# 泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金
# 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 2**

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

**§2 基金简介 6**

2.1 基金基本情况 6

2.2 基金产品说明 6

2.3 基金管理人和基金托管人 7

2.4 信息披露方式 7

2.5 其他相关资料 7

**§3 主要财务指标和基金净值表现 8**

3.1 主要会计数据和财务指标 8

3.2 基金净值表现 8

**§4 管理人报告 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遵规守信情况的说明 14

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15

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 15

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17

**§5 托管人报告 18**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18

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 18

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 18

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） 19**

6.1 资产负债表 19

6.2 利润表 20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 21

6.4 报表附注 22

**§7 投资组合报告.....45**

7.1 期末基金资产组合情况.....45

7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....45

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.....46

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....47

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....49

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.....49

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.....49

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.....49

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.....50

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....50

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....50

7.12 投资组合报告附注.....50

**§8 基金份额持有人信息.....52**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....52

8.3 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.....52

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....53

**§9 开放式基金份额变动.....54**

**§10 重大事件揭示.....55**

10.1 基金份额持有人大会决议.....55

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.....55

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....55

10.4 基金投资策略的改变.....55

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....55

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.....55

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....55

10.8 其他重大事件.....57

**§11 影响投资者决策的其他重要信息.....62**

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.....62

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 62

**§12 备查文件目录 ..... 63**

12.1 备查文件目录 ..... 63

12.2 存放地点 ..... 63

12.3 查阅方式 ..... 63

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泰康港股通 TMT 指数 | |
| 基金主代码 | 006930 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 4 月 3 日 | |
| 基金管理人 | 泰康资产管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 27,041,745.72 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称： | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C |
| 下属分级基金的交易代码： | 006930 | 006931 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,710,747.95 份 | 8,330,997.77 份 |

## 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的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数 中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。<br>股票投资方面，本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。本基金还将根据标的指数成份股及其权重的变动，根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其投资组合进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。<br>本基金将定期、不定期对投资组合进行绩效评定，以衡量指数化投资过程中投资组合的跟踪表现，并通过控制跟踪误差来进行风险管理。<br>债券投资方面，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，投资于债券资产。信用策略中，本基金将重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司 治理、财务质量、融资目的等要素，综合评价并定期更新信用债券的信用等级；同时，结合宏观经济分析，合理预测信用利差曲线的变动趋势，确定信用债券的 配置比例。可转换债券投资策略中，本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证 券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值 工具评定其投资价值，以合理价格买入。中小企业私募债的投资策略中，本基金主要基于信用品种投资，在此基础上 重点分析信用风险及流动性风险。 |
| 业绩比较基准 | 中证港股通 TMT 主题指数收益率（使用估值汇率折算）*95%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

| | |
|---|---|
| | 本基金主要投资香港证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

## 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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈玮光 | 郭明 |
| | 联系电话 | 010-58753683 | （010）66105798 |
| | 电子邮箱 | chenwg06@taikangamc.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4001895522 | 95588 |
| 传真 | | 010-57818785 | （010）66105799 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 100033 | 100140 |
| 法定代表人 | | 段国圣 | 陈四清 |

## 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 | 泰康资产管理有限责任公司 | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层 |

# §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

| 基金级别 | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日) | 报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 1,188,736.22 | 499,954.18 |
| 本期利润 | 2,405,023.42 | 1,477,509.16 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1041 | 0.1505 |
| 本期加权平均净值利润率 | 9.54% | 13.92% |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.82% | 11.61% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 ) | |
| 期末可供分配利润 | 1,704,972.34 | 679,195.17 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0911 | 0.0815 |
| 期末基金资产净值 | 21,038,945.87 | 9,283,996.40 |
| 期末基金份额净值 | 1.1244 | 1.1144 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 ) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 12.44% | 11.44% |

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）本基金所述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

