

# 泰康沪深 300 交易型开放式指数 证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19

6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>76</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	76
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	76
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	78
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	87
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	88
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	89
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	89
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	89
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	89
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	90
8.12 投资组合报告附注.....	90
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>92</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	92
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	92
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	92
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	93
9.5 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.....	93
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>94</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>95</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	95
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	95

---

11.4 基金投资策略的改变 .....	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	95
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	95
11.8 其他重大事件 .....	97
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>105</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	105
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	105
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>106</b>
13.1 备查文件目录 .....	106
13.2 存放地点 .....	106
13.3 查阅方式 .....	106

## § 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	950,499,814.00 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	本基金为混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎</p>

	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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	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。 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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊)	中国上海市浦东新区东育路 588 号

	普通合伙)	前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 12 月 27 日 (基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,157,980,471.72	928,887,763.17	890,463.67
本期利润	-10,249,912.45	2,128,784,960.69	4,080,249.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0110	0.9292	0.0006
本期加权平均净值利润率	-0.21%	27.44%	0.06%
本期基金份额净值增长率	-3.34%	29.46%	0.06%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	984,039,477.43	749,546,053.55	890,463.67
期末可供分配基金份额利润	1.0353	0.5508	0.0001
期末基金资产净值	4,885,979,559.57	7,236,931,353.89	7,164,684,868.67
期末基金份额净值	5.1404	5.3178	1.0006
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	25.22%	29.54%	0.06%

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

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

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

（4）本基金以 2020 年 2 月 12 日为折算日，进行了基金份额折算，折算情况参见《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》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结果的公告》。

### 3.2 基金净值表现

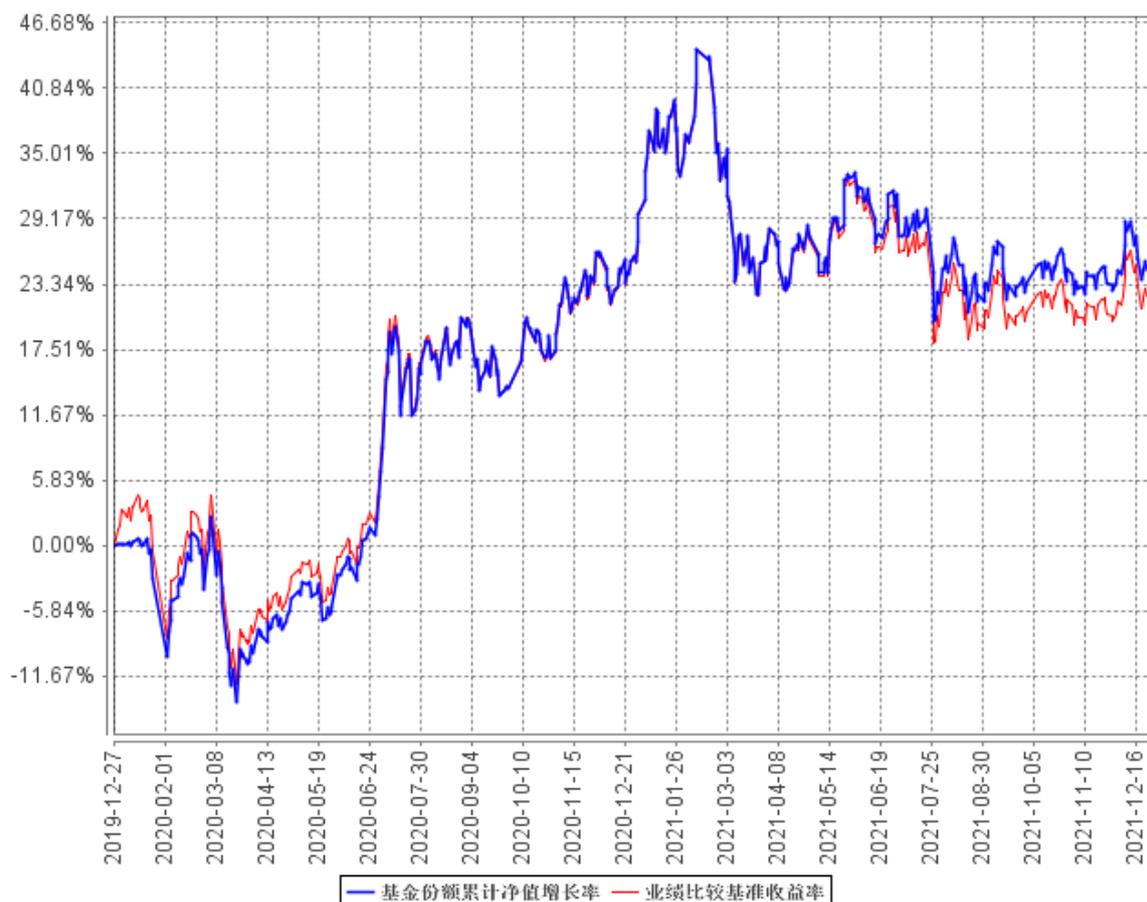
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.41%	0.79%	1.52%	0.79%	-0.11%	0.00%
过去六个月	-4.50%	1.02%	-5.43%	1.02%	0.93%	0.00%
过去一年	-3.34%	1.17%	-5.20%	1.17%	1.86%	0.00%

自基金合同生效起至今	25.22%	1.29%	22.71%	1.31%	2.51%	-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

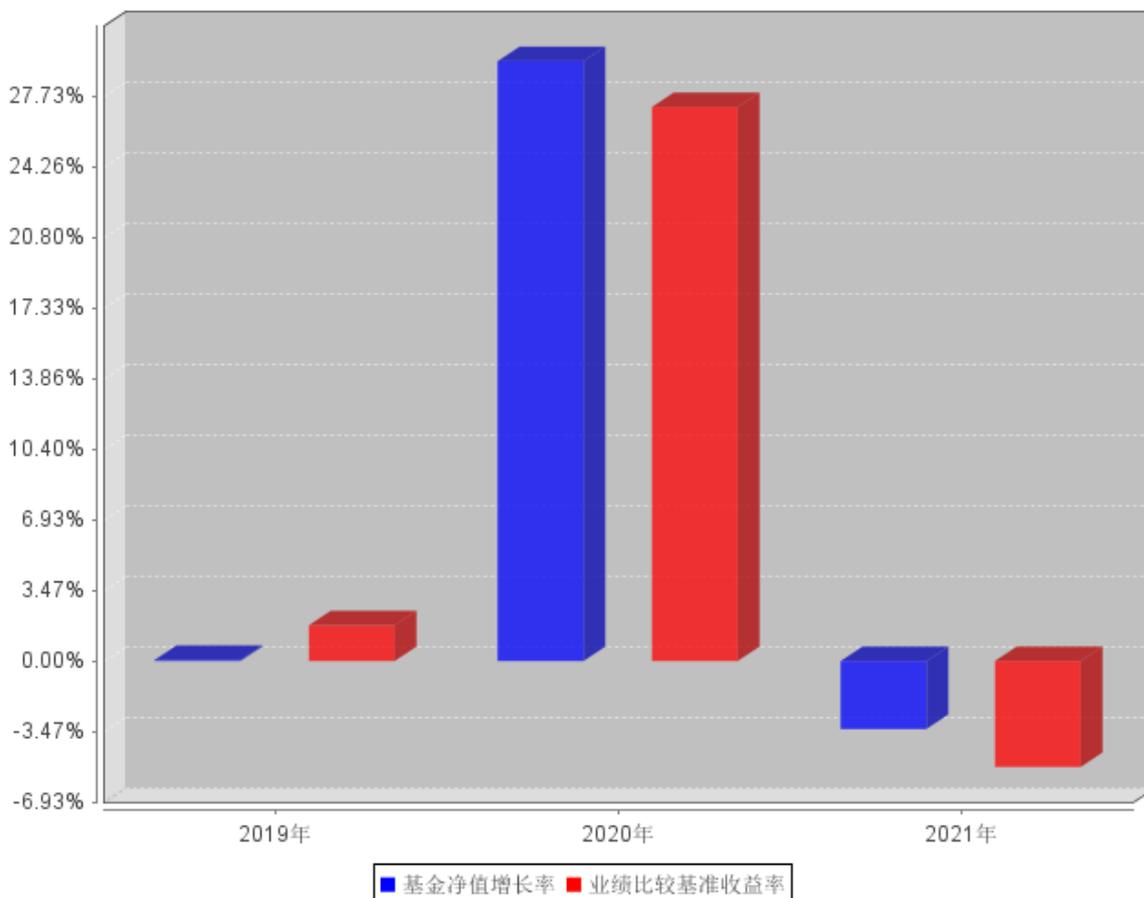


注：1、本基金基金合同于 2019 年 12 月 27 日生效。

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。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于2019年12月27日，2019年度净值增长率的计算期间为2019年12月27日至2019年12月31日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2019年12月27日)至报告期截止日(2021年12月31日)未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2021 年 12 月 31 日，公司管理资产总规模超过 27000 亿元，其中受托管理的第三方资产总规模近 17000 亿元，另类投资管理规模超 5000 亿元，养老金管理规模超 6400 亿元。根据人社部公开数据，2021 年三季度末，泰康资产受托管理的企业年金规模超 4100 亿元，位于市场前列。

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 12 月 31 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易

型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金、泰康润颐 63 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康蓝筹优势一年持有期股票型证券投资基金、泰康创新成长混合型证券投资基金、泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势企业混合型证券投资基金、泰康品质生活混合型证券投资基金、泰康合润混合型证券投资基金、泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康浩泽混合型证券投资基金、泰康安泽中短债债券型证券投资基金、泰康福泽积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、泰康福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、泰康优势精选三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康国证公共卫生与健康交易型开放式指数证券投资基金、泰康鼎泰一年持有期混合型证券投资基金、泰康研究精选股票型发起式证券投资基金，共 63 只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏军	本基金基金经理	2019年12月27日	-	14	魏军于 2019 年 5 月加入泰康资产，历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理。现任公募事业部量化投资总监。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智

