

泰康中证 500 交易型开放式指数
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56

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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 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
场内简称	中证 500ETF 泰康
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	泰康基金管理有限公司
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	24,242,672.00 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	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		泰康基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	张姗
	联系电话	010-89620366	0755-83077987
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	95555
传真		010-89620100	0755-83195201
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	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 3、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		金志刚	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(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	171,724.96
本期利润	2,391,908.11
加权平均基金份额本期利润	0.0972
本期加权平均净值利润率	2.99%
本期基金份额净值增长率	3.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-726,473.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0300
期末基金资产净值	76,857,259.27
期末基金份额净值	3.1703
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-0.93%

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。

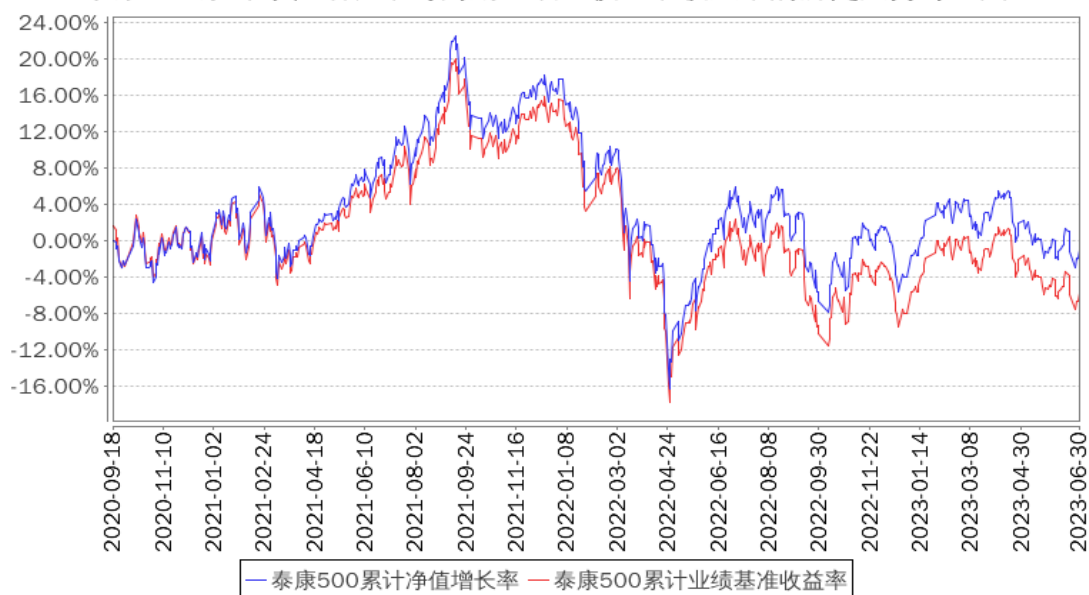
3.2 基金净值表现

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	-0.12%	0.94%	-0.81%	0.93%	0.69%	0.01%
过去三个月	-4.34%	0.83%	-5.38%	0.83%	1.04%	0.00%
过去六个月	3.16%	0.79%	2.29%	0.79%	0.87%	0.00%
过去一年	-5.51%	0.96%	-7.06%	0.96%	1.55%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.93%	1.12%	-5.78%	1.13%	4.85%	-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。

3.3 其他指标

无。

§ 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，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。2021年9月1日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021年10月12日，泰康基金完成工商注册。2022年11月18日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为1.2亿元人民币。截至2023年6月30日，泰康基金共管理72只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题ETF、以及双碳、科技、大健康、消费2+2赛道等方面均进行了战略布局，为投资者提供了丰富多元的投资选择。

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、量化投资部负责人	2020年9月18日	-	15年	魏军于2019年5月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人。曾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等职务。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。2022年9月27

					日至 2023 年 2 月 17 日担任泰康中证新能源动力电池指数型证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 14 日至今担任泰康中证科创创业 50 指数型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 17 日至今担任泰康中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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

宏观经济在 2023 年上半年呈现出先复苏、再环比走弱的特征。一季度，得益于经济场景的恢复、积压需求的回补，经济呈现出复苏态势。但随着回补需求的逐步释放，居民和企业部门的信心恢复速度偏慢，外部经济和金融风险等不确定性有所发酵，内生增长动能不足的问题在二季度逐步凸显。地产、就业市场、出口等部门都呈现出一定压力，物价指数走低，库存主动去化，政策继续坚持高质量发展。

权益市场方面，随着疫情影响的过去，今年以来国内宏观经济逐步进入复苏期，市场的主要关注点一方面在复苏进展和政策节奏，另一方面在以人工智能为代表的科技创新方向，海外重点

公司英伟达和特斯拉轮番推高市场对于相关领域的发展预期。从大盘和板块上来看，上半年上证综指上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%。板块间波动较大，其中，通信、传媒、计算机上涨较多，商贸零售、房地产等板块下跌较多。

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，跟踪指数震荡下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.1703 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.16%；同期业绩比较基准增长率为 2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计经济能在政策的作用下逐步筑底企稳，但缺少向上弹性。当前稳增长的政策基调越发明晰，地产政策也将逐步优化。虽然总体政策基调是在高质量发展的框架下进行的，但政策也更加直面困难，基调也比之前积极。此外，名义库存去化速度较快，工业品价格也有望筑底。往长看，本次经济修复或局限于信心筑底和库存修复，需求侧亮点有限。

对于权益市场，考虑到盈利能力在 22 年处于相对底部，目前市场估值处于有性价比的阶段。从影响资本市场的几个维度来看，宏观基本面逐步回归正常。经济最差的时候已经过去，不过从上半年的经济数据来看，经济复苏力度并不强，后续还要持续跟踪经济复苏的力度。

展望后市，海外流动性有望迎来宽松，国内经济即将触底回升，指数有望迎来反转。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，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的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、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明：

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合规守信、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,156,670.56	1,105,350.67
结算备付金		1,137,573.51	1,045,594.56
存出保证金		305,530.88	347,760.21
交易性金融资产	6.4.7.2	74,451,511.50	69,645,561.07
其中：股票投资		74,451,511.50	69,645,561.07
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	-	-
资产总计		77,051,286.45	72,144,266.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		35,507.09	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		25,056.27	24,447.50
应付托管费		3,132.04	3,055.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	130,331.78	74,811.15
负债合计		194,027.18	102,314.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	77,583,732.59	75,023,495.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-726,473.32	-2,981,543.69
净资产合计		76,857,259.27	72,041,951.91
负债和净资产总计		77,051,286.45	72,144,266.51

