

泰康沪深 300 交易型开放式指数 证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	64
7.1 期末基金资产组合情况	64
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	76
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	76
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	76
§ 8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末上市基金前十名持有人	79
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	80
§ 9 开放式基金份额变动	81
§ 10 重大事件揭示	82
10.1 基金份额持有人大会决议	82
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
10.4 基金投资策略的改变	82
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
10.8 其他重大事件	87
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	87
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	87
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	88
§ 12 备查文件目录	89
12.1 备查文件目录	89
12.2 存放地点	89
12.3 查阅方式	89

§ 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
场内简称	沪深 300ETF 泰康
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	泰康基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	876,699,814.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 3 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现一致的长期回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。 本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。
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	泰康基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	陈玮光	张姗
	联系电话	010-89620366	0755-83077987
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001895522	95555
传真		010-89620100	0755-83195201
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		金志刚	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-22,770,773.30
本期利润	18,159,196.96
加权平均基金份额本期利润	0.0208
本期加权平均净值利润率	0.49%
本期基金份额净值增长率	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,462,912.13
期末可供分配基金份额利润	0.0290
期末基金资产净值	3,624,443,252.76
期末基金份额净值	4.1342
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.71%

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

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

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

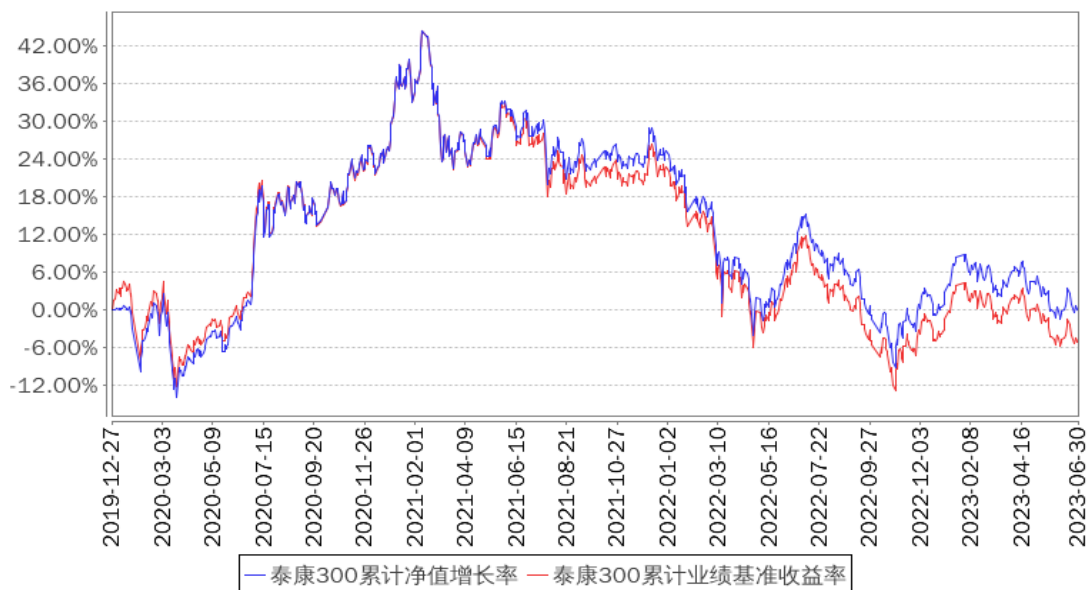
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.13%	0.87%	1.16%	0.87%	0.97%	0.00%
过去三个月	-4.03%	0.83%	-5.15%	0.83%	1.12%	0.00%
过去六个月	0.40%	0.84%	-0.75%	0.84%	1.15%	0.00%
过去一年	-12.31%	0.99%	-14.33%	0.99%	2.02%	0.00%
过去三年	-1.55%	1.20%	-7.72%	1.20%	6.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.71%	1.23%	-4.56%	1.25%	5.27%	-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

泰康300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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021 年 9 月 1 日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021 年 10 月 12 日，泰康基金完成工商注册。2022 年 11 月 18 日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏军	本基金基金经理、量化投资部负责人	2019 年 12 月 27 日	-	15 年	魏军于 2019 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人。曾历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理等职务。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 7 日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 27 日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 6 日至今担任泰康国证公共卫生与健康交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 8 月 1 日至今担任泰康中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022 年 9 月 27