					能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年8月27日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年12月6日至今担任泰康国证公共卫生与健康交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理

的不同投资组合间交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2021 年是经济内生动能逐步减缓的一年，经济从疫后的复苏期逐步进入到下行压力显性化的阶段。宏观政策的定调在结构性改革，GDP 由于基数原因达成目标的难度较小，宏观经济的长期改革得以有效推进。在年中前后逐步推行的诸如“三条红线”、“双碳”、“双减”等政策，有效地推进了经济中长期结构性问题的改革，但也给短期经济增长带来压力；叠加全年疫情影响始终存在，经济下行压力逐步加大。21 年经济的亮点在于出口和制造业投资，中国制造的优势在全球一枝独秀。物价方面，由于双碳的约束和海外供给共振，PPI 一路上行，但 CPI 表现疲弱。

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。3 季度，消费、地产、基建、信贷等数据逐月低于预期，确认我国经济动能趋缓；制造业投资回暖是为数不多的亮点，但上游资源涨价和短缺对中游制造业构成了阶段性冲击。4 季度，随着经济从“内外需双强”转为“外需单强”的格局，局部增长的亮点仍存，对应权益市场仍有结构性的机会。从大盘和板块上来看，上证综指上涨 4.8%，沪深 300 下跌 5.2%，中小板指下跌 4.62%，创业板指上涨 12.02%。其中，电力设备及新能源、基础化工、有色金属等板块表现相对较好，家电、非银行金融、消费者服务等行业表现不佳。

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 指数呈震荡下行的走势。

### 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 5.1404 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.34%；同期业绩比较基准增长率为 -5.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，宏观经济有望从底部逐步恢复，可能是稳增长政策逐步落地见效的过程。政策上可能更多体现为在长效机制的框架下的陆续边际放松和纠偏，力度不会很大，但在基建、地产等多个领域都会有一定程度的对冲，叠加制造业的景气，宏观经济有望见到社融率先企稳回升、工业和投资指标逐步企稳的过程。出口面临海外供需两方面较大的不确定性，但压力可能更多体现在下半年，上半年预计维持韧性，叠加政策靠前发力，经济动能有望在 1-2 季度缓慢恢复。

权益市场方面，受到疫情反复的影响，宏观经济面临一定增速压力；稳增长的背景下，预计流动性将持续保持宽松；从估值上看，目前 A 股市场的估值处于中位数偏上的位置，属合理状态。展望 2022 年，权益市场预计震荡向上，价值和成长风格收益将更加均衡。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债

登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 20988 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“泰康沪深 300ETF”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了泰康沪深 300ETF2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰康沪深 300ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。

其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰康沪深 300ETF 的基金管理人泰康资产管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰康沪深 300ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰康沪深 300ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰康沪深 300ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泰康沪深 300ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泰康沪深 300ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张 勇   周 祎
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	25,471,181.35	28,544,831.79
结算备付金		24,543,359.63	127,635,925.45
存出保证金		6,338,941.01	21,116,276.26
交易性金融资产	7.4.7.2	4,833,421,738.75	7,066,598,647.45
其中：股票投资		4,821,174,738.75	7,061,577,647.45
基金投资		-	-
债券投资		12,247,000.00	5,021,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,979,000.10	2,841,675.76
应收利息	7.4.7.5	174,775.04	307,940.37
应收股利		-	110.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,891,928,995.88	7,247,045,407.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,096,765.60	750,831.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,623,670.91	2,646,319.97
应付托管费		202,958.86	330,790.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	535,051.63	774,964.12
应交税费		25,869.37	386,033.78

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,465,119.94	5,225,113.73
负债合计		5,949,436.31	10,114,053.19
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,901,940,082.14	5,586,691,815.36
未分配利润	7.4.7.10	984,039,477.43	1,650,239,538.53
所有者权益合计		4,885,979,559.57	7,236,931,353.89
负债和所有者权益总计		4,891,928,995.88	7,247,045,407.08

注：（1）报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.1404 元，基金份额总额 950,499,814.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

## 7.2 利润表

会计主体：泰康沪深 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		22,700,696.71	2,175,929,223.54
1.利息收入		11,266,932.49	20,647,498.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,035,154.96	1,898,064.15
债券利息收入		2,508.56	3,663.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	9,718,250.39
证券出借利息收入		10,229,268.97	9,027,520.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,167,573,593.04	951,836,744.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,074,391,582.16	746,209,999.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,253,182.06	3,535,722.71
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	13,672,123.77	42,492,113.59
股利收益	7.4.7.16	76,256,705.05	159,598,909.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,168,230,384.17	1,199,897,197.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	12,090,555.35	3,547,782.33
<b>减：二、费用</b>		32,950,609.16	47,144,262.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	19,606,976.48	30,929,552.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,450,872.08	3,866,194.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	9,057,226.58	9,565,049.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		86,524.03	185,483.99
7. 其他费用	7.4.7.20	1,749,009.99	2,597,983.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-10,249,912.45	2,128,784,960.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-10,249,912.45	2,128,784,960.69

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-10,249,912.45	-10,249,912.45
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）	-1,684,751,733.22	-655,950,148.65	-2,340,701,881.87
其中：1.基金申购款	5,937,272,009.23	1,676,865,001.76	7,614,137,010.99
2.基金赎回款	-7,622,023,742.45	-2,332,815,150.41	-9,954,838,892.86
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	3,901,940,082.14	984,039,477.43	4,885,979,559.57



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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、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 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康沪深 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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 1. 估值方法及关键假设

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	25,471,181.35	28,544,831.79
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：	25,471,181.35	28,544,831.79

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,785,498,573.69	4,821,174,738.75	35,676,165.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	12,247,000.00	12,247,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,247,000.00	12,247,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,797,745,573.69	4,833,421,738.75	35,676,165.06
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,866,907,946.93	7,061,577,647.45	1,194,669,700.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,021,000.00	5,021,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,021,000.00	5,021,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,871,928,946.93	7,066,598,647.45	1,194,669,700.52

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	48,345,325.71	-	-	
-股指期货	48,345,325.71	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	48,345,325.71	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31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	160,427,757.00	-	-	
-股指期货	160,427,757.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	160,427,757.00	-	-	

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12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2203	沪深300期货2203 合约	32	47,525,760.00	-819,565.71
总额合计				-819,565.71
减：可抵销期货暂收款				-819,565.71
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	6,891.46	9,176.05
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	13,362.63	72,302.25
应收债券利息	268.43	370.64

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	153,937.70	225,668.26
其他	314.82	423.17
合计	174,775.04	307,940.37

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	535,051.63	774,964.12
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	535,051.63	774,964.12

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	150,000.00	148,797.81
指数使用费	340,085.83	630,953.51
可退替代款	-	15,266.66
应付替代款	1,975,034.11	4,430,095.75
合计	2,465,119.94	5,225,113.73

#### 7.4.7.9 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12月31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	1,446,300,000.00	5,937,272,009.23
本期赎回(以“-”号填列)	-1,856,700,000.00	-7,622,023,742.45
- 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	950,499,814.00	3,901,940,082.14

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	749,546,053.55	900,693,484.98	1,650,239,538.53
本期利润	1,157,980,471.72	-1,168,230,384.17	-10,249,912.45
本期基金份额交易产生的变动数	-325,040,674.79	-330,909,473.86	-655,950,148.65
其中：基金申购款	2,043,461,000.13	-366,595,998.37	1,676,865,001.76
基金赎回款	-2,368,501,674.92	35,686,524.51	-2,332,815,150.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,582,485,850.48	-598,446,373.05	984,039,477.43

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	225,105.57	244,740.78
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	790,271.65	1,632,514.34
其他	19,777.74	20,809.03
合计	1,035,154.96	1,898,064.15

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	600,880,240.65	481,572,258.82
股票投资收益——赎回差价收入	473,511,341.51	264,637,740.24
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	1,074,391,582.16	746,209,999.06

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	5,394,173,523.58	4,172,378,391.17
减：卖出股票成本总额	4,793,293,282.93	3,690,806,132.35
买卖股票差价收入	600,880,240.65	481,572,258.82

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
赎回基金份额对价总额	9,954,838,892.86	6,311,931,203.71
减：现金支付赎回款总额	4,154,143,191.86	2,426,748,511.71
减：赎回股票成本总额	5,327,184,359.49	3,620,544,951.76
赎回差价收入	473,511,341.51	264,637,740.24

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,253,182.06	3,535,722.71
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	3,253,182.06	3,535,722.71

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	25,872,130.75	107,598,741.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,616,300.00	104,002,805.14
减：应收利息总额	2,648.69	60,213.79
买卖债券差价收入	3,253,182.06	3,535,722.71

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间收益金额 2020年1月1日至2020年12月 31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	13,672,123.77	42,492,113.59

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	76,256,705.05	159,598,909.42
其中：证券出借权益补偿收入	10,153,076.77	13,516,038.94
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	76,256,705.05	159,598,909.42

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,158,993,535.46	1,191,479,914.52
——股票投资	-1,158,993,535.46	1,191,479,914.52
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-9,236,848.71	8,417,283.00
——权证投资	-	-
——股指期货投资	-9,236,848.71	8,417,283.00
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	-1,168,230,384.17	1,199,897,197.52

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-

替代损益	12,090,555.35	3,547,310.56
其他	-	471.77
合计	12,090,555.35	3,547,782.33

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

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	9,057,226.58	9,565,049.58
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	9,057,226.58	9,565,049.58

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	100,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	1,470,523.26	2,319,716.42
银行费用	8,486.73	9,068.92
其他	50,000.00	39,197.81
合计	1,749,009.99	2,597,983.15

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	19,606,976.48	30,929,552.11
其中：支付销售机构的客 户维护费	66,092.67	40,318.47

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% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
----	---	--