注：（1）报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.1703 元，基金份额总额 24,242,672.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,720,779.46	-5,872,663.90
1. 利息收入		13,140.16	16,002.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,140.16	16,002.80
债券利息收入		-	-
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）		342,021.05	-5,853,136.05
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-474,508.54	-6,062,351.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	2,026.91
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-34,554.47	-296,762.76
股利收益	6.4.7.19	851,084.06	503,950.90
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	2,220,183.15	-331,575.71
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	145,435.10	296,045.06
减：二、营业总支出		328,871.35	229,875.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	158,117.13	98,413.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,764.65	12,301.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		341.41	-
8. 其他费用	6.4.7.23	150,648.16	119,160.05
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		2,391,908.11	-6,102,539.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		2,391,908.11	-6,102,539.70
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		2,391,908.11	-6,102,539.70

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	75,023,495.60	-	-2,981,543.69	72,041,951.91

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）	75,023,495.60	-	-2,981,543.69	72,041,951.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,560,236.99	-	2,255,070.37	4,815,307.36
（一）、综合收益总额	-	-	2,391,908.11	2,391,908.11
（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）	2,560,236.99	-	-136,837.74	2,423,399.25
其中：1. 基金申购款	40,963,792.15	-	1,036,621.83	42,000,413.98
2. 基金赎回款	-38,403,555.16	-	-1,173,459.57	-39,577,014.73
（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）	77,583,732.59	-	-726,473.32	76,857,259.27
项目	上年度可比期间			
	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	54,541,599.51	-	9,766,260.51	64,307,860.02

资产(基金净值)				
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

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:

金志刚

金志刚

李俊佑

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1284 号《关于准予泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

243,998,555.00 元(含募集股票市值),业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2000722 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 243,999,138.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 583.00 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,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。

本基金的基金管理人以本基金为目标 ETF,募集成立了泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“泰康中证 500ETF 联接基金”)。泰康中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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 2023年6月30日
活期存款	1,156,670.56
等于：本金	1,156,555.72
加：应计利息	114.84
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	1,156,670.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	76,421,808.97	-	74,451,511.50	-1,970,297.47
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	76,421,808.97	-	74,451,511.50	-1,970,297.47

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
----	-----

	2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	2,399,560.00	-	-	
其中：股指期 货投资	2,399,560.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	2,399,560.00	-	-	

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
IC2307	中证 500 期货 2307 合约	2.00	2,396,320.00	-3,240.00
合计				-3,240.00
减：可抵销期货 暂收款				-3,240.00
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

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	15,988.62
其中：交易所市场	15,988.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
应付指数使用费	35,000.00
合计	130,331.78

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,442,672.00	75,023,495.60
本期申购	12,800,000.00	40,963,792.15
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-38,403,555.16
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	24,242,672.00	77,583,732.59

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

无。

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
上年度末	6,518,205.79	-9,499,749.48	-2,981,543.69
本期利润	171,724.96	2,220,183.15	2,391,908.11
本期基金份额交易产生的变动数	215,111.12	-351,948.86	-136,837.74
其中：基金申购款	3,658,288.06	-2,621,666.23	1,036,621.83
基金赎回款	-3,443,176.94	2,269,717.37	-1,173,459.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,905,041.87	-7,631,515.19	-726,473.32

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	2,064.82
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	10,938.18
其他	137.16
合计	13,140.16

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-527,345.63
股票投资收益——赎回差价收入	52,837.09

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	-474,508.54

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	33,839,719.94
减：卖出股票成本总额	34,300,690.20
减：交易费用	66,375.37
买卖股票差价收入	-527,345.63

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	39,577,014.73
减：现金支付赎回款总额	20,920,930.73
减：赎回股票成本总额	18,603,246.91
减：交易费用	-
赎回差价收入	52,837.09

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-34,554.47

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	851,084.06
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	851,084.06
----	------------

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,108,703.15
股票投资	2,108,703.15
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	111,480.00
权证投资	-
期货投资	111,480.00
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	2,220,183.15

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	145,435.10
合计	145,435.10

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

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023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	1,305.00
指数使用费	70,000.00

其他	24,795.19
合计	150,648.16

6.4.7.24 分部报告

无。

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

本报告期与基金管理人存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	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
泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	158,117.13	98,413.95
其中：支付销售机构的客户维护费	8,243.91	14,581.48

注：支付基金管理人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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,764.65	12,301.80

注：支付基金托管人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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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**

无。

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

无。

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，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
泰康中证500 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金	15,604,500.00	64.3679	12,124,200.00	51.7185

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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,156,670.56	2,064.82	3,469,855.69	4,880.54

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023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

无。

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	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复 牌 日	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
----------	-------------	----------	----------	----------------	-------------	----------------	-----------	------------	----------------	----

	称				期					
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	7,700	44,386.00	53,669.00	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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	上年度末
--------	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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 2023 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 2023 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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	1,156,670.56	-	-	-	1,156,670.56
结算备付金	1,137,573.51	-	-	-	1,137,573.51
存出保证金	305,530.88	-	-	-	305,530.88
交易性金融资产	-	-	-	74,451,511.50	74,451,511.50
资产总计	2,599,774.95	-	-	74,451,511.50	77,051,286.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	25,056.27	25,056.27
应付托管费	-	-	-	3,132.04	3,132.04
应付清算款	-	-	-	35,507.09	35,507.09
其他负债	-	-	-	130,331.78	130,331.78
负债总计	-	-	-	194,027.18	194,027.18
利率敏感度缺口	2,599,774.95	-	-	74,257,484.32	76,857,259.27
上年度末 2022 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	1,105,350.67	-	-	-	1,105,350.67
结算备付金	1,045,594.56	-	-	-	1,045,594.56
存出保证金	347,760.21	-	-	-	347,760.21
交易性金融资产	-	-	-	69,645,561.07	69,645,561.07
资产总计	2,498,705.44	-	-	69,645,561.07	72,144,266.51
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	24,447.50	24,447.50
应付托管费	-	-	-	3,055.95	3,055.95
其他负债	-	-	-	74,811.15	74,811.15
负债总计	-	-	-	102,314.60	102,314.60
利率敏感度缺口	2,498,705.44	-	-	69,543,246.47	72,041,951.91