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

具体投资上，本基金严格按照基金合同的规定，通过紧密跟踪业绩比较基准的被动化投资策略，将基金跟踪误差控制在合理范围内。报告期内跟踪误差主要来自基金份额的申购和赎回、指数成分股调整。报告期内，跟踪指数震荡下行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 4.1342 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%；同期业绩比较基准增长率为-0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

展望后市，指数估值合理，经济即将触底回升，外围流动性有望缓解，指数配置价值仍然较高。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，参与转融通证券出借、大宗交易、可转债投资、股票打新等，力求为投资者带来更好的投资体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	20,263,592.36	15,203,852.28
结算备付金		8,334,922.29	8,753,596.05
存出保证金		3,057,456.31	2,866,013.65
交易性金融资产	6.4.7.2	3,598,009,664.82	3,608,918,487.01
其中：股票投资		3,598,009,664.82	3,608,918,487.01
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		92,971.64	12,306.84
应收股利		317,120.86	5,707.10
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	110,730.86	85,890.68
资产总计		3,630,186,459.14	3,635,845,853.61
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		3,577,413.18	—
应付赎回款		—	—

应付管理人报酬		1,192,534.18	1,238,088.38
应付托管费		149,066.80	154,761.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19,797.89	14,649.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	804,394.33	2,140,415.07
负债合计		5,743,206.38	3,547,913.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,598,980,340.63	3,621,148,126.48
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,462,912.13	11,149,813.42
净资产合计		3,624,443,252.76	3,632,297,939.90
负债和净资产总计		3,630,186,459.14	3,635,845,853.61

注：（1）报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.1342 元，基金份额总额 876,699,814.00 份。

（2）股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.2 利润表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,166,558.00	-405,449,421.50
1. 利息收入		2,890,450.86	3,490,382.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	133,033.74	613,654.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		2,757,417.12	2,876,727.53
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,178,815.72	-238,551,980.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-60,834,793.58	-276,326,078.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	169,573.06	2,963,431.21
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-321,134.22	-2,759,826.05
股利收益	6.4.7.19	43,807,539.02	37,570,493.11
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	40,929,970.26	-170,892,671.26
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	524,952.60	504,847.62
减：二、营业总支出		9,007,361.04	9,927,501.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,384,673.26	8,150,424.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	923,084.17	1,018,803.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9,928.06	10,358.86
8. 其他费用	6.4.7.23	689,675.55	747,914.91
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		18,159,196.96	-415,376,922.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		18,159,196.96	-415,376,922.56
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		18,159,196.96	-415,376,922.56

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产（基金净值）	3,621,148,126.	-	11,149,813.42	3,632,297,939.9

	48			0
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,621,148,126.48	-	11,149,813.42	3,632,297,939.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,167,785.85	-	14,313,098.71	-7,854,687.14
（一）、综合收益总额	-	-	18,159,196.96	18,159,196.96
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-22,167,785.85	-	-3,846,098.25	-26,013,884.10
其中：1. 基金申购款	413,798,671.52	-	18,999,982.17	432,798,653.69
2. 基金赎回款	-435,966,457.37	-	-22,846,080.42	-458,812,537.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,598,980,340.63	-	25,462,912.13	3,624,443,252.76
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	3,901,940,082.14	-	984,039,477.43	4,885,979,559.57
加：会计政策变更	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,901,940,082.14	-	984,039,477.43	4,885,979,559.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-232,761,752.72	-	-439,271,988.47	-672,033,741.19
(一)、综合收益总额	-	-	-415,376,922.56	-415,376,922.56
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-232,761,752.72	-	-23,895,065.91	-256,656,818.63
其中：1. 基金申购款	1,374,402,730.20	-	107,625,993.98	1,482,028,724.18
2. 基金赎回款	-1,607,164,482.92	-	-131,521,059.89	-1,738,685,542.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,669,178,329.42	-	544,767,488.96	4,213,945,818.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