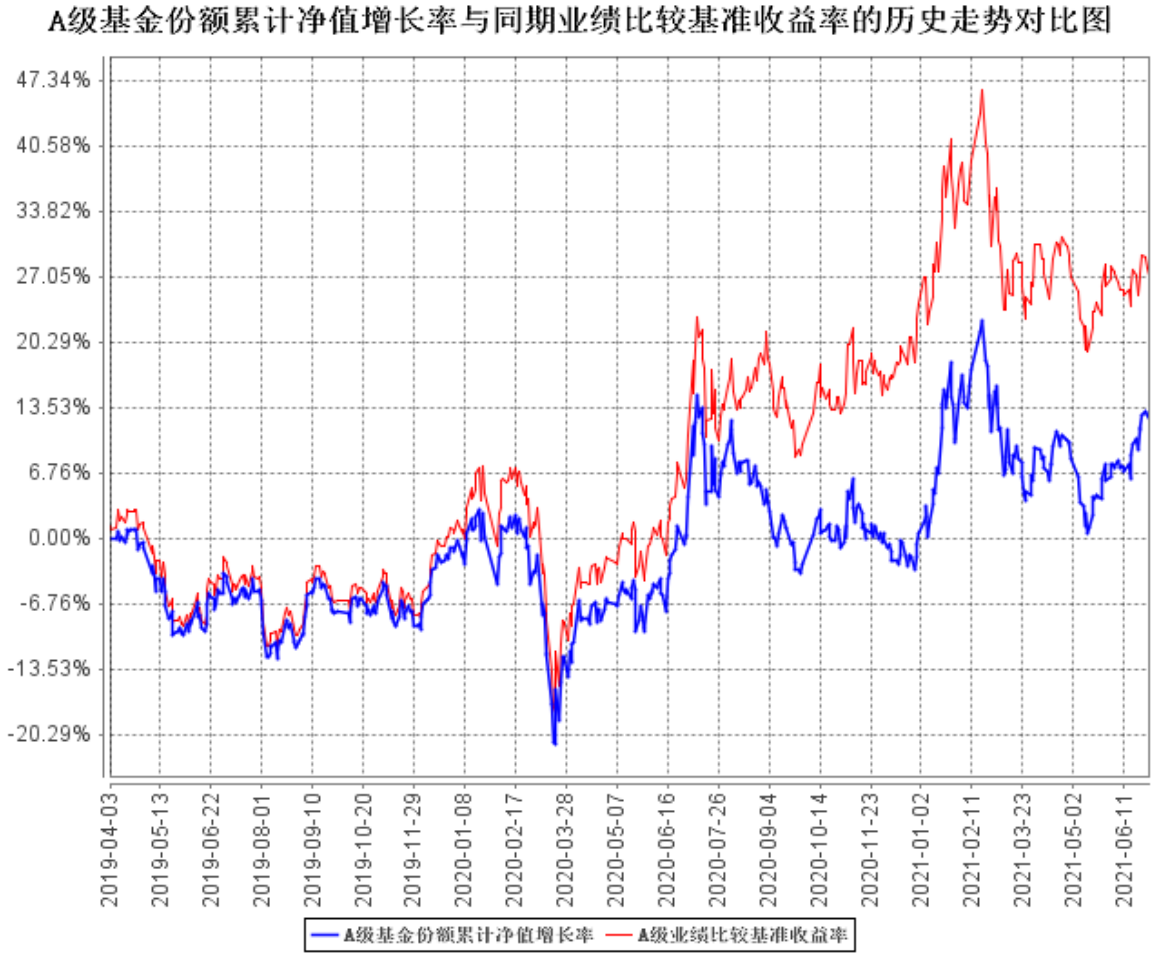
泰康港股通 TMT 指数 A

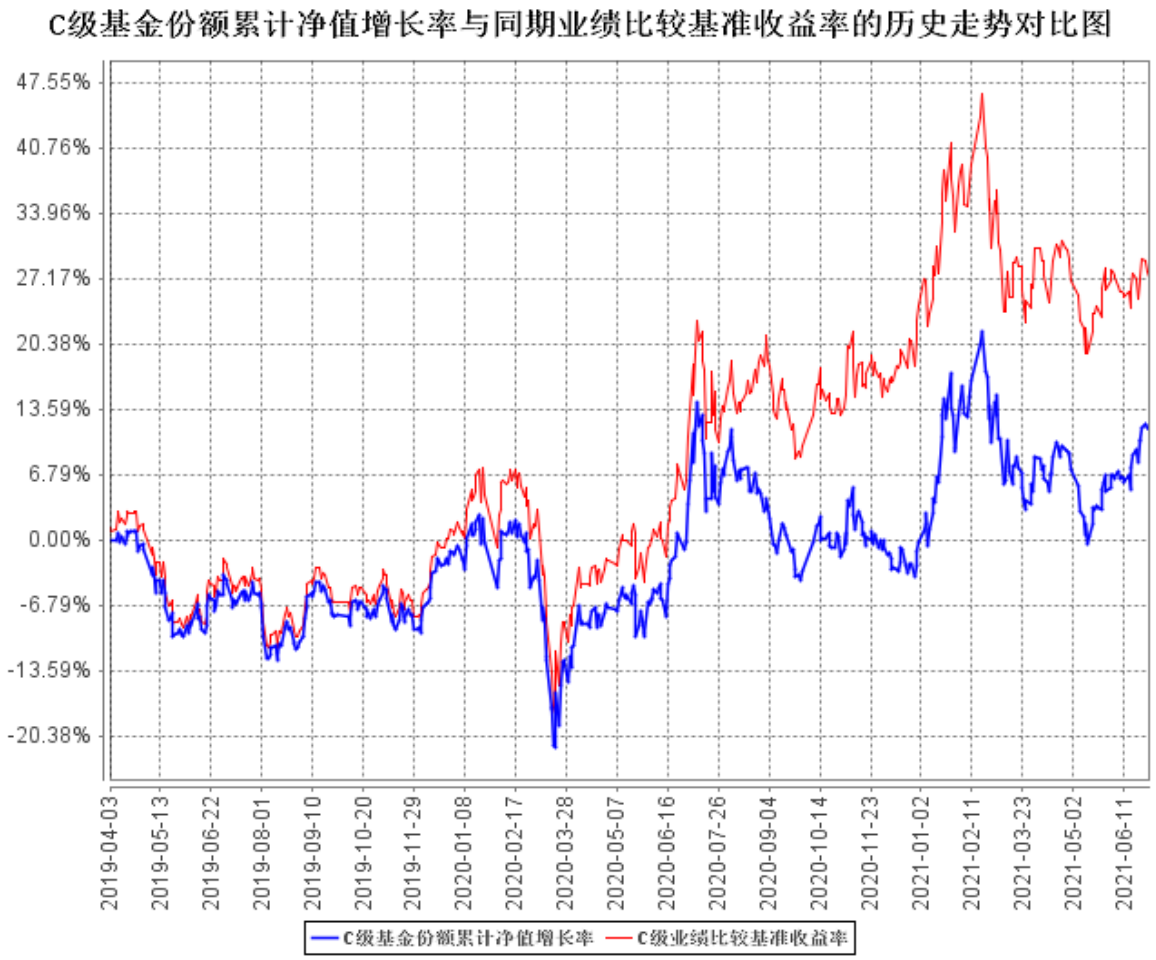
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 5.71% | 0.92% | 0.28% | 0.91% | 5.43% | 0.01% |
| 过去三个月 | 6.09% | 1.11% | 0.89% | 1.18% | 5.20% | -0.07% |
| 过去六个月 | 11.82% | 1.67% | 2.43% | 1.77% | 9.39% | -0.10% |
| 过去一年 | 12.04% | 1.63% | 19.93% | 1.75% | -7.89% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.44% | 1.53% | 27.26% | 1.61% | -14.82% | -0.08% |

