

泰康中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期为 2020 年 9 月 18 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17

6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§9 基金份额持有人信息.....	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	73
§ 11 重大事件揭示.....	74
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§13 备查文件目录.....	80
13.1 备查文件目录.....	80
13.2 存放地点.....	80
13.3 查阅方式.....	80

§ 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	41,042,672.00 份
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020-11-09

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p>
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证 500 指数，业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

风险收益特征	<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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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

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

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

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

（4）本基金以2020年10月15日为折算日，进行了基金份额折算，折算情况参见《关于泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》及《关于泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

（5）本基金合同生效日为2020年9月18日，截止报告期末本基金未满一年。

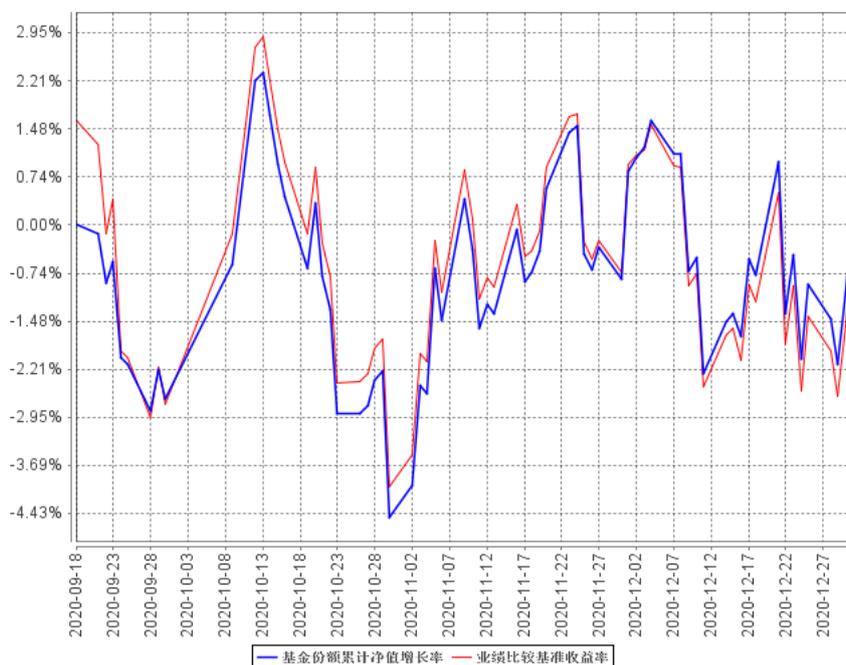
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.25%	1.14%	2.82%	1.16%	0.43%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.49%	1.09%	0.00%	1.16%	0.49%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

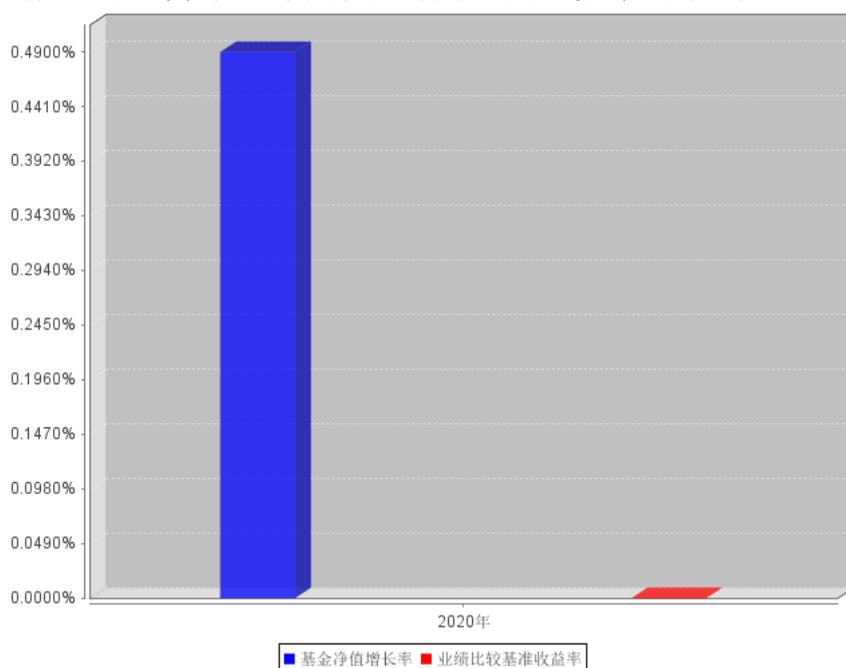


注：1、本基金基金合同于 2020 年 09 月 18 日生效，截止报告期末本基金未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截止报告期末本基金未过建仓期。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2020 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 22000 亿元。除管理泰康保险集团委托的资金外，泰康资产受托管理的第三方资产总规模突破 12000 亿元，另类投资管理规模超过 4400 亿元，退休金管理规模超过 5200 亿元，其中企业年金管理规模超过 3400 亿元。

2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债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共 52 只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏军	本基金基金经理	2020 年 9 月 18 日	-	13	魏军于 2019 年 5 月加入泰康资产，现任公募事业部投资部量化投资总监。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。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。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2020 年经济经受到疫情的冲击，呈现出“V”型复苏的走势。一季度，疫情带来了较大的冲击，经济被按下暂停键，但随着国内疫情控制得当、复工复产顺利推进、以及政策的合理对冲，二季度开始经济明显复苏，GDP 到四季度已经回升到 6.5%，略高于疫情前水平。

对复苏贡献最大的是出口，中国具有完备的产业链和生产优势，迅速在全球市场扩张份额，并且同时带动了出口产业链相关制造业的发展。此外，基建和地产表现稳健，零售的复苏任重道远。金融环境方面，CPI 在食品和非食品的共振下持续下行，PPI 从底部回升，汇率有所升值，社融有序扩张。

权益市场方面，2020 年一季度新冠肺炎对海外经济体的影响超出之前的预期，由于外需的不确定性以及防控海外病例倒灌的影响，中国经济活动尚未企稳复苏，虽然短期权益市场的盈利下调风险还需要释放，但中长期而言中国经济相比全球其他经济体依然有韧性，宽松的政策环境也对冲了部分风险偏好的下降。进入二季度，随着新冠肺炎疫情在中国得到了有效的控制，4、5 月份的数据显示中国经济韧性强于预期，中国庞大的消费市场和在全球产业链中不断上升的地位为后续的复苏提供了持续的动力，权益市场也探底回升。下半年，资金面和政策面维持宽松友好，全球疫情和国际关系又有复杂变数，市场在多重因素的影响下处于弱平衡状态，呈现出震荡上涨格局。从大盘和板块上来看，全年上证综指上涨 13.87%、沪深 300 上涨 27.21%、中小板指上涨 43.91%、创业板指上涨 64.96%，其中，电力设备及新能源、食品饮料、消费者服务等板块表现相对较好，通信、房地产、综合金融等行业表现不佳。