金志刚

基金管理人负责人

金志刚

主管会计工作负责人

李俊佑

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1824 号《关于准予泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 7,158,504,619.00 元(含募集股票市值),业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1900636 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,160,604,619.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,100,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《泰康沪深 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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局

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

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

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

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

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

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

上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	20,263,592.36
等于：本金	20,260,130.36
加：应计利息	3,462.00
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	20,263,592.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,096,848,341.52	—	3,598,009,664.82	-498,838,676.70
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,096,848,341.52	-	3,598,009,664.82	-498,838,676.70

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	24,435,160.00	-	-	
其中：股指期货投资	24,435,160.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	24,435,160.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2307	沪深 300 期货 2307 合约	8.00	9,192,960.00	115,740.00
IF2309	沪深 300 期货 2309 合约	13.00	14,972,100.00	-385,840.00
合计				-270,100.00
减：可抵销期货 暂收款				-270,100.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	110,730.86
待摊费用	-
合计	110,730.86

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	221,048.71
其中：交易所市场	221,048.71
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	133,891.13
应付指数使用费	275,911.25
应退替代款	169,994.04
可退替代款	3,549.20
合计	804,394.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	882,099,814.00	3,621,148,126.48
本期申购	100,800,000.00	413,798,671.52
本期赎回（以“-”号填列）	-106,200,000.00	-435,966,457.37
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	876,699,814.00	3,598,980,340.63

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,116,241,714.08	-1,105,091,900.66	11,149,813.42
本期利润	-22,770,773.30	40,929,970.26	18,159,196.96
本期基金份额交易产生的变动数	-6,962,520.10	3,116,421.85	-3,846,098.25
其中：基金申购款	124,861,968.70	-105,861,986.53	18,999,982.17
基金赎回款	-131,824,488.80	108,978,408.38	-22,846,080.42

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,086,508,420.68	-1,061,045,508.55	25,462,912.13

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	46,983.99
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	84,266.59
其他	1,783.16
合计	133,033.74

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-46,365,192.50
股票投资收益——赎回差价收入	-14,469,601.08
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-60,834,793.58

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	359,922,887.54
减：卖出股票成本总额	405,567,666.23
减：交易费用	720,413.81
买卖股票差价收入	-46,365,192.50

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	458,812,537.79
减：现金支付赎回款总额	196,936,082.79
减：赎回股票成本总额	276,346,056.08
减：交易费用	-
赎回差价收入	-14,469,601.08

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	182.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	169,390.76
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	169,573.06

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,082,621.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	913,000.00
减：应计利息总额	187.78
减：交易费用	43.21
买卖债券差价收入	169,390.76

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-321,134.22

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	43,807,539.02
其中：证券出借权益补偿收入	2,036,978.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	43,807,539.02

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	40,649,612.84
股票投资	40,649,612.84

债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	280,357.42
权证投资	-
期货投资	280,357.42
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	40,929,970.26

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	524,952.60
合计	524,952.60

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,933.97
指数使用费	553,850.45
其他	24,795.19
合计	689,675.55

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与基金管理人存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
泰康沪深 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
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,384,673.26	8,150,424.29
其中：支付销售机构的客户维护费	122,329.08	133,802.50

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	923,084.17	1,018,803.00

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
泰康沪深300 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金	9,753,986.00	1.1126	10,352,086.00	1.1736

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	20,263,592.36	46,983.99	40,881,526.10	99,914.97

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有 2,356,212 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 100,808,307.05 元，估值总额为人民币 77,189,505.12 元，占基金资产净值的比例为 2.13%（上年度末，本基金持有 2,391,212 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 104,514,071.71 元，估值总额为人民币 89,096,559.12 元，占基金资产净值的比例为 2.45%）。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类	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

				型						
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定期流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定期流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定期流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
002555	三七互娱	2023年6月5日	6个月	大宗交易流通受限	30.80	31.49	200,000	6,160,000.00	6,298,000.00	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定期流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-

				限						
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定期流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定期流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定期流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

				限						
301261	恒工精密	2023年6月29日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定期流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定期流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定期流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定期流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定期流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定期流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-

				限						
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定期流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定期流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定期流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定期流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定期流通	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

				受限						
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定期流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定期流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	26.68	26.68	5,196	138,629.28	138,629.28	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定期流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股锁定期流通	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