泰康港股通 TMT 指数 C

| 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 | 5.67% | 0.92% | 0.28% | 0.91% | 5.39% | 0.01% |
| 过去三个月 | 5.98% | 1.11% | 0.89% | 1.18% | 5.09% | -0.07% |
| 过去六个月 | 11.61% | 1.66% | 2.43% | 1.77% | 9.18% | -0.11% |
| 过去一年 | 11.59% | 1.63% | 19.93% | 1.75% | -8.34% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.44% | 1.53% | 27.26% | 1.61% | -15.82% | -0.08% |

### 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






注：1、本基金基金合同于 2019 年 04 月 03 日生效。

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

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 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 2021 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交

易型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金、泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金、泰康创新成长混合型证券投资基金、泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势企业混合型证券投资基金、泰康品质生活混合型证券投资基金、泰康合润混合型证券投资基金、泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、泰康浩泽混合型证券投资基金、泰康安泽中短债债券型证券投资基金、泰康福泽积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）共 56 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 | | |
| 刘伟 | 本基金基金经理 | 2019 年 4 月 3 日 | - | 10 | 刘伟于 2011 年 6 月加入泰康资产，历任风险控制部风险管理研究员、高级经理，公募事业部投资部金融工程研究员、基金经理助理。现任公募事业部投资部量化投资总监。2017 年 5 月 4 日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 29 日至今担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2018 年 2 月 6 日至今担任泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金基金经理。2018 年 12 月 21 日至今担任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基金经理。2019 年 1 月 29 日至今担任泰康中证港股通地产指数型发起式 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 3 日至今担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 9 日至今担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 16 日至今担任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基金经理。 |
| 黄成扬 | 本基金基金经理 | 2019 年 4 月 3 日 | 2021 年 4 月 12 日 | 14 | 黄成扬于 2017 年 7 月加入泰康资产管理有限责任公司，现担任公募事业部投资部股票投资总监。2007 年 7 月至 2008 年 12 月在金捷基金担任研究部研究员，2009 年 1 月至 2012 年 2 月在恒星资产管理公司担任研究部研究员，2012 年 2 月至 2017 年 7 月在长盛基金国际业务部历任高级研究员、专户投资经理、基金经理。2015 年 7 月 21 日至 2017 年 7 月 14 日担任长盛环球景气行业大盘精选证券投资基金基金经理。2017 年 11 月 21 日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 12 月 21 日至 2021 年 4 月 12 日担任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基金经理。2019 年 1 月 29 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 3 日至 2021 年 4 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 月 12 日担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 9 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 16 日至 2021 年 4 月 12 日担任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基金经理。 |
| 何典鸿 | 本基金基金经理助理 | 2020 年 5 月 13 日 | - | 6 | 何典鸿于 2017 年 9 月加入泰康资产，现任公募事业部投资部量化投资高级经理。2015 年至 2017 年在嘉实基金管理有限公司指数投资部担任研究员。2020 年 5 月 13 日至 2021 年 8 月 27 日担任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基金经理助理。 |

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

2、基金管理人已于 2021 年 8 月 27 日发布公司令，何典鸿先生自 2021 年 8 月 27 日起不再担任本基金基金经理助理。

## 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 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2021 年上半年经济延续复苏的格局，并呈现出稳中加固的态势。1 季度，各项经济数据在低基数的影响下表现较强，如果与 19 年相比，则出口延续了高景气度，房地产投资韧性较强，消费在冬季疫情的影响下有一定波折，3 月的 PMI 数据显示制造业或有所好转，货币政策保持相对稳定，实体经济的融资需求延续强劲，大宗商品价格在国际疫情恢复、全球复苏预期的带动下有较为明显的上行，通胀预期发酵，PPI 上行较快，CPI 保持稳定，人民币受到美元阶段性走强的影响，从升值转为震荡。2 季度，各项经济指标同比数据，由于基数效应而有所下滑，如果同 2019 年相比，则呈现出较为平稳的走势。经济内部延续了结构分化的特征，出口延续了较高景气，但零售的恢复力度仍然偏弱。投资内部也有所分化，制造业处于缓慢恢复中，上游价格带来的利润挤压仍需关注；地产的韧性较强，但基建由于政府投资意愿偏弱，而表现较为一般。在供给约束下，PPI 表现很强，但 CPI 由于需求偏平稳，向上的压力不大。融资需求受到表外多重因素的制约，增速有所走低。

港股在今年年初表现亮眼、农历年后大跌至 3 月底以后，呈盘整和波动加大的态势。恒生指数 6 月底第二大权重行业为资讯科技业（恒生行业分类），占比超 27%。拖累恒指的有金融和互联网。此外，市场还受港府调高股票印花税、美债息上升、担忧美股回调等负面因素压制。今年整体市场核心矛盾从估值转为盈利，盈利增长较快、估值水平较匹配、长期空间较大的股票有望在业绩期获得较好的表现。

