美亚光电	2,500	54,200.00	0.11
375	002010	传化智联	8,400	54,012.00	0.11
376	001914	招商积余	3,000	53,910.00	0.11
377	603883	老百姓	1,590	53,869.20	0.11
378	600507	方大特钢	7,700	53,823.00	0.11
379	600737	中粮糖业	7,100	53,392.00	0.11
380	600582	天地科技	11,000	52,580.00	0.11
381	300212	易华录	3,000	52,200.00	0.11
382	600967	内蒙一机	5,700	51,984.00	0.11

383	000488	晨鸣纸业	9,200	51,888.00	0.11
384	003035	南网能源	8,100	51,435.00	0.10
385	002867	周大生	3,300	51,249.00	0.10
386	600871	石化油服	27,100	51,219.00	0.10
387	601000	唐山港	19,800	51,084.00	0.10
388	600435	北方导航	5,900	50,858.00	0.10
389	002174	游族网络	5,200	50,804.00	0.10
390	000685	中山公用	6,600	50,688.00	0.10
391	000537	广宇发展	3,900	50,661.00	0.10
392	601568	北元集团	7,990	50,656.60	0.10
393	002382	蓝帆医疗	5,300	50,615.00	0.10
394	002705	新宝股份	2,300	50,577.00	0.10
395	000402	金融街	8,500	50,575.00	0.10
396	600195	中牧股份	4,100	50,266.00	0.10
397	002146	荣盛发展	16,300	49,389.00	0.10
398	600556	天下秀	6,000	49,380.00	0.10
399	002416	爱施德	5,300	49,290.00	0.10
400	002399	海普瑞	2,800	49,224.00	0.10
401	601333	广深铁路	22,500	49,050.00	0.10
402	688029	南微医学	560	48,832.00	0.10
403	600811	东方集团	17,100	48,393.00	0.10
404	002081	金螳螂	9,500	48,260.00	0.10
405	002925	盈趣科技	2,240	48,204.80	0.10
406	000990	诚志股份	4,400	48,180.00	0.10
407	000967	盈峰环境	9,500	48,070.00	0.10
408	600764	中国海防	1,900	47,956.00	0.10
409	688321	微芯生物	1,900	47,861.00	0.10
410	000528	柳工	7,300	47,523.00	0.10
411	000158	常山北明	7,900	47,400.00	0.10
412	600329	达仁堂	1,900	46,702.00	0.10
413	002387	维信诺	6,900	46,368.00	0.09
414	002423	中粮资本	6,900	46,299.00	0.09
415	603638	艾迪精密	2,240	45,920.00	0.09
416	600120	浙江东方	11,430	45,834.30	0.09
417	601200	上海环境	4,500	45,720.00	0.09
418	600126	杭钢股份	8,900	45,568.00	0.09
419	000563	陕国投 A	14,600	45,552.00	0.09
420	601098	中南传媒	4,800	45,312.00	0.09
421	002948	青岛银行	12,500	45,250.00	0.09
422	600373	中文传媒	4,500	44,955.00	0.09
423	600167	联美控股	6,000	44,940.00	0.09
424	600446	金证股份	4,300	44,634.00	0.09

425	601611	中国核建	5,300	44,467.00	0.09
426	600707	彩虹股份	9,500	44,460.00	0.09
427	601608	中信重工	11,600	43,964.00	0.09
428	600095	湘财股份	5,700	43,833.00	0.09
429	600131	国网信通	3,200	43,040.00	0.09
430	600006	东风汽车	5,700	43,035.00	0.09
431	603317	天味食品	1,488	42,363.36	0.09
432	601187	厦门银行	7,100	42,316.00	0.09
433	600376	首开股份	8,600	42,226.00	0.09
434	300257	开山股份	2,800	41,888.00	0.09
435	600623	华谊集团	5,000	41,500.00	0.08
436	603000	人民网	3,700	41,440.00	0.08
437	688088	虹软科技	1,300	41,067.00	0.08
438	600901	江苏租赁	8,000	41,040.00	0.08
439	601598	中国外运	10,500	40,740.00	0.08
440	600307	酒钢宏兴	20,800	40,352.00	0.08
441	000415	渤海租赁	18,500	40,145.00	0.08
442	601991	大唐发电	16,500	40,095.00	0.08
443	000718	苏宁环球	10,800	39,744.00	0.08
444	603228	景旺电子	1,700	39,661.00	0.08
445	002434	万里扬	4,600	39,330.00	0.08
446	603650	彤程新材	1,200	39,096.00	0.08
447	002242	九阳股份	2,112	38,776.32	0.08
448	600906	财达证券	4,300	38,657.00	0.08
449	000031	大悦城	9,600	38,400.00	0.08
450	600717	天津港	9,560	38,335.60	0.08
451	000553	安道麦 A	3,100	37,541.00	0.08
452	601928	凤凰传媒	5,100	36,465.00	0.07
453	600968	海油发展	13,500	34,830.00	0.07
454	601969	海南矿业	4,000	34,360.00	0.07
455	600648	外高桥	2,500	34,000.00	0.07
456	002563	森马服饰	5,700	33,744.00	0.07
457	600787	中储股份	5,800	33,002.00	0.07
458	000028	国药一致	1,100	32,769.00	0.07
459	600928	西安银行	8,900	32,663.00	0.07
460	600339	中油工程	11,100	32,079.00	0.07
461	002815	崇达技术	2,500	32,025.00	0.07
462	000717	韶钢松山	9,000	31,500.00	0.06
463	688819	天能股份	900	31,122.00	0.06
464	300869	康泰医学	1,100	31,086.00	0.06
465	600835	上海机电	2,200	30,206.00	0.06
466	000869	张裕 A	1,000	29,740.00	0.06

