

泰康沪深 300 交易型开放式指数 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：招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。

基金托管人招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 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 64 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 64 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 64 |
| 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..... | 66 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 75 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 77 |
| 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..... | 77 |
| 7.7 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..... | 77 |
| 7.8 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..... | 77 |
| 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..... | 78 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 78 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 78 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 78 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 81 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 81 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 81 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 82 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 82 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 83 |
| §10 重大事件揭示..... | 84 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 84 |
| 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..... | 84 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 84 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 84 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 84 |
| 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..... | 84 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 84 |
| 10.8 其他重大事件..... | 86 |

| | |
|--|-----------|
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 91 |
| 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 | 91 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 91 |
| §12 备查文件目录 | 92 |
| 12.1 备查文件目录..... | 92 |
| 12.2 存放地点..... | 92 |
| 12.3 查阅方式..... | 92 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称 | 泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 泰康 300 |
| 基金主代码 | 515380 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 27 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 | 946,899,814.00 份 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2020 年 3 月 23 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。</p> <p>本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。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> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率 |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,046,960,701.75 |
| 本期利润 | 197,718,644.27 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1979 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.68% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.22% |
| 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 | 1,209,718,734.60 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.2776 |
| 期末基金资产净值 | 5,096,880,292.38 |
| 期末基金份额净值 | 5.3827 |
| 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 | 31.12% |

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。

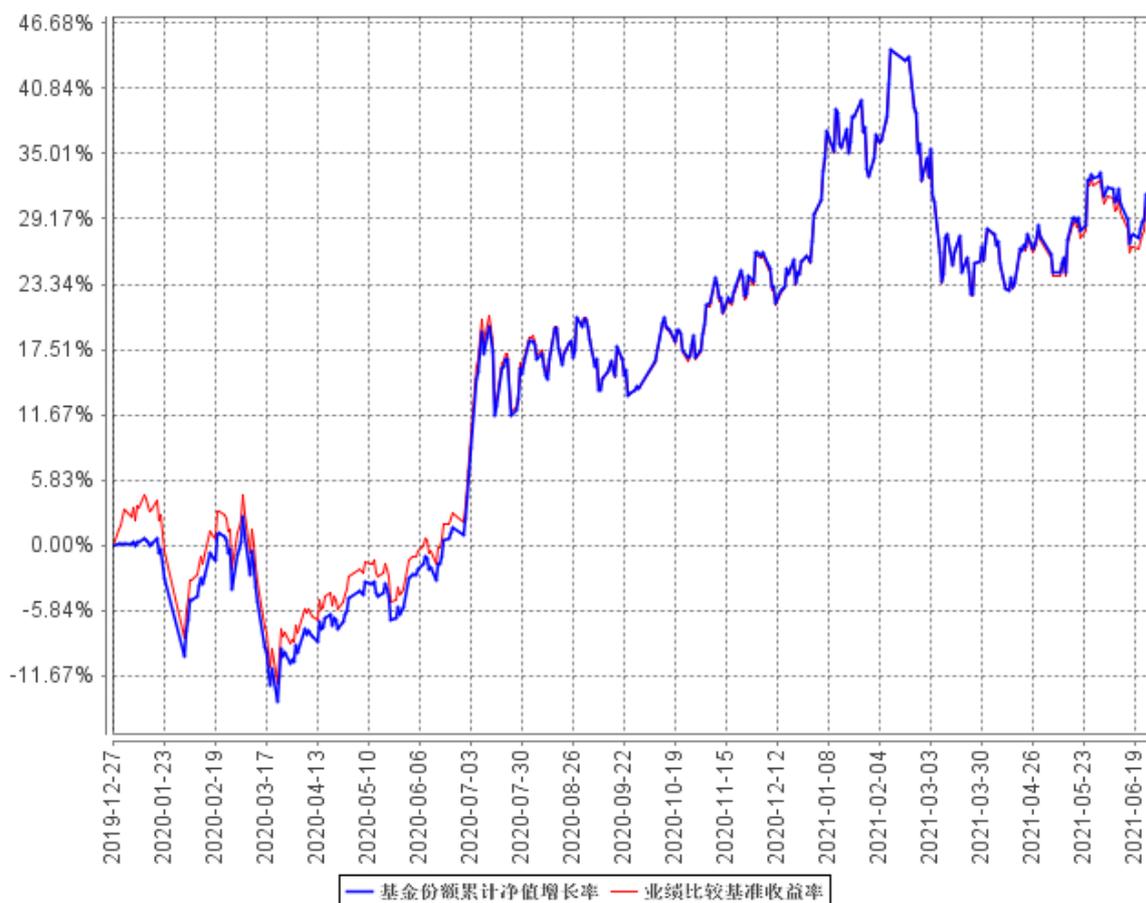
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -1.45% | 0.81% | -2.02% | 0.80% | 0.57% | 0.01% |
| 过去三个月 | 4.52% | 0.98% | 3.48% | 0.98% | 1.04% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.22% | 1.31% | 0.24% | 1.31% | 0.98% | 0.00% |
| 过去一年 | 28.18% | 1.33% | 25.46% | 1.33% | 2.72% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.12% | 1.37% | 29.76% | 1.39% | 1.36% | -0.02% |

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 2019 年 12 月 27 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 | | |
| 魏军 | 本基金基金经理 | 2019 年 12 月 27 日 | - | 13 | 魏军于 2019 年 5 月加入泰康资产，历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理。现任公募事业部量化投资总监。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 27 日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，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。

权益市场方面，春节之后受到美债利率大幅上行等因素的影响，风险偏好显著下降，股票市场经历了较大幅调整，部分优质成长股在经历了前期下跌之后已经到了可以获得合意回报的区间。进入 2 季度，市场对全年经济强复苏的预期有所降温，投资、消费和金融数据都指向需求边际走弱，大宗商品涨幅也在 2 季度放缓，风险偏好在本期显著回升。从大盘和板块上来看，上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，中小板指上涨 3.66%，创业板指上涨 17.22%。其中，基础化工、钢铁、电力设备及新能源等板块表现相对较好，国防军工、家电、非银行金融等行业表现不佳。

具体投资上，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内跟踪误差主要来自基金份额的申购和赎回。报告期内，沪深 300 指数呈先上行后下行、继而盘整震荡的走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康沪深 300ETF 基金份额净值为 5.3827 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.22%；同期业绩比较基准增长率为 0.24%。

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。

权益市场方面，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。下半场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，A 股结构牛行情还将延续。

管理人将继续紧跟市场，控制跟踪误差，通过精细化投资管理，力求为投资者带来更好的投资体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 35,028,603.09 | 28,544,831.79 |
| 结算备付金 | | 24,584,479.27 | 127,635,925.45 |
| 存出保证金 | | 8,428,874.07 | 21,116,276.26 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 5,034,539,948.35 | 7,066,598,647.45 |
| 其中：股票投资 | | 5,030,876,199.73 | 7,061,577,647.45 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,663,748.62 | 5,021,000.00 |
| 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 | | 1,377,926.40 | 2,841,675.76 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 216,221.58 | 307,940.37 |
| 应收股利 | | 576,329.90 | 110.00 |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 5,104,752,382.66 | 7,247,045,407.08 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 631,709.93 | 750,831.58 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,682,146.88 | 2,646,319.97 |
| 应付托管费 | | 210,268.36 | 330,790.01 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 570,188.99 | 774,964.12 |
| 应交税费 | | 70,892.14 | 386,033.78 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 4,706,883.98 | 5,225,113.73 |
| 负债合计 | | 7,872,090.28 | 10,114,053.19 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 3,887,161,557.78 | 5,586,691,815.36 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,209,718,734.60 | 1,650,239,538.53 |
| 所有者权益合计 | | 5,096,880,292.38 | 7,236,931,353.89 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,104,752,382.66 | 7,247,045,407.08 |

注：(1) 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.3827 元，基金份额总额 946,899,814.00 份。

(2) 股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.2 利润表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 216,411,739.04 | 206,488,638.35 |
| 1.利息收入 | | 6,034,013.25 | 11,388,602.07 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 688,027.10 | 554,740.17 |
| 债券利息收入 | | 1,868.35 | 1,781.49 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 9,716,245.73 |
| 证券出借利息收入 | | 5,344,117.80 | 1,103,448.41 |
| 其他利息收入 | | - | 12,386.27 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,052,644,108.34 | -3,463,986.81 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 1,003,336,062.09 | -92,692,261.51 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,635,448.44 | -678,770.62 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | 13,803,498.06 | 15,103,052.92 |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 33,869,099.75 | 74,803,992.40 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -849,242,057.48 | 198,310,985.34 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 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 | 6,975,674.93 | 253,037.75 |
| 减：二、费用 | | 18,693,094.77 | 21,512,803.40 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 10,677,044.39 | 13,847,442.67 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,334,630.58 | 1,730,930.33 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 5,672,561.05 | 4,702,169.34 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 68,935.51 | 64,997.47 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 939,923.24 | 1,167,263.59 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 197,718,644.27 | 184,975,834.95 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 197,718,644.27 | 184,975,834.95 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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） | 5,586,691,815.36 | 1,650,239,538.53 | 7,236,931,353.89 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 197,718,644.27 | 197,718,644.27 |
| 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） | -1,699,530,257.58 | -638,239,448.20 | -2,337,769,705.78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,502,510,183.17 | 1,089,125,798.61 | 4,591,635,981.78 |
| 2. 基金赎回款 | -5,202,040,440.75 | -1,727,365,246.81 | -6,929,405,687.56 |
| 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） | 3,887,161,557.78 | 1,209,718,734.60 | 5,096,880,292.38 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 7,160,604,619.00 | 4,080,249.67 | 7,164,684,868.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 184,975,834.95 | 184,975,834.95 |
| 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） | 229,067,121.79 | -19,642,217.37 | 209,424,904.42 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,477,852,398.07 | -104,794,687.61 | 1,373,057,710.46 |
| 2. 基金赎回款 | -1,248,785,276.28 | 85,152,470.24 | -1,163,632,806.04 |
| 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） | 7,389,671,740.79 | 169,413,867.25 | 7,559,085,608.04 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康沪深 300 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[2019]1824 号《关于准予泰康沪深 300 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《泰康沪深 300 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 7,158,504,619.00 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 1900636 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,160,604,619.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,100,000.00 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《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康沪深 300 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《关于泰康沪深 300 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 2 月 12 日为折算日，进行了基金份额折算，折算前基金份额总额为 7,160,604,619.00 份，折算后基金份额总额为 1,744,299,814.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]65 号核准，本基金 1,744,299,814.00 份基金份额于 2020 年 3 月 23 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《泰康沪深 300 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、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：沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司以本基金为目标 ETF，募集成立了泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“泰康沪深 300ETF 联接基金”)。泰康沪深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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。

(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 2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 35,028,603.09 |

| | |
|----------------|---------------|
| 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： | 35,028,603.09 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 4,678,126,842.31 | 5,030,876,199.73 | 352,749,357.42 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 3,663,748.62 | 91,048.62 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 3,663,748.62 | 91,048.62 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 4,681,699,542.31 | 5,034,539,948.35 | 352,840,406.04 |

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | | |
|--------|------------------------|------|----|----|
| | 合同/名义金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | |
| 货币衍生工具 | - | - | - | |
| 权益衍生工具 | 54,792,600.00 | - | - | |
| -股指期货 | 54,792,600.00 | - | - | |
| 其他衍生工具 | - | - | - | |
| 合计 | 54,792,600.00 | - | - | |

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 6 月 30 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 |
|------------|-------------------|-----------|---------------|--------------|
| IF2109 | 沪深300期货2109 合约 | 36 | 55,797,120.00 | 1,004,520.00 |
| 总额合计 | | | | 1,004,520.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | | | | 1,004,520.00 |
| 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。

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 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 6,862.16 |
| 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 | 12,590.24 |
| 应收债券利息 | 275.95 |
| 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 | 195,713.33 |
| 其他 | 779.90 |
| 合计 | 216,221.58 |