投资操作方面，基金本期秉承被动化投资理念，力争紧密跟踪基准指数表现，并做好对指数成分调整、申赎和流动性头寸的应对，将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内指数波动大，期末录得低个位数正收益，个别成分股有较大跌幅。指数历经 2 月下旬以来的调整，估值处较低水平。报告期内基金维持高仓位紧密跟踪，因法律法规要求使得个别成分股投资受限，报告期内跟踪误差有所放大。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康港股通 TMT 指数 A 基金份额净值为 1.1244 元,本报告期基金份额净值增长率为 11.82%；截至本报告期末泰康港股通 TMT 指数 C 基金份额净值为 1.1144 元,本报告期基金份额净值增长率为 11.61%；同期业绩比较基准增长率为 2.43%。

## 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，经济可能保持相对平稳的格局，总量上变化不会很大，结构上的特点更为突出。总量方面，建筑业可能面临一定的下行压力，但总体可控，有望在政策逆周期调节、以及结构性宽松的支持下所对冲，总体波动不大。结构方面，制造业成本的压制难以消退，消费和服务业面临疫情的负面影响也很难消除，可能都会呈现出在波折中缓慢恢复的局面。政策方面的结构性特征将更为显著，对地产和平台的结构性紧信用持续，但对制造业、小微企业、绿色金融等相关的宽信用加大，货币政策也致力于缓解经济的结构性问题，总体基调是在稳健中注重结构性，保持流动性合理充裕。

展望后市，国内超预期全面降准营造了温和的流动性环境，叠加美就业恢复偏慢加大了联储对通胀继续上行的容忍度，整体利好成长，而前期成长回调明显。互联网方面整体偏负面，反垄断、信安、金融牌照都处于问题揭露与纠偏的阶段，这使得港股互联网板块难以在年内出现趋势行情。互联网板块的机会少不代表港股投资机会的消失，在消费、工业、科技等其他领域将接连涌现结构性投资机遇。后市具有较高景气度的行业、新潮新消费等，预计将获得资金持续青睐。另外，从中长期角度，香港市场不断壮大的新经济格局将持续提升其对国内外资金的长期吸引力，如果市场回调到具有配置价值时仍有结构化的投资机会。

在此背景下，我们将紧密跟踪经济和市场变化，精细化投资管理，控制跟踪误差。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

# §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

本报告期内，本基金托管人在对泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金的管理人——泰康资产管理有限责任公司在泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对泰康资产管理有限责任公司编制和披露的泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §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：泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日： 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,956,081.43 | 3,591,796.85 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 7,400.34 | 106,026.64 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 28,615,345.22 | 28,745,550.12 |
| 其中：股票投资 | | 28,615,345.22 | 28,745,550.12 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 298,068.06 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 397.80 | 263.88 |
| 应收股利 | | 29,047.79 | 34,848.72 |
| 应收申购款 | | 52,828.40 | 58,031.41 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 30,959,169.04 | 32,536,517.62 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2021 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 1,057,234.01 |
| 应付赎回款 | | 565,715.40 | 513,233.78 |
| 应付管理人报酬 | | 13,609.93 | 12,154.52 |
| 应付托管费 | | 2,721.98 | 2,430.91 |
| 应付销售服务费 | | 3,165.48 | 3,799.12 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 3,611.50 | 3,604.56 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 47,402.48 | 40,178.04 |
| 负债合计 | | 636,226.77 | 1,632,634.94 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 27,041,745.72 | 30,826,207.85 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 3,281,196.55 | 77,674.83 |
| 所有者权益合计 | | 30,322,942.27 | 30,903,882.68 |
| 负债和所有者权益总计 | | 30,959,169.04 | 32,536,517.62 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，泰康港股通 TMT 指数 A 基金份额净值 1.1244 元，基金份额总额 18,710,747.95 份；泰康港股通 TMT 指数 C 基金份额净值 1.1144 元，基金份额总额 8,330,997.77 份。泰康港股通 TMT 指数份额总额合计为 27,041,745.72 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | 4,134,238.50 | 1,257,376.82 |
| 1.利息收入 | | 5,347.67 | 23,621.32 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 5,347.67 | 4,677.77 |
| 债券利息收入 | | - | 18,943.55 |
| 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） | | 1,926,130.16 | 544,709.34 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 1,657,526.36 | 180,091.76 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | -10,216.43 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 268,603.80 | 374,834.01 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,193,842.18 | 678,965.92 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 列） | | | |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 8,918.49 | 10,080.24 |
| **减：二、费用** | | 251,705.92 | 255,772.34 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 88,917.09 | 89,031.88 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 17,783.40 | 17,806.36 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 21,045.16 | 36,570.40 |
| 4．交易费用 | 6.4.7.19 | 65,342.75 | 50,884.10 |
| 5．利息支出 | | - | 318.18 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | 318.18 |
| 6．税金及附加 | | - | - |
| 7．其他费用 | 6.4.7.20 | 58,617.52 | 61,161.42 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 3,882,532.58 | 1,001,604.48 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 3,882,532.58 | 1,001,604.48 |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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） | 30,826,207.85 | 77,674.83 | 30,903,882.68 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,882,532.58 | 3,882,532.58 |
| 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） | -3,784,462.13 | -679,010.86 | -4,463,472.99 |
| 其中：1.基金申购款 | 25,800,235.80 | 1,946,341.92 | 27,746,577.72 |
| 2.基金赎回款 | -29,584,697.93 | -2,625,352.78 | -32,210,050.71 |
| 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） | 27,041,745.72 | 3,281,196.55 | 30,322,942.27 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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） | 42,638,871.59 | -634,259.79 | 42,004,611.80 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,001,604.48 | 1,001,604.48 |
| 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） | -6,205,260.54 | -322,053.79 | -6,527,314.33 |
| 其中：1.基金申购款 | 22,545,315.04 | -1,561,035.64 | 20,984,279.40 |
| 2.基金赎回款 | -28,750,575.58 | 1,238,981.85 | -27,511,593.73 |
| 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） | 36,433,611.05 | 45,290.90 | 36,478,901.95 |