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率下调	0.00	0.00

	0.25%		
--	-------	--	--

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	74,451,511.50	96.87	69,645,561.07	96.67
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	74,451,511.50	96.87	69,645,561.07	96.67

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准中的权益指数上涨5%	2,993,166.58	3,260,962.14
	业绩比较基准中的权益指数下跌5%	-2,993,166.58	-3,260,962.14

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	74,397,842.50	69,384,938.17
第二层次	53,669.00	260,622.90
第三层次	-	-
合计	74,451,511.50	69,645,561.07

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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

本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 42,000,413.98 元(上年度可比期间：67,605,100.70 元)，其中包括以股票支付的申购款 19,852,028.00 元和以现金支付的申购款 22,148,385.98 元(上年度可比期间：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)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	74,451,511.50	96.63
	其中：股票	74,451,511.50	96.63
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	2,294,244.07	2.98
8	其他各项资产	305,530.88	0.40
9	合计	77,051,286.45	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	523,736.00	0.68
B	采矿业	2,967,213.00	3.86
C	制造业	46,514,491.62	60.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,383,371.87	3.10
E	建筑业	831,991.00	1.08
F	批发和零售业	2,360,084.64	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,126,670.00	1.47
H	住宿和餐饮业	140,230.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,441,243.32	8.38
J	金融业	6,223,500.85	8.10
K	房地产业	942,842.00	1.23

L	租赁和商务服务业	917,780.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	836,879.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	414,939.20	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	375,015.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	1,057,849.00	1.38
S	综合	393,675.00	0.51
	合计	74,451,511.50	96.87

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

本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	7,100	1,046,895.00	1.36
2	000988	华工科技	11,100	421,911.00	0.55
3	688256	寒武纪	2,200	413,600.00	0.54
4	002384	东山精密	15,100	391,090.00	0.51
5	002340	格林美	56,500	390,415.00	0.51
6	002422	科伦药业	13,000	385,840.00	0.50
7	600372	中航电子	24,700	374,946.00	0.49
8	300418	昆仑万维	9,200	370,576.00	0.48
9	300012	华测检测	18,500	360,750.00	0.47
10	300724	捷佳伟创	3,100	348,285.00	0.45
11	600157	永泰能源	244,500	347,190.00	0.45
12	600079	人福医药	12,600	339,444.00	0.44
13	600489	中金黄金	32,000	330,560.00	0.43
14	300003	乐普医疗	14,500	327,845.00	0.43
15	688777	中控技术	5,130	322,061.40	0.42
16	002738	中矿资源	6,300	320,922.00	0.42
17	600487	亨通光电	21,700	318,122.00	0.41
18	002028	思源电气	6,700	313,024.00	0.41

19	002463	沪电股份	14,700	307,818.00	0.40
20	600536	中国软件	6,559	307,485.92	0.40
21	601058	赛轮轮胎	26,900	306,391.00	0.40
22	601555	东吴证券	44,100	306,054.00	0.40
23	600765	中航重机	11,260	298,502.60	0.39
24	300037	新宙邦	5,680	294,735.20	0.38
25	000066	中国长城	21,300	294,579.00	0.38
26	600885	宏发股份	9,180	292,383.00	0.38
27	000807	云铝股份	22,900	291,517.00	0.38
28	600482	中国动力	11,900	278,936.00	0.36
29	000009	中国宝安	22,700	273,989.00	0.36
30	300146	汤臣倍健	11,200	268,576.00	0.35
31	600352	浙江龙盛	28,600	267,410.00	0.35
32	000423	东阿阿胶	5,000	267,250.00	0.35
33	300058	蓝色光标	27,400	264,958.00	0.34
34	002156	通富微电	11,700	264,420.00	0.34
35	002966	苏州银行	40,340	264,227.00	0.34
36	688099	晶晨股份	3,100	261,392.00	0.34
37	002185	华天科技	28,200	259,440.00	0.34
38	601108	财通证券	35,700	258,468.00	0.34
39	600415	小商品城	30,200	257,606.00	0.34
40	002625	光启技术	16,600	253,316.00	0.33
41	002624	完美世界	14,900	251,661.00	0.33
42	600027	华电国际	37,500	250,875.00	0.33
43	300144	宋城演艺	20,200	250,480.00	0.33
44	600109	国金证券	28,700	248,829.00	0.32
45	000783	长江证券	42,600	247,080.00	0.32
46	600161	天坛生物	9,100	247,065.00	0.32
47	601233	桐昆股份	18,600	246,450.00	0.32
48	600988	赤峰黄金	18,300	246,318.00	0.32
49	603444	吉比特	500	245,555.00	0.32
50	601077	渝农商行	68,100	244,479.00	0.32
51	002008	大族激光	9,300	243,660.00	0.32
52	600418	江淮汽车	19,300	242,987.00	0.32
53	600298	安琪酵母	6,700	242,607.00	0.32
54	300568	星源材质	14,100	242,379.00	0.32
55	300285	国瓷材料	8,800	241,120.00	0.31
56	600096	云天化	14,100	240,687.00	0.31
57	002385	大北农	36,450	240,570.00	0.31
58	002223	鱼跃医疗	6,600	237,534.00	0.31
59	000630	铜陵有色	81,000	234,090.00	0.30
60	603882	金城医学	3,100	234,050.00	0.30
61	002407	多氟多	11,780	233,950.80	0.30