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 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 570,188.99 |

| | |
|-------------|------------|
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 570,188.99 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 133,891.13 |
| 指数使用费 | 374,468.87 |
| 可退替代款 | 700.74 |
| 应付替代款 | 4,197,823.24 |
| 合计 | 4,706,883.98 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,360,899,814.00 | 5,586,691,815.36 |
| 本期申购 | 853,200,000.00 | 3,502,510,183.17 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,267,200,000.00 | -5,202,040,440.75 |
| - 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 | 946,899,814.00 | 3,887,161,557.78 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| 上年度末 | 749,546,053.55 | 900,693,484.98 | 1,650,239,538.53 |
| 本期利润 | 1,046,960,701.75 | -849,242,057.48 | 197,718,644.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -339,662,051.22 | -298,577,396.98 | -638,239,448.20 |
| 其中：基金申购款 | 1,073,039,217.04 | 16,086,581.57 | 1,089,125,798.61 |
| 基金赎回款 | -1,412,701,268.26 | -314,663,978.55 | -1,727,365,246.81 |

| | | | |
|---------|------------------|-----------------|------------------|
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,456,844,704.08 | -247,125,969.48 | 1,209,718,734.60 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|----------------------|--|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | 121,488.76 | |
| 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 | 554,697.34 | |
| 其他 | 11,841.00 | |
| 合计 | 688,027.10 | |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------------|----------------------|--|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 541,823,327.01 | |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 461,512,735.08 | |
| 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 | 1,003,336,062.09 | |

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------|----------------------|--|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 卖出股票成交总额 | 3,462,934,460.94 | |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,921,111,133.93 | |
| 买卖股票差价收入 | 541,823,327.01 | |

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-------------|----------------------|--|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 赎回基金份额对价总额 | 6,929,405,687.56 | |
| 减：现金支付赎回款总额 | 2,903,770,526.56 | |
| 减：赎回股票成本总额 | 3,564,122,425.92 | |
| 赎回差价收入 | 461,512,735.08 | |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30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 | 1,635,448.44 |
| 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 | 1,635,448.44 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 18,045,639.12 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 16,408,200.00 |
| 减：应收利息总额 | 1,990.68 |
| 买卖债券差价收入 | 1,635,448.44 |

6.4.7.13.3 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

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**6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------|--------------------------------|
| 国债期货投资收益 | - |
| 股指期货投资收益 | 13,803,498.06 |

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 33,869,099.75 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 5,155,548.94 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 33,869,099.75 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -841,829,294.48 |
| ——股票投资 | -841,920,343.10 |
| ——债券投资 | 91,048.62 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | -7,412,763.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——股指期货投资 | -7,412,763.00 |
| 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 | -849,242,057.48 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 6,975,674.93 |
| 合计 | 6,975,674.93 |

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 5,672,561.05 |

| | |
|-----------|--------------|
| 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 | 5,672,561.05 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| IOPV 计算发布费 | 24,795.19 |
| 指数使用费 | 800,778.35 |
| 银行费用 | 5,253.76 |
| 其他 | - |
| 合计 | 939,923.24 |

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、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 |
| 泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 | 本基金的联接基金 |

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 2021年1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 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 | 10,677,044.39 | 13,847,442.67 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 31,352.60 | - |

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 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 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 | 1,334,630.58 | 1,730,930.33 |

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2021年6月30日 | | 上年度末 2020年12月31日 | |
|--|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金 份额 占基金总份 额的比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金 份额 占基金总份 额的比例 |
| 泰康沪深 300 交易型开放式 指数证券投资 基金联接基金 | 12,445,986.00 | 1.3144% | 18,618,486.00 | 1.3681% |

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 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 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 |
| 招商银行 | 35,028,603.09 | 121,488.76 | 24,608,008.02 | 104,724.07 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2021年6月30日，本基金持有2,910,412股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币136,508,459.40元，估值总额为人民币157,715,226.28元，占基金资产净值的比例为3.09%（2020

年 12 月 31 日，本基金持有 4,456,845 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 170,616,565.78 元，估值总额为人民币 195,878,337.75 元，占基金资产净值的比例为 2.71%)。

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 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 |
| 688499 | 利元亨 | 2021年6月23日 | 2021年7月1日 | 网下新股流通受限 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 网下新股流通受限 | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日 | 新股锁定期流通受限 | 10.64 | 10.64 | 421 | 4,479.44 | 4,479.44 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 网下新股流通受限 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 605162 | 新中港 | 2021年6月29日 | 2021年7月7日 | 网下新股流通受限 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 000063 | 中兴通讯 | 2021年1月25日 | 2021年7月26日 | 大宗交易流通受限 | 31.17 | 32.46 | 440,000 | 13,714,800.00 | 14,282,400.00 | - |
| 600745 | 闻泰科技 | 2021年4月29日 | 2021年11月1日 | 大宗交易流通受限 | 81.78 | 91.38 | 83,000 | 6,787,740.00 | 7,584,540.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|-----------|--------|--------|---------|--------------|--------------|---|
| 600352 | 浙江龙盛 | 2021年2月9日 | 2021年8月10日 | 大宗交易流通受限 | 14.78 | 13.58 | 430,000 | 6,355,400.00 | 5,839,400.00 | - |
| 601360 | 三六零 | 2021年5月27日 | 2021年11月29日 | 大宗交易流通受限 | 11.32 | 11.66 | 500,000 | 5,660,000.00 | 5,830,000.00 | - |
| 002555 | 三七互娱 | 2021年3月8日 | 2021年9月9日 | 大宗交易流通受限 | 28.94 | 23.07 | 210,000 | 6,077,400.00 | 4,844,700.00 | - |
| 002602 | 世纪华通 | 2021年3月18日 | 2021年9月22日 | 大宗交易流通受限 | 7.35 | 6.24 | 640,000 | 4,704,000.00 | 3,993,600.00 | - |
| 002607 | 中公教育 | 2021年2月2日 | 2021年8月3日 | 大宗交易流通受限 | 37.10 | 20.09 | 115,000 | 4,266,500.00 | 2,310,350.00 | - |
| 688696 | 极米科技 | 2021年2月23日 | 2021年9月3日 | 新股锁定期流通受限 | 133.73 | 780.24 | 1,252 | 167,429.96 | 976,860.48 | - |
| 688425 | 铁建重工 | 2021年6月11日 | 2021年12月22日 | 新股锁定期流通受限 | 2.87 | 4.75 | 135,282 | 388,259.34 | 642,589.50 | - |
| 300957 | 贝泰妮 | 2021年3月18日 | 2021年9月27日 | 新股锁定期流通受限 | 47.33 | 251.96 | 853 | 40,372.49 | 214,921.88 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定期流通受限 | 33.22 | 87.50 | 925 | 30,728.50 | 80,937.50 | - |
| 688468 | 科美诊断 | 2021年3月31日 | 2021年10月11日 | 新股锁定期流通受限 | 7.15 | 16.50 | 3,919 | 28,020.85 | 64,663.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|---------------------------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | | | | 限 | | | | | | |
| 688217 | 睿昂基因 | 2021年5月7日 | 2021年11月17日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 18.42 | 58.40 | 1,040 | 19,156.80 | 60,736.00 | - |
| 688328 | 深科达 | 2021年3月1日 | 2021年9月9日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 16.49 | 37.79 | 1,499 | 24,718.51 | 56,647.21 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年4月8日 | 2021年10月15日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021年2月2日 | 2021年8月9日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 21.31 | 49.94 | 399 | 8,502.69 | 19,926.06 | - |
| 300614 | 百川畅银 | 2021年5月18日 | 2021年11月25日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 9.19 | 40.38 | 329 | 3,023.51 | 13,285.02 | - |
| 300937 | 药易购 | 2021年1月20日 | 2021年7月27日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 12.25 | 53.71 | 244 | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 301013 | 利和兴 | 2021年6月21日 | 2021年12月29日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 8.72 | 27.11 | 471 | 4,107.12 | 12,768.81 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021年2月2日 | 2021年8月9日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 5.31 | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300997 | 欢乐家 | 2021年5月26日 | 2021年12月2日 | 新股 锁定 期流 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|-----------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|--|
| | | | 日 | 通受限 | | | | | | | |
| 300933 | 中辰股份 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日 | 新股锁定期流通受限 | 3.37 | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - | |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021年3月16日 | 2021年9月24日 | 新股锁定期流通受限 | 16.53 | 46.07 | 232 | 3,834.96 | 10,688.24 | - | |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股锁定期流通受限 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | - | |
| 300966 | 共同药业 | 2021年3月31日 | 2021年10月11日 | 新股锁定期流通受限 | 8.24 | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44 | - | |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月18日 | 2021年8月25日 | 新股锁定期流通受限 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08 | - | |
| 300931 | 通用电梯 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日 | 新股锁定期流通受限 | 4.31 | 13.11 | 672 | 2,896.32 | 8,809.92 | - | |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年3月23日 | 2021年9月30日 | 新股锁定期流通受限 | 8.48 | 22.07 | 394 | 3,341.12 | 8,695.58 | - | |
| 300958 | 建工修复 | 2021年3月18日 | 2021年9月29日 | 新股锁定期流通受限 | 8.53 | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00 | - | |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月 | 2021年11 | 新股锁定 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | | 21 日 | 月 1 日 | 期流 通受 限 | | | | | | |
| 300987 | 川网 传媒 | 2021 年 4 月 28 日 | 2021 年 11 月 11 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 6.79 | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300926 | 博俊 科技 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 7 月 12 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |
| 300985 | 致远 新能 | 2021 年 4 月 21 日 | 2021 年 10 月 29 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300971 | 博亚 精工 | 2021 年 4 月 7 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |
| 300975 | 商络 电子 | 2021 年 4 月 14 日 | 2021 年 10 月 21 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 5.48 | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 300963 | 中洲 特材 | 2021 年 3 月 30 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 301011 | 华立 科技 | 2021 年 6 月 9 日 | 2021 年 12 月 17 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300943 | 春晖 智控 | 2021 年 2 月 3 日 | 2021 年 8 月 10 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 9.79 | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300967 | 晓鸣 | 2021 | 2021 | 新股 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|---------------------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | 股份 | 年 4 月 2 日 | 年 10 月 13 日 | 锁定 期流 通受 限 | | | | | | |
| 300972 | 万辰 生物 | 2021 年 4 月 8 日 | 2021 年 10 月 19 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 7.19 | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300929 | 华骐 环保 | 2021 年 1 月 12 日 | 2021 年 7 月 21 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 301012 | 扬电 科技 | 2021 年 6 月 15 日 | 2021 年 12 月 22 日 | 新股 锁定 期流 通受 限 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 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： 张) | 期末 成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|----------|----------|-----------------------|--------------------------|----------------------|----------|------------|------------------|--------------|--------------|----|
| 113049 | 长汽 转债 | 2021 年 6 月 11 日 | 2021 年 7 月 8 日 | 配债 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 1,570 | 157,000.00 | 157,000.00 | - |
| 113050 | 南银 转债 | 2021 年 6 月 16 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 配债 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 18,630 | 1,863,000.00 | 1,863,000.00 | - |
| 113050 | 南银 转债 | 2021 年 6 月 17 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 网下 新债 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 8,720 | 872,000.00 | 872,000.00 | - |
| 123117 | 健帆 转债 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 12 日 | 配债 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 1,160 | 116,000.00 | 116,000.00 | - |
| 127038 | 国微 转债 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 7 月 14 日 | 配债 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 2,709 | 270,900.00 | 270,900.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--|--|--|---|--|--|--|--|--|--|--|
| | | | 日 | | | | | | | |
|--|--|--|---|--|--|--|--|--|--|--|

注：1、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票，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票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金其持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。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票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、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。