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：

| 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 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金(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[2019]51 号《关于准予泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式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《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金合同》

负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 35,583,982.33 元，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 1900219 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 4 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 35,587,536.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,553.75 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式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成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括港股通标的股票，并包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券资产（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、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、中小企业私募债券、非金融企业债务融资工具等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证港股通 TMT 主题指数收益率（使用估值汇率折算）*95%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 1,956,081.43 |
| 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： | 1,956,081.43 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 25,781,035.63 | 28,615,345.22 | 2,834,309.59 |
| 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 | | 25,781,035.63 | 28,615,345.22 | 2,834,309.59 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 195.46 |
| 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 | 202.34 |
| 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 | - |
| 合计 | 397.80 |

### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,611.50 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 3,611.50 |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 153.74 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 37,248.74 |
| 指数使用费 | 10,000.00 |
| 合计 | 47,402.48 |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 泰康港股通 TMT 指数 A | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |

| | | |
|---|---|---|
| 上年度末 | 17,842,774.00 | 17,842,774.00 |
| 本期申购 | 14,606,432.83 | 14,606,432.83 |
| 本期赎回(以"-"号填列) | -13,738,458.88 | -13,738,458.88 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以"-"号填列) | - | - |
| 本期末 | 18,710,747.95 | 18,710,747.95 |

金额单位：人民币元

| 泰康港股通 TMT 指数 C | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 12,983,433.85 | 12,983,433.85 |
| 本期申购 | 11,193,802.97 | 11,193,802.97 |
| 本期赎回(以"-"号填列) | -15,846,239.05 | -15,846,239.05 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以"-"号填列) | - | - |
| 本期末 | 8,330,997.77 | 8,330,997.77 |

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 泰康港股通 TMT 指数 A | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 666,155.95 | -568,582.04 | 97,573.91 |
| 本期利润 | 1,188,736.22 | 1,216,287.20 | 2,405,023.42 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -149,919.83 | -24,479.58 | -174,399.41 |
| 其中：基金申购款 | 687,607.70 | 403,304.03 | 1,090,911.73 |
| 基金赎回款 | -837,527.53 | -427,783.61 | -1,265,311.14 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,704,972.34 | 623,225.58 | 2,328,197.92 |

单位：人民币元

| 泰康港股通 TMT 指数 C | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 393,630.55 | -413,529.63 | -19,899.08 |
| 本期利润 | 499,954.18 | 977,554.98 | 1,477,509.16 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -214,389.56 | -290,221.89 | -504,611.45 |
| 其中：基金申购款 | 473,890.02 | 381,540.17 | 855,430.19 |
| 基金赎回款 | -688,279.58 | -671,762.06 | -1,360,041.64 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 679,195.17 | 273,803.46 | 952,998.63 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 4,456.43 |
| 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 | 549.27 |
| 其他 | 341.97 |
| 合计 | 5,347.67 |

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 22,098,909.09 |
| 减：卖出股票成本总额 | 20,441,382.73 |
| 买卖股票差价收入 | 1,657,526.36 |

### 6.4.7.13 债券投资收益

本报告期，本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本报告期，本基金无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 268,603.80 |
| 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 | 268,603.80 |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 2,193,842.18 |
| ——股票投资 | 2,193,842.18 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 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 | 2,193,842.18 |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 8,885.17 |
| 基金转换费收入 | 33.32 |
| 合计 | 8,918.49 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 65,342.75 |
| 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 | 65,342.75 |

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 22,372.35 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数使用费 | 20,000.00 |
| 银行费用 | 1,368.78 |
| 其他 | - |
| 合计 | 58,617.52 |

## 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

本报告期内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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |

| | |
|---|---|
| 泰康保险集团股份有限公司 | 基金管理人控股股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 88,917.09 | 89,031.88 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 24,249.81 | 32,350.19 |

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 0.50%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×0.50% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 17,783.40 | 17,806.36 |

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

| | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C | 合计 |
|---|---|---|---|
| 泰康资产管理有限责任公司 | - | 5,560.76 | 5,560.76 |
| 工商银行 | - | 1,494.22 | 1,494.22 |
| 合计 | - | 7,054.98 | 7,054.98 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C | 合计 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | - | 19,583.51 | 19,583.51 |
| 工商银行 | - | 8,195.53 | 8,195.53 |
| 合计 | - | 27,779.04 | 27,779.04 |

注：本基金 A 类基金份额不计提销售服务费，C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费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，按月支付给泰康资产管理有限责任公司，再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费＝C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/ 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C |
| 基金合同生效日（ 2019 年 4 月 3 日 ）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 52.9134% | 1.2004% |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C |
| 基金合同生效日（ 2019 年 4 月 3 日 ）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 9,900,495.05 | 100,005.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 52.7303% | 0.5663% |

注：1.期间申购/买入总份额含红利再投、转换入及自动升降级调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出及自动升降级调减份额；

2.基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付；

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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 |
| 工商银行 | 1,956,081.43 | 4,456.43 | 2,487,234.27 | 3,959.19 |

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具包括港股通标的股票、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、外汇风险、香港市场风险等。

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，制订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行中国工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。

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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

### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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

### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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

### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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

等。

### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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

### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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