				受限						
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定期流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	39.78	39.78	2,618	104,144.04	104,144.04	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定期流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-

				限						
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定期流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定期流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定期流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定期流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定期流通	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-

				受限						
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定期流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定期流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定期流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定期流	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

				通受限						
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定期流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定期流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定期流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定期流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股锁定期	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-

				流通受限						
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定期流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定期流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	网下新股流通受限	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-

				流通受限						
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定期流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定期流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定期流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
837592	华信永道	2023年6月28日	1-6个月(含)	网上新股流通受限	10.38	10.38	1,400	14,532.00	14,532.00	-
873576	天力复合	2023年6月29日	1-6个月(含)	网上新股流	9.35	9.35	1,800	16,830.00	16,830.00	-

				通 受 限						
--	--	--	--	-------------	--	--	--	--	--	--

- 注：1、截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。
- 2、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。
- 3、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。
- 4、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。
- 5、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设定限售期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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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： 股）	期末估值 总额
1	000063	中兴通讯	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	45.54	6,000	273,240.0 0
2	000069	华侨城 A	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 3 日	4.40	195,000	858,000.0 0
3	000100	TCL 科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 10 日	3.94	654,000	2,576,760 .00
4	000157	中联重科	2023 年 7 月 13 日	6.75	230,000	1,552,500 .00
5	000301	东方盛	2023 年 7 月 12 日	11.82	17,700	209,214.0

		虹				0
6	000333	美的集团	2023 年 7 月 3 日	58.92	13,000	765,960.00
7	000408	藏格矿业	2023 年 7 月 3 日	22.57	17,500	394,975.00
8	000425	徐工机械	2023 年 7 月 13 日	6.77	220,000	1,489,400.00
9	000538	云南白药	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	52.48	3,800	199,424.00
10	000568	泸州老窖	2023 年 7 月 3 日	209.57	1,000	209,570.00
11	000596	古井贡酒	2023 年 7 月 11 日	247.38	2,000	494,760.00
12	000617	中油资本	2023 年 7 月 10 日	7.23	120,300	869,769.00
13	000625	长安汽车	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 28 日	12.93	236,100	3,052,773.00
14	000661	长春高新	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	136.30	6,000	817,800.00
15	000723	美锦能源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	7.54	123,600	931,944.00
16	000733	振华科技	2023 年 7 月 7 日	95.85	10,000	958,500.00
17	000792	盐湖股份	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	19.17	114,900	2,202,633.00
18	000800	一汽解放	2023 年 7 月 3 日	8.37	3,500	29,295.00
19	000876	新希望	2023 年 7 月 3 日	11.68	107,000	1,249,760.00
20	000877	天山股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	8.14	81,600	664,224.00
21	000895	双汇发展	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 17 日	24.49	13,800	337,962.00
22	000938	紫光股份	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 28 日	31.85	69,500	2,213,575.00
23	000977	浪潮信息	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	48.50	48,800	2,366,800.00
24	001289	龙源电力	2023 年 7 月 13 日	22.50	6,500	146,250.00
25	001979	招商蛇口	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	13.03	139,500	1,817,685.00
26	002001	新和成	2023 年 7 月 3 日	15.40	6,700	103,180.00
27	002049	紫光国	2023 年 7 月 4 日-2023 年	93.25	12,200	1,137,650