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

4、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。

5、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。

6、根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本 93,340,000.00 股为基数，向全体股东每股派发现金红利 0.08 元（含税），每股派送红股 0.50 股。除权除息日为 2021 年 6 月 4 日，本基金所持有的冠中生态获得转增股 108 股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|-----------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002024 | 苏宁易购 | 2021年6月16日 | 临时停牌 | 5.59 | 2021年7月6日 | 6.15 | 665,100 | 5,464,275.48 | 3,717,909.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 出借到期日 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末估值总额 |
|----|--------|------|--------------------------|--------|----------|---------------|
| 1 | 000001 | 平安银行 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 22.62 | 573,600 | 12,974,832.00 |
| 2 | 000002 | 万科 A | 2021年7月2日 | 23.81 | 406,700 | 9,683,527.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|--------|-------------------------------------|--------|-----------|---------------|
| | | | -2021 年 7 月 13 日 | | | |
| 3 | 000066 | 中国长城 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日 | 14.60 | 103,000 | 1,503,800.00 |
| 4 | 000100 | TCL 科技 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日 | 7.65 | 74,500 | 569,925.00 |
| 5 | 000157 | 中联重科 | 2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日 | 9.24 | 71,000 | 656,040.00 |
| 6 | 000166 | 申万宏源 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日 | 4.68 | 503,400 | 2,355,912.00 |
| 7 | 000338 | 潍柴动力 | 2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日 | 17.87 | 240,800 | 4,303,096.00 |
| 8 | 000538 | 云南白药 | 2021 年 7 月 27 日 -2021 年 7 月 27 日 | 115.72 | 10,000 | 1,157,200.00 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 7 日 | 235.94 | 40,000 | 9,437,600.00 |
| 10 | 000625 | 长安汽车 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日 | 26.28 | 132,000 | 3,468,960.00 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日 | 52.10 | 282,000 | 14,692,200.00 |
| 12 | 000703 | 恒逸石化 | 2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日 | 11.95 | 130,000 | 1,553,500.00 |
| 13 | 000708 | 中信特钢 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日 | 20.84 | 50,500 | 1,052,420.00 |
| 14 | 000725 | 京东方 A | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日 | 6.24 | 1,666,800 | 10,400,832.00 |
| 15 | 000768 | 中航西飞 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日 | 26.28 | 78,900 | 2,073,492.00 |
| 16 | 000776 | 广发证券 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 9 日 | 15.14 | 173,500 | 2,626,790.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|---------------------------|--------|---------|--------------|
| 17 | 000783 | 长江证券 | 2021年7月2日 -2021年7月13日 | 7.32 | 227,900 | 1,668,228.00 |
| 18 | 000786 | 北新建材 | 2021年7月1日 -2021年7月8日 | 39.25 | 20,000 | 785,000.00 |
| 19 | 000800 | 一汽解放 | 2021年7月6日 -2021年7月14日 | 10.82 | 55,200 | 597,264.00 |
| 20 | 000858 | 五粮液 | 2021年7月9日 -2021年7月9日 | 297.89 | 27,100 | 8,072,819.00 |
| 21 | 000860 | 顺鑫农业 | 2021年7月2日 -2021年7月15日 | 42.18 | 30,500 | 1,286,490.00 |
| 22 | 000876 | 新希望 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 14.67 | 102,900 | 1,509,543.00 |
| 23 | 000895 | 双汇发展 | 2021年7月2日 -2021年7月13日 | 31.80 | 82,900 | 2,636,220.00 |
| 24 | 000938 | 紫光股份 | 2021年7月13日 -2021年7月13日 | 21.88 | 10,000 | 218,800.00 |
| 25 | 000963 | 华东医药 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 46.01 | 47,800 | 2,199,278.00 |
| 26 | 000977 | 浪潮信息 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 28.13 | 60,300 | 1,696,239.00 |
| 27 | 001979 | 招商蛇口 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 10.95 | 98,100 | 1,074,195.00 |
| 28 | 002001 | 新和成 | 2021年7月1日 -2021年7月27日 | 28.68 | 22,400 | 642,432.00 |
| 29 | 002007 | 华兰生物 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 36.68 | 59,000 | 2,164,120.00 |
| 30 | 002008 | 大族激光 | 2021年7月2日 -2021年7月7日 | 40.39 | 34,800 | 1,405,572.00 |
| 31 | 002024 | 苏宁易购 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 5.59 | 216,000 | 1,207,440.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|-----------------------|--------|---------|--------------|
| | | | 日 | | | |
| 32 | 002027 | 分众传媒 | 2021年7月13日-2021年7月13日 | 9.41 | 106,100 | 998,401.00 |
| 33 | 002032 | 苏泊尔 | 2021年7月1日-2021年7月1日 | 63.79 | 10,000 | 637,900.00 |
| 34 | 002044 | 美年健康 | 2021年7月9日-2021年7月9日 | 9.11 | 37,200 | 338,892.00 |
| 35 | 002049 | 紫光国微 | 2021年7月27日-2021年7月27日 | 154.19 | 10,000 | 1,541,900.00 |
| 36 | 002050 | 三花智控 | 2021年7月1日-2021年7月14日 | 23.98 | 14,100 | 338,118.00 |
| 37 | 002120 | 韵达股份 | 2021年7月9日-2021年7月9日 | 13.53 | 10,000 | 135,300.00 |
| 38 | 002129 | 中环股份 | 2021年7月1日-2021年7月1日 | 38.60 | 20,000 | 772,000.00 |
| 39 | 002142 | 宁波银行 | 2021年7月9日-2021年7月13日 | 38.97 | 211,300 | 8,234,361.00 |
| 40 | 002153 | 石基信息 | 2021年7月1日-2021年7月1日 | 23.51 | 18,300 | 430,233.00 |
| 41 | 002157 | 正邦科技 | 2021年7月5日-2021年7月9日 | 11.95 | 91,900 | 1,098,205.00 |
| 42 | 002202 | 金风科技 | 2021年7月1日-2021年7月14日 | 12.16 | 161,600 | 1,965,056.00 |
| 43 | 002230 | 科大讯飞 | 2021年7月1日-2021年7月5日 | 67.58 | 10,000 | 675,800.00 |
| 44 | 002236 | 大华股份 | 2021年7月5日-2021年7月6日 | 21.10 | 103,400 | 2,181,740.00 |
| 45 | 002241 | 歌尔股份 | 2021年7月6日-2021年7月13日 | 42.74 | 142,600 | 6,094,724.00 |
| 46 | 002252 | 上海莱士 | 2021年7月1日 | 7.49 | 120,100 | 899,549.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|---------------------------|--------|---------|---------------|
| | | | -2021年7月13日 | | | |
| 47 | 002271 | 东方雨虹 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 55.32 | 20,000 | 1,106,400.00 |
| 48 | 002304 | 洋河股份 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 207.20 | 10,000 | 2,072,000.00 |
| 49 | 002311 | 海大集团 | 2021年7月1日 -2021年7月9日 | 81.60 | 48,600 | 3,965,760.00 |
| 50 | 002352 | 顺丰控股 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 67.70 | 107,700 | 7,291,290.00 |
| 51 | 002371 | 北方华创 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 277.38 | 10,000 | 2,773,800.00 |
| 52 | 002384 | 东山精密 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 20.84 | 20,000 | 416,800.00 |
| 53 | 002410 | 广联达 | 2021年7月1日 -2021年7月6日 | 68.20 | 24,300 | 1,657,260.00 |
| 54 | 002414 | 高德红外 | 2021年7月1日 -2021年7月9日 | 27.58 | 55,100 | 1,519,658.00 |
| 55 | 002415 | 海康威视 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 64.50 | 276,100 | 17,808,450.00 |
| 56 | 002456 | 欧菲光 | 2021年7月1日 -2021年7月6日 | 8.88 | 94,800 | 841,824.00 |
| 57 | 002460 | 赣锋锂业 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 121.09 | 15,000 | 1,816,350.00 |
| 58 | 002463 | 沪电股份 | 2021年7月7日 -2021年7月27日 | 15.47 | 71,600 | 1,107,652.00 |
| 59 | 002475 | 立讯精密 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 46.00 | 284,700 | 13,096,200.00 |
| 60 | 002493 | 荣盛石化 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 17.27 | 20,000 | 345,400.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|---------------------------|--------|---------|---------------|
| 61 | 002508 | 老板电器 | 2021年7月8日 -2021年7月12日 | 46.50 | 23,000 | 1,069,500.00 |
| 62 | 002555 | 三七互娱 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 24.02 | 20,000 | 480,400.00 |
| 63 | 002594 | 比亚迪 | 2021年7月1日 -2021年7月21日 | 251.00 | 50,000 | 12,550,000.00 |
| 64 | 002600 | 领益智造 | 2021年7月2日 -2021年7月5日 | 9.19 | 166,900 | 1,533,811.00 |
| 65 | 002601 | 龙麟佰利 | 2021年7月5日 -2021年7月9日 | 34.58 | 46,600 | 1,611,428.00 |
| 66 | 002624 | 完美世界 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 23.91 | 14,100 | 337,131.00 |
| 67 | 002673 | 西部证券 | 2021年7月1日 -2021年7月9日 | 8.25 | 104,100 | 858,825.00 |
| 68 | 002714 | 牧原股份 | 2021年7月5日 -2021年7月27日 | 60.82 | 136,200 | 8,283,684.00 |
| 69 | 002736 | 国信证券 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 10.75 | 154,000 | 1,655,500.00 |
| 70 | 002739 | 万达电影 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 15.79 | 31,300 | 494,227.00 |
| 71 | 002773 | 康弘药业 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 23.13 | 20,000 | 462,600.00 |
| 72 | 002812 | 恩捷股份 | 2021年7月7日 -2021年7月7日 | 234.10 | 10,000 | 2,341,000.00 |
| 73 | 002841 | 视源股份 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 124.29 | 10,000 | 1,242,900.00 |
| 74 | 002916 | 深南电路 | 2021年7月2日 -2021年7月2日 | 111.13 | 10,000 | 1,111,300.00 |
| 75 | 002939 | 长城证券 | 2021年7月6日 -2021年7月13日 | 11.13 | 55,400 | 616,602.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|---------------------------|--------|--------|--------------|
| | | | 日 | | | |
| 76 | 300003 | 乐普医疗 | 2021年7月1日 -2021年7月8日 | 32.12 | 68,900 | 2,213,068.00 |
| 77 | 300014 | 亿纬锂能 | 2021年7月1日 -2021年7月27日 | 103.93 | 57,100 | 5,934,403.00 |
| 78 | 300015 | 爱尔眼科 | 2021年7月2日 -2021年7月14日 | 70.98 | 59,155 | 4,198,821.90 |
| 79 | 300033 | 同花顺 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 112.78 | 10,000 | 1,127,800.00 |
| 80 | 300124 | 汇川技术 | 2021年7月14日 -2021年7月14日 | 74.26 | 91,700 | 6,809,642.00 |
| 81 | 300136 | 信维通信 | 2021年7月2日 -2021年7月6日 | 30.88 | 10,500 | 324,240.00 |
| 82 | 300142 | 沃森生物 | 2021年7月14日 -2021年7月27日 | 61.70 | 30,000 | 1,851,000.00 |
| 83 | 300144 | 宋城演艺 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 16.80 | 54,500 | 915,600.00 |
| 84 | 300274 | 阳光电源 | 2021年7月2日 -2021年7月28日 | 115.06 | 23,700 | 2,726,922.00 |
| 85 | 300347 | 泰格医药 | 2021年7月2日 -2021年7月2日 | 193.30 | 10,000 | 1,933,000.00 |
| 86 | 300408 | 三环集团 | 2021年7月1日 -2021年7月6日 | 42.42 | 41,900 | 1,777,398.00 |
| 87 | 300413 | 芒果超媒 | 2021年7月2日 -2021年7月14日 | 68.60 | 42,200 | 2,894,920.00 |
| 88 | 300433 | 蓝思科技 | 2021年7月7日 -2021年7月7日 | 29.41 | 10,000 | 294,100.00 |
| 89 | 300450 | 先导智能 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 60.14 | 10,000 | 601,400.00 |
| 90 | 300601 | 康泰生物 | 2021年7月7日 | 149.00 | 10,000 | 1,490,000.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|---------------------------------|--------|---------|---------------|
| | | | -2021 年 7 月 7 日 | | | |
| 91 | 300677 | 英科医疗 | 2021 年 7 月 13 日-2021 年 7 月 13 日 | 124.80 | 12,500 | 1,560,000.00 |
| 92 | 600000 | 浦发银行 | 2021 年 7 月 7 日-2021 年 7 月 7 日 | 10.00 | 125,200 | 1,252,000.00 |
| 93 | 600009 | 上海机场 | 2021 年 7 月 9 日-2021 年 7 月 12 日 | 48.13 | 57,400 | 2,762,662.00 |
| 94 | 600011 | 华能国际 | 2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 13 日 | 4.22 | 214,200 | 903,924.00 |
| 95 | 600015 | 华夏银行 | 2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 14 日 | 6.19 | 250,500 | 1,550,595.00 |
| 96 | 600016 | 民生银行 | 2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 7 日 | 4.41 | 155,900 | 687,519.00 |
| 97 | 600018 | 上港集团 | 2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 8 日 | 4.77 | 10,000 | 47,700.00 |
| 98 | 600019 | 宝钢股份 | 2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 1 日 | 7.64 | 341,100 | 2,606,004.00 |
| 99 | 600025 | 华能水电 | 2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 5 日 | 5.79 | 45,100 | 261,129.00 |
| 100 | 600028 | 中国石化 | 2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 8 日 | 4.36 | 190,100 | 828,836.00 |
| 101 | 600029 | 南方航空 | 2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 2 日 | 6.02 | 10,000 | 60,200.00 |
| 102 | 600030 | 中信证券 | 2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 8 日 | 24.94 | 447,300 | 11,155,662.00 |
| 103 | 600031 | 三一重工 | 2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 13 日 | 29.07 | 319,500 | 9,287,865.00 |
| 104 | 600036 | 招商银行 | 2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 1 日 | 54.19 | 275,500 | 14,929,345.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|--------------------------|--------|---------|---------------|
| 105 | 600050 | 中国联通 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 4.32 | 935,500 | 4,041,360.00 |
| 106 | 600061 | 国投资本 | 2021年7月6日 -2021年7月8日 | 8.49 | 37,000 | 314,130.00 |
| 107 | 600085 | 同仁堂 | 2021年7月2日 -2021年7月5日 | 40.85 | 30,500 | 1,245,925.00 |
| 108 | 600104 | 上汽集团 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 21.97 | 196,300 | 4,312,711.00 |
| 109 | 600109 | 国金证券 | 2021年7月2日 -2021年7月14日 | 12.69 | 142,500 | 1,808,325.00 |
| 110 | 600111 | 北方稀土 | 2021年7月1日 -2021年7月21日 | 20.70 | 127,700 | 2,643,390.00 |
| 111 | 600115 | 中国东航 | 2021年7月5日 -2021年7月14日 | 5.08 | 264,300 | 1,342,644.00 |
| 112 | 600118 | 中国卫星 | 2021年7月2日 -2021年7月8日 | 29.26 | 27,500 | 804,650.00 |
| 113 | 600150 | 中国船舶 | 2021年7月6日 -2021年7月13日 | 16.51 | 76,000 | 1,254,760.00 |
| 114 | 600161 | 天坛生物 | 2021年7月8日 -2021年7月13日 | 34.25 | 10,000 | 342,500.00 |
| 115 | 600176 | 中国巨石 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 15.51 | 40,000 | 620,400.00 |
| 116 | 600196 | 复星医药 | 2021年7月1日 -2021年7月27日 | 72.13 | 70,800 | 5,106,804.00 |
| 117 | 600233 | 圆通速递 | 2021年7月1日 -2021年7月5日 | 10.01 | 71,400 | 714,714.00 |
| 118 | 600299 | 安迪苏 | 2021年7月7日 -2021年7月7日 | 11.96 | 16,100 | 192,556.00 |
| 119 | 600309 | 万华化学 | 2021年7月1日 -2021年7月2日 | 108.82 | 92,500 | 10,065,850.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|--------------------------|--------|---------|--------------|
| | | | 日 | | | |
| 120 | 600340 | 华夏幸福 | 2021年7月5日 -2021年7月5日 | 5.24 | 11,400 | 59,736.00 |
| 121 | 600346 | 恒力石化 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 26.24 | 124,600 | 3,269,504.00 |
| 122 | 600362 | 江西铜业 | 2021年7月5日 -2021年7月13日 | 22.38 | 57,300 | 1,282,374.00 |
| 123 | 600383 | 金地集团 | 2021年7月9日 -2021年7月9日 | 10.24 | 50,800 | 520,192.00 |
| 124 | 600406 | 国电南瑞 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 23.24 | 115,720 | 2,689,332.80 |
| 125 | 600436 | 片仔癀 | 2021年7月5日 -2021年7月8日 | 448.30 | 10,000 | 4,483,000.00 |
| 126 | 600438 | 通威股份 | 2021年7月1日 -2021年7月27日 | 43.27 | 50,000 | 2,163,500.00 |
| 127 | 600482 | 中国动力 | 2021年7月5日 -2021年7月6日 | 17.42 | 38,300 | 667,186.00 |
| 128 | 600489 | 中金黄金 | 2021年7月6日 -2021年7月14日 | 8.62 | 114,000 | 982,680.00 |
| 129 | 600521 | 华海药业 | 2021年7月1日 -2021年7月2日 | 20.88 | 51,700 | 1,079,496.00 |
| 130 | 600547 | 山东黄金 | 2021年7月6日 -2021年7月7日 | 19.22 | 106,800 | 2,052,696.00 |
| 131 | 600570 | 恒生电子 | 2021年7月7日 -2021年7月7日 | 93.25 | 46,600 | 4,345,450.00 |
| 132 | 600584 | 长电科技 | 2021年7月2日 -2021年7月9日 | 37.68 | 73,100 | 2,754,408.00 |
| 133 | 600588 | 用友网络 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 33.26 | 20,000 | 665,200.00 |
| 134 | 600600 | 青岛啤酒 | 2021年7月5日 | 115.65 | 20,000 | 2,313,000.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|---------------------------|--------|---------|--------------|
| | | | -2021年7月13日 | | | |
| 135 | 600606 | 绿地控股 | 2021年7月1日 -2021年7月2日 | 5.45 | 175,800 | 958,110.00 |
| 136 | 600655 | 豫园股份 | 2021年7月5日 -2021年7月8日 | 11.59 | 90,800 | 1,052,372.00 |
| 137 | 600690 | 海尔智家 | 2021年7月7日 -2021年7月9日 | 25.91 | 20,000 | 518,200.00 |
| 138 | 600703 | 三安光电 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 32.05 | 155,100 | 4,970,955.00 |
| 139 | 600705 | 中航资本 | 2021年7月1日 -2021年7月2日 | 3.87 | 81,200 | 314,244.00 |
| 140 | 600741 | 华域汽车 | 2021年7月2日 -2021年7月14日 | 26.27 | 77,000 | 2,022,790.00 |
| 141 | 600745 | 闻泰科技 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 96.90 | 10,000 | 969,000.00 |
| 142 | 600760 | 中航沈飞 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 60.30 | 10,000 | 603,000.00 |
| 143 | 600763 | 通策医疗 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 411.00 | 10,000 | 4,110,000.00 |
| 144 | 600795 | 国电电力 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 2.43 | 588,600 | 1,430,298.00 |
| 145 | 600809 | 山西汾酒 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 448.00 | 20,600 | 9,228,800.00 |
| 146 | 600848 | 上海临港 | 2021年7月6日 -2021年7月27日 | 17.90 | 56,900 | 1,018,510.00 |
| 147 | 600872 | 中炬高新 | 2021年7月2日 -2021年7月2日 | 42.02 | 10,000 | 420,200.00 |
| 148 | 600886 | 国投电力 | 2021年7月5日 -2021年7月5日 | 9.61 | 12,300 | 118,203.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|---------------------------|-------|---------|---------------|
| 149 | 600893 | 航发动力 | 2021年7月7日 -2021年7月27日 | 53.19 | 24,400 | 1,297,836.00 |
| 150 | 600900 | 长江电力 | 2021年7月7日 -2021年7月13日 | 20.64 | 211,500 | 4,365,360.00 |
| 151 | 600926 | 杭州银行 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 14.75 | 174,900 | 2,579,775.00 |
| 152 | 600999 | 招商证券 | 2021年7月7日 -2021年7月13日 | 19.02 | 91,600 | 1,742,232.00 |
| 153 | 601009 | 南京银行 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 10.52 | 50,900 | 535,468.00 |
| 154 | 601012 | 隆基股份 | 2021年7月7日 -2021年7月27日 | 88.84 | 145,400 | 12,917,336.00 |
| 155 | 601021 | 春秋航空 | 2021年7月2日 -2021年7月7日 | 56.90 | 20,000 | 1,138,000.00 |
| 156 | 601066 | 中信建投 | 2021年7月12日 -2021年7月12日 | 31.43 | 20,000 | 628,600.00 |
| 157 | 601100 | 恒立液压 | 2021年7月7日 -2021年7月13日 | 85.92 | 22,300 | 1,916,016.00 |
| 158 | 601111 | 中国国航 | 2021年7月2日 -2021年7月13日 | 7.78 | 176,500 | 1,373,170.00 |
| 159 | 601155 | 新城控股 | 2021年7月9日 -2021年7月9日 | 41.60 | 50,600 | 2,104,960.00 |
| 160 | 601162 | 天风证券 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 4.86 | 222,400 | 1,080,864.00 |
| 161 | 601166 | 兴业银行 | 2021年7月14日 -2021年7月14日 | 20.55 | 859,500 | 17,662,725.00 |
| 162 | 601169 | 北京银行 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 4.87 | 76,300 | 371,581.00 |
| 163 | 601225 | 陕西煤业 | 2021年7月1日 -2021年7月7日 | 11.85 | 51,800 | 613,830.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|---------------------------|-------|---------|--------------|
| | | | 日 | | | |
| 164 | 601231 | 环旭电子 | 2021年7月1日 -2021年7月6日 | 16.81 | 35,800 | 601,798.00 |
| 165 | 601236 | 红塔证券 | 2021年7月6日 -2021年7月8日 | 13.56 | 22,300 | 302,388.00 |
| 166 | 601238 | 广汽集团 | 2021年7月1日 -2021年7月5日 | 12.95 | 127,900 | 1,656,305.00 |
| 167 | 601288 | 农业银行 | 2021年7月14日 -2021年7月14日 | 3.03 | 17,900 | 54,237.00 |
| 168 | 601319 | 中国人保 | 2021年7月5日 -2021年7月9日 | 5.93 | 138,300 | 820,119.00 |
| 169 | 601328 | 交通银行 | 2021年7月14日 -2021年7月14日 | 4.90 | 10,200 | 49,980.00 |
| 170 | 601377 | 兴业证券 | 2021年7月5日 -2021年7月9日 | 9.66 | 129,600 | 1,251,936.00 |
| 171 | 601390 | 中国中铁 | 2021年7月1日 -2021年7月6日 | 5.24 | 322,100 | 1,687,804.00 |
| 172 | 601398 | 工商银行 | 2021年7月5日 -2021年7月5日 | 5.17 | 125,700 | 649,869.00 |
| 173 | 601555 | 东吴证券 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 8.34 | 184,200 | 1,536,228.00 |
| 174 | 601600 | 中国铝业 | 2021年7月1日 -2021年7月9日 | 5.30 | 224,500 | 1,189,850.00 |
| 175 | 601601 | 中国太保 | 2021年7月1日 -2021年7月13日 | 28.97 | 49,500 | 1,434,015.00 |
| 176 | 601607 | 上海医药 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 21.13 | 10,000 | 211,300.00 |
| 177 | 601618 | 中国中冶 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 2.98 | 78,200 | 233,036.00 |
| 178 | 601628 | 中国人寿 | 2021年7月6日 | 33.89 | 24,700 | 837,083.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|------------------------------------|--------|---------|--------------|
| | | | -2021 年 7 月 6 日 | | | |
| 179 | 601633 | 长城汽车 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 27 日 | 43.59 | 50,000 | 2,179,500.00 |
| 180 | 601668 | 中国建筑 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日 | 4.65 | 216,900 | 1,008,585.00 |
| 181 | 601669 | 中国电建 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日 | 3.87 | 407,700 | 1,577,799.00 |
| 182 | 601696 | 中银证券 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 14 日 | 20.59 | 48,600 | 1,000,674.00 |
| 183 | 601727 | 上海电气 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日 | 4.24 | 304,200 | 1,289,808.00 |
| 184 | 601788 | 光大证券 | 2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 27 日 | 17.89 | 70,600 | 1,263,034.00 |
| 185 | 601799 | 星宇股份 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日 | 225.72 | 10,000 | 2,257,200.00 |
| 186 | 601800 | 中国交建 | 2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 9 日 | 6.48 | 50,700 | 328,536.00 |
| 187 | 601808 | 中海油服 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日 | 14.36 | 29,800 | 427,928.00 |
| 188 | 601816 | 京沪高铁 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日 | 5.29 | 218,800 | 1,157,452.00 |
| 189 | 601857 | 中国石油 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 12 日 | 5.29 | 579,600 | 3,066,084.00 |
| 190 | 601872 | 招商轮船 | 2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日 | 4.62 | 182,800 | 844,536.00 |
| 191 | 601877 | 正泰电器 | 2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 9 日 | 33.38 | 43,600 | 1,455,368.00 |
| 192 | 601878 | 浙商证券 | 2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 6 日 | 13.08 | 91,600 | 1,198,128.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|---------------------------|--------|---------|---------------|
| 193 | 601888 | 中国中免 | 2021年7月5日 -2021年7月7日 | 300.10 | 57,400 | 17,225,740.00 |
| 194 | 601901 | 方正证券 | 2021年7月1日 -2021年7月7日 | 9.36 | 239,900 | 2,245,464.00 |
| 195 | 601919 | 中远海控 | 2021年7月1日 -2021年7月27日 | 30.54 | 172,400 | 5,265,096.00 |
| 196 | 601985 | 中国核电 | 2021年7月8日 -2021年7月8日 | 5.06 | 10,000 | 50,600.00 |
| 197 | 601988 | 中国银行 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 3.08 | 819,700 | 2,524,676.00 |
| 198 | 601989 | 中国重工 | 2021年7月7日 -2021年7月7日 | 4.12 | 37,800 | 155,736.00 |
| 199 | 601990 | 南京证券 | 2021年7月1日 -2021年7月2日 | 10.52 | 35,400 | 372,408.00 |
| 200 | 601995 | 中金公司 | 2021年7月13日 -2021年7月13日 | 61.50 | 10,000 | 615,000.00 |
| 201 | 603019 | 中科曙光 | 2021年7月9日 -2021年7月9日 | 27.61 | 11,100 | 306,471.00 |
| 202 | 603259 | 药明康德 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 156.59 | 20,000 | 3,131,800.00 |
| 203 | 603369 | 今世缘 | 2021年7月1日 -2021年7月14日 | 54.16 | 36,800 | 1,993,088.00 |
| 204 | 603659 | 璞泰来 | 2021年7月14日 -2021年7月14日 | 136.60 | 12,300 | 1,680,180.00 |
| 205 | 603799 | 华友钴业 | 2021年7月6日 -2021年7月27日 | 114.20 | 35,000 | 3,997,000.00 |
| 206 | 603806 | 福斯特 | 2021年7月14日 -2021年7月14日 | 105.13 | 20,000 | 2,102,600.00 |
| 207 | 603833 | 欧派家居 | 2021年7月1日 -2021年7月1日 | 141.96 | 10,000 | 1,419,600.00 |