### 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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权

益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 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 2021 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 2021 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<br>2021 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 | 1,956,081.43 | - | - | - | 1,956,081.43 |
| 存出保证金 | - | - | - | 7,400.34 | 7,400.34 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 28,615,345.22 | 28,615,345.22 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 298,068.06 | 298,068.06 |
| 应收利息 | - | - | - | 397.80 | 397.80 |
| 应收股利 | - | - | - | 29,047.79 | 29,047.79 |
| 应收申购款 | 800.00 | - | - | 52,028.40 | 52,828.40 |
| 资产总计 | 1,956,881.43 | - | - | 29,002,287.61 | 30,959,169.04 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 565,715.40 | 565,715.40 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 13,609.93 | 13,609.93 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,721.98 | 2,721.98 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 3,165.48 | 3,165.48 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 3,611.50 | 3,611.50 |
| 其他负债 | - | - | - | 47,402.48 | 47,402.48 |
| 负债总计 | - | - | - | 636,226.77 | 636,226.77 |
| 利率敏感度缺口 | 1,956,881.43 | - | - | 28,366,060.84 | 30,322,942.27 |
| 上年度末 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以 | 不计息 | 合计 |

| 2020 年 12 月 31 日 | | | 上 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 3,591,796.85 | - | - | - | 3,591,796.85 |
| 存出保证金 | 106,026.64 | - | - | - | 106,026.64 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 28,745,550.12 | 28,745,550.12 |
| 应收利息 | - | - | - | 263.88 | 263.88 |
| 应收股利 | - | - | - | 34,848.72 | 34,848.72 |
| 应收申购款 | 15,100.00 | - | - | 42,931.41 | 58,031.41 |
| 资产总计 | 3,712,923.49 | - | - | 28,823,594.13 | 32,536,517.62 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,057,234.01 | 1,057,234.01 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 513,233.78 | 513,233.78 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 12,154.52 | 12,154.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,430.91 | 2,430.91 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 3,799.12 | 3,799.12 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 3,604.56 | 3,604.56 |
| 其他负债 | - | - | - | 40,178.04 | 40,178.04 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,632,634.94 | 1,632,634.94 |
| 利率敏感度缺口 | 3,712,923.49 | - | - | 27,190,959.19 | 30,903,882.68 |

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（ 2021 年 6 月 30 日 ） | 上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ） |
| | 市场利率下调 0.25% | 0.00 | 0.00 |
| | 市场利率上调 0.25% | 0.00 | 0.00 |

### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 28,615,345.22 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 28,615,345.22 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 28,745,550.12 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风

险敞口净额 28,745,550.12 元）。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 286,153.45 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-286,153.45 元（于 2020 年 12 月 31 日，若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 287,455.50 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-287,455.50 元）。

### 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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或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<br>2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |

| | | （%） | | |
|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产-股票投资 | 28,615,345.22 | 94.37 | 28,745,550.12 | 93.02 |
| 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 | 28,615,345.22 | 94.37 | 28,745,550.12 | 93.02 |

### 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 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（ 2021 年 6 月 30 日 ） | 上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ） |
| | 业绩比较基准中的权益指数上涨 5% | 1,773,358.58 | 1,437,277.51 |
| | 业绩比较基准中的权益指数下降 5% | -1,773,358.58 | -1,437,277.51 |

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 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 28,615,345.22 元，无属于第二层级和第三层次的余额（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 28,745,550.12 元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

(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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，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 | 28,615,345.22 | 92.43 |
| | 其中：股票 | 28,615,345.22 | 92.43 |
| 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 | 1,956,081.43 | 6.32 |
| 8 | 其他各项资产 | 387,742.39 | 1.25 |
| 9 | 合计 | 30,959,169.04 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 28,615,345.22 元，占期末资产净值比例为 94.37%。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数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指数投资境内股票。

### 7.2.2 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

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 143,553.77 | 0.47 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | 146,329.59 | 0.48 |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | 14,238,045.40 | 46.95 |