当期发生的基金应支付的托管费	2,450,872.08	3,866,194.02
----------------	--------------	--------------

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，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。

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

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

本报告期及上年度可比期间，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。

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

本报告期及上年度可比期间，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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31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	9,185,986.00	0.9664%	18,618,486.00	1.3681%

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	25,471,181.35	225,105.57	28,544,831.79	244,740.78

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

于2021年12月31日，本基金持有2,689,612股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币131,776,839.65元，估值总额为人民币131,011,000.52元，占基金资产净值的比例为2.68%（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%）。

**7.4.11 利润分配情况**

本报告期本基金无利润分配。

**7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年7月7日	新股锁定期流通受限	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	网下新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021年12月	2022年1月	网下新股	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

		月 31 日	月 11 日	流 通 受 限							
603986	兆易 创新	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 9 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	173.33	161.75	100,000	17,333,000.00	16,175,000.00	-	
002555	三七 互娱	2021 年 11 月 1 日	2022 年 5 月 5 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	23.09	25.03	250,000	5,772,500.00	6,257,500.00	-	
688012	中微 公司	2021 年 7 月 27 日	2022 年 1 月 28 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	198.00	124.40	46,000	9,108,000.00	5,722,400.00	-	
000425	徐工 机械	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 9 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	5.60	5.67	900,000	5,040,000.00	5,103,000.00	-	
688561	奇安 信	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 15 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	95.50	82.82	50,000	4,775,000.00	4,141,000.00	-	
300677	英科 医疗	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 17 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	108.26	56.80	60,000	4,330,400.00	3,408,000.00	注 6	
300676	华大 基因	2021 年 11 月 26 日	2022 年 5 月 27 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	84.04	84.28	40,000	3,361,600.00	3,371,200.00	-	
002607	中公 教育	2021 年 9 月 23 日	2022 年 3 月 24 日	大 宗 交 易 流 通 受 限	10.92	7.36	350,000	3,822,000.00	2,576,000.00	-	
688305	科德 数控	2021 年 7 月 2 日	2022 年 1 月 10 日	新 股 锁 定 流 通 受 限	11.03	105.68	1,496	16,500.88	158,097.28	-	
301029	怡合 达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新 股 锁 定 流 通 受 限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-	

301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新锁定期受限	股 定 流 受	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新锁定期受限	股 定 流 受	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新锁定期受限	股 定 流 受	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新锁定期受限	股 定 流 受	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新锁定期受限	股 定 流 受	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新锁定期受限	股 定 流 受	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新锁定期受限	股 定 流 受	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新锁定期受限	股 定 流 受	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新锁定期受限	股 定 流 受	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-

				限							
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新	股	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新	股	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新	股	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新	股	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新	股	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新	股	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新	股	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新	股	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
				锁	定						
				期	流						
				通	受						
				限							
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新	股	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
				锁	定						
				期	流						

			日	通受						
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新限售期	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新限售期	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新限售期	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新限售期	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新限售期	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新限售期	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新限售期	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新限售期	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021年8月	2022年3月	新限售期	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

		25 日	月 1	期 流						
			日	通 受						
				限						

7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021 年 12 月 29 日	2022 年 1 月 14 日	网下新债流通受限	100.00	100.00	47,310	4,731,000.00	4,731,000.00	-
113052	兴业转债	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 14 日	老股东配债流通受限	100.00	100.00	75,160	7,516,000.00	7,516,000.00	-

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》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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

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，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金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、根据英科医疗 2021 年半年度权益分派实施公告，以分红派息股权登记日的总股本为基数，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，不进行现金分红，除权除息日为 2021 年 9 月 30 日，本基金所持有的英科医疗获得转增股 20000 股。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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	2022 年 1 月 11	16.48	394,200	6,496,416.00

			日-2022年1月14日			
2	000002	万科 A	2022年1月4日-2022年1月14日	19.76	315,900	6,242,184.00
3	000066	中国长城	2022年1月4日-2022年1月11日	14.16	95,800	1,356,528.00
4	000069	华侨城 A	2022年1月4日-2022年1月5日	7.04	67,900	478,016.00
5	000100	TCL 科技	2022年1月5日-2022年1月14日	6.17	461,300	2,846,221.00
6	000157	中联重科	2022年1月4日-2022年1月10日	7.17	263,200	1,887,144.00
7	000166	申万宏源	2022年1月5日-2022年1月14日	5.12	617,300	3,160,576.00
8	000301	东方盛虹	2022年1月10日-2022年1月10日	19.34	75,700	1,464,038.00
9	000333	美的集团	2022年1月10日-2022年1月14日	73.81	162,600	12,001,506.00
10	000338	潍柴动力	2022年1月4日-2022年1月12日	17.89	250,800	4,486,812.00
11	000538	云南白药	2022年1月4日-2022年1月4日	104.65	26,500	2,773,225.00
12	000568	泸州老窖	2022年1月4日-2022年1月14日	253.87	40,000	10,154,800.00
13	000651	格力电器	2022年1月11日-2022年1月11日	37.03	10,000	370,300.00
14	000661	长春高新	2022年1月4日-2022年1月4日	271.40	10,000	2,714,000.00
15	000703	恒逸石化	2022年1月4日-2022年1月14日	10.62	118,500	1,258,470.00

16	000708	中信特钢	2022年1月6日 -2022年1月6日	20.48	20,800	425,984.00
17	000725	京东方A	2022年1月4日 -2022年1月7日	5.05	1,108,500	5,597,925.00
18	000768	中航西飞	2022年1月4日 -2022年1月14日	36.50	61,400	2,241,100.00
19	000776	广发证券	2022年1月4日 -2022年1月4日	24.59	59,100	1,453,269.00
20	000783	长江证券	2022年1月4日 -2022年1月14日	7.54	209,000	1,575,860.00
21	000786	北新建材	2022年1月14日 -2022年1月14日	35.83	10,000	358,300.00
22	000800	一汽解放	2022年1月4日 -2022年1月10日	10.29	49,600	510,384.00
23	000858	五粮液	2022年1月4日 -2022年1月12日	222.66	99,500	22,154,670.00
24	000876	新希望	2022年1月4日 -2022年1月14日	15.21	120,400	1,831,284.00
25	000895	双汇发展	2022年1月13日 -2022年1月13日	31.55	19,700	621,535.00
26	000938	紫光股份	2022年1月4日 -2022年1月14日	22.85	77,200	1,764,020.00
27	000963	华东医药	2022年1月6日 -2022年1月10日	40.20	46,600	1,873,320.00
28	000977	浪潮信息	2022年1月4日 -2022年1月14日	35.83	31,800	1,139,394.00
29	001979	招商蛇口	2022年1月4日 -2022年1月6日	13.34	149,200	1,990,328.00
30	002001	新和成	2022年1月10日 -2022年1月	31.12	82,200	2,558,064.00

			14 日			
31	002007	华兰生物	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 11 日	29.14	50,700	1,477,398.00
32	002008	大族激光	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	54.00	45,800	2,473,200.00
33	002024	苏宁易购	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	4.12	202,000	832,240.00
34	002044	美年健康	2022 年 1 月 13 日-2022 年 1 月 13 日	7.85	100,700	790,495.00
35	002064	华峰化学	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 12 日	10.44	74,300	775,692.00
36	002129	中环股份	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 14 日	41.75	123,800	5,168,650.00
37	002157	正邦科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	9.66	83,900	810,474.00
38	002179	中航光电	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 14 日	100.56	20,000	2,011,200.00
39	002202	金风科技	2022 年 1 月 5 日 -2022 年 1 月 12 日	16.47	30,900	508,923.00
40	002230	科大讯飞	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	52.51	98,800	5,187,988.00
41	002236	大华股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	23.48	96,800	2,272,864.00
42	002241	歌尔股份	2022 年 1 月 13 日-2022 年 1 月 13 日	54.10	10,000	541,000.00
43	002271	东方雨虹	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 11 日	52.68	37,100	1,954,428.00
44	002304	洋河股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	164.73	31,800	5,238,414.00
45	002311	海大集团	2022 年 1 月 4 日	73.30	44,300	3,247,190.00

			-2022年1月14日			
46	002371	北方华创	2022年1月5日-2022年1月5日	347.02	12,700	4,407,154.00
47	002410	广联达	2022年1月14日-2022年1月14日	63.98	30,000	1,919,400.00
48	002414	高德红外	2022年1月10日-2022年1月14日	24.21	50,100	1,212,921.00
49	002415	海康威视	2022年1月7日-2022年1月13日	52.32	37,800	1,977,696.00
50	002460	赣锋锂业	2022年1月12日-2022年1月12日	142.85	10,000	1,428,500.00
51	002466	天齐锂业	2022年1月11日-2022年1月12日	107.00	56,500	6,045,500.00
52	002475	立讯精密	2022年1月4日-2022年1月14日	49.20	192,400	9,466,080.00
53	002568	百润股份	2022年1月5日-2022年1月13日	59.83	20,000	1,196,600.00
54	002594	比亚迪	2022年1月12日-2022年1月12日	268.12	10,000	2,681,200.00
55	002600	领益智造	2022年1月14日-2022年1月14日	7.36	149,800	1,102,528.00
56	002601	龙佰集团	2022年1月4日-2022年1月13日	28.59	62,100	1,775,439.00
57	002602	世纪华通	2022年1月4日-2022年1月11日	8.39	240,100	2,014,439.00
58	002624	完美世界	2022年1月13日-2022年1月13日	20.31	62,200	1,263,282.00
59	002714	牧原股份	2022年1月5日-2022年1月14日	53.36	116,700	6,227,112.00