| | | | | | | |
|-----|--------|------|---------------------------|--------|------------|----------------|
| | | | 日 | | | |
| 208 | 603899 | 晨光文具 | 2021年7月5日 -2021年7月5日 | 84.56 | 10,000 | 845,600.00 |
| 209 | 603939 | 益丰药房 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 56.09 | 10,000 | 560,900.00 |
| 210 | 603986 | 兆易创新 | 2021年7月1日 -2021年7月5日 | 187.90 | 30,000 | 5,637,000.00 |
| 211 | 603993 | 洛阳钼业 | 2021年7月1日 -2021年7月7日 | 5.16 | 232,600 | 1,200,216.00 |
| 212 | 688008 | 澜起科技 | 2021年7月2日 -2021年7月27日 | 62.38 | 20,000 | 1,247,600.00 |
| 213 | 688012 | 中微公司 | 2021年7月6日 -2021年7月6日 | 165.92 | 10,000 | 1,659,200.00 |
| 214 | 688036 | 传音控股 | 2021年7月27日 -2021年7月27日 | 209.50 | 10,000 | 2,095,000.00 |
| 215 | 688126 | 沪硅产业 | 2021年7月28日 -2021年7月28日 | 29.18 | 20,000 | 583,600.00 |
| 216 | 688396 | 华润微 | 2021年7月13日 -2021年7月13日 | 91.02 | 15,600 | 1,419,912.00 |
| 合计 | | | | | 23,828,275 | 537,575,428.70 |

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告‘本基金持有的流通受限证券’部分内容。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管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。

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

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

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

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

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

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

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

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 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 2,892,000.00 | 4,605,000.00 |
| AAA 以下 | 771,748.62 | 416,000.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 3,663,748.62 | 5,021,000.00 |

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

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

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

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

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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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 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 | 35,028,603.09 | - | - | - | 35,028,603.09 |
| 结算备付金 | 24,584,479.27 | - | - | - | 24,584,479.27 |
| 存出保证金 | 1,733,219.67 | - | - | 6,695,654.40 | 8,428,874.07 |
| 交易性金融资产 | - | -3,663,748.62 | 5,568,451,628.43 | 5,572,115,377.05 | 5,572,115,377.05 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,377,926.40 | 1,377,926.40 |
| 应收利息 | - | - | - | 216,221.58 | 216,221.58 |
| 应收股利 | - | - | - | 576,329.90 | 576,329.90 |
| 其他资产 | - | - | - | -537,575,428.70 | -537,575,428.70 |
| 资产总计 | 61,346,302.03 | -3,663,748.62 | 5,039,742,332.01 | 5,104,752,382.66 | 5,104,752,382.66 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,043,763.85 | 1,043,763.85 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,682,146.88 | 1,682,146.88 |
| 应付托管费 | - | - | - | 210,268.36 | 210,268.36 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 570,188.99 | 570,188.99 |
| 应交税费 | - | - | - | 70,892.14 | 70,892.14 |
| 其他负债 | - | - | - | 4,294,830.06 | 4,294,830.06 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,872,090.28 | 7,872,090.28 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|---------------|------------------|------------------|----------------|
| 利率敏感度缺口 | 61,346,302.03 | -3,663,748.62 | 5,031,870,241.73 | 5,096,880,292.38 | |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 28,544,831.79 | - | - | - | 28,544,831.79 |
| 结算备付金 | 127,635,925.45 | - | - | - | 127,635,925.45 |
| 存出保证金 | 854,871.46 | - | - | 20,261,404.80 | 21,116,276.26 |
| 交易性金融资产 | - | -5,021,000.00 | 7,061,577,647.45 | 7,066,598,647.45 | |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 2,841,675.76 | 2,841,675.76 |
| 应收利息 | - | - | - | 307,940.37 | 307,940.37 |
| 应收股利 | - | - | - | 110.00 | 110.00 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 157,035,628.70 | -5,021,000.00 | 7,084,988,778.38 | 7,247,045,407.08 | |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 750,831.58 | 750,831.58 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,646,319.97 | 2,646,319.97 |
| 应付托管费 | - | - | - | 330,790.01 | 330,790.01 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 774,964.12 | 774,964.12 |
| 应交税费 | - | - | - | 386,033.78 | 386,033.78 |
| 其他负债 | - | - | - | 5,225,113.73 | 5,225,113.73 |
| 负债总计 | - | - | - | 10,114,053.19 | 10,114,053.19 |
| 利率敏感度缺口 | 157,035,628.70 | -5,021,000.00 | 7,074,874,725.19 | 7,236,931,353.89 | |

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% | 53,648.54 | 72,895.23 |
| 市场利率上调 0.25% | -52,739.43 | -71,667.83 | |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 5,030,876,199.73 | 98.71 | 7,061,577,647.45 | 97.58 |
| 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 | 5,030,876,199.73 | 98.71 | 7,061,577,647.45 | 97.58 |

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% | 267,377,313.81 | 363,941,706.70 |
| | 业绩比较基准中的权益指数 下降 5% | -267,377,313.81 | -363,941,706.70 |

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 4,983,607,502.05 元，属于第二层次的余额为 50,932,446.30 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 6,905,742,190.99 元，第二层次 160,856,456.46 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 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) 基金申购款

于 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间,本基金申购基金份额的对价总额为 4,591,635,981.78 元(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间: 1,328,021,029.38 元),其中包括以股票支付的申购款 2,601,105,193.98 元和以现金支付的申购款 1,990,530,787.80 元(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间: 其中包括以股票支付的申购款 809,733,225.95 元和以现金支付的申购款 518,287,803.43 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。

§ 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 | 5,030,876,199.73 | 98.55 |
| | 其中：股票 | 5,030,876,199.73 | 98.55 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,663,748.62 | 0.07 |
| | 其中：债券 | 3,663,748.62 | 0.07 |
| | 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 | 59,613,082.36 | 1.17 |
| 8 | 其他各项资产 | 10,599,351.95 | 0.21 |
| 9 | 合计 | 5,104,752,382.66 | 100.00 |

注：（1）本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 537,575,428.70 元，占期末资产净值比例为 10.55%

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 52,682,472.15 | 1.03 |
| B | 采矿业 | 106,216,427.84 | 2.08 |
| C | 制造业 | 2,782,248,951.52 | 54.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 88,684,886.83 | 1.74 |
| E | 建筑业 | 60,781,785.91 | 1.19 |
| F | 批发和零售业 | 36,093,100.28 | 0.71 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 147,051,432.65 | 2.89 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 164,454,814.63 | 3.23 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| J | 金融业 | 1,186,155,487.64 | 23.27 |
| K | 房地产业 | 103,475,021.22 | 2.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | 91,672,916.60 | 1.80 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 71,849,120.32 | 1.41 |
| 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 | 8,997,239.00 | 0.18 |
| Q | 卫生和社会工作 | 106,774,856.70 | 2.09 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 20,978,252.20 | 0.41 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,028,116,765.49 | 98.65 |

7.2.2 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 11,290.28 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,585,207.43 | 0.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 11,014.44 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 19,516.00 | 0.00 |
| 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 | 40,226.27 | 0.00 |
| J | 金融业 | 34,721.10 | 0.00 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 44,438.33 | 0.00 |
| 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 | 2,759,434.24 | 0.05 |