62	600862	中航高科	9,200	232,852.00	0.30
63	300390	天华新能	6,490	232,342.00	0.30
64	603688	石英股份	2,000	227,680.00	0.30
65	300024	机器人	13,628	227,178.76	0.30
66	601162	天风证券	76,200	227,076.00	0.30
67	300073	当升科技	4,500	226,485.00	0.29
68	002409	雅克科技	3,100	225,928.00	0.29
69	002497	雅化集团	12,700	225,806.00	0.29
70	000933	神火股份	17,300	224,900.00	0.29
71	600705	中航产融	58,400	223,672.00	0.29
72	300604	长川科技	4,700	223,203.00	0.29
73	002240	盛新锂能	7,000	223,090.00	0.29
74	300395	菲利华	4,500	221,400.00	0.29
75	601168	西部矿业	21,000	220,710.00	0.29
76	300474	景嘉微	2,450	220,475.50	0.29
77	605358	立昂微	6,000	220,380.00	0.29
78	000932	华菱钢铁	45,688	217,931.76	0.28
79	002439	启明星辰	7,300	217,248.00	0.28
80	600066	宇通客车	14,600	215,204.00	0.28
81	300136	信维通信	10,700	214,856.00	0.28
82	002600	领益智造	31,000	214,210.00	0.28
83	603596	伯特利	2,700	214,002.00	0.28
84	000975	银泰黄金	18,220	213,174.00	0.28
85	600060	海信视像	8,600	212,850.00	0.28
86	002138	顺络电子	8,900	212,799.00	0.28
87	002797	第一创业	37,100	212,212.00	0.28
88	002568	百润股份	5,800	210,830.00	0.27
89	002465	海格通信	20,300	209,902.00	0.27
90	300832	新产业	3,500	206,500.00	0.27
91	603816	顾家家居	5,400	206,010.00	0.27
92	600563	法拉电子	1,500	205,950.00	0.27
93	000021	深科技	10,300	205,897.00	0.27
94	600839	四川长虹	40,700	205,535.00	0.27
95	600160	巨化股份	14,900	205,322.00	0.27
96	601128	常熟银行	30,100	205,282.00	0.27
97	603939	益丰药房	5,540	204,980.00	0.27
98	000591	太阳能	30,200	204,756.00	0.27
99	300253	卫宁健康	18,900	204,498.00	0.27
100	600879	航天电子	24,000	203,760.00	0.27
101	600873	梅花生物	22,700	202,711.00	0.26
102	688567	孚能科技	9,300	200,787.00	0.26
103	000683	远兴能源	27,900	200,601.00	0.26
104	601990	南京证券	24,400	199,592.00	0.26

105	600392	盛和资源	15,500	199,485.00	0.26
106	002850	科达利	1,500	198,375.00	0.26
107	002078	太阳纸业	18,500	197,765.00	0.26
108	002368	太极股份	4,800	197,616.00	0.26
109	300699	光威复材	6,400	197,440.00	0.26
110	603589	口子窖	4,000	197,400.00	0.26
111	600497	驰宏锌锗	39,200	196,784.00	0.26
112	601696	中银证券	18,400	196,144.00	0.26
113	000729	燕京啤酒	15,500	193,285.00	0.25
114	600177	雅戈尔	30,600	193,086.00	0.25
115	300866	安克创新	2,200	192,500.00	0.25
116	688169	石头科技	600	192,408.00	0.25
117	000831	中国稀土	6,500	192,400.00	0.25
118	300118	东方日升	7,500	192,225.00	0.25
119	600516	方大炭素	31,000	192,200.00	0.25
120	002025	航天电器	3,000	191,400.00	0.25
121	300017	网宿科技	26,800	190,548.00	0.25
122	002294	信立泰	6,100	190,259.00	0.25
123	600642	申能股份	27,100	189,429.00	0.25
124	600141	兴发集团	8,500	188,870.00	0.25
125	002673	西部证券	29,600	187,960.00	0.24
126	000728	国元证券	28,800	187,776.00	0.24
127	688521	芯原股份	2,600	186,992.00	0.24
128	688390	固德威	1,120	186,883.20	0.24
129	002430	杭氧股份	5,400	185,544.00	0.24
130	600699	均胜电子	10,500	185,220.00	0.24
131	000629	钒钛股份	47,300	184,943.00	0.24
132	002532	天山铝业	30,800	184,492.00	0.24
133	600170	上海建工	68,500	184,265.00	0.24
134	600118	中国卫星	6,500	183,365.00	0.24
135	600325	华发股份	18,600	183,210.00	0.24
136	002273	水晶光电	15,300	182,682.00	0.24
137	002195	岩山科技	63,100	182,359.00	0.24
138	002268	电科网安	6,500	181,155.00	0.24
139	600153	建发股份	16,600	181,106.00	0.24
140	002739	万达电影	14,400	180,576.00	0.23
141	002372	伟星新材	8,787	180,484.98	0.23
142	600521	华海药业	9,800	180,418.00	0.23
143	601966	玲珑轮胎	8,100	179,982.00	0.23
144	600166	福田汽车	52,900	179,860.00	0.23
145	000400	许继电气	7,800	179,790.00	0.23
146	600143	金发科技	20,500	178,965.00	0.23
147	600549	厦门钨业	9,400	178,882.00	0.23

148	300595	欧普康视	5,900	178,121.00	0.23
149	603000	人民网	6,100	178,120.00	0.23
150	000998	隆平高科	11,600	178,060.00	0.23
151	600399	抚顺特钢	17,400	177,480.00	0.23
152	600637	东方明珠	22,600	176,732.00	0.23
153	000738	航发控制	7,200	175,680.00	0.23
154	600486	扬农化工	2,000	174,840.00	0.23
155	688536	思瑞浦	800	174,400.00	0.23
156	002065	东华软件	24,700	174,382.00	0.23
157	688220	翱捷科技	2,300	173,397.00	0.23
158	600481	双良节能	12,400	173,352.00	0.23
159	300438	鹏辉能源	3,600	172,944.00	0.23
160	002444	巨星科技	7,900	172,852.00	0.22
161	600859	王府井	8,700	172,173.00	0.22
162	000997	新大陆	9,100	171,990.00	0.22
163	300487	蓝晓科技	2,750	171,655.00	0.22
164	601577	长沙银行	22,100	171,496.00	0.22
165	002131	利欧股份	74,300	170,890.00	0.22
166	002353	杰瑞股份	6,800	170,884.00	0.22
167	601198	东兴证券	21,300	170,826.00	0.22
168	600499	科达制造	15,000	170,400.00	0.22
169	688072	拓荆科技	400	170,388.00	0.22
170	688002	睿创微纳	3,800	170,240.00	0.22
171	300383	光环新网	15,800	169,850.00	0.22
172	000960	锡业股份	10,900	169,495.00	0.22
173	600704	物产中大	34,300	169,442.00	0.22
174	600271	航天信息	12,300	168,387.00	0.22
175	300682	朗新科技	7,200	167,616.00	0.22
176	000519	中兵红箭	9,200	166,428.00	0.22
177	002373	千方科技	12,200	166,408.00	0.22
178	300001	特锐德	8,000	166,240.00	0.22
179	600021	上海电力	15,401	165,868.77	0.22
180	601997	贵阳银行	32,100	165,636.00	0.22
181	688009	中国通号	28,500	165,300.00	0.22
182	603077	和邦生物	68,000	165,240.00	0.21
183	000623	吉林敖东	10,300	165,212.00	0.21
184	000703	恒逸石化	24,240	164,347.20	0.21
185	600511	国药股份	4,200	163,170.00	0.21
186	300088	长信科技	27,000	162,810.00	0.21
187	002056	横店东磁	8,900	162,069.00	0.21
188	300676	华大基因	2,700	161,973.00	0.21
189	002507	涪陵榨菜	8,840	161,860.40	0.21
190	600380	健康元	12,715	161,607.65	0.21