投资操作方面，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内跟踪误差主要来自基金建仓、基金份额的申赎和指数成分股定期调整。自基金 9 月下旬成立以来，中证 500 指数宽幅震荡，至年底指数涨跌幅为 0%，中证 500 指数走势与沪深 300 风格分化显著。我们长期看好核心宽基指数表现，基金将紧跟市场、以控制跟踪误差为基础，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 3.2159 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.49%；同期业绩比较基准增长率为 0.00%。

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 2021 年，宏观上，当前国内经济仍持续复苏，企业融资需求旺盛，国内经济活力逐步恢复，预计全年将录得同比较高增长。政策上，当前国内宽松货币政策及信用政策呈现边际收紧趋势，但收紧的力度及幅度仍较为温和。估值上，当前 A 股整体估值处于历史高位，但结构性特征明显，资金抱团股票估值处于历史高位，而中小盘股票估值仍处于历史较低水平，市场风格和估值分化明显。

权益市场方面，从海内外情况来看，持续复苏的经济和不断修复的企业盈利将对 A 股市场形成较有力的支撑，而持续收紧的政策和较高的估值可能压制 A 股大幅上涨，预计 A 股结构牛行情

还将延续，沪深 300、中证 500 等核心宽基指数具有相对估值优势，具有较高的配置价值。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22844 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“泰康中证 500ETF”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰康中证 500ETF2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰康中证 500ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

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

	<p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰康中证 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰康中证 500ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张 勇 周 祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	1,406,489.13
结算备付金		2,251,500.13
存出保证金		608,251.15
交易性金融资产	7.4.7.2	128,174,580.91
其中：股票投资		128,174,580.91
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		348,860.96
应收利息	7.4.7.5	1,469.64
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		132,791,151.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		77,974.24
应付赎回款		-
应付管理人报酬		46,082.98
应付托管费		5,760.37
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	74,665.57
应交税费		0.03

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	598,073.91
负债合计		802,557.10
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	131,348,709.72
未分配利润	7.4.7.10	639,885.10
所有者权益合计		131,988,594.82
负债和所有者权益总计		132,791,151.92

注：（1）本基金合同生效日为2020年9月18日，本报告期自基金合同生效日2020年9月18日起至2020年12月31日止，报告截止日2020年12月31日，基金份额净值3.2159元，基金份额总额41,042,672.00份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 利润表

会计主体：泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
一、收入		1,560,961.79
1.利息收入		95,194.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	42,373.62
债券利息收入		42.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		52,778.81
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		672,204.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	554,938.08
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	64,441.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	19,668.83
股利收益	7.4.7.16	33,156.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	758,432.68

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

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

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年9月18日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	243,999,138.00	-	243,999,138.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	893,747.02	893,747.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-112,650,428.28	-253,861.92	-112,904,290.20
其中：1.基金申购款	94,728,769.30	95,041.32	94,823,810.62
2.基金赎回款	-207,379,197.58	-348,903.24	-207,728,100.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	131,348,709.72	639,885.10	131,988,594.82

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1284 号《关于准予泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 243,998,555.00 元(含募集股票市值)，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2000722 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 243,999,138.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 583.00 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《关于泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，本基金以 2020 年 10 月 15 日为折算日，进行了基金份额折算，折算前基金份额总额为 243,999,138.00 份，折算后基金份额总额为 76,242,672.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]357 号核准，本基金 76,242,672.00 份基金份额于 2020 年 11 月 9 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资

目标，还可投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定，本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1. 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证

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

2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

活期存款	1,406,489.13
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,406,489.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	127,537,628.23	128,174,580.91	636,952.68
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	127,537,628.23	128,174,580.91	636,952.68

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	3,629,360.00	-	-	
-股指期货	3,629,360.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	3,629,360.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂

收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于2020年12月31日,本基金持有的股指期货合约情况如下:

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2103	中证500期货2103 合约	3	3,750,840.00	121,480.00
总额合计				121,480.00
减:可抵销期货暂收款				121,480.00
股指期货投资净额				0.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末,本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末,本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	202.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,225.84
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	41.14
合计	1,469.64

7.4.7.6 其他资产

本报告期末,本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

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

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

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

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	243,999,138.00	243,999,138.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
2020 年 10 月 15 日 基金拆分/份额折算前	243,999,138.00	243,999,138.00
基金拆分/份额折算变动份额	-167,756,466.00	-
本期申购	29,600,000.00	94,728,769.30
本期赎回(以“-”号填列)	-64,800,000.00	-207,379,197.58
本期末	41,042,672.00	131,348,709.72

注：1. 申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 8 月 24 日至 2020 年 9 月 11 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 243,998,555.00 元(含募集股票市值)。根据《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金

设立募集期内认购基金资金产生的利息收入 65,523.62 元,其中 583.00 元为注册登记结算机构实际记录结转基金份额金额,折合 583.00 份基金份额。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。

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	135,314.34	758,432.68	893,747.02
本期基金份额交易产生的变动数	-240,302.97	-13,558.95	-253,861.92
其中:基金申购款	314,232.36	-219,191.04	95,041.32
基金赎回款	-554,535.33	205,632.09	-348,903.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-104,988.63	744,873.73	639,885.10

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,344.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	25,797.25
其他	231.77
合计	42,373.62

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期
	2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价	71,298.13

收入	
股票投资收益——赎回差价收入	483,639.95
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	554,938.08

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	150,426,153.16
减：卖出股票成本总额	150,354,855.03
买卖股票差价收入	71,298.13

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	207,728,100.82
减：现金支付赎回款总额	115,759,169.82
减：赎回股票成本总额	91,485,291.05
赎回差价收入	483,639.95

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	64,441.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差	-

价收入	
合计	64,441.54

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	358,785.24
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	294,300.00
减：应收利息总额	43.70
买卖债券差价收入	64,441.54

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

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

7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日,本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	19,668.83

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	33,156.47
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	33,156.47
----	-----------

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	636,952.68
——股票投资	636,952.68
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	121,480.00
——权证投资	-
——股指期货投资	121,480.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-
合计	758,432.68

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	64,954.62
替代损益	-29,825.38
合计	35,129.24

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	321,770.46

银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	321,770.46

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年9月18日(基金合同生效日)至2020年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	7,640.44
指数使用费	39,945.65
银行费用	1,694.74
合计	89,280.83

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	227,597.12
其中:支付销售机构的客户维护费	2,015.57

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,449.67

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金未与关联方通过约

定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，基金管理人未运用自有资金投资基金份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,406,489.13	16,344.60