467	002945	华林证券	1,900	28,975.00	0.06
468	600377	宁沪高速	3,300	28,281.00	0.06
469	603056	德邦股份	2,100	28,203.00	0.06
470	000062	深圳华强	2,200	27,940.00	0.06
471	601139	深圳燃气	3,900	27,066.00	0.06
472	603379	三美股份	1,200	26,700.00	0.05
473	002653	海思科	1,600	25,776.00	0.05
474	601298	青岛港	4,600	25,162.00	0.05
475	300741	华宝股份	900	25,038.00	0.05
476	001872	招商港口	1,600	24,960.00	0.05
477	600299	安迪苏	2,600	24,908.00	0.05
478	601869	长飞光纤	800	24,736.00	0.05
479	001227	兰州银行	4,700	23,124.00	0.05
480	603868	飞科电器	300	22,725.00	0.05
481	601828	美凯龙	3,700	22,422.00	0.05
482	600823	世茂股份	7,500	22,350.00	0.05
483	601156	东航物流	1,100	21,780.00	0.04
484	600350	山东高速	4,100	21,525.00	0.04
485	603355	莱克电气	800	20,184.00	0.04
486	600927	永安期货	1,000	20,170.00	0.04
487	001203	大中矿业	1,700	19,210.00	0.04
488	603786	科博达	300	18,471.00	0.04
489	603515	欧普照明	1,000	17,450.00	0.04
490	603719	良品铺子	600	17,178.00	0.03
491	002946	新乳业	1,300	16,887.00	0.03
492	601665	齐鲁银行	3,400	16,592.00	0.03
493	601003	柳钢股份	3,400	13,770.00	0.03
494	002901	大博医疗	300	11,742.00	0.02
495	600956	新天绿能	900	11,088.00	0.02
496	603983	丸美股份	400	10,720.00	0.02
497	600917	重庆燃气	1,100	7,942.00	0.02

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601089	福元医药	1,322	27,828.10	0.06
2	001268	联合精密	327	9,064.44	0.02

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	000733	振华科技	583,214.00	0.91
2	002180	纳思达	412,146.00	0.64
3	002340	格林美	389,674.00	0.61
4	000009	中国宝安	347,971.00	0.54
5	002268	卫士通	339,000.00	0.53
6	300012	华测检测	326,870.00	0.51
7	002497	雅化集团	322,887.00	0.50
8	300769	德方纳米	320,370.00	0.50
9	000723	美锦能源	314,681.00	0.49
10	002240	盛新锂能	314,055.00	0.49
11	000630	铜陵有色	313,310.00	0.49
12	002384	东山精密	309,363.00	0.48
13	000983	山西焦煤	304,738.00	0.47
14	002028	思源电气	304,329.00	0.47
15	300474	景嘉微	299,798.00	0.47
16	002385	大北农	297,030.00	0.46
17	300285	国瓷材料	296,701.00	0.46
18	002603	以岭药业	295,534.00	0.46
19	300390	天华超净	292,978.00	0.46
20	600096	云天化	281,904.00	0.44

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	000733	振华科技	967,381.00	1.50
2	002340	格林美	735,679.00	1.14
3	000723	美锦能源	594,248.00	0.92
4	002180	纳思达	419,203.00	0.65
5	002013	中航机电	417,051.00	0.65
6	000009	中国宝安	409,910.00	0.64
7	300223	北京君正	383,742.00	0.60
8	002268	卫士通	380,411.00	0.59
9	300763	锦浪科技	367,895.00	0.57
10	300751	迈为股份	359,517.00	0.56