191	600867	通化东宝	15,300	159,732.00	0.21
192	000513	丽珠集团	4,100	159,531.00	0.21
193	002281	光迅科技	4,300	159,487.00	0.21
194	002152	广电运通	13,600	159,392.00	0.21
195	600998	九州通	15,347	159,301.86	0.21
196	600498	烽火通信	7,800	158,886.00	0.21
197	688301	奕瑞科技	560	158,160.80	0.21
198	600529	山东药玻	5,800	157,876.00	0.21
199	600546	山煤国际	10,900	157,723.00	0.21
200	002203	海亮股份	13,100	157,331.00	0.20
201	601016	节能风电	42,830	157,186.10	0.20
202	002299	圣农发展	8,200	157,030.00	0.20
203	603338	浙江鼎力	2,800	156,828.00	0.20
204	600348	华阳股份	19,800	156,618.00	0.20
205	000636	风华高科	10,200	156,468.00	0.20
206	603517	绝味食品	4,200	156,030.00	0.20
207	603737	三棵树	2,380	155,699.60	0.20
208	600739	辽宁成大	11,800	155,170.00	0.20
209	603712	七一二	5,100	154,071.00	0.20
210	002192	融捷股份	2,300	153,709.00	0.20
211	002595	豪迈科技	4,361	153,201.93	0.20
212	601636	旗滨集团	17,700	152,574.00	0.20
213	002080	中材科技	7,400	151,848.00	0.20
214	002432	九安医疗	4,300	151,403.00	0.20
215	603885	吉祥航空	9,800	151,214.00	0.20
216	002506	协鑫集成	51,500	150,895.00	0.20
217	002531	天顺风能	9,900	150,777.00	0.20
218	688516	奥特维	800	150,720.00	0.20
219	603927	中科软	3,900	150,384.00	0.20
220	600970	中材国际	11,700	149,175.00	0.19
221	688772	珠海冠宇	7,400	149,110.00	0.19
222	600863	内蒙华电	35,800	148,570.00	0.19
223	600580	卧龙电驱	10,100	147,561.00	0.19
224	600655	豫园股份	21,500	147,490.00	0.19
225	002092	中泰化学	22,800	147,060.00	0.19
226	300182	捷成股份	23,200	146,392.00	0.19
227	300212	易华录	4,400	146,212.00	0.19
228	000878	云南铜业	13,200	145,860.00	0.19
229	300296	利亚德	22,300	145,619.00	0.19
230	600820	隧道股份	24,200	145,442.00	0.19
231	600528	中铁工业	14,700	145,236.00	0.19
232	002939	长城证券	17,800	144,714.00	0.19
233	600909	华安证券	30,960	144,583.20	0.19

234	002683	广东宏大	4,900	144,256.00	0.19
235	002926	华西证券	17,300	143,763.00	0.19
236	600535	天士力	9,900	143,649.00	0.19
237	300244	迪安诊断	5,500	140,965.00	0.18
238	000750	国海证券	42,000	140,700.00	0.18
239	300748	金力永磁	4,700	140,624.00	0.18
240	688385	复旦微电	2,800	140,280.00	0.18
241	600258	首旅酒店	7,400	140,230.00	0.18
242	000547	航天发展	14,000	140,000.00	0.18
243	000893	亚钾国际	6,100	139,934.00	0.18
244	603233	大参林	4,988	139,713.88	0.18
245	600008	首创环保	48,500	139,680.00	0.18
246	000039	中集集团	20,250	139,522.50	0.18
247	600416	湘电股份	7,300	139,357.00	0.18
248	600329	达仁堂	3,100	139,159.00	0.18
249	603160	汇顶科技	3,000	138,750.00	0.18
250	603156	养元饮品	5,600	138,320.00	0.18
251	688200	华峰测控	900	137,700.00	0.18
252	002557	洽洽食品	3,300	137,115.00	0.18
253	002429	兆驰股份	24,900	136,950.00	0.18
254	603456	九洲药业	5,000	136,900.00	0.18
255	000060	中金岭南	28,800	136,800.00	0.18
256	000970	中科三环	10,605	135,956.10	0.18
257	601991	大唐发电	40,900	135,379.00	0.18
258	603658	安图生物	2,600	134,498.00	0.17
259	300558	贝达药业	2,800	134,484.00	0.17
260	000830	鲁西化工	12,700	134,112.00	0.17
261	600369	西南证券	36,600	133,590.00	0.17
262	600435	北方导航	11,600	133,284.00	0.17
263	600390	五矿资本	24,700	132,886.00	0.17
264	002500	山西证券	23,700	132,246.00	0.17
265	002508	老板电器	5,200	131,508.00	0.17
266	603893	瑞芯微	1,800	131,130.00	0.17
267	600038	中直股份	3,290	131,007.80	0.17
268	002128	电投能源	9,900	130,878.00	0.17
269	600398	海澜之家	19,000	130,720.00	0.17
270	002936	郑州银行	56,680	130,364.00	0.17
271	601880	辽港股份	83,100	129,636.00	0.17
272	300009	安科生物	12,900	129,000.00	0.17
273	300070	碧水源	24,000	128,640.00	0.17
274	601717	郑煤机	10,200	126,990.00	0.17
275	600848	上海临港	10,600	126,670.00	0.16
276	603858	步长制药	6,100	125,599.00	0.16