60	002736	国信证券	2022年1月4日 -2022年1月4日	11.48	154,500	1,773,660.00
61	002812	恩捷股份	2022年1月7日 -2022年1月7日	250.40	10,000	2,504,000.00
62	002841	视源股份	2022年1月4日 -2022年1月4日	81.40	10,000	814,000.00
63	002916	深南电路	2022年1月4日 -2022年1月4日	121.82	10,000	1,218,200.00
64	300003	乐普医疗	2022年1月10日 -2022年1月10日	22.63	66,900	1,513,947.00
65	300014	亿纬锂能	2022年1月4日 -2022年1月7日	118.18	60,700	7,173,526.00
66	300033	同花顺	2022年1月5日 -2022年1月5日	144.58	11,200	1,619,296.00
67	300124	汇川技术	2022年1月14日 -2022年1月14日	68.60	10,600	727,160.00
68	300142	沃森生物	2022年1月4日 -2022年1月4日	56.20	50,300	2,826,860.00
69	300144	宋城演艺	2022年1月6日 -2022年1月10日	14.32	81,700	1,169,944.00
70	300274	阳光电源	2022年1月10日 -2022年1月12日	145.80	20,000	2,916,000.00
71	300408	三环集团	2022年1月4日 -2022年1月4日	44.60	14,700	655,620.00
72	300413	芒果超媒	2022年1月5日 -2022年1月7日	57.22	40,200	2,300,244.00
73	300450	先导智能	2022年1月11日 -2022年1月11日	74.37	13,000	966,810.00
74	300558	贝达药业	2022年1月6日 -2022年1月6日	79.83	12,800	1,021,824.00

			日			
75	300595	欧普康视	2022年1月4日 -2022年1月4日	57.37	15,900	912,183.00
76	300628	亿联网络	2022年1月14日 -2022年1月14日	81.45	12,000	977,400.00
77	300759	康龙化成	2022年1月4日 -2022年1月4日	141.27	14,100	1,991,907.00
78	600000	浦发银行	2022年1月4日 -2022年1月4日	8.53	47,000	400,910.00
79	600009	上海机场	2022年1月4日 -2022年1月14日	46.69	45,600	2,129,064.00
80	600010	包钢股份	2022年1月5日 -2022年1月12日	2.79	1,241,100	3,462,669.00
81	600011	华能国际	2022年1月4日 -2022年1月7日	9.69	236,100	2,287,809.00
82	600015	华夏银行	2022年1月4日 -2022年1月13日	5.60	332,300	1,860,880.00
83	600018	上港集团	2022年1月5日 -2022年1月6日	5.48	34,400	188,512.00
84	600019	宝钢股份	2022年1月6日 -2022年1月14日	7.16	465,800	3,335,128.00
85	600025	华能水电	2022年1月10日 -2022年1月14日	6.59	95,200	627,368.00
86	600028	中国石化	2022年1月4日 -2022年1月14日	4.23	130,400	551,592.00
87	600029	南方航空	2022年1月4日 -2022年1月14日	6.81	276,900	1,885,689.00
88	600031	三一重工	2022年1月12日 -2022年1月14日	22.80	140,300	3,198,840.00
89	600036	招商银行	2022年1月13日	48.71	86,900	4,232,899.00

			日-2022年1月14日			
90	600048	保利发展	2022年1月5日-2022年1月14日	15.63	108,900	1,702,107.00
91	600050	中国联通	2022年1月14日-2022年1月14日	3.93	649,900	2,554,107.00
92	600061	国投资本	2022年1月4日-2022年1月11日	8.22	139,000	1,142,580.00
93	600079	人福医药	2022年1月12日-2022年1月14日	22.52	53,500	1,204,820.00
94	600085	同仁堂	2022年1月7日-2022年1月7日	44.98	34,600	1,556,308.00
95	600104	上汽集团	2022年1月4日-2022年1月14日	20.63	147,600	3,044,988.00
96	600109	国金证券	2022年1月5日-2022年1月5日	11.33	124,900	1,415,117.00
97	600111	北方稀土	2022年1月12日-2022年6月2日	45.80	117,000	5,358,600.00
98	600115	中国东航	2022年1月4日-2022年1月13日	5.16	266,700	1,376,172.00
99	600132	重庆啤酒	2022年1月6日-2022年1月6日	151.32	10,000	1,513,200.00
100	600143	金发科技	2022年1月4日-2022年1月13日	12.58	97,600	1,227,808.00
101	600150	中国船舶	2022年1月4日-2022年1月14日	24.79	88,900	2,203,831.00
102	600161	天坛生物	2022年1月4日-2022年1月4日	28.96	36,800	1,065,728.00
103	600176	中国巨石	2022年1月10日-2022年1月14日	18.20	121,600	2,213,120.00

104	600183	生益科技	2022年1月7日 -2022年1月13日	23.55	60,100	1,415,355.00
105	600196	复星医药	2022年1月11日 -2022年1月11日	48.94	16,000	783,040.00
106	600332	白云山	2022年1月4日 -2022年1月4日	34.20	37,200	1,272,240.00
107	600346	恒力石化	2022年1月6日 -2022年1月14日	22.97	113,200	2,600,204.00
108	600352	浙江龙盛	2022年1月13日 -2022年1月14日	12.63	55,500	700,965.00
109	600362	江西铜业	2022年1月4日 -2022年1月7日	22.33	55,500	1,239,315.00
110	600383	金地集团	2022年1月12日 -2022年1月14日	12.97	120,200	1,558,994.00
111	600406	国电南瑞	2022年1月7日 -2022年1月13日	40.03	90,100	3,606,703.00
112	600426	华鲁恒升	2022年1月7日 -2022年1月12日	31.30	79,800	2,497,740.00
113	600438	通威股份	2022年1月4日 -2022年1月14日	44.96	135,700	6,101,072.00
114	600489	中金黄金	2022年1月10日 -2022年1月14日	8.23	159,600	1,313,508.00
115	600547	山东黄金	2022年1月4日 -2022年1月14日	18.82	97,400	1,833,068.00
116	600570	恒生电子	2022年1月12日 -2022年1月14日	62.15	33,400	2,075,810.00
117	600584	长电科技	2022年1月6日 -2022年1月12日	31.02	62,100	1,926,342.00
118	600585	海螺水泥	2022年1月7日 -2022年1月7日	40.30	28,200	1,136,460.00

			日			
119	600588	用友网络	2022年1月5日 -2022年1月12日	35.88	87,800	3,150,264.00
120	600600	青岛啤酒	2022年1月5日 -2022年1月5日	99.00	19,200	1,900,800.00
121	600606	绿地控股	2022年1月4日 -2022年1月6日	4.34	205,700	892,738.00
122	600655	豫园股份	2022年1月4日 -2022年1月7日	10.30	83,400	859,020.00
123	600660	福耀玻璃	2022年1月10日 -2022年1月14日	47.14	76,300	3,596,782.00
124	600690	海尔智家	2022年1月4日 -2022年1月14日	29.89	30,000	896,700.00
125	600745	闻泰科技	2022年1月14日 -2022年1月14日	129.30	10,000	1,293,000.00
126	600760	中航沈飞	2022年1月10日 -2022年1月14日	68.04	32,100	2,184,084.00
127	600763	通策医疗	2022年1月14日 -2022年1月14日	199.00	10,000	1,990,000.00
128	600795	国电电力	2022年1月5日 -2022年1月12日	3.17	488,000	1,546,960.00
129	600809	山西汾酒	2022年1月6日 -2022年1月14日	315.78	20,000	6,315,600.00
130	600845	宝信软件	2022年1月14日 -2022年1月14日	60.83	10,000	608,300.00
131	600848	上海临港	2022年1月4日 -2022年1月5日	14.87	52,100	774,727.00
132	600886	国投电力	2022年1月4日 -2022年1月5日	11.47	77,800	892,366.00
133	600893	航发动力	2022年1月4日	63.46	73,100	4,638,926.00

			-2022年1月14日			
134	600900	长江电力	2022年1月10日-2022年1月10日	22.70	30,000	681,000.00
135	600905	三峡能源	2022年1月10日-2022年1月14日	7.51	469,000	3,522,190.00
136	600918	中泰证券	2022年1月13日-2022年1月13日	9.97	40,600	404,782.00
137	600919	江苏银行	2022年1月13日-2022年1月13日	5.83	414,600	2,417,118.00
138	600926	杭州银行	2022年1月11日-2022年1月14日	12.82	81,600	1,046,112.00
139	600958	东方证券	2022年1月4日-2022年1月14日	14.74	225,400	3,322,396.00
140	600999	招商证券	2022年1月12日-2022年1月12日	17.65	42,000	741,300.00
141	601006	大秦铁路	2022年1月7日-2022年1月14日	6.40	56,900	364,160.00
142	601012	隆基股份	2022年1月12日-2022年1月14日	86.20	96,300	8,301,060.00
143	601021	春秋航空	2022年1月12日-2022年1月12日	56.80	19,400	1,101,920.00
144	601066	中信建投	2022年1月11日-2022年1月12日	29.25	49,000	1,433,250.00
145	601088	中国神华	2022年1月11日-2022年1月11日	22.52	30,900	695,868.00
146	601100	恒立液压	2022年1月12日-2022年1月13日	81.80	27,800	2,274,040.00
147	601108	财通证券	2022年1月6日-2022年1月12日	11.12	130,400	1,450,048.00