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 148,007 | 304,405,996.90 | 5.97 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,546,549 | 163,692,169.72 | 3.21 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 2,910,412 | 157,715,226.28 | 3.09 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 456,674 | 136,038,617.86 | 2.67 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 1,018,247 | 90,461,063.48 | 1.77 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 1,159,839 | 82,777,709.43 | 1.62 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,052,903 | 71,565,816.91 | 1.40 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 1,097,944 | 70,817,388.00 | 1.39 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 3,418,283 | 70,245,715.65 | 1.38 |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 229,696 | 68,931,769.60 | 1.35 |
| 11 | 603259 | 药明康德 | 421,648 | 66,025,860.32 | 1.30 |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 1,944,226 | 63,751,170.54 | 1.25 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 1,131,692 | 58,961,153.20 | 1.16 |
| 14 | 600900 | 长江电力 | 2,673,357 | 55,178,088.48 | 1.08 |
| 15 | 002594 | 比亚迪 | 213,042 | 53,473,542.00 | 1.05 |
| 16 | 002475 | 立讯精密 | 1,149,495 | 52,876,770.00 | 1.04 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 1,429,764 | 52,658,208.12 | 1.03 |
| 18 | 000001 | 平安银行 | 2,281,472 | 51,606,896.64 | 1.01 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 2,004,100 | 49,982,254.00 | 0.98 |
| 20 | 000725 | 京东方 A | 7,963,000 | 49,689,120.00 | 0.97 |
| 21 | 300015 | 爱尔眼科 | 635,980 | 45,141,860.40 | 0.89 |
| 22 | 601398 | 工商银行 | 8,239,500 | 42,598,215.00 | 0.84 |
| 23 | 600031 | 三一重工 | 1,396,772 | 40,604,162.04 | 0.80 |
| 24 | 000568 | 泸州老窖 | 171,972 | 40,575,073.68 | 0.80 |
| 25 | 600309 | 万华化学 | 368,623 | 40,113,554.86 | 0.79 |
| 26 | 603501 | 韦尔股份 | 122,512 | 39,448,864.00 | 0.77 |
| 27 | 603288 | 海天味业 | 296,835 | 38,276,873.25 | 0.75 |
| 28 | 000002 | 万科 A | 1,600,700 | 38,112,667.00 | 0.75 |
| 29 | 002714 | 牧原股份 | 618,675 | 37,627,813.50 | 0.74 |
| 30 | 600809 | 山西汾酒 | 81,729 | 36,614,592.00 | 0.72 |
| 31 | 300122 | 智飞生物 | 188,100 | 35,123,913.00 | 0.69 |
| 32 | 601919 | 中远海控 | 1,137,340 | 34,734,363.60 | 0.68 |
| 33 | 002142 | 宁波银行 | 847,308 | 33,019,592.76 | 0.65 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 34 | 600436 | 片仔癀 | 70,700 | 31,694,810.00 | 0.62 |
| 35 | 601328 | 交通银行 | 6,455,600 | 31,632,440.00 | 0.62 |
| 36 | 601899 | 紫金矿业 | 3,247,500 | 31,468,275.00 | 0.62 |
| 37 | 002304 | 洋河股份 | 142,000 | 29,422,400.00 | 0.58 |
| 38 | 002812 | 恩捷股份 | 125,500 | 29,379,550.00 | 0.58 |
| 39 | 002352 | 顺丰控股 | 428,677 | 29,021,432.90 | 0.57 |
| 40 | 002230 | 科大讯飞 | 418,300 | 28,268,714.00 | 0.55 |
| 41 | 300014 | 亿纬锂能 | 266,191 | 27,665,230.63 | 0.54 |
| 42 | 300274 | 阳光电源 | 240,000 | 27,614,400.00 | 0.54 |
| 43 | 600000 | 浦发银行 | 2,759,672 | 27,596,720.00 | 0.54 |
| 44 | 600438 | 通威股份 | 635,600 | 27,502,412.00 | 0.54 |
| 45 | 300124 | 汇川技术 | 363,495 | 26,993,138.70 | 0.53 |
| 46 | 600837 | 海通证券 | 2,269,300 | 26,096,950.00 | 0.51 |
| 47 | 000661 | 长春高新 | 66,400 | 25,696,800.00 | 0.50 |
| 48 | 000100 | TCL 科技 | 3,298,100 | 25,230,465.00 | 0.50 |
| 49 | 601816 | 京沪高铁 | 4,615,200 | 24,414,408.00 | 0.48 |
| 50 | 002241 | 歌尔股份 | 562,368 | 24,035,608.32 | 0.47 |
| 51 | 300347 | 泰格医药 | 123,401 | 23,853,413.30 | 0.47 |
| 52 | 000063 | 中兴通讯 | 726,100 | 23,789,503.00 | 0.47 |
| 53 | 603986 | 兆易创新 | 125,282 | 23,540,487.80 | 0.46 |
| 54 | 601601 | 中国太保 | 803,800 | 23,286,086.00 | 0.46 |
| 55 | 600585 | 海螺水泥 | 564,959 | 23,191,566.95 | 0.46 |
| 56 | 600690 | 海尔智家 | 890,420 | 23,070,782.20 | 0.45 |
| 57 | 002271 | 东方雨虹 | 415,164 | 22,966,872.48 | 0.45 |
| 58 | 601668 | 中国建筑 | 4,927,700 | 22,913,805.00 | 0.45 |
| 59 | 002460 | 赣锋锂业 | 188,899 | 22,873,779.91 | 0.45 |
| 60 | 603799 | 华友钴业 | 199,476 | 22,780,159.20 | 0.45 |
| 61 | 002027 | 分众传媒 | 2,416,700 | 22,741,147.00 | 0.45 |
| 62 | 300142 | 沃森生物 | 367,876 | 22,697,949.20 | 0.45 |
| 63 | 600016 | 民生银行 | 5,005,500 | 22,074,255.00 | 0.43 |
| 64 | 600763 | 通策医疗 | 52,350 | 21,515,850.00 | 0.42 |
| 65 | 601288 | 农业银行 | 6,756,500 | 20,472,195.00 | 0.40 |
| 66 | 600196 | 复星医药 | 283,500 | 20,448,855.00 | 0.40 |
| 67 | 600048 | 保利地产 | 1,690,683 | 20,355,823.32 | 0.40 |
| 68 | 600703 | 三安光电 | 631,600 | 20,242,780.00 | 0.40 |
| 69 | 000338 | 潍柴动力 | 1,115,600 | 19,935,772.00 | 0.39 |
| 70 | 600919 | 江苏银行 | 2,775,600 | 19,706,760.00 | 0.39 |
| 71 | 002129 | 中环股份 | 499,396 | 19,276,685.60 | 0.38 |
| 72 | 601229 | 上海银行 | 2,340,234 | 19,189,918.80 | 0.38 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 73 | 601688 | 华泰证券 | 1,210,000 | 19,118,000.00 | 0.38 |
| 74 | 600050 | 中国联通 | 4,377,500 | 18,910,800.00 | 0.37 |
| 75 | 600660 | 福耀玻璃 | 329,745 | 18,416,258.25 | 0.36 |
| 76 | 600570 | 恒生电子 | 196,157 | 18,291,640.25 | 0.36 |
| 77 | 601211 | 国泰君安 | 1,060,200 | 18,171,828.00 | 0.36 |
| 78 | 600104 | 上汽集团 | 824,900 | 18,123,053.00 | 0.36 |
| 79 | 601766 | 中国中车 | 2,856,530 | 17,367,702.40 | 0.34 |
| 80 | 688111 | 金山办公 | 43,600 | 17,213,280.00 | 0.34 |
| 81 | 601169 | 北京银行 | 3,483,700 | 16,965,619.00 | 0.33 |
| 82 | 600999 | 招商证券 | 871,780 | 16,581,255.60 | 0.33 |
| 83 | 002371 | 北方华创 | 57,935 | 16,070,010.30 | 0.32 |
| 84 | 600019 | 宝钢股份 | 2,093,100 | 15,991,284.00 | 0.31 |
| 85 | 002311 | 海大集团 | 195,290 | 15,935,664.00 | 0.31 |
| 86 | 002049 | 紫光国微 | 100,000 | 15,419,000.00 | 0.30 |
| 87 | 601988 | 中国银行 | 4,952,200 | 15,252,776.00 | 0.30 |
| 88 | 002410 | 广联达 | 223,253 | 15,225,854.60 | 0.30 |
| 89 | 601088 | 中国神华 | 776,600 | 15,159,232.00 | 0.30 |
| 90 | 600406 | 国电南瑞 | 652,200 | 15,157,128.00 | 0.30 |
| 91 | 300498 | 温氏股份 | 1,047,645 | 15,054,658.65 | 0.30 |
| 92 | 601818 | 光大银行 | 3,891,100 | 14,708,358.00 | 0.29 |
| 93 | 300601 | 康泰生物 | 96,775 | 14,419,475.00 | 0.28 |
| 94 | 000625 | 长安汽车 | 533,464 | 14,019,433.92 | 0.28 |
| 95 | 000538 | 云南白药 | 120,165 | 13,905,493.80 | 0.27 |
| 96 | 600745 | 闻泰科技 | 146,617 | 13,749,027.30 | 0.27 |
| 97 | 600028 | 中国石化 | 3,148,220 | 13,726,239.20 | 0.27 |
| 98 | 600893 | 航发动力 | 251,200 | 13,361,328.00 | 0.26 |
| 99 | 300450 | 先导智能 | 220,500 | 13,260,870.00 | 0.26 |
| 100 | 601628 | 中国人寿 | 390,800 | 13,244,212.00 | 0.26 |
| 101 | 600346 | 恒力石化 | 495,700 | 13,007,168.00 | 0.26 |
| 102 | 002821 | 凯莱英 | 34,500 | 12,854,700.00 | 0.25 |
| 103 | 601658 | 邮储银行 | 2,555,400 | 12,828,108.00 | 0.25 |
| 104 | 600588 | 用友网络 | 383,924 | 12,769,312.24 | 0.25 |
| 105 | 601390 | 中国中铁 | 2,391,500 | 12,531,460.00 | 0.25 |
| 106 | 601633 | 长城汽车 | 287,000 | 12,510,330.00 | 0.25 |
| 107 | 300595 | 欧普康视 | 120,108 | 12,437,183.40 | 0.24 |
| 108 | 601009 | 南京银行 | 1,177,923 | 12,391,749.96 | 0.24 |
| 109 | 002493 | 荣盛石化 | 712,885 | 12,311,523.95 | 0.24 |
| 110 | 601377 | 兴业证券 | 1,257,600 | 12,148,416.00 | 0.24 |
| 111 | 601857 | 中国石油 | 2,285,400 | 12,089,766.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 112 | 688036 | 传音控股 | 56,900 | 11,920,550.00 | 0.23 |
| 113 | 300413 | 芒果超媒 | 167,011 | 11,456,954.60 | 0.22 |
| 114 | 600132 | 重庆啤酒 | 56,500 | 11,184,175.00 | 0.22 |
| 115 | 601225 | 陕西煤业 | 940,700 | 11,147,295.00 | 0.22 |
| 116 | 600584 | 长电科技 | 292,278 | 11,013,035.04 | 0.22 |
| 117 | 002601 | 龙蟠佰利 | 316,220 | 10,934,887.60 | 0.21 |
| 118 | 600009 | 上海机场 | 226,845 | 10,918,049.85 | 0.21 |
| 119 | 300408 | 三环集团 | 256,533 | 10,882,129.86 | 0.21 |
| 120 | 600426 | 华鲁恒升 | 348,700 | 10,792,265.00 | 0.21 |
| 121 | 600111 | 北方稀土 | 511,400 | 10,585,980.00 | 0.21 |
| 122 | 601100 | 恒立液压 | 122,988 | 10,567,128.96 | 0.21 |
| 123 | 601939 | 建设银行 | 1,582,300 | 10,522,295.00 | 0.21 |
| 124 | 000776 | 广发证券 | 694,700 | 10,517,758.00 | 0.21 |
| 125 | 688012 | 中微公司 | 63,200 | 10,486,144.00 | 0.21 |
| 126 | 002001 | 新和成 | 362,700 | 10,402,236.00 | 0.20 |
| 127 | 603882 | 金域医学 | 65,000 | 10,385,050.00 | 0.20 |
| 128 | 000895 | 双汇发展 | 325,500 | 10,350,900.00 | 0.20 |
| 129 | 300433 | 蓝思科技 | 351,486 | 10,337,203.26 | 0.20 |
| 130 | 600926 | 杭州银行 | 697,400 | 10,286,650.00 | 0.20 |
| 131 | 002179 | 中航光电 | 129,377 | 10,223,370.54 | 0.20 |
| 132 | 002050 | 三花智控 | 421,510 | 10,107,809.80 | 0.20 |
| 133 | 000166 | 申万宏源 | 2,123,600 | 9,938,448.00 | 0.19 |
| 134 | 600958 | 东方证券 | 983,100 | 9,821,169.00 | 0.19 |
| 135 | 600741 | 华域汽车 | 371,170 | 9,750,635.90 | 0.19 |
| 136 | 002841 | 视源股份 | 78,400 | 9,744,336.00 | 0.19 |
| 137 | 600600 | 青岛啤酒 | 83,032 | 9,602,650.80 | 0.19 |
| 138 | 300003 | 乐普医疗 | 296,600 | 9,526,792.00 | 0.19 |
| 139 | 002007 | 华兰生物 | 258,487 | 9,481,303.16 | 0.19 |
| 140 | 000963 | 华东医药 | 205,600 | 9,459,656.00 | 0.19 |
| 141 | 000786 | 北新建材 | 238,218 | 9,350,056.50 | 0.18 |
| 142 | 000157 | 中联重科 | 998,900 | 9,229,836.00 | 0.18 |
| 143 | 601006 | 大秦铁路 | 1,395,901 | 9,185,028.58 | 0.18 |
| 144 | 603806 | 福斯特 | 86,500 | 9,093,745.00 | 0.18 |
| 145 | 601901 | 方正证券 | 969,300 | 9,072,648.00 | 0.18 |
| 146 | 601336 | 新华保险 | 196,300 | 9,012,133.00 | 0.18 |
| 147 | 601799 | 星宇股份 | 39,900 | 9,006,228.00 | 0.18 |
| 148 | 002607 | 中公教育 | 435,100 | 8,997,239.00 | 0.18 |
| 149 | 600029 | 南方航空 | 1,494,100 | 8,994,482.00 | 0.18 |
| 150 | 600015 | 华夏银行 | 1,451,200 | 8,982,928.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 151 | 002236 | 大华股份 | 422,659 | 8,918,104.90 | 0.17 |
| 152 | 600143 | 金发科技 | 424,800 | 8,861,328.00 | 0.17 |
| 153 | 601989 | 中国重工 | 2,148,404 | 8,851,424.48 | 0.17 |
| 154 | 601155 | 新城控股 | 212,101 | 8,823,401.60 | 0.17 |
| 155 | 600176 | 中国巨石 | 565,696 | 8,773,944.96 | 0.17 |
| 156 | 601138 | 工业富联 | 702,500 | 8,718,025.00 | 0.17 |
| 157 | 000768 | 中航西飞 | 326,086 | 8,569,540.08 | 0.17 |
| 158 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,658,000 | 8,555,280.00 | 0.17 |
| 159 | 601877 | 正泰电器 | 253,350 | 8,456,823.00 | 0.17 |
| 160 | 600760 | 中航沈飞 | 138,380 | 8,344,314.00 | 0.16 |
| 161 | 600352 | 浙江龙盛 | 611,100 | 8,327,714.00 | 0.16 |
| 162 | 600010 | 包钢股份 | 5,368,300 | 8,320,865.00 | 0.16 |
| 163 | 601788 | 光大证券 | 458,900 | 8,209,721.00 | 0.16 |
| 164 | 001979 | 招商蛇口 | 744,658 | 8,154,005.10 | 0.16 |
| 165 | 600547 | 山东黄金 | 424,212 | 8,153,354.64 | 0.16 |
| 166 | 300529 | 健帆生物 | 94,403 | 8,152,643.08 | 0.16 |
| 167 | 601600 | 中国铝业 | 1,536,700 | 8,144,510.00 | 0.16 |
| 168 | 002008 | 大族激光 | 201,111 | 8,122,873.29 | 0.16 |