277	600985	淮北矿业	10,900	125,568.00	0.16
278	002153	石基信息	8,958	125,412.00	0.16
279	300026	红日药业	23,100	125,202.00	0.16
280	000050	深天马 A	13,500	123,930.00	0.16
281	300529	健帆生物	5,300	122,854.00	0.16
282	002572	索菲亚	7,000	121,940.00	0.16
283	601179	中国西电	22,500	121,725.00	0.16
284	300373	扬杰科技	3,000	121,710.00	0.16
285	603127	昭衍新药	2,960	121,064.00	0.16
286	002244	滨江集团	13,700	120,834.00	0.16
287	600673	东阳光	16,600	119,686.00	0.16
288	002408	齐翔腾达	18,740	119,373.80	0.16
289	601456	国联证券	13,100	119,210.00	0.16
290	600566	济川药业	4,100	119,064.00	0.15
291	002266	浙富控股	28,800	118,944.00	0.15
292	003035	南网能源	16,700	118,904.00	0.15
293	600667	太极实业	16,300	118,338.00	0.15
294	688779	长远锂科	10,500	118,335.00	0.15
295	600895	张江高科	8,500	118,320.00	0.15
296	002019	亿帆医药	8,100	118,260.00	0.15
297	601958	金钼股份	10,600	118,190.00	0.15
298	600827	百联股份	8,800	117,656.00	0.15
299	603267	鸿远电子	1,800	117,540.00	0.15
300	002958	青农商行	42,900	116,688.00	0.15
301	000155	川能动力	8,100	116,640.00	0.15
302	688538	和辉光电	45,900	116,586.00	0.15
303	600208	新潮中宝	46,800	116,064.00	0.15
304	300357	我武生物	3,443	115,788.09	0.15
305	601666	平煤股份	15,300	115,362.00	0.15
306	000739	普洛药业	6,500	115,310.00	0.15
307	600171	上海贝岭	6,300	114,975.00	0.15
308	601000	唐山港	32,500	114,725.00	0.15
309	600282	南钢股份	34,000	114,580.00	0.15
310	688116	天奈科技	2,500	114,375.00	0.15
311	000887	中鼎股份	8,700	113,883.00	0.15
312	600755	厦门国贸	14,700	113,778.00	0.15
313	002155	湖南黄金	9,300	113,460.00	0.15
314	600378	昊华科技	3,000	112,920.00	0.15
315	002670	国盛金控	12,800	112,384.00	0.15
316	600959	江苏有线	33,100	111,878.00	0.15
317	300677	英科医疗	5,040	110,880.00	0.14
318	600316	洪都航空	4,700	110,215.00	0.14
319	300115	长盈精密	9,240	110,048.40	0.14

320	601231	环旭电子	7,300	109,208.00	0.14
321	300888	稳健医疗	2,600	108,342.00	0.14
322	603218	日月股份	5,700	108,243.00	0.14
323	002487	大金重工	3,500	107,940.00	0.14
324	600517	国网英大	18,900	107,730.00	0.14
325	000778	新兴铸管	26,400	107,712.00	0.14
326	601866	中远海发	43,600	107,692.00	0.14
327	600315	上海家化	3,700	107,337.00	0.14
328	002030	达安基因	10,760	107,277.20	0.14
329	600131	国网信通	5,300	107,007.00	0.14
330	000598	兴蓉环境	19,700	106,971.00	0.14
331	603026	胜华新材	1,800	106,650.00	0.14
332	300363	博腾股份	3,600	106,524.00	0.14
333	600056	中国医药	8,180	106,176.40	0.14
334	600582	天地科技	18,200	106,106.00	0.14
335	000987	越秀资本	16,555	105,124.25	0.14
336	002221	东华能源	12,100	104,665.00	0.14
337	300251	光线传媒	12,900	104,361.00	0.14
338	002249	大洋电机	18,300	104,310.00	0.14
339	002518	科士达	2,600	104,026.00	0.14
340	600598	北大荒	7,800	103,974.00	0.14
341	002326	永太科技	6,800	103,972.00	0.14
342	601005	重庆钢铁	74,000	103,600.00	0.13
343	000027	深圳能源	15,700	103,463.00	0.13
344	000709	河钢股份	45,600	103,056.00	0.13
345	600906	财达证券	14,300	102,960.00	0.13
346	002183	怡亚通	20,000	102,000.00	0.13
347	601106	中国一重	30,200	101,472.00	0.13
348	688281	华秦科技	500	101,250.00	0.13
349	002690	美亚光电	3,900	100,425.00	0.13
350	600718	东软集团	9,400	100,204.00	0.13
351	002831	裕同科技	4,100	99,999.00	0.13
352	600373	中文传媒	7,500	99,900.00	0.13
353	601992	金隅集团	45,800	99,844.00	0.13
354	000883	湖北能源	21,800	99,408.00	0.13
355	688082	盛美上海	900	99,360.00	0.13
356	601665	齐鲁银行	25,300	99,176.00	0.13
357	002511	中顺洁柔	8,800	98,120.00	0.13
358	000825	太钢不锈	25,200	97,524.00	0.13
359	601778	晶科科技	19,700	97,318.00	0.13
360	002985	北摩高科	2,204	97,240.48	0.13
361	603568	伟明环保	5,520	96,655.20	0.13
362	601928	凤凰传媒	8,400	95,760.00	0.12