148	601111	中国国航	2022年1月4日 -2022年1月14日	9.13	159,300	1,454,409.00
149	601138	工业富联	2022年1月14日 -2022年1月14日	11.92	10,000	119,200.00
150	601155	新城控股	2022年1月11日 -2022年1月11日	29.13	17,800	518,514.00
151	601162	天风证券	2022年1月4日 -2022年1月14日	4.05	231,400	937,170.00
152	601216	君正集团	2022年1月4日 -2022年1月4日	5.23	180,600	944,538.00
153	601225	陕西煤业	2022年1月4日 -2022年1月11日	12.20	82,000	1,000,400.00
154	601229	上海银行	2022年1月7日 -2022年1月14日	7.13	211,800	1,510,134.00
155	601236	红塔证券	2022年1月7日 -2022年1月7日	11.92	43,300	516,136.00
156	601288	农业银行	2022年1月6日 -2022年1月6日	2.94	1,789,000	5,259,660.00
157	601319	中国人保	2022年1月5日 -2022年1月5日	4.70	32,600	153,220.00
158	601328	交通银行	2022年1月4日 -2022年1月7日	4.61	192,200	886,042.00
159	601336	新华保险	2022年1月10日 -2022年1月10日	38.88	16,900	657,072.00
160	601377	兴业证券	2022年1月7日 -2022年1月12日	9.88	287,500	2,840,500.00
161	601390	中国中铁	2022年1月13日 -2022年1月14日	5.79	112,000	648,480.00
162	601398	工商银行	2022年1月4日 -2022年1月14日	4.63	356,800	1,651,984.00

			日			
163	601600	中国铝业	2022年1月4日 -2022年1月12日	6.09	424,500	2,585,205.00
164	601601	中国太保	2022年1月7日 -2022年1月14日	27.12	104,500	2,834,040.00
165	601607	上海医药	2022年1月7日 -2022年1月14日	19.87	53,400	1,061,058.00
166	601618	中国中冶	2022年1月4日 -2022年1月14日	3.83	326,600	1,250,878.00
167	601628	中国人寿	2022年1月6日 -2022年1月14日	30.09	88,800	2,671,992.00
168	601633	长城汽车	2022年1月11日 -2022年1月11日	48.54	14,000	679,560.00
169	601658	邮储银行	2022年1月4日 -2022年1月4日	5.10	38,700	197,370.00
170	601668	中国建筑	2022年1月4日 -2022年1月14日	5.00	80,300	401,500.00
171	601669	中国电建	2022年1月4日 -2022年1月12日	8.08	418,800	3,383,904.00
172	601688	华泰证券	2022年1月7日 -2022年1月7日	17.76	200,000	3,552,000.00
173	601696	中银证券	2022年1月10日 -2022年1月14日	13.45	40,700	547,415.00
174	601698	中国卫通	2022年1月5日 -2022年1月5日	14.39	22,700	326,653.00
175	601766	中国中车	2022年1月10日 -2022年1月12日	6.09	124,500	758,205.00
176	601788	光大证券	2022年1月14日 -2022年1月14日	14.93	17,200	256,796.00
177	601800	中国交建	2022年1月4日	8.58	187,300	1,607,034.00

			-2022年1月12日			
178	601808	中海油服	2022年1月13日-2022年1月14日	15.00	31,700	475,500.00
179	601838	成都银行	2022年1月5日-2022年1月14日	12.00	113,500	1,362,000.00
180	601857	中国石油	2022年1月4日-2022年1月14日	4.91	502,800	2,468,748.00
181	601865	福莱特	2022年1月10日-2022年1月13日	57.94	27,900	1,616,526.00
182	601877	正泰电器	2022年1月4日-2022年1月13日	53.89	57,900	3,120,231.00
183	601878	浙商证券	2022年1月14日-2022年1月14日	13.18	83,200	1,096,576.00
184	601881	中国银河	2022年1月14日-2022年1月14日	11.19	11,200	125,328.00
185	601888	中国中免	2022年1月14日-2022年1月14日	219.41	10,000	2,194,100.00
186	601898	中煤能源	2022年1月11日-2022年1月11日	6.29	97,700	614,533.00
187	601901	方正证券	2022年1月5日-2022年1月14日	7.84	220,000	1,724,800.00
188	601916	浙商银行	2022年1月4日-2022年1月13日	3.50	450,400	1,576,400.00
189	601919	中远海控	2022年1月11日-2022年1月13日	18.69	74,100	1,384,929.00
190	601933	永辉超市	2022年1月4日-2022年1月14日	4.05	196,400	795,420.00
191	601966	玲珑轮胎	2022年1月5日-2022年1月5日	36.55	10,000	365,500.00

192	601985	中国核电	2022年1月5日 -2022年1月5日	8.30	379,500	3,149,850.00
193	601988	中国银行	2022年1月5日 -2022年1月5日	3.05	500,000	1,525,000.00
194	601989	中国重工	2022年1月4日 -2022年1月14日	4.22	617,700	2,606,694.00
195	601990	南京证券	2022年1月4日 -2022年1月4日	9.91	28,300	280,453.00
196	601995	中金公司	2022年1月14日 -2022年1月14日	49.03	17,100	838,413.00
197	601998	中信银行	2022年1月7日 -2022年1月10日	4.62	110,600	510,972.00
198	603019	中科曙光	2022年1月4日 -2022年1月14日	27.57	63,800	1,758,966.00
199	603160	汇顶科技	2022年1月12日 -2022年1月12日	107.77	11,800	1,271,686.00
200	603233	大参林	2022年1月14日 -2022年1月14日	42.11	17,000	715,870.00
201	603259	药明康德	2022年1月12日 -2022年1月12日	118.58	10,000	1,185,800.00
202	603288	海天味业	2022年1月14日 -2022年1月14日	105.11	15,100	1,587,161.00
203	603338	浙江鼎力	2022年1月5日 -2022年1月5日	80.26	10,000	802,600.00
204	603369	今世缘	2022年1月6日 -2022年1月12日	54.40	32,500	1,768,000.00
205	603501	韦尔股份	2022年1月7日 -2022年1月7日	310.77	10,000	3,107,700.00
206	603517	绝味食品	2022年1月13日 -2022年1月	68.33	13,000	888,290.00

			13 日			
207	603658	安图生物	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 10 日	55.06	12,200	671,732.00
208	603659	璞泰来	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 7 日	160.61	10,700	1,718,527.00
209	603799	华友钴业	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 10 日	110.31	10,000	1,103,100.00
210	603882	金域医学	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 7 日	111.37	10,000	1,113,700.00
211	603899	晨光文具	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 12 日	64.51	20,100	1,296,651.00
212	603939	益丰药房	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 5 日	55.11	10,700	589,677.00
213	603986	兆易创新	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 12 日	175.85	10,000	1,758,500.00
214	603993	洛阳钼业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.58	380,200	2,121,516.00
215	688008	澜起科技	2022 年 1 月 14 日-2022 年 1 月 14 日	83.87	23,400	1,962,558.00
216	688009	中国通号	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	4.98	139,400	694,212.00
217	688126	沪硅产业	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 13 日	25.82	39,500	1,019,890.00
218	688396	华润微	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 12 日	64.60	13,800	891,480.00
219	688599	天合光能	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 4 日	78.90	30,700	2,422,230.00
220	688981	中芯国际	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 11 日	52.99	104,700	5,548,053.00
合计					27,430,800	459,013,375.00

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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方

式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	12,247,000.00	4,605,000.00
AAA 以下	0.00	416,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	12,247,000.00	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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 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。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,471,181.35	-	-	-	25,471,181.35

结算备付金	24,543,359.63	-	-	-	24,543,359.63
存出保证金	635,849.81	-	-	5,703,091.20	6,338,941.01
交易性金融资产	-	-12,247,000.00	4,821,174,738.75	-	4,833,421,738.75
应收证券清算款	-	-	-	1,979,000.10	1,979,000.10
应收利息	-	-	-	174,775.04	174,775.04
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	50,650,390.79	-12,247,000.00	4,829,031,605.09	-	4,891,928,995.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,096,765.60	1,096,765.60
应付管理人报酬	-	-	-	1,623,670.91	1,623,670.91
应付托管费	-	-	-	202,958.86	202,958.86
应付交易费用	-	-	-	535,051.63	535,051.63
应交税费	-	-	-	25,869.37	25,869.37
其他负债	-	-	-	2,465,119.94	2,465,119.94
负债总计	-	-	-	5,949,436.31	5,949,436.31
利率敏感度缺口	50,650,390.79	-12,247,000.00	4,823,082,168.78	-	4,885,979,559.57
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	181,854.17	72,895.23
	市场利率上调 0.25%	-178,866.87	-71,667.83

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不

包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	4,821,174,738.75	98.67	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	4,821,174,738.75	98.67	7,061,577,647.45	97.58

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 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%	252,536,240.52	363,941,706.70
业绩比较基准中的权益指数下跌 5%	-252,536,240.52	-363,941,706.70	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,772,870,243.35 元，属于第二层次的余额为 13,200,964.13 元，属于第三层次的余额为 47,350,531.27 元(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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的金额为 47,350,531.27 元(2020 年 12 月 31 日：无)。2021 年度购买第三层次金融工具的金额为 53,773,131.47 元，计入当期损益的利得或损失金额为-6,422,600.20 元，均计入利润表中的公允价值变动损益项目(2020 年度：无)。于 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动-公允价值变动损益金额为-6,422,600.20 元(2020 年 12 月 31 日：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 7,614,137,010.99 元(2020 年度：4,255,392,728.24 元)，其中包括以股票支付的申购款 4,336,800,513.79 元和以现金支付的申购款 3,277,336,497.20 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 2,586,259,483.17 元和以现金支付的申购款 1,669,133,245.07 元)。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(4) 除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,821,174,738.75	98.55
	其中：股票	4,821,174,738.75	98.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,247,000.00	0.25
	其中：债券	12,247,000.00	0.25
	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	50,014,540.98	1.02
8	其他各项资产	8,492,716.15	0.17
9	合计	4,891,928,995.88	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 459,013,375.00 元，占期末资产净值比例为 9.39%。

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	52,408,638.70	1.07
B	采矿业	105,073,091.44	2.15
C	制造业	2,843,797,945.59	58.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	116,084,100.39	2.38
E	建筑业	80,621,321.64	1.65
F	批发和零售业	29,823,075.56	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	127,196,872.19	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,163,732.90	3.22