| | | |
|---|---|---|
| I 电信服务 | 14,087,416.46 | 46.46 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 28,615,345.22 | 94.37 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 00700 | 腾讯控股 | 11,500 | 5,588,249.28 | 18.43 |
| 2 | 02382 | 舜宇光学科技 | 19,800 | 4,043,010.15 | 13.33 |
| 3 | 00941 | 中国移动 | 85,500 | 3,453,984.88 | 11.39 |
| 4 | 02018 | 瑞声科技 | 48,000 | 2,320,504.70 | 7.65 |
| 5 | 00552 | 中国通信服务 | 602,000 | 1,943,539.18 | 6.41 |
| 6 | 00981 | 中芯国际 | 66,500 | 1,322,466.35 | 4.36 |
| 7 | 00268 | 金蝶国际 | 48,000 | 1,052,414.78 | 3.47 |
| 8 | 00992 | 联想集团 | 100,000 | 743,047.44 | 2.45 |
| 9 | 00788 | 中国铁塔 | 648,000 | 576,930.99 | 1.90 |
| 10 | 03888 | 金山软件 | 14,400 | 557,759.87 | 1.84 |
| 11 | 00772 | 阅文集团 | 7,200 | 517,320.78 | 1.71 |
| 12 | 00909 | 明源云 | 16,000 | 513,226.94 | 1.69 |
| 13 | 02013 | 微盟集团 | 34,000 | 484,337.13 | 1.60 |
| 14 | 00728 | 中国电信 | 192,000 | 464,899.74 | 1.53 |
| 15 | 00285 | 比亚迪电子 | 9,500 | 403,142.76 | 1.33 |
| 16 | 00522 | ASM PACIFIC | 4,600 | 402,660.15 | 1.33 |
| 17 | 00148 | 建滔集团 | 11,000 | 394,489.13 | 1.30 |
| 18 | 01347 | 华虹半导体 | 11,000 | 392,658.55 | 1.29 |
| 19 | 00354 | 中国软件国际 | 32,000 | 377,032.09 | 1.24 |
| 20 | 00762 | 中国联通 | 84,000 | 296,353.61 | 0.98 |
| 21 | 00008 | 电讯盈科 | 64,000 | 216,740.20 | 0.71 |
| 22 | 00763 | 中兴通讯 | 10,400 | 209,850.58 | 0.69 |
| 23 | 01888 | 建滔积层板 | 13,000 | 188,432.84 | 0.62 |
| 24 | 02400 | 心动公司 | 3,200 | 182,391.94 | 0.60 |
| 25 | 00696 | 中国民航信息网络 | 12,000 | 167,347.93 | 0.55 |
| 26 | 00303 | VTECH HOLDINGS | 2,400 | 163,254.10 | 0.54 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 27 | 01060 | 阿里影业 | 180,000 | 161,756.35 | 0.53 |
| 28 | 09923 | 移卡 | 3,600 | 146,329.59 | 0.48 |
| 29 | 01310 | 香港宽频 | 18,000 | 140,787.94 | 0.46 |
| 30 | 01896 | 猫眼娱乐 | 9,400 | 95,579.37 | 0.32 |
| 31 | 00799 | IGG | 11,000 | 93,908.55 | 0.31 |
| 32 | 00777 | 网龙 | 5,000 | 86,120.28 | 0.28 |
| 33 | 01675 | 亚信科技 | 7,600 | 83,474.27 | 0.28 |
| 34 | 01478 | 丘钛科技 | 6,000 | 79,480.28 | 0.26 |
| 35 | 03969 | 中国通号 | 27,000 | 64,477.88 | 0.21 |
| 36 | 00136 | 恒腾网络 | 12,400 | 64,073.49 | 0.21 |
| 37 | 01686 | 新意网集团 | 9,000 | 59,535.32 | 0.20 |
| 38 | 06988 | 乐享互动 | 21,000 | 55,391.57 | 0.18 |
| 39 | 01883 | 中信国际电讯 | 25,000 | 53,461.14 | 0.18 |
| 40 | 00856 | 伟仕佳杰 | 10,000 | 52,171.42 | 0.17 |
| 41 | 01860 | 汇量科技 | 6,000 | 49,924.80 | 0.16 |
| 42 | 06088 | FIT HON TENG | 28,000 | 49,625.25 | 0.16 |
| 43 | 09990 | 祖龙娱乐 | 4,000 | 49,392.27 | 0.16 |
| 44 | 00861 | 神州控股 | 11,000 | 46,954.27 | 0.15 |
| 45 | 02038 | 富智康集团 | 44,000 | 46,862.75 | 0.15 |
| 46 | 01357 | 美图公司 | 30,000 | 43,933.82 | 0.14 |
| 47 | 02342 | 京信通信 | 26,000 | 43,917.18 | 0.14 |
| 48 | 01981 | 华夏视听教育 | 9,000 | 40,439.09 | 0.13 |
| 49 | 00302 | 中手游 | 10,000 | 31,702.25 | 0.10 |

注：1.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。

2.根据香港法律法规要求，本基金对标的指数个别成分股的投资受到一定限制。

### 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 | 00700 | 腾讯控股 | 3,386,339.00 | 10.96 |
| 2 | 02382 | 舜宇光学科技 | 2,486,747.54 | 8.05 |
| 3 | 00552 | 中国通信服务 | 2,026,595.12 | 6.56 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 4 | 00941 | 中国移动 | 1,896,491.63 | 6.14 |
| 5 | 02018 | 瑞声科技 | 1,704,760.53 | 5.52 |
| 6 | 00981 | 中芯国际 | 788,999.60 | 2.55 |
| 7 | 00268 | 金蝶国际 | 735,251.05 | 2.38 |
| 8 | 00992 | 联想集团 | 462,994.77 | 1.50 |
| 9 | 00909 | 明源云 | 411,693.90 | 1.33 |
| 10 | 02013 | 微盟集团 | 365,691.11 | 1.18 |
| 11 | 00788 | 中国铁塔 | 338,635.15 | 1.10 |
| 12 | 03888 | 金山软件 | 320,794.99 | 1.04 |
| 13 | 01347 | 华虹半导体 | 219,910.83 | 0.71 |
| 14 | 00522 | ASM PACIFIC | 217,615.80 | 0.70 |
| 15 | 00728 | 中国电信 | 204,537.11 | 0.66 |
| 16 | 00148 | 建滔集团 | 183,952.94 | 0.60 |
| 17 | 00762 | 中国联通 | 182,803.94 | 0.59 |
| 18 | 00772 | 阅文集团 | 182,257.95 | 0.59 |
| 19 | 00354 | 中国软件国际 | 163,029.41 | 0.53 |
| 20 | 00285 | 比亚迪电子 | 157,533.00 | 0.51 |