363	600663	陆家嘴	9,700	95,739.00	0.12
364	603883	老百姓	3,190	95,221.50	0.12
365	600967	内蒙一机	9,400	94,940.00	0.12
366	603228	景旺电子	3,700	94,905.00	0.12
367	688188	柏楚电子	500	94,280.00	0.12
368	600737	中粮糖业	11,700	94,185.00	0.12
369	300776	帝尔激光	1,440	93,456.00	0.12
370	603529	爱玛科技	2,900	93,438.00	0.12
371	603225	新凤鸣	8,400	92,820.00	0.12
372	600155	华创云信	14,900	92,678.00	0.12
373	600801	华新水泥	7,500	92,625.00	0.12
374	600297	广汇汽车	44,500	92,560.00	0.12
375	601098	中南传媒	7,900	91,640.00	0.12
376	300482	万孚生物	3,440	91,607.20	0.12
377	300861	美畅股份	2,100	91,077.00	0.12
378	002468	申通快递	8,400	90,888.00	0.12
379	002791	坚朗五金	1,400	90,594.00	0.12
380	000012	南玻 A	15,200	90,592.00	0.12
381	002745	木林森	9,800	90,160.00	0.12
382	002032	苏泊尔	1,800	90,000.00	0.12
383	001227	兰州银行	31,400	89,804.00	0.12
384	688778	厦钨新能	1,800	89,100.00	0.12
385	000156	华数传媒	10,200	88,740.00	0.12
386	603866	桃李面包	8,761	88,661.32	0.12
387	600871	石化油服	44,700	88,506.00	0.12
388	688208	道通科技	2,900	87,899.00	0.11
389	600500	中化国际	15,800	87,848.00	0.11
390	688276	百克生物	1,400	87,640.00	0.11
391	000581	威孚高科	5,500	86,625.00	0.11
392	000401	冀东水泥	11,700	86,229.00	0.11
393	301029	怡合达	1,920	85,785.60	0.11
394	688690	纳微科技	2,200	85,470.00	0.11
395	002867	周大生	4,800	85,344.00	0.11
396	688520	神州细胞	1,500	85,110.00	0.11
397	002250	联化科技	8,100	84,726.00	0.11
398	601118	海南橡胶	18,900	84,672.00	0.11
399	601611	中国核建	10,000	84,500.00	0.11
400	600556	天下秀	11,900	84,371.00	0.11
401	600022	山东钢铁	58,700	83,354.00	0.11
402	000785	居然之家	21,700	82,677.00	0.11
403	000930	中粮科技	10,200	82,620.00	0.11
404	300850	新强联	2,200	82,236.00	0.11
405	002010	传化智联	15,400	81,928.00	0.11

406	002423	中粮资本	10,200	81,600.00	0.11
407	688029	南微医学	1,000	81,560.00	0.11
408	688006	杭可科技	2,660	81,050.20	0.11
409	601608	中信重工	19,200	80,832.00	0.11
410	601598	中国外运	17,300	80,618.00	0.10
411	600062	华润双鹤	4,600	80,132.00	0.10
412	603826	坤彩科技	1,600	80,000.00	0.10
413	002505	鹏都农牧	42,200	79,758.00	0.10
414	000559	万向钱潮	14,600	79,570.00	0.10
415	600259	广晟有色	2,200	79,508.00	0.10
416	688052	纳芯微	500	79,185.00	0.10
417	600597	光明乳业	7,600	79,040.00	0.10
418	002081	金螳螂	17,500	78,925.00	0.10
419	600782	新钢股份	21,000	77,910.00	0.10
420	000089	深圳机场	11,200	77,840.00	0.10
421	300618	寒锐钴业	2,400	77,784.00	0.10
422	000958	电投产融	17,800	77,074.00	0.10
423	600901	江苏金租	18,480	76,322.40	0.10
424	600339	中油工程	18,400	74,888.00	0.10
425	600707	彩虹股份	15,700	74,732.00	0.10
426	603638	艾迪精密	3,640	74,692.80	0.10
427	600409	三友化工	13,600	74,120.00	0.10
428	600095	湘财股份	9,500	74,100.00	0.10
429	000937	冀中能源	11,600	74,008.00	0.10
430	601187	厦门银行	14,600	73,292.00	0.10
431	000898	鞍钢股份	26,300	73,114.00	0.10
432	000537	广宇发展	6,200	72,354.00	0.09
433	603707	健友股份	5,334	72,009.00	0.09
434	688107	安路科技	1,300	72,007.00	0.09
435	601718	际华集团	24,200	71,874.00	0.09
436	000415	渤海租赁	34,100	71,610.00	0.09
437	002761	浙江建投	4,700	71,346.00	0.09
438	600507	方大特钢	15,300	70,839.00	0.09
439	001914	招商积余	4,700	70,735.00	0.09
440	000967	盈峰环境	14,000	70,700.00	0.09
441	600167	联美控股	10,100	70,397.00	0.09
442	601568	北元集团	13,190	69,511.30	0.09
443	000563	陕国投 A	22,600	68,930.00	0.09
444	600968	海油发展	22,400	68,768.00	0.09
445	600808	马钢股份	26,600	68,362.00	0.09
446	601156	东航物流	5,200	67,600.00	0.09
447	300257	开山股份	4,400	66,748.00	0.09
448	002925	盈趣科技	3,440	66,736.00	0.09

449	603650	彤程新材	2,000	65,600.00	0.09
450	600195	中牧股份	5,600	65,408.00	0.09
451	600764	中国海防	2,400	65,328.00	0.08
452	002705	新宝股份	3,600	64,908.00	0.08
453	600126	杭钢股份	14,900	64,666.00	0.08
454	300442	润泽科技	2,100	64,596.00	0.08
455	002608	江苏国信	8,400	63,588.00	0.08
456	603379	三美股份	2,700	63,477.00	0.08
457	688234	天岳先进	843	62,331.42	0.08
458	000959	首钢股份	17,300	60,550.00	0.08
459	000402	金融街	13,200	59,664.00	0.08
460	603786	科博达	900	59,130.00	0.08
461	002653	海思科	2,500	59,000.00	0.08
462	688819	天能股份	1,600	58,944.00	0.08
463	688185	康希诺	700	57,050.00	0.07
464	601828	美凯龙	11,900	57,001.00	0.07
465	002110	三钢闽光	13,500	56,970.00	0.07
466	001203	大中矿业	5,000	55,550.00	0.07
467	002563	森马服饰	8,900	55,358.00	0.07
468	600377	宁沪高速	5,500	54,065.00	0.07
469	688289	圣湘生物	3,200	53,888.00	0.07
470	601298	青岛港	7,700	53,669.00	0.07
471	601228	广州港	16,600	53,618.00	0.07
472	603056	德邦股份	3,400	52,428.00	0.07
473	600927	永安期货	3,200	52,032.00	0.07
474	600928	西安银行	14,700	51,744.00	0.07
475	600623	华谊集团	8,300	51,709.00	0.07
476	000031	大悦城	14,100	51,606.00	0.07
477	603317	天味食品	3,523	51,471.03	0.07
478	601869	长飞光纤	1,300	48,113.00	0.06
479	600350	山东高速	7,500	47,775.00	0.06
480	002399	海普瑞	4,100	47,027.00	0.06
481	601136	首创证券	3,300	46,761.00	0.06
482	601139	深圳燃气	6,400	46,656.00	0.06
483	000869	张裕 A	1,500	45,990.00	0.06
484	001872	招商港口	2,600	44,902.00	0.06
485	601969	海南矿业	6,700	44,086.00	0.06
486	600995	南网储能	3,900	42,939.00	0.06
487	002945	华林证券	3,000	41,040.00	0.05
488	000553	安道麦 A	4,800	40,512.00	0.05
489	688105	诺唯赞	1,300	39,637.00	0.05
490	600299	安迪苏	4,400	35,068.00	0.05
491	601158	重庆水务	6,300	35,028.00	0.05