J	金融业	1,015,189,233.35	20.78
K	房地产业	84,314,647.86	1.73
L	租赁和商务服务业	64,575,105.36	1.32
M	科学研究和技术服务业	80,056,845.44	1.64
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	2,970,572.00	0.06
Q	卫生和社会工作	46,043,128.12	0.94
R	文化、体育和娱乐业	14,183,674.86	0.29
S	综合	-	-
	合计	4,819,501,985.40	98.64

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,362,017.12	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	34,225.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,072.08	0.00
J	金融业	69,749.68	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	89,656.54	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	34,387.07	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	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,672,753.35	0.03

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	136,609	280,048,450.00	5.73
2	300750	宁德时代	303,853	178,665,564.00	3.66
3	600036	招商银行	2,689,612	131,011,000.52	2.68
4	601318	中国平安	2,353,953	118,662,770.73	2.43
5	000858	五粮液	421,748	93,906,409.68	1.92
6	601012	隆基股份	940,907	81,106,183.40	1.66
7	000333	美的集团	1,062,639	78,433,384.59	1.61
8	300059	东方财富	1,797,597	66,708,824.67	1.37
9	601166	兴业银行	3,159,283	60,152,748.32	1.23
10	600900	长江电力	2,470,157	56,072,563.90	1.15
11	002415	海康威视	1,013,959	53,050,334.88	1.09
12	603259	药明康德	445,948	52,880,513.84	1.08
13	002594	比亚迪	197,042	52,830,901.04	1.08
14	002475	立讯精密	1,072,095	52,747,074.00	1.08
15	600276	恒瑞医药	973,508	49,366,590.68	1.01
16	600030	中信证券	1,850,200	48,863,782.00	1.00
17	601888	中国中免	212,196	46,557,924.36	0.95
18	600887	伊利股份	1,112,164	46,110,319.44	0.94
19	000568	泸州老窖	158,722	40,294,754.14	0.82
20	300760	迈瑞医疗	105,600	40,212,480.00	0.82
21	000651	格力电器	1,028,327	38,078,948.81	0.78
22	601398	工商银行	7,613,900	35,252,357.00	0.72
23	603501	韦尔股份	113,412	35,245,047.24	0.72
24	000001	平安银行	2,109,372	34,762,450.56	0.71
25	600309	万华化学	341,323	34,473,623.00	0.71
26	600809	山西汾酒	106,041	33,485,626.98	0.69
27	002142	宁波银行	862,369	33,011,485.32	0.68
28	300274	阳光电源	226,001	32,950,945.80	0.67
29	000725	京东方 A	6,520,900	32,930,545.00	0.67
30	002714	牧原股份	572,075	30,525,922.00	0.62

31	601899	紫金矿业	3,132,000	30,380,400.00	0.62
32	600031	三一重工	1,292,972	29,479,761.60	0.60
33	002352	顺丰控股	426,477	29,392,794.84	0.60
34	000002	万科 A	1,479,100	29,227,016.00	0.60
35	002812	恩捷股份	116,400	29,146,560.00	0.60
36	300014	亿纬锂能	246,391	29,118,488.38	0.60
37	603288	海天味业	274,255	28,826,943.05	0.59
38	600436	片仔癀	65,387	28,583,927.05	0.59
39	002241	歌尔股份	520,044	28,134,380.40	0.58
40	601328	交通银行	5,975,200	27,545,672.00	0.56
41	300124	汇川技术	399,195	27,384,777.00	0.56
42	600438	通威股份	586,600	26,373,536.00	0.54
43	601919	中远海控	1,376,692	25,730,373.48	0.53
44	600837	海通证券	2,097,700	25,717,802.00	0.53
45	002460	赣锋锂业	174,799	24,970,037.15	0.51
46	300015	爱尔眼科	587,404	24,835,441.12	0.51
47	600690	海尔智家	821,920	24,567,188.80	0.50
48	600048	保利发展	1,561,883	24,412,231.29	0.50
49	600406	国电南瑞	602,100	24,102,063.00	0.49
50	002466	天齐锂业	224,817	24,055,419.00	0.49
51	603799	华友钴业	212,476	23,438,227.56	0.48
52	000063	中兴通讯	690,000	23,115,000.00	0.47
53	601668	中国建筑	4,553,600	22,768,000.00	0.47
54	601288	农业银行	7,637,600	22,454,544.00	0.46
55	688981	中芯国际	421,000	22,308,790.00	0.46
56	600000	浦发银行	2,549,672	21,748,702.16	0.45
57	600111	北方稀土	473,500	21,686,300.00	0.44
58	002304	洋河股份	131,300	21,629,049.00	0.44
59	300122	智飞生物	173,530	21,621,838.00	0.44
60	600016	民生银行	5,391,100	21,025,290.00	0.43
61	600585	海螺水泥	521,459	21,014,797.70	0.43
62	002230	科大讯飞	399,600	20,982,996.00	0.43
63	600745	闻泰科技	162,217	20,974,658.10	0.43
64	600104	上汽集团	1,016,000	20,960,080.00	0.43
65	002049	紫光国微	92,200	20,745,000.00	0.42
66	603986	兆易创新	125,922	20,733,383.70	0.42
67	601816	京沪高铁	4,263,600	20,593,188.00	0.42
68	002129	中环股份	491,296	20,511,608.00	0.42
69	002271	东方雨虹	383,764	20,216,687.52	0.41

70	601601	中国太保	743,900	20,174,568.00	0.41
71	601688	华泰证券	1,119,400	19,880,544.00	0.41
72	002371	北方华创	56,735	19,688,179.70	0.40
73	300142	沃森生物	340,297	19,124,691.40	0.39
74	000661	长春高新	70,100	19,025,140.00	0.39
75	000100	TCL 科技	3,049,300	18,814,181.00	0.39
76	300498	温氏股份	965,745	18,600,248.70	0.38
77	000338	潍柴动力	1,031,100	18,446,379.00	0.38
78	600893	航发动力	289,660	18,381,823.60	0.38
79	002027	分众传媒	2,199,900	18,017,181.00	0.37
80	300450	先导智能	238,500	17,737,245.00	0.36
81	601211	国泰君安	979,300	17,519,677.00	0.36
82	300782	卓胜微	51,100	16,699,480.00	0.34
83	601088	中国神华	716,000	16,124,320.00	0.33
84	601766	中国中车	2,641,830	16,088,744.70	0.33
85	600050	中国联通	4,035,000	15,857,550.00	0.32
86	600570	恒生电子	254,520	15,818,418.00	0.32
87	000776	广发证券	642,900	15,808,911.00	0.32
88	601229	上海银行	2,163,634	15,426,710.42	0.32
89	600919	江苏银行	2,571,100	14,989,513.00	0.31
90	300347	泰格医药	113,807	14,544,534.60	0.30
91	600660	福耀玻璃	304,745	14,365,679.30	0.29
92	002709	天赐材料	124,718	14,298,918.70	0.29
93	601169	北京银行	3,215,900	14,278,596.00	0.29
94	600999	招商证券	806,580	14,236,137.00	0.29
95	688599	天合光能	179,400	14,154,660.00	0.29
96	600905	三峡能源	1,863,900	13,997,889.00	0.29
97	601988	中国银行	4,582,800	13,977,540.00	0.29
98	002821	凯莱英	32,100	13,963,500.00	0.29
99	600019	宝钢股份	1,937,700	13,873,932.00	0.28
100	600010	包钢股份	4,953,600	13,820,544.00	0.28
101	601669	中国电建	1,660,633	13,417,914.64	0.27
102	600958	东方证券	908,000	13,383,920.00	0.27
103	002410	广联达	206,753	13,228,056.94	0.27
104	002311	海大集团	180,297	13,215,770.10	0.27
105	002459	晶澳科技	139,400	12,922,380.00	0.26
106	601633	长城汽车	266,100	12,916,494.00	0.26
107	600196	复星医药	262,200	12,832,068.00	0.26
108	601390	中国中铁	2,211,600	12,805,164.00	0.26

109	600588	用友网络	356,124	12,777,729.12	0.26
110	601985	中国核电	1,521,000	12,624,300.00	0.26
111	601877	正泰电器	233,950	12,607,565.50	0.26
112	000625	长安汽车	827,150	12,564,408.50	0.26
113	000166	申万宏源	2,450,200	12,545,024.00	0.26
114	600028	中国石化	2,907,720	12,299,655.60	0.25
115	603659	璞泰来	75,379	12,106,621.19	0.25
116	601658	邮储银行	2,361,400	12,043,140.00	0.25
117	002179	中航光电	119,577	12,024,663.12	0.25
118	002493	荣盛石化	660,785	11,999,855.60	0.25
119	601818	光大银行	3,600,400	11,953,328.00	0.24
120	000895	双汇发展	375,900	11,859,645.00	0.24
121	000538	云南白药	111,298	11,647,335.70	0.24
122	601377	兴业证券	1,162,100	11,481,548.00	0.23
123	300408	三环集团	250,633	11,178,231.80	0.23
124	000768	中航西飞	300,686	10,975,039.00	0.22
125	601628	中国人寿	361,800	10,886,562.00	0.22
126	603806	福斯特	82,491	10,769,200.05	0.22
127	688111	金山办公	40,300	10,679,500.00	0.22
128	600346	恒力石化	460,300	10,573,091.00	0.22
129	002001	新和成	336,900	10,484,328.00	0.21
130	601989	中国重工	2,481,004	10,469,836.88	0.21
131	601600	中国铝业	1,705,300	10,385,277.00	0.21
132	601857	中国石油	2,108,700	10,353,717.00	0.21
133	601138	工业富联	862,900	10,285,768.00	0.21
134	601225	陕西煤业	842,600	10,279,720.00	0.21
135	300896	爱美客	18,900	10,132,479.00	0.21
136	600426	华鲁恒升	321,800	10,072,340.00	0.21
137	002008	大族激光	185,811	10,033,794.00	0.21
138	300433	蓝思科技	433,086	9,952,316.28	0.20
139	002202	金风科技	600,164	9,884,701.08	0.20
140	002050	三花智控	390,310	9,874,843.00	0.20
141	600009	上海机场	209,545	9,783,656.05	0.20
142	600763	通策医疗	49,150	9,780,850.00	0.20
143	601009	南京银行	1,089,723	9,763,918.08	0.20
144	300316	晶盛机电	139,700	9,709,150.00	0.20
145	600741	华域汽车	342,870	9,703,221.00	0.20
146	600150	中国船舶	389,300	9,650,747.00	0.20
147	600176	中国巨石	521,496	9,491,227.20	0.19