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

7.4.11 利润分配情况

本报告期 2020 年 9 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本基金无利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	网下新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	网下新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	网下新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300913	兆龙互连	2020年11月27日	2021年6月7日	新股锁定期流通受限	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定期流通受限	39.74	60.44	189	7,510.86	11,423.16	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定期流通受限	29.57	40.67	270	7,983.90	10,980.90	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定期流通受限	30.26	47.87	210	6,354.60	10,052.70	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定期流通受限	24.87	33.51	265	6,590.55	8,880.15	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定期流通受限	24.35	33.06	251	6,111.85	8,298.06	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定期流通受限	18.78	31.94	232	4,356.96	7,410.08	-

注：1、截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

2、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金可作为特定投资者，所认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深

圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

3、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项停牌	3.23	2021年1月7日	3.40	47,700	264,817.79	154,071.00	-
--------	------	-------------	--------	------	-----------	------	--------	------------	------------	---

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日

A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

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

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于2020年12月31日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,406,489.13	-	-	-	1,406,489.13
结算备付金	2,251,500.13	-	-	-	2,251,500.13
存出保证金	83,133.55	-	-	525,117.60	608,251.15
交易性金融资产	-	-	-	128,174,580.91	128,174,580.91
应收证券清算款	-	-	-	348,860.96	348,860.96
应收利息	-	-	-	1,469.64	1,469.64
资产总计	3,741,122.81	-	-	129,050,029.11	132,791,151.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	77,974.24	77,974.24
应付管理人报酬	-	-	-	46,082.98	46,082.98
应付托管费	-	-	-	5,760.37	5,760.37
应付交易费用	-	-	-	74,665.57	74,665.57
应交税费	-	-	-	0.03	0.03
其他负债	-	-	-	598,073.91	598,073.91
负债总计	-	-	-	802,557.10	802,557.10
利率敏感度缺口	3,741,122.81	-	-	128,247,472.01	131,988,594.82

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年12月31日）
	市场利率下调0.25%	0.00
	市场利率上调0.25%	0.00

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	128,174,580.91	97.11
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	128,174,580.91	97.11

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附件 7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 127,926,593.12 元，属于第二层次的余额为 247,987.79 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

本报告期 2020 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日，本基金申购基金份额

的对价总额为 94,823,810.62 元，其中包括以股票支付的申购款 40,817,644.88 元和以现金支付的申购款 54,006,165.74 元。

(3) 除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	128,174,580.91	96.52
	其中：股票	128,174,580.91	96.52
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	3,657,989.26	2.75
8	其他各项资产	958,581.75	0.72
9	合计	132,791,151.92	100.00

注：(1) 本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

(2) 本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 0.00 元，占期末资产净值比例为 0.00%

(3) 股票投资项含可退替代款的估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,435,227.00	1.09
B	采矿业	4,078,647.20	3.09
C	制造业	82,047,433.26	62.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,931,741.12	2.22
E	建筑业	1,809,373.00	1.37
F	批发和零售业	4,815,907.00	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,499,341.20	1.89
H	住宿和餐饮业	613,833.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,659,336.00	7.32

J	金融业	7,783,517.00	5.90
K	房地产业	3,768,355.00	2.86
L	租赁和商务服务业	1,273,232.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	1,187,434.52	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	1,184,353.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	104,544.00	0.08
Q	卫生和社会工作	1,143,100.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	1,047,581.00	0.79
S	综合	612,028.00	0.46
	合计	127,994,983.30	96.97

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	153,508.29	0.12
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	18,716.24	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,410.08	0.01
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	179,634.61	0.14

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	23,100	1,669,668.00	1.27
2	300012	华测检测	37,796	1,034,476.52	0.78
3	600426	华鲁恒升	25,800	962,340.00	0.73
4	002074	国轩高科	23,200	907,584.00	0.69
5	600089	特变电工	84,200	854,630.00	0.65
6	600079	人福医药	24,500	830,060.00	0.63
7	603882	金域医学	6,300	807,156.00	0.61
8	000547	航天发展	29,100	800,250.00	0.61
9	300285	国瓷材料	17,500	789,425.00	0.60
10	300496	中科创达	6,700	783,900.00	0.59
11	002709	天赐材料	7,500	778,500.00	0.59
12	300207	欣旺达	25,000	767,750.00	0.58
13	600143	金发科技	40,800	699,312.00	0.53
14	601233	桐昆股份	33,900	698,001.00	0.53
15	002185	华天科技	49,700	676,914.00	0.51
16	600739	辽宁成大	27,700	673,664.00	0.51
17	002797	第一创业	66,800	664,660.00	0.50
18	600132	重庆啤酒	5,500	654,445.00	0.50
19	002385	大北农	66,550	642,873.00	0.49
20	600885	宏发股份	11,800	639,796.00	0.48
21	002568	百润股份	6,100	636,169.00	0.48
22	601099	太平洋	154,700	631,176.00	0.48
23	601799	星宇股份	3,101	621,750.50	0.47
24	002340	格林美	86,900	607,431.00	0.46
25	603806	福斯特	7,000	597,800.00	0.45
26	688002	睿创微纳	5,100	566,100.00	0.43
27	300595	欧普康视	6,900	565,248.00	0.43
28	603589	口子窖	8,200	564,980.00	0.43
29	600316	洪都航空	9,800	557,326.00	0.42
30	600486	扬农化工	4,200	554,400.00	0.42

31	601966	玲珑轮胎	15,594	548,440.98	0.42
32	300357	我武生物	7,143	547,868.10	0.42
33	000636	风华高科	16,200	545,940.00	0.41
34	600529	山东药玻	10,800	541,620.00	0.41
35	002625	光启技术	24,310	540,897.50	0.41
36	601168	西部矿业	43,300	536,054.00	0.41
37	600201	生物股份	25,447	531,587.83	0.40
38	002507	涪陵榨菜	12,500	528,750.00	0.40
39	300699	光威复材	5,900	525,395.00	0.40
40	603345	安井食品	2,700	520,749.00	0.39
41	600219	南山铝业	162,700	514,132.00	0.39
42	002078	太阳纸业	35,400	510,822.00	0.39
43	603816	顾家家居	7,200	507,672.00	0.38
44	000750	国海证券	86,400	506,304.00	0.38
45	002013	中航机电	44,100	504,945.00	0.38
46	300088	长信科技	55,500	493,395.00	0.37
47	002030	达安基因	13,900	476,770.00	0.36
48	600862	中航高科	15,800	475,580.00	0.36
49	600699	均胜电子	18,600	471,696.00	0.36
50	600884	杉杉股份	25,800	465,174.00	0.35
51	601997	贵阳银行	58,500	465,075.00	0.35
52	002131	利欧股份	153,200	464,196.00	0.35
53	601128	常熟银行	62,500	461,250.00	0.35
54	002353	杰瑞股份	13,000	455,000.00	0.34
55	002465	海格通信	41,800	452,694.00	0.34
56	603486	科沃斯	5,100	451,299.00	0.34
57	600460	士兰微	17,900	447,500.00	0.34
58	002212	天融信	21,242	446,294.42	0.34
59	603338	浙江鼎力	4,400	445,236.00	0.34
60	000009	中国宝安	58,500	440,505.00	0.33
61	300316	晶盛机电	14,600	439,168.00	0.33
62	002075	沙钢股份	40,000	438,800.00	0.33
63	002500	山西证券	48,900	437,655.00	0.33
64	600867	通化东宝	32,700	437,526.00	0.33
65	300146	汤臣倍健	17,900	432,285.00	0.33
66	002791	坚朗五金	2,984	429,696.00	0.33
67	000630	铜陵有色	167,000	429,190.00	0.33
68	002683	宏大爆破	11,900	427,805.00	0.32
69	603444	吉比特	1,000	426,000.00	0.32