		微	7 月 11 日			. 00
28	002050	三花智控	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 10 日	30.26	101,600	3,074,416.00
29	002064	华峰化学	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	6.86	94,200	646,212.00
30	002120	韵达股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	9.56	54,600	521,976.00
31	002129	TCL 中环	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	33.20	39,000	1,294,800.00
32	002180	纳思达	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 10 日	34.25	20,100	688,425.00
33	002202	金风科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	10.62	59,000	626,580.00
34	002230	科大讯飞	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 27 日	67.96	88,400	6,007,664.00
35	002236	大华股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	19.75	79,000	1,560,250.00
36	002241	歌尔股份	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 27 日	17.75	80,200	1,423,550.00
37	002271	东方雨虹	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	27.26	18,700	509,762.00
38	002304	洋河股份	2023 年 7 月 13 日	131.35	1,600	210,160.00
39	002371	北方华创	2023 年 7 月 4 日	317.65	10,000	3,176,500.00
40	002410	广联达	2023 年 7 月 10 日	32.49	6,000	194,940.00
41	002414	高德红外	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	7.77	48,300	375,291.00
42	002415	海康威视	2023 年 7 月 4 日	33.11	14,000	463,540.00
43	002459	晶澳科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	41.70	44,000	1,834,800.00
44	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 14 日	60.96	8,300	505,968.00
45	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	69.91	43,000	3,006,130.00
46	002493	荣盛石化	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	11.64	85,800	998,712.00
47	002601	龙佰集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	16.50	43,100	711,150.00
48	002648	卫星化学	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	14.96	41,000	613,360.00
49	002709	天赐材	2023 年 7 月 5 日-2023 年	41.19	21,500	885,585.00

		料	7 月 11 日			0
50	002756	永兴材料	2023 年 7 月 3 日	62.61	6,000	375,660.00
51	002821	凯莱英	2023 年 7 月 10 日	117.86	11,400	1,343,604.00
52	002841	视源股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	66.84	19,900	1,330,116.00
53	002920	德赛西威	2023 年 7 月 14 日	155.81	3,400	529,754.00
54	002938	鹏鼎控股	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	24.29	16,200	393,498.00
55	300014	亿纬锂能	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	60.50	57,800	3,496,900.00
56	300033	同花顺	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	175.28	10,200	1,787,856.00
57	300059	东方财富	2023 年 7 月 5 日	14.20	50,000	710,000.00
58	300124	汇川技术	2023 年 7 月 4 日	64.21	10,000	642,100.00
59	300207	欣旺达	2023 年 7 月 14 日	16.32	13,000	212,160.00
60	300223	北京君正	2023 年 7 月 27 日-2023 年 7 月 28 日	88.31	11,300	997,903.00
61	300274	阳光电源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	116.63	21,000	2,449,230.00
62	300316	晶盛机电	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 11 日	70.90	9,000	638,100.00
63	300347	泰格医药	2023 年 7 月 3 日	64.54	8,000	516,320.00
64	300408	三环集团	2023 年 7 月 3 日	29.35	15,000	440,250.00
65	300413	芒果超媒	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	34.21	35,400	1,211,034.00
66	300450	先导智能	2023 年 7 月 3 日	36.17	29,200	1,056,164.00
67	300454	深信服	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 27 日	113.25	7,600	860,700.00
68	300496	中科创达	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	96.35	15,200	1,464,520.00
69	300601	康泰生物	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	25.39	28,400	721,076.00
70	300628	亿联网络	2023 年 7 月 13 日	35.07	1,000	35,070.00
71	300661	圣邦股	2023 年 7 月 3 日-2023 年	82.13	14,200	1,166,246

		份	7 月 14 日			.00
72	300750	宁德时代	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	228.79	5,000	1,143,950 .00
73	300751	迈为股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	169.38	2,300	389,574.0 0
74	300759	康龙化成	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	38.28	24,100	922,548.0 0
75	300760	迈瑞医疗	2023 年 7 月 27 日	299.80	1,000	299,800.0 0
76	300763	锦浪科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	104.10	9,400	978,540.0 0
77	300769	德方纳米	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	110.23	10,500	1,157,415 .00
78	300782	卓胜微	2023 年 7 月 11 日	96.63	5,000	483,150.0 0
79	300896	爱美客	2023 年 7 月 10 日	444.95	1,000	444,950.0 0
80	300919	中伟股份	2023 年 7 月 10 日	60.25	1,400	84,350.00
81	300957	贝泰妮	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	88.88	6,000	533,280.0 0
82	300979	华利集团	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 28 日	48.74	6,600	321,684.0 0
83	300999	金龙鱼	2023 年 7 月 4 日	39.99	1,000	39,990.00
84	600009	上海机场	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	45.42	43,000	1,953,060 .00
85	600010	宝钢股份	2023 年 7 月 14 日	1.79	417,000	746,430.0 0
86	600011	华能国际	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	9.26	109,000	1,009,340 .00
87	600018	上港集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 19 日	5.25	40,500	212,625.0 0
88	600025	华能水电	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 14 日	7.13	85,300	608,189.0 0
89	600028	中国石化	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	6.36	43,200	274,752.0 0
90	600029	南方航空	2023 年 7 月 13 日	6.03	120,000	723,600.0 0
91	600048	保利发展	2023 年 7 月 3 日	13.03	10,000	130,300.0 0
92	600050	中国联通	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 7 日	4.80	524,600	2,518,080 .00
93	600061	国投资本	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	7.12	119,800	852,976.0 0