148	300413	芒果超媒	162,511	9,298,879.42	0.19
149	601100	恒立液压	113,588	9,291,498.40	0.19
150	600011	华能国际	954,900	9,252,981.00	0.19
151	001979	招商蛇口	689,958	9,204,039.72	0.19
152	002236	大华股份	390,622	9,171,804.56	0.19
153	300601	康泰生物	89,475	8,816,866.50	0.18
154	600760	中航沈飞	127,980	8,707,759.20	0.18
155	603993	洛阳钼业	1,536,200	8,571,996.00	0.18
156	601939	建设银行	1,456,200	8,533,332.00	0.17
157	600584	长电科技	270,378	8,387,125.56	0.17
158	600989	宝丰能源	477,700	8,292,872.00	0.17
159	688008	澜起科技	98,800	8,286,356.00	0.17
160	600926	杭州银行	646,000	8,281,720.00	0.17
161	601006	大秦铁路	1,293,201	8,276,486.40	0.17
162	688036	传音控股	52,700	8,268,630.00	0.17
163	601066	中信建投	281,900	8,245,575.00	0.17
164	002602	世纪华通	973,200	8,165,148.00	0.17
165	300759	康龙化成	57,100	8,066,517.00	0.17
166	003816	中国广核	2,564,801	8,027,827.13	0.16
167	000977	浪潮信息	221,728	7,944,514.24	0.16
168	600132	重庆啤酒	52,300	7,914,036.00	0.16
169	601360	三六零	620,300	7,890,216.00	0.16
170	000786	北新建材	220,018	7,883,244.94	0.16
171	601186	中国铁建	997,800	7,782,840.00	0.16
172	000157	中联重科	1,077,600	7,726,392.00	0.16
173	601868	中国能建	2,815,900	7,687,407.00	0.16
174	000963	华东医药	189,800	7,629,960.00	0.16
175	600600	青岛啤酒	77,032	7,626,168.00	0.16
176	603486	科沃斯	50,120	7,565,614.00	0.15
177	600015	华夏银行	1,338,100	7,493,360.00	0.15
178	600029	南方航空	1,098,800	7,482,828.00	0.15
179	000876	新希望	490,808	7,465,189.68	0.15
180	600886	国投电力	648,288	7,435,863.36	0.15
181	603369	今世缘	136,618	7,432,019.20	0.15
182	002601	龙佰集团	258,620	7,393,945.80	0.15
183	600547	山东黄金	392,812	7,392,721.84	0.15
184	002555	三七互娱	288,700	7,303,174.00	0.15
185	601238	广汽集团	474,400	7,206,136.00	0.15
186	002736	国信证券	625,156	7,176,790.88	0.15

187	600352	浙江龙盛	566,700	7,157,421.00	0.15
188	000938	紫光股份	310,499	7,094,902.15	0.15
189	601336	新华保险	181,388	7,052,365.44	0.14
190	601901	方正证券	895,000	7,016,800.00	0.14
191	603019	中科曙光	253,940	7,001,125.80	0.14
192	002007	华兰生物	238,687	6,955,339.18	0.14
193	000425	徐工机械	1,193,142	6,858,920.58	0.14
194	300033	同花顺	47,115	6,811,886.70	0.14
195	603882	金城医学	60,600	6,749,022.00	0.14
196	688012	中微公司	54,000	6,735,200.00	0.14
197	600085	同仁堂	149,053	6,704,403.94	0.14
198	601800	中国交建	767,515	6,585,278.70	0.13
199	000596	古井贡酒	26,800	6,539,200.00	0.13
200	002938	鹏鼎控股	151,789	6,440,407.27	0.13
201	601865	福莱特	110,800	6,419,752.00	0.13
202	601799	星宇股份	31,300	6,393,025.00	0.13
203	300628	亿联网络	78,239	6,372,566.55	0.13
204	300595	欧普康视	110,678	6,349,596.86	0.13
205	600383	金地集团	489,116	6,343,834.52	0.13
206	601788	光大证券	424,600	6,339,278.00	0.13
207	601916	浙商银行	1,809,900	6,334,650.00	0.13
208	000783	长江证券	838,100	6,319,274.00	0.13
209	000069	华侨城 A	892,500	6,283,200.00	0.13
210	300003	乐普医疗	273,300	6,184,779.00	0.13
211	600115	中国东航	1,194,000	6,161,040.00	0.13
212	600795	国电电力	1,930,300	6,119,051.00	0.13
213	000301	东方盛虹	314,600	6,084,364.00	0.12
214	601108	财通证券	545,600	6,067,072.00	0.12
215	600918	中泰证券	604,213	6,024,003.61	0.12
216	002252	上海莱士	878,100	5,988,642.00	0.12
217	601618	中国中冶	1,557,200	5,964,076.00	0.12
218	600109	国金证券	524,900	5,947,117.00	0.12
219	600183	生益科技	252,300	5,941,665.00	0.12
220	601111	中国国航	650,614	5,940,105.82	0.12
221	300999	金龙鱼	93,900	5,909,127.00	0.12
222	002841	视源股份	72,400	5,893,360.00	0.12
223	603833	欧派家居	39,880	5,882,300.00	0.12
224	603392	万泰生物	26,470	5,863,105.00	0.12
225	601155	新城控股	197,101	5,741,552.13	0.12

226	601838	成都银行	471,400	5,656,800.00	0.12
227	300529	健帆生物	105,303	5,612,649.90	0.11
228	601966	玲珑轮胎	149,800	5,475,190.00	0.11
229	603517	绝味食品	79,800	5,452,734.00	0.11
230	000066	中国长城	384,500	5,444,520.00	0.11
231	603160	汇顶科技	50,095	5,398,738.15	0.11
232	600332	白云山	153,149	5,237,695.80	0.11
233	002916	深南电路	42,927	5,229,367.14	0.11
234	600489	中金黄金	633,800	5,216,174.00	0.11
235	603899	晨光文具	80,542	5,195,764.42	0.11
236	002120	韵达股份	253,460	5,185,791.60	0.11
237	002624	完美世界	253,504	5,148,666.24	0.11
238	002791	坚朗五金	28,200	5,120,838.00	0.10
239	600362	江西铜业	226,600	5,059,978.00	0.10
240	000703	恒逸石化	475,740	5,052,358.80	0.10
241	601607	上海医药	252,158	5,010,379.46	0.10
242	688561	奇安信	59,700	4,993,824.00	0.10
243	600143	金发科技	391,400	4,923,812.00	0.10
244	002414	高德红外	203,342	4,922,909.82	0.10
245	300144	宋城演艺	341,117	4,884,795.44	0.10
246	002568	百润股份	81,240	4,860,589.20	0.10
247	600079	人福医药	212,500	4,785,500.00	0.10
248	300677	英科医疗	83,450	4,764,348.00	0.10
249	601990	南京证券	478,800	4,744,908.00	0.10
250	688169	石头科技	5,800	4,715,400.00	0.10
251	002044	美年健康	595,900	4,677,815.00	0.10
252	603260	合盛硅业	35,400	4,671,738.00	0.10
253	600872	中炬高新	121,800	4,624,746.00	0.09
254	600061	国投资本	561,049	4,611,822.78	0.09
255	300676	华大基因	53,600	4,565,280.00	0.09
256	002600	领益智造	617,200	4,542,592.00	0.09
257	601021	春秋航空	79,400	4,509,920.00	0.09
258	000708	中信特钢	220,100	4,507,648.00	0.09
259	600845	宝信软件	73,820	4,490,470.60	0.09
260	601878	浙商证券	335,500	4,421,890.00	0.09
261	601728	中国电信	1,007,000	4,360,310.00	0.09
262	600161	天坛生物	150,180	4,349,212.80	0.09
263	603939	益丰药房	77,870	4,291,415.70	0.09
264	300558	贝达药业	53,600	4,278,888.00	0.09

265	603338	浙江鼎力	52,585	4,220,472.10	0.09
266	688126	沪硅产业	161,000	4,157,020.00	0.09
267	600018	上港集团	755,600	4,140,688.00	0.08
268	601696	中银证券	300,700	4,044,415.00	0.08
269	601216	君正集团	736,800	3,853,464.00	0.08
270	601162	天风证券	935,800	3,789,990.00	0.08
271	688396	华润微	58,000	3,746,800.00	0.08
272	300866	安克创新	35,700	3,659,250.00	0.07
273	600606	绿地控股	831,945	3,610,641.30	0.07
274	600655	豫园股份	337,300	3,474,190.00	0.07
275	601995	中金公司	69,700	3,417,391.00	0.07
276	002024	苏宁易购	807,600	3,327,312.00	0.07
277	002157	正邦科技	339,800	3,282,468.00	0.07
278	688363	华熙生物	21,100	3,276,830.00	0.07
279	601933	永辉超市	791,428	3,205,283.40	0.07
280	002064	华峰化学	303,000	3,163,320.00	0.06
281	601881	中国银河	280,704	3,141,077.76	0.06
282	600848	上海临港	208,660	3,102,774.20	0.06
283	601998	中信银行	670,100	3,095,862.00	0.06
284	002607	中公教育	400,200	2,970,572.00	0.06
285	601319	中国人保	615,800	2,894,260.00	0.06
286	603233	大参林	68,500	2,884,535.00	0.06
287	603195	公牛集团	17,100	2,860,830.00	0.06
288	603658	安图生物	51,660	2,844,399.60	0.06
289	688009	中国通号	563,400	2,805,732.00	0.06
290	603087	甘李药业	36,800	2,588,512.00	0.05
291	600025	华能水电	387,500	2,553,625.00	0.05
292	601898	中煤能源	400,300	2,517,887.00	0.05
293	601236	红塔证券	206,420	2,460,526.40	0.05
294	601231	环旭电子	144,856	2,326,387.36	0.05
295	002032	苏泊尔	35,200	2,190,848.00	0.04
296	000800	一汽解放	201,600	2,074,464.00	0.04
297	601808	中海油服	129,100	1,936,500.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	9,700	1,763,848.00	0.04
299	300888	稳健医疗	18,800	1,550,060.00	0.03
300	601698	中国卫通	94,900	1,365,611.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.02
2	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.00
3	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
4	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
5	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
6	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
7	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
8	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
9	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
10	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
11	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
12	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
13	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
14	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
15	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
16	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
17	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
18	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
19	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
20	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
21	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
22	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
23	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
24	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
25	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
26	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
27	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
28	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
29	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
30	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
31	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
32	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
33	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
34	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00