70	600511	国药股份	8,600	424,066.00	0.32
71	000988	华工科技	18,200	422,058.00	0.32
72	600038	中直股份	6,690	419,529.90	0.32
73	300482	万孚生物	4,700	419,287.00	0.32
74	000998	隆平高科	20,900	414,029.00	0.31
75	600733	北汽蓝谷	47,600	412,692.00	0.31
76	300463	迈克生物	8,800	410,080.00	0.31
77	300168	万达信息	18,800	407,772.00	0.31
78	002250	联化科技	16,800	403,032.00	0.31
79	300001	特锐德	13,600	399,296.00	0.30
80	600909	华安证券	49,300	394,400.00	0.30
81	300223	北京君正	4,300	393,407.00	0.30
82	002223	鱼跃医疗	13,700	386,477.00	0.29
83	300070	碧水源	50,300	384,795.00	0.29
84	002156	通富微电	15,100	381,124.00	0.29
85	000021	深科技	20,000	380,200.00	0.29
86	002444	巨星科技	12,200	379,542.00	0.29
87	688099	晶晨股份	4,800	377,904.00	0.29
88	600754	锦江酒店	7,300	376,169.00	0.29
89	002572	索菲亚	14,500	375,550.00	0.28
90	002299	圣农发展	14,100	374,214.00	0.28
91	002557	洽洽食品	6,900	371,565.00	0.28
92	300418	昆仑万维	18,600	371,070.00	0.28
93	002926	华西证券	29,700	370,656.00	0.28
94	600879	航天电子	49,400	369,512.00	0.28
95	601689	拓普集团	9,600	368,928.00	0.28
96	600380	健康元	26,515	368,823.65	0.28
97	600418	江淮汽车	30,100	368,123.00	0.28
98	002080	中材科技	15,200	367,536.00	0.28
99	600516	方大炭素	51,900	366,933.00	0.28
100	603866	桃李面包	6,200	366,420.00	0.28
101	600779	水井坊	4,400	365,288.00	0.28
102	600155	华创阳安	27,600	364,044.00	0.28
103	603737	三棵树	2,400	363,600.00	0.28
104	002670	国盛金控	26,400	363,000.00	0.28
105	000039	中集集团	24,200	362,758.00	0.27
106	002138	顺络电子	14,600	357,992.00	0.27
107	300271	华宇软件	14,800	353,276.00	0.27
108	002603	以岭药业	13,700	349,350.00	0.26

109	000623	吉林敖东	21,100	347,517.00	0.26
110	300024	机器人	28,228	347,204.40	0.26
111	600372	中航电子	17,500	343,875.00	0.26
112	002081	金螳螂	36,500	342,735.00	0.26
113	002373	千方科技	17,900	342,248.00	0.26
114	600415	小商品城	61,800	340,518.00	0.26
115	000513	丽珠集团	8,400	340,200.00	0.26
116	300244	迪安诊断	9,800	335,944.00	0.25
117	300115	长盈精密	13,600	335,240.00	0.25
118	000878	云南铜业	23,100	334,257.00	0.25
119	600563	法拉电子	3,100	333,405.00	0.25
120	000050	深天马A	22,300	328,702.00	0.25
121	688088	虹软科技	4,700	328,624.00	0.25
122	600166	福田汽车	104,200	328,230.00	0.25
123	000975	银泰黄金	37,720	324,769.20	0.25
124	300618	寒锐钴业	3,400	322,694.00	0.24
125	601615	明阳智能	17,000	322,660.00	0.24
126	600549	厦门钨业	19,100	321,835.00	0.24
127	600765	中航重机	12,800	320,000.00	0.24
128	300315	掌趣科技	62,600	319,886.00	0.24
129	002273	水晶光电	27,600	319,884.00	0.24
130	600153	建发股份	38,900	319,369.00	0.24
131	300009	安科生物	21,700	318,556.00	0.24
132	002019	亿帆医药	16,800	318,024.00	0.24
133	002064	华峰氨纶	31,500	317,835.00	0.24
134	600801	华新水泥	15,400	317,702.00	0.24
135	600667	太极实业	33,400	315,630.00	0.24
136	000686	东北证券	31,900	313,258.00	0.24
137	000739	普洛药业	13,400	311,952.00	0.24
138	002920	德赛西威	3,700	311,318.00	0.24
139	002511	中顺洁柔	14,900	310,963.00	0.24
140	600598	北大荒	16,100	309,925.00	0.23
141	002705	新宝股份	7,300	308,425.00	0.23
142	300017	网宿科技	44,500	306,605.00	0.23
143	002124	天邦股份	20,900	305,140.00	0.23
144	600535	天士力	20,600	304,674.00	0.23
145	600170	上海建工	101,100	304,311.00	0.23
146	002831	裕同科技	9,900	303,138.00	0.23
147	000401	冀东水泥	21,400	302,810.00	0.23