94	600085	同仁堂	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	57.56	21,400	1,231,784 .00
95	600089	特变电 工	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	22.29	52,400	1,167,996 .00
96	600104	上汽集 团	2023 年 7 月 19 日	14.17	10,000	141,700.0 0
97	600111	北方稀 土	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	23.98	54,500	1,306,910 .00
98	600115	中国东 航	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	4.76	325,700	1,550,332 .00
99	600132	重庆啤 酒	2023 年 7 月 10 日	92.16	10,700	986,112.0 0
100	600150	中国船 舶	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	32.91	105,800	3,481,878 .00
101	600176	中国巨 石	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	14.16	64,600	914,736.0 0
102	600183	生益科 技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	14.20	51,900	736,980.0 0
103	600188	兖矿能 源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	29.92	41,100	1,229,712 .00
104	600219	南山铝 业	2023 年 7 月 11 日	3.02	6,000	18,120.00
105	600346	恒力石 化	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 10 日	14.33	46,200	662,046.0 0
106	600383	金地集 团	2023 年 7 月 10 日	7.21	81,000	584,010.0 0
107	600406	国电南 瑞	2023 年 7 月 12 日	23.10	66,900	1,545,390 .00
108	600426	华鲁恒 升	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	30.63	12,400	379,812.0 0
109	600436	片仔癀	2023 年 7 月 3 日	286.36	2,000	572,720.0 0
110	600438	通威股 份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	34.31	127,900	4,388,249 .00
111	600460	士兰微	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	30.27	40,200	1,216,854 .00
112	600570	恒生电 子	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 4 日	44.29	14,000	620,060.0 0
113	600584	长电科 技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	31.17	38,000	1,184,460 .00
114	600585	海螺水 泥	2023 年 7 月 14 日	23.74	32,100	762,054.0 0
115	600588	用友网 络	2023 年 7 月 3 日	20.50	21,000	430,500.0 0

116	600600	青岛啤酒	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	103.63	7,000	725,410.00
117	600606	绿地控股	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 10 日	2.75	169,500	466,125.00
118	600660	福耀玻璃	2023 年 7 月 14 日	35.85	2,100	75,285.00
119	600674	川投能源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	15.05	6,400	96,320.00
120	600690	海尔智家	2023 年 7 月 3 日	23.48	36,000	845,280.00
121	600732	爱旭股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	30.75	51,900	1,595,925.00
122	600741	华域汽车	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	18.46	58,800	1,085,448.00
123	600763	通策医疗	2023 年 7 月 3 日	96.86	8,000	774,880.00
124	600803	新奥股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 3 日	18.98	21,700	411,866.00
125	600809	山西汾酒	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	185.07	8,000	1,480,560.00
126	600845	宝信软件	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	50.81	26,400	1,341,384.00
127	600884	杉杉股份	2023 年 7 月 3 日	15.14	50,000	757,000.00
128	600886	国投电力	2023 年 7 月 3 日	12.65	44,000	556,600.00
129	600900	长江电力	2023 年 7 月 10 日	22.06	6,000	132,360.00
130	600905	三峡能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	5.37	202,900	1,089,573.00
131	600918	中泰证券	2023 年 7 月 11 日	6.91	54,000	373,140.00
132	600941	中国移动	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 28 日	93.30	16,000	1,492,800.00
133	600989	宝丰能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	12.61	83,900	1,057,979.00
134	601006	大秦铁路	2023 年 7 月 3 日	7.43	215,200	1,598,936.00
135	601021	春秋航空	2023 年 7 月 3 日	57.47	5,000	287,350.00
136	601088	中国神华	2023 年 7 月 13 日	30.75	156,400	4,809,300.00
137	601100	恒立液压	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	64.33	9,000	578,970.00