11	000630	铜陵有色	353,495.00	0.55
12	002384	东山精密	350,883.00	0.55
13	688005	容百科技	346,780.60	0.54
14	002385	大北农	345,254.00	0.54
15	002028	思源电气	340,268.00	0.53
16	000983	山西焦煤	336,283.00	0.52
17	300285	国瓷材料	335,288.00	0.52
18	300474	景嘉微	330,841.50	0.51
19	002603	以岭药业	321,533.00	0.50
20	002185	华天科技	312,695.00	0.49

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	48,078,032.92
卖出股票收入（成交）总额	49,368,325.77

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 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。

7.8 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。

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 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

江苏中天科技股份有限公司因未依法履行其他职责等原因在本报告编制前一年内受到上海证券交易所的监管警示。

盛新锂能集团股份有限公司因未及时披露公司重大事项、未依法履行其他职责等原因在本报告编制前一年内受到深圳证券交易所的监管关注。

基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	381,457.71
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	381,457.71

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

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。

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

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 (%)
736	19,894.93	9,109,606.00	62.21	5,533,066.00	37.79

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	中信建投证券股份有限公司	4,990,475.00	34.08
2	东方证券股份有限公司	1,987,649.00	13.57
3	华泰证券股份有限公司	1,405,684.00	9.60
4	广发证券股份有限公司	615,298.00	4.20
5	陈志伟	317,100.00	2.17
6	王少孟	294,200.00	2.01
7	王洁人	260,000.00	1.78
8	王甜芳	195,200.00	1.33
9	凌碧清	155,400.00	1.06
10	靳绪玲	124,991.00	0.85

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	17,042,672.00
本报告期基金总申购份额	21,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,642,672.00

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

本报告期本基金无投资策略的变化。

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 (%)	
广发证券	2	70,292,510.74	72.32	18,669.41	71.56	-
申万宏源	4	26,909,166.03	27.68	7,420.50	28.44	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

海通证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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 14 个交易单元，为信达证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，德邦证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，汇丰前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东北证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，西部证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华西证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国金证券上海、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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	17,127.60	100.00	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	2022年01月17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平安银行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	2022年01月21日
3	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年“春节”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	2022年01月25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广发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	2022年02月11日
5	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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	2022年02月16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上海攀赢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	2022年02月22日
7	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安信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	2022年02月24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上海凯石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	2022年02月25日
9	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加平安证券股份有	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；	2022年02月28日

	限公司费率优惠活动的公告	《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	
10	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加平安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	2022 年 02 月 28 日
11	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雪球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	2022 年 03 月 08 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上海长量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	2022 年 03 月 11 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上海万得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	2022 年 03 月 11 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在部分销售机构开通定投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	2022 年 03 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诺亚正行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	2022 年 03 月 21 日
16	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增东方财富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	2022 年 03 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京东肯特瑞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	2022 年 03 月 29 日
18	关于泰康资产管理有限责任公司旗下	《中国证券报》；《上海	2022 年 03 月 29 日

	部分基金 2022 年“清明节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	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	
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博时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	2022 年 04 月 02 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参加上海利得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	2022 年 04 月 02 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广发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	2022 年 04 月 15 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泰信财富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	2022 年 04 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	2022 年 04 月 20 日
24	泰康资产管理有限责任公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 04 月 21 日
25	泰康资产管理有限责任公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 04 月 26 日
26	泰康资产管理有限责任公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	《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	2022 年 04 月 29 日

27	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浙江同花顺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	2022年05月13日
28	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	2022年05月18日
29	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华泰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	2022年05月18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江苏银行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	2022年05月20日
31	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部分销售机构最低申购金额、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	2022年05月26日
32	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	2022年05月27日
33	泰康资产管理有限责任公司关于完成设立泰康基金管理有限公司的公告	《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	2022年05月28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宁波银行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	2022年05月30日
35	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金2022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	2022年05月31日

		基金管理人网站	
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上海华夏财富投资管理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	2022年06月10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恒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	2022年06月14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新增上海联泰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	2022年06月15日
39	泰康资产管理有限责任公司关于旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年06月20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新增玄元保险代理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	2022年06月22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参加和讯信息科技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	2022年06月23日
42	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浙江同花顺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	2022年06月28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	20220101-20220630	4,150,000.00	0.00	0.00	4,150,000.00	28.34
	2	20220101-20220104	4,322,045.00	15,024,475.00	17,358,871.00	1,987,649.00	13.57
	3	20220617-20220617	4,322,045.00	15,024,475.00	17,358,871.00	1,987,649.00	13.57
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

2022 年 8 月 31 日