148	000540	中天金融	95,300	300,195.00	0.23
149	600895	张江高科	17,500	298,200.00	0.23
150	000738	航发控制	13,000	298,090.00	0.23
151	000830	鲁西化工	23,300	297,774.00	0.23
152	603858	步长制药	12,900	297,603.00	0.23
153	002152	广电运通	27,600	294,768.00	0.22
154	002506	协鑫集成	69,200	294,100.00	0.22
155	002195	二三四五	129,600	292,896.00	0.22
156	600642	申能股份	55,700	290,754.00	0.22
157	002966	苏州银行	37,800	290,304.00	0.22
158	002648	卫星石化	11,100	289,932.00	0.22
159	603883	老百姓	4,600	289,018.00	0.22
160	000690	宝新能源	39,500	288,350.00	0.22
161	600409	三友化工	28,000	287,000.00	0.22
162	600859	王府井	8,800	286,704.00	0.22
163	600392	盛和资源	31,900	283,591.00	0.21
164	603638	艾迪精密	4,100	282,654.00	0.21
165	002056	横店东磁	18,600	282,534.00	0.21
166	600008	首创股份	99,700	282,151.00	0.21
167	601456	国联证券	13,200	281,556.00	0.21
168	601992	金隅集团	94,400	280,368.00	0.21
169	600580	卧龙电驱	17,800	277,680.00	0.21
170	600497	驰宏锌锗	57,800	277,440.00	0.21
171	002028	思源电气	13,800	276,828.00	0.21
172	002382	蓝帆医疗	13,100	276,279.00	0.21
173	002281	光迅科技	9,500	275,880.00	0.21
174	000060	中金岭南	56,700	273,294.00	0.21
175	000729	燕京啤酒	32,000	272,640.00	0.21
176	300058	蓝色光标	45,200	271,200.00	0.21
177	002690	美亚光电	6,100	270,108.00	0.20
178	300212	易华录	8,800	269,720.00	0.20
179	002294	信立泰	9,500	269,135.00	0.20
180	002595	豪迈科技	9,061	268,658.65	0.20
181	601866	中远海发	90,100	267,597.00	0.20
182	600315	上海家化	7,700	267,421.00	0.20
183	002372	伟星新材	14,287	267,166.90	0.20
184	000807	云铝股份	35,400	266,562.00	0.20
185	600827	百联股份	18,200	265,720.00	0.20
186	002221	东华能源	26,200	265,668.00	0.20

187	603290	斯达半导	1,100	264,990.00	0.20
188	000581	威孚高科	11,400	264,366.00	0.20
189	600528	中铁工业	30,200	263,948.00	0.20
190	000983	山西焦煤	46,400	261,696.00	0.20
191	600256	广汇能源	91,900	260,077.00	0.20
192	601717	郑煤机	23,700	259,041.00	0.20
193	300296	利亚德	40,400	256,944.00	0.19
194	000960	锡业股份	22,800	255,360.00	0.19
195	000997	新大陆	16,700	255,176.00	0.19
196	002429	兆驰股份	41,000	254,200.00	0.19
197	600875	东方电气	25,300	252,241.00	0.19
198	600704	物产中大	57,400	250,838.00	0.19
199	603605	珀莱雅	1,400	249,200.00	0.19
200	600160	巨化股份	30,700	248,977.00	0.19
201	300630	普利制药	5,900	247,151.00	0.19
202	600260	凯乐科技	22,600	246,340.00	0.19
203	600811	东方集团	67,300	245,645.00	0.19
204	002745	木林森	16,800	245,112.00	0.19
205	002396	星网锐捷	10,600	244,436.00	0.19
206	600839	四川长虹	83,900	243,310.00	0.18
207	600728	佳都科技	31,800	241,362.00	0.18
208	002368	太极股份	9,200	240,212.00	0.18
209	600515	海航基础	35,500	239,625.00	0.18
210	002092	中泰化学	38,900	239,235.00	0.18
211	600325	华发股份	38,400	238,464.00	0.18
212	300474	景嘉微	3,400	237,694.00	0.18
213	603317	天味食品	2,890	237,673.60	0.18
214	600258	首旅酒店	11,200	237,664.00	0.18
215	600167	联美控股	20,800	236,080.00	0.18
216	600737	中粮糖业	24,200	234,256.00	0.18
217	600967	内蒙一机	19,200	233,472.00	0.18
218	603927	中科软	5,800	232,522.00	0.18
219	600820	隧道股份	42,800	231,548.00	0.18
220	000012	南玻A	31,200	230,256.00	0.17
221	600881	亚泰集团	73,900	229,090.00	0.17
222	002085	万丰奥威	34,700	227,632.00	0.17
223	300002	神州泰岳	44,400	226,884.00	0.17
224	600597	光明乳业	13,900	226,014.00	0.17
225	002390	信邦制药	26,500	224,720.00	0.17

226	002268	卫 士 通	13,300	222,110.00	0.17
227	600446	金证股份	13,700	222,077.00	0.17
228	000999	华润三九	8,900	221,966.00	0.17
229	600410	华胜天成	25,000	221,500.00	0.17
230	002242	九阳股份	6,912	221,460.48	0.17
231	600567	山鹰国际	72,900	220,158.00	0.17
232	002174	游族网络	16,600	218,456.00	0.17
233	600804	鹏博士	32,500	218,400.00	0.17
234	600282	南钢股份	69,500	216,840.00	0.16
235	603712	七一二	5,200	216,580.00	0.16
236	000877	天山股份	14,300	215,930.00	0.16
237	000709	河钢股份	96,300	215,712.00	0.16
238	601179	中国西电	46,600	214,826.00	0.16
239	000930	中粮科技	25,400	213,868.00	0.16
240	600435	北方导航	23,700	213,300.00	0.16
241	603000	人民网	12,600	212,940.00	0.16
242	002387	维信诺	18,600	212,040.00	0.16
243	000629	攀钢钒钛	97,600	211,792.00	0.16
244	600026	中远海能	31,490	210,353.20	0.16
245	300166	东方国信	19,200	210,240.00	0.16
246	002807	江阴银行	49,100	210,148.00	0.16
247	600273	嘉化能源	22,700	209,748.00	0.16
248	000301	东方盛虹	21,900	207,612.00	0.16
249	600216	浙江医药	15,212	206,883.20	0.16
250	001914	招商积余	9,600	206,688.00	0.16
251	002233	塔牌集团	16,200	206,388.00	0.16
252	600718	东软集团	19,700	205,077.00	0.16
253	600060	海信视像	17,800	204,344.00	0.15
254	600908	无锡银行	33,500	203,680.00	0.15
255	600188	兖州煤业	20,200	203,414.00	0.15
256	600037	歌华有线	22,000	202,400.00	0.15
257	600064	南京高科	19,600	201,292.00	0.15
258	000778	新兴铸管	54,300	199,824.00	0.15
259	600572	康恩贝	42,400	199,704.00	0.15
260	002004	华邦健康	36,000	199,440.00	0.15
261	002925	盈趣科技	3,100	199,423.00	0.15
262	000932	华菱钢铁	41,700	199,326.00	0.15
263	600755	厦门国贸	29,700	198,396.00	0.15
264	000400	许继电气	13,700	198,102.00	0.15