138	601111	中国国航	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	8.24	165,300	1,362,072.00
139	601138	工业富联	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	25.20	162,100	4,084,920.00
140	601155	新城控股	2023 年 7 月 12 日	14.41	43,000	619,630.00
141	601186	中国铁建	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	9.85	168,000	1,654,800.00
142	601216	君正集团	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	4.10	137,500	563,750.00
143	601225	陕西煤业	2023 年 7 月 13 日	18.19	30,000	545,700.00
144	601236	红塔证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 10 日	7.45	44,800	333,760.00
145	601238	广汽集团	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	10.42	5,200	54,184.00
146	601319	中国人保	2023 年 7 月 13 日	5.84	72,300	422,232.00
147	601360	三六零	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	12.54	93,000	1,166,220.00
148	601377	兴业证券	2023 年 7 月 14 日	6.12	261,700	1,601,604.00
149	601600	中国铝业	2023 年 7 月 4 日	5.49	8,000	43,920.00
150	601615	明阳智能	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 14 日	16.88	75,500	1,274,440.00
151	601628	中国人寿	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 28 日	34.96	13,000	454,480.00
152	601633	长城汽车	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	25.17	31,000	780,270.00
153	601658	邮储银行	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 12 日	4.89	525,600	2,570,184.00
154	601669	中国电建	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	5.74	325,800	1,870,092.00
155	601689	拓普集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	80.70	21,200	1,710,840.00
156	601698	中国卫通	2023 年 7 月 11 日	19.88	19,800	393,624.00
157	601728	中国电信	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	5.63	72,000	405,360.00
158	601788	光大证券	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	15.89	67,100	1,066,219.00
159	601799	星宇股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	123.60	3,000	370,800.00

160	601800	中国交建	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	10.91	81,300	886,983.00
161	601808	中海油服	2023 年 7 月 17 日	13.88	5,800	80,504.00
162	601816	京沪高铁	2023 年 7 月 10 日	5.26	13,800	72,588.00
163	601865	福莱特	2023 年 7 月 11 日	38.51	20,000	770,200.00
164	601872	招商轮船	2023 年 7 月 10 日	5.79	154,600	895,134.00
165	601877	正泰电器	2023 年 7 月 4 日	27.65	35,000	967,750.00
166	601881	中国银河	2023 年 7 月 10 日	11.61	59,000	684,990.00
167	601888	中国中免	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	110.53	30,800	3,404,324.00
168	601898	中煤能源	2023 年 7 月 3 日	8.44	42,900	362,076.00
169	601919	中远海控	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	9.40	302,600	2,844,440.00
170	601988	中国银行	2023 年 7 月 3 日	3.91	553,300	2,163,403.00
171	601989	中国重工	2023 年 7 月 5 日	4.82	203,700	981,834.00
172	601995	中金公司	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	35.52	34,300	1,218,336.00
173	603019	中科曙光	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	50.90	55,400	2,819,860.00
174	603185	弘元绿能	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	74.55	9,700	723,135.00
175	603195	公牛集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	96.06	3,500	336,210.00
176	603259	药明康德	2023 年 7 月 3 日	62.31	10,000	623,100.00
177	603260	合盛硅业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	70.02	14,800	1,036,296.00
178	603288	海天味业	2023 年 7 月 13 日	46.85	66,800	3,129,580.00
179	603369	今世缘	2023 年 7 月 10 日	52.80	5,000	264,000.00
180	603392	万泰生物	2023 年 7 月 4 日	66.77	11,200	747,824.00
181	603486	科沃斯	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	77.77	10,200	793,254.00