| 169 | 601186 | 中国铁建 | 1,082,100 | 8,040,003.00 | 0.16 |
| 170 | 603369 | 今世缘 | 147,618 | 7,994,990.88 | 0.16 |
| 171 | 688169 | 石头科技 | 6,300 | 7,944,300.00 | 0.16 |
| 172 | 002202 | 金风科技 | 651,164 | 7,918,154.24 | 0.16 |
| 173 | 601916 | 浙商银行 | 1,967,000 | 7,808,990.00 | 0.15 |
| 174 | 000876 | 新希望 | 528,608 | 7,754,679.36 | 0.15 |
| 175 | 003816 | 中国广核 | 2,770,101 | 7,396,169.67 | 0.15 |
| 176 | 000938 | 紫光股份 | 336,599 | 7,364,786.12 | 0.14 |
| 177 | 603899 | 晨光文具 | 86,942 | 7,351,815.52 | 0.14 |
| 178 | 002555 | 三七互娱 | 313,800 | 7,337,976.00 | 0.14 |
| 179 | 002736 | 国信证券 | 677,256 | 7,280,502.00 | 0.14 |
| 180 | 601066 | 中信建投 | 229,100 | 7,200,613.00 | 0.14 |
| 181 | 600109 | 国金证券 | 567,300 | 7,199,037.00 | 0.14 |
| 182 | 000069 | 华侨城 A | 963,200 | 7,166,208.00 | 0.14 |
| 183 | 600989 | 宝丰能源 | 516,900 | 7,071,192.00 | 0.14 |
| 184 | 300136 | 信维通信 | 228,086 | 7,043,295.68 | 0.14 |
| 185 | 000425 | 徐工机械 | 1,105,400 | 7,041,398.00 | 0.14 |
| 186 | 600150 | 中国船舶 | 422,200 | 6,970,522.00 | 0.14 |
| 187 | 601669 | 中国电建 | 1,793,733 | 6,941,746.71 | 0.14 |
| 188 | 603160 | 汇顶科技 | 53,495 | 6,934,556.85 | 0.14 |
| 189 | 603659 | 璞泰来 | 49,579 | 6,772,491.40 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 190 | 000977 | 浪潮信息 | 239,728 | 6,743,548.64 | 0.13 |
| 191 | 600795 | 国电电力 | 2,771,600 | 6,734,988.00 | 0.13 |
| 192 | 002384 | 东山精密 | 321,600 | 6,702,144.00 | 0.13 |
| 193 | 688008 | 澜起科技 | 107,100 | 6,680,898.00 | 0.13 |
| 194 | 000783 | 长江证券 | 910,600 | 6,665,592.00 | 0.13 |
| 195 | 601238 | 广汽集团 | 511,900 | 6,629,105.00 | 0.13 |
| 196 | 603019 | 中科曙光 | 239,040 | 6,599,894.40 | 0.13 |
| 197 | 600085 | 同仁堂 | 161,153 | 6,583,100.05 | 0.13 |
| 198 | 000596 | 古井贡酒 | 27,300 | 6,538,350.00 | 0.13 |
| 199 | 600079 | 人福医药 | 230,900 | 6,527,543.00 | 0.13 |
| 200 | 002624 | 完美世界 | 272,704 | 6,520,352.64 | 0.13 |
| 201 | 601838 | 成都银行 | 511,000 | 6,459,040.00 | 0.13 |
| 202 | 300677 | 英科医疗 | 51,400 | 6,414,720.00 | 0.13 |
| 203 | 600183 | 生益科技 | 270,000 | 6,320,700.00 | 0.12 |
| 204 | 600886 | 国投电力 | 657,188 | 6,315,576.68 | 0.12 |
| 205 | 300558 | 贝达药业 | 57,900 | 6,267,096.00 | 0.12 |
| 206 | 601985 | 中国核电 | 1,235,400 | 6,251,124.00 | 0.12 |
| 207 | 000703 | 恒逸石化 | 521,140 | 6,227,623.00 | 0.12 |
| 208 | 601108 | 财通证券 | 590,900 | 6,198,541.00 | 0.12 |
| 209 | 300144 | 宋城演艺 | 368,617 | 6,192,765.60 | 0.12 |
| 210 | 002600 | 领益智造 | 666,200 | 6,122,378.00 | 0.12 |
| 211 | 603833 | 欧派家居 | 43,080 | 6,115,636.80 | 0.12 |
| 212 | 002414 | 高德红外 | 220,502 | 6,081,445.16 | 0.12 |
| 213 | 601555 | 东吴证券 | 728,440 | 6,075,189.60 | 0.12 |
| 214 | 603517 | 绝味食品 | 72,000 | 6,068,880.00 | 0.12 |
| 215 | 000066 | 中国长城 | 414,600 | 6,053,160.00 | 0.12 |
| 216 | 601360 | 三六零 | 512,200 | 5,978,962.00 | 0.12 |
| 217 | 002252 | 上海莱士 | 792,200 | 5,933,578.00 | 0.12 |
| 218 | 002044 | 美年健康 | 645,300 | 5,878,683.00 | 0.12 |
| 219 | 002938 | 鹏鼎控股 | 162,989 | 5,848,045.32 | 0.11 |
| 220 | 300676 | 华大基因 | 49,100 | 5,823,260.00 | 0.11 |
| 221 | 601077 | 渝农商行 | 1,455,500 | 5,807,445.00 | 0.11 |
| 222 | 600522 | 中天科技 | 575,600 | 5,756,000.00 | 0.11 |
| 223 | 300033 | 同花顺 | 50,915 | 5,742,193.70 | 0.11 |
| 224 | 000728 | 国元证券 | 717,880 | 5,721,503.60 | 0.11 |
| 225 | 601607 | 上海医药 | 270,058 | 5,706,325.54 | 0.11 |
| 226 | 688396 | 华润微 | 62,300 | 5,670,546.00 | 0.11 |
| 227 | 600332 | 白云山 | 164,400 | 5,564,940.00 | 0.11 |
| 228 | 002602 | 世纪华通 | 878,000 | 5,521,560.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 229 | 600161 | 天坛生物 | 161,180 | 5,520,415.00 | 0.11 |
| 230 | 600872 | 中炬高新 | 131,300 | 5,517,226.00 | 0.11 |
| 231 | 600362 | 江西铜业 | 245,100 | 5,485,338.00 | 0.11 |
| 232 | 601111 | 中国国航 | 704,414 | 5,480,340.92 | 0.11 |
| 233 | 600383 | 金地集团 | 529,716 | 5,424,291.84 | 0.11 |
| 234 | 601800 | 中国交建 | 828,815 | 5,370,721.20 | 0.11 |
| 235 | 600115 | 中国东航 | 1,051,500 | 5,341,620.00 | 0.10 |
| 236 | 600845 | 宝信软件 | 104,920 | 5,340,428.00 | 0.10 |
| 237 | 300628 | 亿联网络 | 63,139 | 5,291,048.20 | 0.10 |
| 238 | 002508 | 老板电器 | 111,600 | 5,189,400.00 | 0.10 |
| 239 | 002916 | 深南电路 | 46,427 | 5,159,432.51 | 0.10 |
| 240 | 000860 | 顺鑫农业 | 121,700 | 5,133,306.00 | 0.10 |
| 241 | 600061 | 国投资本 | 602,449 | 5,114,792.01 | 0.10 |
| 242 | 601727 | 上海电气 | 1,206,190 | 5,114,245.60 | 0.10 |
| 243 | 601618 | 中国中冶 | 1,672,500 | 4,984,050.00 | 0.10 |
| 244 | 601162 | 天风证券 | 1,018,300 | 4,948,938.00 | 0.10 |
| 245 | 000708 | 中信特钢 | 236,600 | 4,930,744.00 | 0.10 |
| 246 | 002024 | 苏宁易购 | 881,100 | 4,925,349.00 | 0.10 |
| 247 | 601021 | 春秋航空 | 86,300 | 4,910,470.00 | 0.10 |
| 248 | 600705 | 中航资本 | 1,259,500 | 4,874,265.00 | 0.10 |
| 249 | 601878 | 浙商证券 | 365,700 | 4,783,356.00 | 0.09 |
| 250 | 688363 | 华熙生物 | 17,200 | 4,779,192.00 | 0.09 |
| 251 | 603939 | 益丰药房 | 84,070 | 4,715,486.30 | 0.09 |
| 252 | 600606 | 绿地控股 | 857,300 | 4,672,285.00 | 0.09 |
| 253 | 601990 | 南京证券 | 434,600 | 4,571,992.00 | 0.09 |
| 254 | 002456 | 欧菲光 | 506,100 | 4,494,168.00 | 0.09 |
| 255 | 002157 | 正邦科技 | 369,900 | 4,420,305.00 | 0.09 |
| 256 | 002463 | 沪电股份 | 284,100 | 4,395,027.00 | 0.09 |
| 257 | 600011 | 华能国际 | 1,031,200 | 4,351,664.00 | 0.09 |
| 258 | 000656 | 金科股份 | 749,464 | 4,339,396.56 | 0.09 |
| 259 | 600521 | 华海药业 | 204,900 | 4,278,312.00 | 0.08 |
| 260 | 601933 | 永辉超市 | 897,828 | 4,246,726.44 | 0.08 |
| 261 | 600655 | 豫园股份 | 364,400 | 4,223,396.00 | 0.08 |
| 262 | 603392 | 万泰生物 | 15,840 | 4,105,411.20 | 0.08 |
| 263 | 600118 | 中国卫星 | 139,300 | 4,075,918.00 | 0.08 |
| 264 | 601216 | 君正集团 | 797,300 | 4,058,257.00 | 0.08 |
| 265 | 601696 | 中银证券 | 196,400 | 4,043,876.00 | 0.08 |
| 266 | 600848 | 上海临港 | 224,060 | 4,010,674.00 | 0.08 |
| 267 | 600489 | 中金黄金 | 453,700 | 3,910,894.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 268 | 600018 | 上港集团 | 815,200 | 3,888,504.00 | 0.08 |
| 269 | 002558 | 巨人网络 | 284,100 | 3,778,530.00 | 0.07 |
| 270 | 601995 | 中金公司 | 61,300 | 3,769,950.00 | 0.07 |
| 271 | 603195 | 公牛集团 | 18,500 | 3,737,000.00 | 0.07 |
| 272 | 002120 | 韵达股份 | 271,660 | 3,675,559.80 | 0.07 |
| 273 | 601998 | 中信银行 | 720,100 | 3,672,510.00 | 0.07 |
| 274 | 601872 | 招商轮船 | 760,000 | 3,511,200.00 | 0.07 |
| 275 | 002673 | 西部证券 | 421,500 | 3,477,375.00 | 0.07 |
| 276 | 601319 | 中国人保 | 585,500 | 3,472,015.00 | 0.07 |
| 277 | 688009 | 中国通号 | 604,600 | 3,440,174.00 | 0.07 |
| 278 | 688126 | 沪硅产业 | 116,800 | 3,408,224.00 | 0.07 |
| 279 | 603338 | 浙江鼎力 | 57,100 | 3,351,199.00 | 0.07 |
| 280 | 002739 | 万达电影 | 210,800 | 3,328,532.00 | 0.07 |
| 281 | 601881 | 中国银河 | 302,004 | 3,255,603.12 | 0.06 |
| 282 | 603658 | 安图生物 | 41,650 | 3,155,820.50 | 0.06 |
| 283 | 600233 | 圆通速递 | 297,300 | 2,975,973.00 | 0.06 |
| 284 | 603233 | 大参林 | 55,100 | 2,816,161.00 | 0.06 |
| 285 | 600482 | 中国动力 | 153,100 | 2,667,002.00 | 0.05 |
| 286 | 601231 | 环旭电子 | 154,456 | 2,596,405.36 | 0.05 |
| 287 | 002153 | 石基信息 | 105,590 | 2,482,420.90 | 0.05 |
| 288 | 600025 | 华能水电 | 424,400 | 2,457,276.00 | 0.05 |
| 289 | 002032 | 苏泊尔 | 38,400 | 2,449,536.00 | 0.05 |
| 290 | 002939 | 长城证券 | 219,000 | 2,437,470.00 | 0.05 |
| 291 | 600340 | 华夏幸福 | 461,120 | 2,416,268.80 | 0.05 |
| 292 | 000800 | 一汽解放 | 219,100 | 2,370,662.00 | 0.05 |
| 293 | 601236 | 红塔证券 | 171,100 | 2,320,116.00 | 0.05 |
| 294 | 002773 | 康弘药业 | 87,396 | 2,021,469.48 | 0.04 |
| 295 | 601808 | 中海油服 | 139,700 | 2,006,092.00 | 0.04 |
| 296 | 600918 | 中泰证券 | 177,813 | 1,923,936.66 | 0.04 |
| 297 | 601698 | 中国卫通 | 102,400 | 1,657,856.00 | 0.03 |
| 298 | 603087 | 甘李药业 | 14,600 | 1,556,068.00 | 0.03 |
| 299 | 600299 | 安迪苏 | 92,700 | 1,108,692.00 | 0.02 |
| 300 | 002945 | 华林证券 | 64,400 | 890,008.00 | 0.02 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 1 | 688696 | 极米科技 | 1,252 | 976,860.48 | 0.02 |
| 2 | 688425 | 铁建重工 | 135,282 | 642,589.50 | 0.01 |
| 3 | 300957 | 贝泰妮 | 853 | 214,921.88 | 0.00 |
| 4 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 99,430.00 | 0.00 |
| 5 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.00 |
| 6 | 300979 | 华利集团 | 925 | 80,937.50 | 0.00 |
| 7 | 688468 | 科美诊断 | 3,919 | 64,663.50 | 0.00 |
| 8 | 688217 | 睿昂基因 | 1,040 | 60,736.00 | 0.00 |
| 9 | 688328 | 深科达 | 1,499 | 56,647.21 | 0.00 |
| 10 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.00 |
| 11 | 300894 | 火星人 | 628 | 42,704.00 | 0.00 |
| 12 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.00 |
| 13 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 14 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 15 | 300941 | 创识科技 | 399 | 19,926.06 | 0.00 |
| 16 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 17 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 18 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 19 | 301013 | 利和兴 | 471 | 12,768.81 | 0.00 |
| 20 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 21 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 22 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 23 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 24 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 25 | 300955 | 嘉亨家化 | 232 | 10,688.24 | 0.00 |
| 26 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 27 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.00 |
| 28 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 29 | 300931 | 通用电梯 | 672 | 8,809.92 | 0.00 |
| 30 | 300961 | 深水海纳 | 394 | 8,695.58 | 0.00 |
| 31 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 32 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 33 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 34 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 35 | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 36 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 37 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 38 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 39 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 40 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 41 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 42 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 43 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 44 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 45 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 46 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |

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 | 000858 | 五粮液 | 144,555,986.35 | 2.00 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 104,150,638.47 | 1.44 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 71,175,613.12 | 0.98 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 70,277,836.08 | 0.97 |
| 5 | 002415 | 海康威视 | 61,495,172.35 | 0.85 |
| 6 | 002714 | 牧原股份 | 54,440,379.91 | 0.75 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 54,362,964.77 | 0.75 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 53,136,880.27 | 0.73 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 51,578,770.60 | 0.71 |
| 10 | 000002 | 万科 A | 49,750,136.51 | 0.69 |
| 11 | 000725 | 京东方 A | 48,386,277.00 | 0.67 |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 46,520,897.95 | 0.64 |
| 13 | 300122 | 智飞生物 | 44,742,176.00 | 0.62 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 40,839,457.91 | 0.56 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 36,390,857.10 | 0.50 |
| 16 | 002352 | 顺丰控股 | 36,156,390.04 | 0.50 |
| 17 | 300015 | 爱尔眼科 | 34,556,511.08 | 0.48 |
| 18 | 002142 | 宁波银行 | 31,516,906.88 | 0.44 |
| 19 | 000100 | TCL 科技 | 30,013,765.00 | 0.41 |
| 20 | 300124 | 汇川技术 | 29,929,252.51 | 0.41 |