265	000027	深圳能源	32,400	197,316.00	0.15
266	601975	招商南油	78,300	196,533.00	0.15
267	601005	重庆钢铁	132,700	196,396.00	0.15
268	000598	兴蓉环境	40,800	195,840.00	0.15
269	600039	四川路桥	43,400	195,734.00	0.15
270	000887	中鼎股份	16,600	194,386.00	0.15
271	002985	北摩高科	1,000	193,300.00	0.15
272	002128	露天煤业	17,500	191,450.00	0.15
273	000089	深圳机场	23,300	190,361.00	0.14
274	002701	奥瑞金	38,400	189,696.00	0.14
275	603198	迎驾贡酒	5,400	188,460.00	0.14
276	600398	海澜之家	29,300	188,106.00	0.14
277	002110	三钢闽光	27,800	187,094.00	0.14
278	300026	红日药业	40,800	186,864.00	0.14
279	601118	海南橡胶	38,700	186,534.00	0.14
280	600158	中体产业	15,200	186,352.00	0.14
281	601106	中国一重	62,300	186,277.00	0.14
282	000825	太钢不锈	51,600	186,276.00	0.14
283	002191	劲嘉股份	20,000	184,600.00	0.14
284	002563	森马服饰	18,300	183,366.00	0.14
285	000970	中科三环	19,300	182,385.00	0.14
286	300072	三聚环保	32,000	181,760.00	0.14
287	600120	浙江东方	30,200	180,294.00	0.14
288	600171	上海贝岭	12,800	179,456.00	0.14
289	000488	晨鸣纸业	27,900	179,118.00	0.14
290	002048	宁波华翔	11,400	177,498.00	0.13
291	600022	山东钢铁	124,100	177,463.00	0.13
292	601699	潞安环能	27,200	176,800.00	0.13
293	600195	中牧股份	13,800	176,778.00	0.13
294	002936	郑州银行	39,600	176,616.00	0.13
295	002867	周大生	6,600	175,890.00	0.13
296	000090	天健集团	29,600	175,824.00	0.13
297	000402	金融街	27,200	175,440.00	0.13
298	000967	盈峰环境	21,500	175,010.00	0.13
299	603228	景旺电子	5,800	174,870.00	0.13
300	002217	合力泰	42,600	174,660.00	0.13
301	002839	张家港行	28,600	174,460.00	0.13
302	601860	紫金银行	41,400	174,294.00	0.13
303	600056	中国医药	12,100	173,393.00	0.13

304	300133	华策影视	28,000	173,040.00	0.13
305	000528	柳工	23,500	172,960.00	0.13
306	000883	湖北能源	44,400	172,272.00	0.13
307	601333	广深铁路	77,400	171,828.00	0.13
308	600673	东阳光	34,100	171,523.00	0.13
309	600376	首开股份	29,200	171,404.00	0.13
310	600006	东风汽车	18,100	170,864.00	0.13
311	603077	和邦生物	120,300	170,826.00	0.13
312	688321	微芯生物	4,600	170,246.00	0.13
313	600507	方大特钢	24,400	169,336.00	0.13
314	000563	陕国投A	44,900	169,273.00	0.13
315	600021	上海电力	23,701	168,751.12	0.13
316	000990	诚志股份	14,200	168,412.00	0.13
317	600928	西安银行	30,200	167,912.00	0.13
318	300376	易事特	21,000	167,160.00	0.13
319	000685	中山公用	20,100	166,830.00	0.13
320	601000	唐山港	66,900	165,912.00	0.13
321	600782	新钢股份	36,100	165,699.00	0.13
322	601200	上海环境	15,200	165,680.00	0.13
323	300180	华峰超纤	28,000	165,480.00	0.13
324	000898	鞍钢股份	54,300	165,072.00	0.13
325	600500	中化国际	31,300	164,951.00	0.12
326	002266	浙富控股	36,500	164,250.00	0.12
327	601865	福莱特	4,100	163,590.00	0.12
328	002203	海亮股份	22,100	163,319.00	0.12
329	002317	众生药业	14,800	163,096.00	0.12
330	603568	伟明环保	8,600	162,798.00	0.12
331	002155	湖南黄金	19,100	162,541.00	0.12
332	600126	杭钢股份	30,700	162,403.00	0.12
333	600970	中材国际	23,600	162,368.00	0.12
334	002244	滨江集团	35,200	161,568.00	0.12
335	300113	顺网科技	9,400	161,210.00	0.12
336	000559	万向钱潮	30,000	160,500.00	0.12
337	600466	蓝光发展	34,300	158,809.00	0.12
338	000758	中色股份	31,200	158,496.00	0.12
339	601598	中国外运	35,800	157,520.00	0.12
340	000519	中兵红箭	15,700	157,314.00	0.12
341	600266	城建发展	30,800	156,464.00	0.12
342	600649	城投控股	28,800	156,384.00	0.12

343	000028	国药一致	3,400	155,720.00	0.12
344	601608	中信重工	39,300	155,628.00	0.12
345	600348	阳泉煤业	27,700	155,397.00	0.12
346	600373	中文传媒	15,400	155,386.00	0.12
347	601016	节能风电	45,300	155,379.00	0.12
348	601098	中南传媒	16,300	155,339.00	0.12
349	300010	豆神教育	15,800	154,208.00	0.12
350	300182	捷成股份	47,700	154,071.00	0.12
351	600073	上海梅林	14,900	153,321.00	0.12
352	600546	山煤国际	18,000	153,180.00	0.12
353	600645	中源协和	7,800	152,958.00	0.12
354	603885	吉祥航空	13,400	152,358.00	0.12
355	600388	龙净环保	17,000	150,960.00	0.11
356	600959	江苏有线	45,500	150,605.00	0.11
357	601718	际华集团	49,700	150,591.00	0.11
358	002458	益生股份	13,500	150,525.00	0.11
359	000078	海王生物	37,500	150,375.00	0.11
360	600901	江苏租赁	27,200	149,872.00	0.11
361	002183	怡亚通	33,800	147,368.00	0.11
362	688029	南微医学	800	147,208.00	0.11
363	002505	大康农业	57,900	146,487.00	0.11
364	002399	海普瑞	8,500	146,370.00	0.11
365	002249	大洋电机	32,400	145,800.00	0.11
366	600094	大名城	36,200	145,524.00	0.11
367	002640	跨境通	28,300	145,462.00	0.11
368	002440	闰土股份	15,600	145,392.00	0.11
369	600808	马钢股份	54,200	144,172.00	0.11
370	600633	浙数文化	17,700	144,078.00	0.11
371	600835	上海机电	7,300	142,058.00	0.11
372	600062	华润双鹤	11,800	141,482.00	0.11
373	002038	双鹭药业	14,000	141,400.00	0.11
374	000564	供销大集	54,400	140,896.00	0.11
375	002468	申通快递	13,900	140,112.00	0.11
376	600141	兴发集团	12,700	140,081.00	0.11
377	600675	中华企业	41,500	139,440.00	0.11
378	002010	传化智联	29,400	138,474.00	0.10
379	000959	首钢股份	36,000	137,880.00	0.10
380	600643	爱建集团	18,300	137,616.00	0.10
381	601778	晶科科技	18,900	137,214.00	0.10