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。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 02382 | 舜宇光学科技 | 4,097,090.06 | 13.26 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 3,072,786.59 | 9.94 |
| 3 | 02018 | 瑞声科技 | 2,713,428.00 | 8.78 |
| 4 | 00552 | 中国通信服务 | 2,574,674.23 | 8.33 |
| 5 | 00941 | 中国移动 | 2,346,419.41 | 7.59 |
| 6 | 00981 | 中芯国际 | 678,517.07 | 2.20 |
| 7 | 00268 | 金蝶国际 | 632,445.97 | 2.05 |
| 8 | 00992 | 联想集团 | 581,199.87 | 1.88 |
| 9 | 00909 | 明源云 | 434,162.98 | 1.40 |
| 10 | 00788 | 中国铁塔 | 406,662.80 | 1.32 |
| 11 | 03888 | 金山软件 | 336,580.07 | 1.09 |
| 12 | 00772 | 阅文集团 | 291,912.96 | 0.94 |
| 13 | 02013 | 微盟集团 | 274,964.46 | 0.89 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 14 | 00522 | ASM PACIFIC | 270,392.93 | 0.87 |
| 15 | 00728 | 中国电信 | 265,469.33 | 0.86 |
| 16 | 01347 | 华虹半导体 | 258,166.14 | 0.84 |
| 17 | 00148 | 建滔集团 | 229,904.69 | 0.74 |
| 18 | 00285 | 比亚迪电子 | 220,801.51 | 0.71 |
| 19 | 00354 | 中国软件国际 | 217,814.31 | 0.70 |
| 20 | 00762 | 中国联通 | 203,455.83 | 0.66 |

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。

### 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 | 18,215,944.71 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 22,098,909.09 |

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。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

腾讯控股有限公司因构成未依法申报违法实施的经营者集中等原因在本报告编制前一年内受到国家市场监管总局的行政处罚。

基金投资该主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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 | 7,400.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | 298,068.06 |
| 3 | 应收股利 | 29,047.79 |
| 4 | 应收利息 | 397.80 |
| 5 | 应收申购款 | 52,828.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 387,742.39 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

# §8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 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 |
| 泰康港股通 TMT 指数 A | 2,539 | 7,369.34 | 9,900,495.05 | 52.91% | 8,810,252.90 | 47.09% |
| 泰康港股通 TMT 指数 C | 2,976 | 2,799.39 | 100,005.00 | 1.20% | 8,230,992.77 | 98.80% |
| 合计 | 5,223 | 5,177.44 | 10,000,500.05 | 36.98% | 17,041,245.67 | 63.02% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 泰康港股通 TMT 指数 A | 39,487.44 | 0.2110% |
| | 泰康港股通 TMT 指数 C | 6,331.83 | 0.0760% |
| | 合计 | 45,819.27 | 0.1694% |

## 8.3 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 | 份额级别 | 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 | 泰康港股通 TMT 指数 A | 0 |
| | 泰康港股通 TMT 指数 C | 0 |

| | | |
|---|---|---|
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰康港股通 TMT 指数 A | 0 |
| | 泰康港股通 TMT 指数 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,500.05 | 36.98 | 10,000,500.05 | 36.98 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,500.05 | 36.98 | 10,000,500.05 | 36.98 | - |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰康港股通 TMT 指数 A | 泰康港股通 TMT 指数 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2019 年 4 月 3 日）基金份额总额 | 17,497,495.25 | 18,090,040.83 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 17,842,774.00 | 12,983,433.85 |
| 本报告期基金总申购份额 | 14,606,432.83 | 11,193,802.97 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 13,738,458.88 | 15,846,239.05 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 18,710,747.95 | 8,330,997.77 |

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未出现重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”） 根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

## 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“投资策略”补充基金运作过程中，如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整情形的处理

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 兴业证券 | 2 | 33,114,276.71 | 82.34% | 9,933.60 | 82.34% | - |
| 东方证券 | 2 | 6,470,102.44 | 16.09% | 1,940.93 | 16.09% | - |
| 中金公司 | 2 | 631,865.59 | 1.57% | 189.56 | 1.57% | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 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 2 个交易单元，为中泰证券上海、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 |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年非港股通交易日不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 1 月 1 日 |
| 2 | 关于直销电子交易平台开展汇款交易;赎回转认购业务费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 1 月 21 日 |
| 3 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 4 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 5 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 1 月 29 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 6 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“春节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 2 月 5 日 |
| 7 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 2 月 8 日 |
| 8 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 3 月 2 日 |
| 9 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 3 月 12 日 |
| 10 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 3 月 16 日 |
| 11 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在珠海盈米基金销售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 3 月 19 日 |
| 12 | 泰康资产管理有限责任公司关于修订旗下指数基金法律文件的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 3 月 30 日 |
| 13 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券 | 2021 年 3 月 31 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | “香港耶稣受难节;清明节;香港复活节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 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 | |
| 14 | 泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理变更公告 | 《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 | 2021 年 4 月 14 日 |
| 15 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 4 月 26 日 |
| 16 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“劳动节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 4 月 27 日 |
| 17 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在济安财富（北京）基金销售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 18 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 5 月 10 日 |
| 19 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港佛诞日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 5 月 17 日 |
| 20 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 5 月 18 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 21 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金开通在北京植信基金销售有限公司定投及转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 5 月 21 日 |
| 22 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 8 日 |
| 23 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“端午节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 9 日 |
| 24 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 15 日 |
| 25 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中泰证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 17 日 |
| 26 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 18 日 |
| 27 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 28 日 |
| 28 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券 | 2021 年 6 月 29 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | “香港特别行政区成立纪念日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 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 | |
| 29 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 30 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 7 月 12 日 |
| 31 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》;中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021 年 7 月 15 日 |

# §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 | 20210101 - 20210630 | 10,000,500.05 | - | - | 10,000,500.05 | 36.98% |
| 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港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金注册的文件；

（二）《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金合同》；

（三）《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金招募说明书》；

（四）《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金托管协议》；

（五）《泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金产品资料概要》。

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日