35	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
36	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	207,154,984.25	2.86
2	300750	宁德时代	200,077,028.98	2.76
3	000333	美的集团	155,768,016.61	2.15
4	002415	海康威视	103,000,156.74	1.42
5	000651	格力电器	101,190,490.61	1.40
6	300059	东方财富	97,384,223.55	1.35
7	600519	贵州茅台	93,513,218.12	1.29
8	000568	泸州老窖	81,158,604.60	1.12
9	000001	平安银行	80,986,664.98	1.12
10	002594	比亚迪	78,515,140.59	1.08
11	002475	立讯精密	76,165,612.71	1.05
12	000725	京东方 A	74,950,177.00	1.04
13	002714	牧原股份	74,497,901.46	1.03
14	000002	万科 A	71,996,771.30	0.99
15	300122	智飞生物	65,907,694.60	0.91
16	002142	宁波银行	55,485,491.30	0.77
17	002352	顺丰控股	55,337,417.04	0.76
18	300015	爱尔眼科	55,100,001.56	0.76
19	000063	中兴通讯	53,366,725.76	0.74
20	002371	北方华创	53,196,149.02	0.74

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

### 8.4.2 累计卖出金额超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	292,804,258.56	4.05
2	000333	美的集团	221,918,481.39	3.07
3	000651	格力电器	143,358,915.97	1.98
4	300059	东方财富	133,735,194.70	1.85
5	002415	海康威视	124,489,855.21	1.72
6	000001	平安银行	111,039,249.90	1.53
7	002594	比亚迪	109,900,862.22	1.52
8	000568	泸州老窖	108,057,065.41	1.49
9	002475	立讯精密	101,821,777.63	1.41
10	000002	万科 A	99,807,692.41	1.38
11	002714	牧原股份	98,419,462.10	1.36
12	000725	京东方 A	95,759,046.48	1.32
13	600519	贵州茅台	83,934,192.52	1.16
14	002352	顺丰控股	77,846,521.17	1.08
15	300122	智飞生物	74,666,387.17	1.03
16	300014	亿纬锂能	69,244,598.18	0.96
17	300015	爱尔眼科	66,188,192.57	0.91
18	000063	中兴通讯	65,229,054.73	0.90
19	002142	宁波银行	65,195,888.26	0.90
20	300124	汇川技术	62,776,523.90	0.87

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,702,267,755.39
卖出股票收入（成交）总额	5,394,173,523.58

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	12,247,000.00	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,247,000.00	0.25

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	113052	兴业转债	122,470	12,247,000.00	0.25

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2203	沪深300期货2203合约	32	47,525,760.00	-819,565.71	-
公允价值变动总额合计(元)					-819,565.71
股指期货投资本期收益(元)					13,672,123.77
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-9,236,848.71

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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

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，因未按照保险公司提供的销售合同条款全面、客观揭示所代销保险产品风险等原因在本报告编制前一年内受到上海银保监局的行政处罚。

兴业银行股份有限公司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。

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。

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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,338,941.01
2	应收证券清算款	1,979,000.10
3	应收股利	-
4	应收利息	174,775.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,492,716.15

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000858	五 粮 液	22,154,670.00	0.45	转融通证券出借
2	000333	美的集团	12,001,506.00	0.25	转融通证券出借
3	601012	隆基股份	8,301,060.00	0.17	转融通证券出借
4	600036	招商银行	4,232,899.00	0.09	转融通证券出借
5	600900	长江电力	681,000.00	0.01	转融通证券出借

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688176	亚虹医药	873,010.20	0.02	网下新股流通受限
2	688305	科德数控	158,097.28	0.00	新股锁定期流通受限
3	301136	招标股份	75,449.44	0.00	网下新股流通受限
4	301029	怡 合 达	41,519.94	0.00	新股锁定期流通受限

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,940	241,243.61	946,903,110.00	99.62%	3,596,704.00	0.38%

### 9.2 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	9,185,986.00	0.97%

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。

### 9.3 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	66.11%
2	泰康人寿保险有限责任公司—传统保险产品	144,042,647.00	15.15%
3	中信证券—工行—中信证券贵宾定制7号集合资产管理计划	51,156,200.00	5.38%
4	广发证券股份有限公司	20,277,503.00	2.13%
5	国泰君安证券股份有限公司	19,916,529.00	2.10%
6	中信证券—浦发银行—中信证券星辰53号集合资产管理计划	17,266,100.00	1.82%
7	泰康养老保险股份有限公司—自有资金	9,835,900.00	1.03%
8	中信证券—中信银行—中信证券财富优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）集合资	6,666,200.00	0.70%
9	东方证券股份有限公司	6,366,149.00	0.67%
10	招商证券股份有限公司	5,970,412.00	0.63%
11	招商银行股份有限公司—泰康沪深	9,185,986.00	0.97%

	300 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金		
--	----------------------------	--	--

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

#### 9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	1,446,300,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	1,856,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	950,499,814.00

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人未出现重大人事变动。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 100,000.00 元；截至 2021 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 3 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	4	4,258,957,709.83	42.28%	1,123,032.10	42.01%	-
华泰证券	4	2,461,003,003.20	24.43%	643,121.37	24.06%	-
中信证券	3	1,213,430,644.18	12.05%	332,656.59	12.44%	-
中金公司	2	690,693,788.18	6.86%	183,265.32	6.86%	-
广发证券	2	471,454,907.66	4.68%	123,193.47	4.61%	-
申万宏源证	4	439,346,441.73	4.36%	120,418.64	4.50%	-

券						
开源证券	2	225,631,333.71	2.24%	61,946.76	2.32%	-
天风证券	2	225,199,160.54	2.24%	61,558.24	2.30%	-
安信证券	4	47,273,737.17	0.47%	12,947.05	0.48%	-
光大证券	4	40,168,883.08	0.40%	10,998.54	0.41%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	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 11 个交易单元，为开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元

各 1 个，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，浙商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信证券北京证券交易所交易单元 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	9,340,303.50	36.10%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	8,705,335.62	33.65%	-	-	-	-
开源证券	4,730,339.26	18.28%	-	-	-	-
天风证券	2,050,013.37	7.92%	-	-	-	-
安信证券	1,046,139.00	4.04%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰康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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日	2021 年 3 月 30 日

	告	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	
2	关于直销电子交易平台开展汇款交易;赎回转认购业务费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、 中国证监会基金电 子披露网站及基金 管理人网站	2021 年 1 月 21 日
3	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商银行招赢通为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、 中国证监会基金电 子披露网站及基金 管理人网站	2021 年 1 月 22 日
4	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、 中国证监会基金电 子披露网站及基金 管理人网站	2021 年 1 月 22 日
5	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、 中国证监会基金电 子披露网站及基金 管理人网站	2021 年 1 月 29 日
6	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分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
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
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	2021 年 3 月 12 日

		子披露网站及基金管理人网站	
9	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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
10	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在珠海盈米基金销售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年3月19日
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	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
13	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
14	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
15	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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

16	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金开通在北京植信基金销售有限公司定投及转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年5月21日
17	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增通华财富（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
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
19	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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
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
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
22	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加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
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上海利	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日	2021年7月12日

	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	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	
24	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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
25	泰康资产管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金在北京新浪仓石基金销售有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年7月21日
26	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天风证券股份有限公司最低申购金额;追加申购最低金额;赎回最低份额和持有最低限额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年7月21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7月26日
28	关于旗下基金开展直销电子交易系统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30日
29	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年7月30日
30	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海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	2021年8月4日

		子披露网站及基金管理人网站	
31	关于直销电子交易系统开通赎回转申购业务并开展相关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8月6日
32	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增泰信财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年8月12日
33	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司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9月2日
34	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增招商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9月3日
35	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创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年9月6日
36	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增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9月7日
37	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增上海天天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9月10日

38	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加上海基煜基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年9月27日
39	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创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年9月30日
40	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金参加中信证券华南股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年10月15日
41	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金新增宜信普泽（北京）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10月22日
42	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10月28日
43	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金开通在泰信财富基金销售有限公司定投及转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021年11月18日
44	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11月19日
45	泰康资产管理有限责任公司关于旗下部分公募基金可投资北交所	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日	2021年11月20日

	股票的公告	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	
46	关于直销电子交易系统开通赎回 转申购业务并开展相关费率优惠 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 11 月 23 日
47	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国信证 券股份有限公司费率优惠活动的 公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券日 报》、《证券时报》、 中国证监会基金电 子披露网站及基金 管理人网站	2021 年 11 月 26 日
48	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宜信 普泽（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 12 月 29 日
49	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 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210101~20211231	808,033,466.00	-	179,684,000.00	628,349,466.00	66.11%
	2	20210101~20210208	305,254,747.00	-	161,212,100.00	144,042,647.00	15.15%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康沪深 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》。

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日