382	002434	万里扬	15,300	136,476.00	0.10
383	601958	金钼股份	21,900	135,999.00	0.10
384	600863	内蒙华电	52,800	135,696.00	0.10
385	601880	大连港	70,300	135,679.00	0.10
386	002408	齐翔腾达	16,200	135,432.00	0.10
387	000869	张裕A	3,100	135,160.00	0.10
388	000158	常山北明	21,800	135,160.00	0.10
389	000415	渤海租赁	55,900	134,160.00	0.10
390	600729	重庆百货	4,600	132,940.00	0.10
391	000826	启迪环境	19,500	131,820.00	0.10
392	600717	天津港	27,500	131,450.00	0.10
393	600312	平高电气	18,400	131,376.00	0.10
394	601611	中国核建	18,000	131,040.00	0.10
395	002544	杰赛科技	7,800	130,884.00	0.10
396	000031	大悦城	29,200	128,480.00	0.10
397	600776	东方通信	10,819	128,205.15	0.10
398	002583	海能达	20,800	127,712.00	0.10
399	300459	金科文化	39,800	126,962.00	0.10
400	002424	贵州百灵	15,900	124,497.00	0.09
401	002589	瑞康医药	23,800	124,474.00	0.09
402	002635	安洁科技	7,200	124,056.00	0.09
403	603650	彤程新材	4,000	124,000.00	0.09
404	600259	广晟有色	4,100	123,697.00	0.09
405	000681	视觉中国	9,500	123,500.00	0.09
406	600566	济川药业	6,100	123,403.00	0.09
407	002002	鸿达兴业	41,100	123,300.00	0.09
408	000501	鄂武商A	10,500	122,325.00	0.09
409	600648	外高桥	8,500	118,745.00	0.09
410	300324	旋极信息	28,000	118,440.00	0.09
411	000718	苏宁环球	34,500	118,335.00	0.09
412	600339	中油工程	38,200	117,656.00	0.09
413	600823	世茂股份	25,500	117,555.00	0.09
414	000717	韶钢松山	27,500	117,425.00	0.09
415	603708	家家悦	5,500	117,150.00	0.09
416	600307	酒钢宏兴	70,900	116,985.00	0.09
417	600131	国网信通	8,200	116,686.00	0.09
418	000046	泛海控股	35,400	116,112.00	0.09
419	002815	崇达技术	8,000	115,520.00	0.09
420	600582	天地科技	37,300	114,884.00	0.09

421	600329	中新药业	6,500	113,880.00	0.09
422	002375	亚厦股份	15,200	113,088.00	0.09
423	000156	华数传媒	13,100	112,136.00	0.08
424	000008	神州高铁	44,000	111,760.00	0.08
425	002948	青岛银行	18,800	111,484.00	0.08
426	600985	淮北矿业	9,900	110,781.00	0.08
427	600968	海油发展	45,900	109,701.00	0.08
428	601928	凤凰传媒	17,300	109,509.00	0.08
429	600664	哈药股份	34,300	109,417.00	0.08
430	000061	农产品	15,400	108,570.00	0.08
431	000543	皖能电力	25,800	107,844.00	0.08
432	603260	合盛硅业	3,200	107,008.00	0.08
433	600338	西藏珠峰	10,200	106,896.00	0.08
434	600707	彩虹股份	16,000	106,560.00	0.08
435	300257	开山股份	7,800	106,470.00	0.08
436	603377	东方时尚	5,400	104,544.00	0.08
437	002416	爱施德	14,000	104,440.00	0.08
438	600556	天下秀	8,200	103,730.00	0.08
439	600748	上实发展	21,000	103,110.00	0.08
440	603515	欧普照明	3,400	102,714.00	0.08
441	601298	青岛港	15,900	102,237.00	0.08
442	000937	冀中能源	24,200	100,672.00	0.08
443	002302	西部建设	11,400	100,092.00	0.08
444	600869	智慧能源	25,000	99,750.00	0.08
445	601127	小康股份	5,700	97,356.00	0.07
446	600639	浦东金桥	7,700	95,480.00	0.07
447	002503	搜于特	42,400	94,976.00	0.07
448	601139	深圳燃气	13,100	94,844.00	0.07
449	601228	广州港	27,900	93,744.00	0.07
450	600277	亿利洁能	31,100	92,989.00	0.07
451	600787	中储股份	20,100	92,661.00	0.07
452	000600	建投能源	16,200	90,882.00	0.07
453	600545	卓郎智能	25,900	90,650.00	0.07
454	000813	德展健康	20,400	90,372.00	0.07
455	300134	大富科技	8,700	89,871.00	0.07
456	603888	新华网	4,700	89,300.00	0.07
457	000062	深圳华强	7,100	88,324.00	0.07
458	600640	号百控股	7,200	88,200.00	0.07
459	603225	新风鸣	6,300	87,570.00	0.07

460	600517	国网英大	14,400	87,552.00	0.07
461	600350	山东高速	14,100	87,138.00	0.07
462	601828	美凯龙	10,000	84,900.00	0.06
463	600291	西水股份	14,900	84,483.00	0.06
464	600871	石化油服	42,900	84,084.00	0.06
465	603056	德邦股份	6,600	83,754.00	0.06
466	002419	天虹股份	10,900	83,276.00	0.06
467	002093	国脉科技	11,400	83,106.00	0.06
468	600575	淮河能源	35,300	81,896.00	0.06
469	603379	三美股份	4,200	80,220.00	0.06
470	002051	中工国际	11,300	80,117.00	0.06
471	000537	广宇发展	12,700	79,629.00	0.06
472	600657	信达地产	19,400	78,570.00	0.06
473	000553	安道麦 A	9,900	77,418.00	0.06
474	601869	长飞光纤	2,800	75,712.00	0.06
475	002901	大博医疗	1,000	73,730.00	0.06
476	600623	华谊集团	12,700	73,660.00	0.06
477	000732	泰禾集团	22,500	73,575.00	0.06
478	603893	瑞芯微	1,000	72,350.00	0.05
479	603328	依顿电子	9,000	71,550.00	0.05
480	002946	新乳业	3,900	68,679.00	0.05
481	603786	科博达	1,000	67,620.00	0.05
482	600903	贵州燃气	5,200	66,040.00	0.05
483	601801	皖新传媒	13,600	64,600.00	0.05
484	002653	海思科	3,600	63,072.00	0.05
485	603983	丸美股份	1,200	62,652.00	0.05
486	601003	柳钢股份	11,500	59,685.00	0.05
487	603719	良品铺子	1,000	58,670.00	0.04
488	603355	莱克电气	1,900	57,437.00	0.04
489	600053	九鼎投资	2,900	56,695.00	0.04
490	601969	海南矿业	8,900	53,222.00	0.04
491	603868	飞科电器	1,100	51,458.00	0.04
492	002941	新疆交建	4,400	48,400.00	0.04
493	002818	富森美	3,400	48,042.00	0.04
494	002423	中粮资本	4,100	39,688.00	0.03
495	002957	科瑞技术	1,900	38,855.00	0.03
496	001872	招商港口	2,400	38,208.00	0.03
497	601512	中新集团	3,800	37,772.00	0.03
498	603256	宏和科技	4,000	35,320.00	0.03