492	688248	南网科技	900	34,551.00	0.04
493	603355	莱克电气	1,300	33,033.00	0.04
494	688295	中复神鹰	900	33,012.00	0.04
495	603868	飞科电器	500	31,545.00	0.04
496	600032	浙江新能	2,400	30,144.00	0.04
497	300741	华宝股份	1,400	29,988.00	0.04
498	600956	新天绿能	3,400	29,648.00	0.04
499	002901	大博医疗	600	18,648.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600372	中航电子	315,853.00	0.44
2	002463	沪电股份	313,843.00	0.44
3	000066	中国长城	302,148.00	0.42
4	002850	科达利	273,028.00	0.38
5	000423	东阿阿胶	270,031.00	0.37
6	300308	中际旭创	257,126.83	0.36
7	002340	格林美	255,577.00	0.35
8	002384	东山精密	249,935.00	0.35
9	000933	神火股份	246,691.00	0.34
10	002240	盛新锂能	243,961.00	0.34
11	300073	当升科技	235,567.00	0.33
12	300012	华测检测	234,339.00	0.33
13	002008	大族激光	231,140.00	0.32
14	002422	科伦药业	223,792.00	0.31
15	300724	捷佳伟创	223,425.00	0.31
16	603882	金域医学	222,722.00	0.31
17	002738	中矿资源	220,768.00	0.31
18	300395	菲利华	214,110.00	0.30
19	688777	中控技术	210,778.00	0.29
20	002192	融捷股份	205,991.00	0.29

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	000999	华润三九	461,522.00	0.64
2	688122	西部超导	422,514.50	0.59
3	603345	安井食品	386,685.90	0.54
4	002603	以岭药业	384,443.60	0.53
5	603605	珀莱雅	349,462.04	0.49
6	300168	万达信息	322,842.00	0.45
7	300418	昆仑万维	317,433.00	0.44
8	601607	上海医药	301,945.00	0.42
9	002850	科达利	290,392.00	0.40
10	603606	东方电缆	271,389.00	0.38
11	002340	格林美	249,003.00	0.35
12	688777	中控技术	247,584.89	0.34
13	601699	潞安环能	238,557.00	0.33
14	002384	东山精密	236,841.00	0.33
15	300073	当升科技	231,875.00	0.32
16	603613	国联股份	230,896.60	0.32
17	002212	天融信	225,945.78	0.31
18	300012	华测检测	224,239.00	0.31
19	601872	招商轮船	221,259.00	0.31
20	300724	捷佳伟创	217,547.00	0.30

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	35,749,156.39
卖出股票收入（成交）总额	33,839,719.94

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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**

昆仑万维科技股份有限公司因未依法履行其他职责在本报告编制前一年内受到深圳证券交易所的监管关注。

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	305,530.88
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	305,530.88

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

8.1.1 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 (%)
583	41,582.63	20,187,215.00	83.27	4,055,457.00	16.73

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
招商银行股份有限公司-泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	15,604,500.00	64.37

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	东方证券股份有限公司	2,211,030.00	9.12
2	中信建投证券股份有限公司	954,821.00	3.94
3	华泰证券股份有限公司	752,635.00	3.10
4	广发证券股份有限公司	647,929.00	2.67
5	陈志伟	320,700.00	1.32
6	刘卫	205,600.00	0.85
7	袁玲	128,439.00	0.53
8	靳绪玲	124,991.00	0.52
9	李德良	113,017.00	0.47
10	于洪顺	100,000.00	0.41
11	招商银行股份有限公司-泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	15,604,500.00	64.37

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	23,442,672.00
本报告期基金总申购份额	12,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,242,672.00

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	4	26,532,422.00	38.13	7,199.27	26.61	-
中信证券	4	22,059,397.18	31.70	11,175.07	41.30	-
华泰证券	4	12,762,329.21	18.34	6,398.27	23.65	-
申万宏源证券	6	8,226,192.94	11.82	2,284.74	8.44	-

安信证券	4	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	6	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	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	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	4	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；

- (2) 财务状况和经营状况良好；
- (3) 内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- (5) 能及时提供准确的信息资讯服务；
- (6) 满足基金运作的保密要求；
- (7) 符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金新增租用 30 个交易单元，国信证券上海证券交易所交易单元 1 个，国泰君安证券上海证券交易所交易单元 1 个，华安证券上海证券交易所交易单元 1 个，中信建投证券上海证券交易所交易单元 1 个，开源证券深圳证券交易所交易单元 1 个，国盛证券深圳证券交易所交易单元 1 个，国金证券深圳证券交易所交易单元 1 个，国海证券深圳证券交易所交易单元 1 个，中泰证券深圳证券交易所交易单元 1 个，中信建投证券深圳证券交易所交易单元 2 个，申万宏源证券深圳证券交易所交易单元 1 个，东吴证券深圳证券交易所交易单元 1 个，华创证券深圳证券交易所交易单元 1 个，华西证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国联证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华福证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中邮证券上海、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，财通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

本报告期内本基金减少租用 60 个交易单元，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、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 2 个，国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、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，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，中信证券上海、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，信达证券上海、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，西部证券上海、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，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，华鑫证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，财通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，民生证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华安证券上海、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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证	-	-	-	-	-	-

券						
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 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	-	-	-	-	-	-

投证券						
中邮证 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	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第四季度报告	《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	2023 年 01 月 19 日
2	泰康基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	《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	2023 年 03 月 17 日
3	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	《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	2023 年 03 月 30 日
4	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务公告	《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	2023 年 04 月 21 日
5	泰康基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《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	2023 年 04 月 21 日
6	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第一季度报告	《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	2023 年 04 月 21 日
7	关于泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	《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	2023 年 05 月 24 日
8	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	《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	2023 年 05 月 25 日
9	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告	《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	2023 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	20230101 - 20230630	12,124,20 0.00	17,913,5 00.00	14,433,20 0.00	15,604,500.00	64.37

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。

泰康基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日