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|----------------|-----------------|
| 1 | 000858 | 五粮液 | 218,959,129.38 | 3.03 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 163,448,566.21 | 2.26 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 106,971,250.77 | 1.48 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 85,925,878.24 | 1.19 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 79,383,979.77 | 1.10 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 77,069,322.66 | 1.06 |
| 7 | 002714 | 牧原股份 | 75,820,328.71 | 1.05 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 75,253,897.41 | 1.04 |
| 9 | 000002 | 万科 A | 74,366,302.40 | 1.03 |
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 68,336,587.20 | 0.94 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 68,241,682.86 | 0.94 |
| 12 | 000725 | 京东方 A | 60,289,624.48 | 0.83 |
| 13 | 002352 | 顺丰控股 | 58,323,843.14 | 0.81 |
| 14 | 300122 | 智飞生物 | 50,613,799.60 | 0.70 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 46,864,737.97 | 0.65 |
| 16 | 000100 | TCL 科技 | 44,888,685.72 | 0.62 |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能 | 42,912,291.48 | 0.59 |
| 18 | 300124 | 汇川技术 | 42,729,872.54 | 0.59 |
| 19 | 300015 | 爱尔眼科 | 41,796,222.64 | 0.58 |
| 20 | 002142 | 宁波银行 | 40,353,712.75 | 0.56 |

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,701,200,888.25 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,462,934,460.94 |

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

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

(3) 不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,663,748.62 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,663,748.62 | 0.07 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 113050 | 南银转债 | 27,350 | 2,735,000.00 | 0.05 |
| 2 | 127036 | 三花转债 | 2,938 | 384,848.62 | 0.01 |
| 3 | 127038 | 国微转债 | 2,709 | 270,900.00 | 0.01 |
| 4 | 113049 | 长汽转债 | 1,570 | 157,000.00 | 0.00 |
| 5 | 123117 | 健帆转债 | 1,160 | 116,000.00 | 0.00 |

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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

7.10.1 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 |
|-------------------|-------------------|----------|---------------|--------------|---------------|
| IF2109 | 沪深 300 期货 2109 合约 | 36 | 55,797,120.00 | 1,004,520.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 1,004,520.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 13,803,498.06 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -7,412,763.00 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.10.2 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。

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

兴业银行股份有限公司因同业投资用途不合规等原因在本报告编制前一年内受到福建银保监局的行政处罚，因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定在本报告编制前一年内受到中国人民银行福州中心支行的行政处罚，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等行为在本报告编制前一年内受到中国人民银行的行政处罚。

招商银行股份有限公司因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺等原因在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

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

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 | 8,428,874.07 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,377,926.40 |
| 3 | 应收股利 | 576,329.90 |
| 4 | 应收利息 | 216,221.58 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,599,351.95 |

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

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 | 002415 | 海康威视 | 17,808,450.00 | 0.35 | 转融通证券出借 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 17,662,725.00 | 0.35 | 转融通证券出借 |
| 3 | 601888 | 中国中免 | 17,225,740.00 | 0.34 | 转融通证券出借 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 14,929,345.00 | 0.29 | 转融通证券出借 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 12,917,336.00 | 0.25 | 转融通证券出借 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 8,072,819.00 | 0.16 | 转融通证券出借 |

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

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 | 688696 | 极米科技 | 976,860.48 | 0.02 | 新股锁定期流通受限 |
| 2 | 688425 | 铁建重工 | 642,589.50 | 0.01 | 新股锁定期流通受限 |
| 3 | 300957 | 贝泰妮 | 214,921.88 | 0.00 | 新股锁定期流通受限 |
| 4 | 688499 | 利元亨 | 83,488.65 | 0.00 | 网下新股流通受限 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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 |
| 2,652 | 357,051.21 | 941,781,179.00 | 99.46% | 5,118,635.00 | 0.54% |

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 项目 | 持有份额（份） | 占总份额比例 |
|--------------------------------------|---------------|--------|
| 招商银行股份有限公司－泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 12,445,986.00 | 1.31% |

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“招商银行股份有限公司－泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金”持有的份额。

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|--------------------------------------|----------------|----------|
| 1 | 泰康人寿保险有限责任公司－个人分红产品 | 628,349,466.00 | 66.36% |
| 2 | 泰康人寿保险有限责任公司－传统保险产品 | 144,042,647.00 | 15.21% |
| 3 | 泰康人寿保险有限责任公司－分红型保险产品 | 90,400,269.00 | 9.55% |
| 4 | 广发证券股份有限公司 | 9,901,246.00 | 1.05% |
| 5 | 中信证券股份有限公司融券专用证券账户 | 9,429,000.00 | 1.00% |
| 6 | 国泰君安证券股份有限公司 | 7,781,286.00 | 0.82% |
| 7 | 华泰证券股份有限公司 | 5,428,800.00 | 0.57% |
| 8 | 华融证券股份有限公司 | 4,000,000.00 | 0.42% |
| 9 | 中信建投证券股份有限公司融券专用证券账户 | 3,880,000.00 | 0.41% |
| 10 | 招商证券股份有限公司 | 3,613,097.00 | 0.38% |
| 11 | 招商银行股份有限公司－泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 12,445,986.00 | 1.31% |

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00 | 0.0000% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 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 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 12 月 27 日）基金份额总额 | 7,160,604,619.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,360,899,814.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 853,200,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,267,200,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 946,899,814.00 |

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金“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 | |
| 华泰证券 | 4 | 2,458,379,940.25 | 39.97% | 642,384.71 | 39.39% | - |
| 中信建投 | 4 | 1,914,424,847.13 | 31.12% | 500,250.83 | 30.68% | - |

| | | | | | | |
|------|---|------------------|--------|------------|--------|---|
| 中信证券 | 2 | 1,213,430,644.18 | 19.73% | 332,656.59 | 20.40% | - |
| 申万宏源 | 4 | 439,346,441.73 | 7.14% | 120,418.64 | 7.38% | - |
| 中金公司 | 2 | 47,565,840.00 | 0.77% | 13,672.53 | 0.84% | - |
| 光大证券 | 4 | 40,168,883.08 | 0.65% | 10,998.54 | 0.67% | - |
| 开源证券 | 2 | 37,593,247.03 | 0.61% | 10,314.99 | 0.63% | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 4 | - | - | - | - | - |

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

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

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

3、本报告期内本基金新增租用 4 个交易单元，为光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

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 |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 9,340,303.50 | 51.76% | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 8,705,335.62 | 48.24% | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

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 |
| 2 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通为销售机构并参加其费 | 《中国证券报》;《上海证券报》;《证券日报》;《证券时报》; | 2021年1月22日 |

| | | | |
|---|--|---|------------|
| | 率优惠活动的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | |
| 3 | 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 |
| 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 |
| 5 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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 |
| 6 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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 |
| 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 |
| 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 |
| 9 | 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 | 2021年3月19日 |

| | | | |
|----|--|---|------------|
| | | 管理人网站 | |
| 10 | 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 |
| 11 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增光大证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2021年4月26日 |
| 12 | 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 |
| 13 | 泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在济安财富（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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 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 |
| 17 | 关于泰康资产管理有限责任公司 | 《中国证券报》；《上 | 2021年5月21日 |

| | | | |
|----|---|---|------------|
| | 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 | 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 | |
| 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 |
| 19 | 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 |
| 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 |
| 21 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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 |
| 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 |
| 23 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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 |
| 24 | 关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年“香港特别行政区成立纪念日”期间不开放 | 《中国证券报》；《上海证券报》；《证券日报》；《证券时报》； | 2021年6月29日 |

| | | | |
|----|---|---|------------|
| | 申购赎回等交易类业务的提示性公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | |
| 25 | 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 |
| 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 |
| 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 | 808,033,466.00 | - | 179,684,000.00 | 628,349,466.00 | 66.36% |
| | 2 | 20210101~20210208 | 305,254,747.00 | - | 161,212,100.00 | 144,042,647.00 | 15.21% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p> | | | | | | | |

注：报告期期间基金申购份额含转换入、基金折算调增份额；基金赎回份额含转换出、基金折算调减份额。

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日