499	600917	重庆燃气	4,200	28,812.00	0.02
500	601068	中铝国际	6,800	24,208.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.02
2	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
3	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
4	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
5	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.01
6	300908	仲景食品	189	11,423.16	0.01
7	300909	汇创达	270	10,980.90	0.01
8	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
9	300910	瑞丰新材	210	10,052.70	0.01
10	300884	狄耐克	265	8,880.15	0.01
11	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
12	300911	亿田智能	251	8,298.06	0.01
13	300917	特发服务	232	7,410.08	0.01
14	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
15	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002821	凯莱英	2,718,312.00	2.06
2	300274	阳光电源	2,363,273.00	1.79
3	300012	华测检测	2,266,451.48	1.72
4	300285	国瓷材料	2,029,637.00	1.54
5	002185	华天科技	2,009,257.00	1.52
6	300207	欣旺达	1,983,279.00	1.50
7	300253	卫宁健康	1,908,200.10	1.45
8	600739	辽宁成大	1,884,961.03	1.43

9	002797	第一创业	1,807,712.00	1.37
10	002127	南极电商	1,805,788.00	1.37
11	002385	大北农	1,728,655.50	1.31
12	000547	航天发展	1,712,150.00	1.30
13	002507	涪陵榨菜	1,666,818.00	1.26
14	600079	人福医药	1,663,262.99	1.26
15	600143	金发科技	1,651,857.00	1.25
16	002013	中航机电	1,638,939.00	1.24
17	300088	长信科技	1,628,730.00	1.23
18	300496	中科创达	1,535,308.00	1.16
19	002074	国轩高科	1,534,543.18	1.16
20	002465	海格通信	1,410,039.00	1.07

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002821	凯莱英	2,854,862.65	2.16
2	300274	阳光电源	2,178,943.00	1.65
3	002127	南极电商	1,638,832.00	1.24
4	300253	卫宁健康	1,637,196.40	1.24
5	002625	光启技术	1,573,457.00	1.19
6	300285	国瓷材料	1,397,614.00	1.06
7	300012	华测检测	1,385,623.00	1.05
8	002414	高德红外	1,376,960.00	1.04
9	002185	华天科技	1,360,659.00	1.03
10	300207	欣旺达	1,266,423.00	0.96
11	300558	贝达药业	1,205,826.00	0.91
12	002439	启明星辰	1,128,616.98	0.86
13	000547	航天发展	1,122,731.00	0.85
14	002074	国轩高科	1,083,094.00	0.82
15	002013	中航机电	1,063,513.00	0.81
16	002797	第一创业	1,063,481.05	0.81
17	002507	涪陵榨菜	1,057,460.00	0.80

18	300088	长信科技	1,011,510.00	0.77
19	002385	大北农	1,008,918.00	0.76
20	300496	中科创达	1,005,126.00	0.76

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	324,986,560.43
卖出股票收入（成交）总额	150,426,153.16

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2103	中证500期货2103合约	3	3,750,840.00	121,480.00	-
公允价值变动总额合计(元)					121,480.00

股指期货投资本期收益（元）	19,668.83
股指期货投资本期公允价值变动（元）	121,480.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	608,251.15
2	应收证券清算款	348,860.96
3	应收股利	-
4	应收利息	1,469.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	958,581.75

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300913	兆龙互连	15,082.20	0.01	新股锁定期流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,725	23,792.85	11,786,211.00	28.72%	29,256,461.00	71.28%

9.2 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	广发证券股份有限公司	3,569,895.00	8.70%
2	东方证券股份有限公司	3,494,973.00	8.52%
3	中信建投证券股份有限公司	2,626,510.00	6.40%
4	黎宁	937,436.00	2.28%
5	上海易善资产管理有限公司—易善 稳睿十八号私募证券投资基金	800,016.00	1.95%
6	喻萍	624,957.00	1.52%
7	财达证券股份有限公司	340,000.00	0.83%
8	湖北荆通运业股份有限公司	318,728.00	0.78%
9	喻云霞	312,478.00	0.76%
10	杜娟	312,478.00	0.76%
11	北京三友恒瑞科技有限公司	312,478.00	0.76%

注：期末上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月18日）基金份额总额	243,999,138.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,600,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	64,800,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-167,756,466.00
本报告期期末基金份额总额	41,042,672.00

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人未出现重大人事变动。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资范围增加存托凭证，并相应增加存托凭证投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 40,000.00 元；截至 2020 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	4	140,234,371.94	29.57%	37,188.64	29.35%	-
国盛证券	2	97,883,606.68	20.64%	26,450.72	20.87%	-
华泰证券	4	92,978,102.53	19.61%	24,296.01	19.17%	-
中信证券	2	57,678,413.58	12.16%	15,131.17	11.94%	-
申万宏源	4	42,275,833.45	8.92%	11,528.71	9.10%	-
中金公司	2	41,900,950.20	8.84%	11,791.64	9.31%	-

方正证券	2	1,217,298.47	0.26%	333.12	0.26%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

- （1）经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- （2）财务状况和经营状况良好；
- （3）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- （4）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- （5）能及时提供准确的信息资讯服务；
- （6）满足基金运作的保密要求；
- （7）符合中国证监会规定的其他条件。

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

3、本报告期内本基金新增租用 44 个交易单元，为海通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，申万宏源上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，国信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中金公司上海、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，广发证券上海、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，方正证券上海、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，光大证券上海、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，中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，华泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	168,069.98	46.84%	92,300,000.00	24.14%	-	-
国盛证券	-	-	160,000,000.00	41.85%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	21,769.50	6.07%	-	-	-	-
申万宏源	122,297.76	34.09%	-	-	-	-
中金公司	-	-	130,000,000.00	34.00%	-	-
方正证券	46,648.00	13.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	《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	2020 年 8 月 19 日

2.	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	《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	2020 年 8 月 19 日
3.	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	《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	2020 年 8 月 19 日
4.	关于泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购清单调整的提示性公告	《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	2020 年 8 月 25 日
5.	关于泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金可投资科创板股票的公告	《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	2020 年 9 月 19 日
6.	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	《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	2020 年 9 月 19 日
7.	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	《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	2020 年 10 月 14 日
8.	关于泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	《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	2020 年 10 月 17 日
9.	泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购;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	2020 年 11 月 4 日
10.	泰康资产管理有限责任公司关于终止大泰金石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	2020 年 11 月 4 日
11.	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 11 月 19 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腾安基金销售（深圳）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	2020 年 12 月 9 日
13.	泰康资产管理有限责任公司关于终止深圳盈信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	2020 年 12 月 23 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参加交通银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 29 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参加中国工商银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 12 月 29 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西部证券股份有限公司为销售机构的公告	《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	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 3 月 31 日