182	603501	韦尔股份	2023 年 7 月 27 日	98.04	10,000	980,400.00
183	603806	福斯特	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	37.19	24,500	911,155.00
184	603833	欧派家居	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	95.80	8,600	823,880.00
185	603899	晨光股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 12 日	44.64	17,500	781,200.00
186	603986	兆易创新	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 27 日	106.25	25,000	2,656,250.00
187	605499	东鹏饮料	2023 年 7 月 4 日	172.90	1,900	328,510.00
188	688005	容百科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	54.02	14,100	761,682.00
189	688008	澜起科技	2023 年 7 月 12 日	57.42	8,000	459,360.00
190	688012	中微公司	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	156.45	20,000	3,129,000.00
191	688036	传音控股	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 28 日	147.00	14,800	2,175,600.00
192	688065	凯赛生物	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	62.26	8,200	510,532.00
193	688111	金山办公	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	472.22	8,600	4,061,092.00
194	688126	沪硅产业	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 7 日	20.90	50,000	1,045,000.00
195	688187	时代电气	2023 年 7 月 3 日	41.86	5,300	221,858.00
196	688223	晶科能源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	14.06	94,300	1,325,858.00
197	688303	大全能源	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 5 日	40.45	14,100	570,345.00
198	688363	华熙生物	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	89.16	9,100	811,356.00
199	688396	华润微	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	52.41	21,600	1,132,056.00
200	688561	奇安信	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	51.81	5,700	295,317.00
201	688599	天合光能	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	42.61	51,300	2,185,893.00
合计	-	-	-	-	12,385,500	216,526,390.00

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公

司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的

国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.3 流动性风险

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

理的价格变现。

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

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,263,592.36	-	-	-	20,263,592.36
结算备付金	8,334,922.29	-	-	-	8,334,922.29
存出保证金	3,057,456.31	-	-	-	3,057,456.31
交易性金融资产	-	-	-	3,598,009,664.82	3,598,009,664.82
应收股利	-	-	-	317,120.86	317,120.86
应收清算款	-	-	-	92,971.64	92,971.64
其他资产	-	-	-	110,730.86	110,730.86
资产总计	31,655,970.96	-	-	3,598,530,488.18	3,630,186,459.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,192,534.18	1,192,534.18
应付托管费	-	-	-	149,066.80	149,066.80
应付清算款	-	-	-	3,577,413.18	3,577,413.18
应交税费	-	-	-	19,797.89	19,797.89
其他负债	-	-	-	804,394.33	804,394.33
负债总计	-	-	-	5,743,206.38	5,743,206.38

利率敏感度缺口	31,655,970.96	-	-	-3,592,787,281.80	3,624,443,252.76
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,203,852.28	-	-	-	15,203,852.28
结算备付金	8,753,596.05	-	-	-	8,753,596.05
存出保证金	2,866,013.65	-	-	-	2,866,013.65
交易性金融资产	-	-	-	-3,608,918,487.01	3,608,918,487.01
应收股利	-	-	-	5,707.10	5,707.10
应收清算款	-	-	-	12,306.84	12,306.84
其他资产	-	-	-	85,890.68	85,890.68
资产总计	26,823,461.98	-	-	-3,609,022,391.63	3,635,845,853.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,238,088.38	1,238,088.38
应付托管费	-	-	-	154,761.02	154,761.02
应交税费	-	-	-	14,649.24	14,649.24
其他负债	-	-	-	2,140,415.07	2,140,415.07
负债总计	-	-	-	3,547,913.71	3,547,913.71
利率敏感度缺口	26,823,461.98	-	-	-3,605,474,477.92	3,632,297,939.90

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,598,009,664.82	99.27	3,608,918,487.01	99.36
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,598,009,664.82	99.27	3,608,918,487.01	99.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准中的 权益指数上涨 5%	175,361,083.08	182,468,536.50
	业绩比较基准中的 权益指数下跌 5%	-175,361,083.08	-182,468,536.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,589,705,875.85	3,582,323,903.56
第二层次	896,796.18	-
第三层次	7,406,992.79	26,594,583.45
合计	3,598,009,664.82	3,608,918,487.01

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 432,798,653.69 元(上年度可比期间：1,482,028,724.18 元)，其中包括以股票支付的申购款 245,509,758.00 元和以现金支付的申购款 187,288,895.69 元(上年度可比期间：其中包括以股票支付的申购款 846,211,446.25 元和以现金支付的申购款 635,817,277.93 元)。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,598,009,664.82	99.11
	其中：股票	3,598,009,664.82	99.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,598,514.65	0.79
8	其他各项资产	3,578,279.67	0.10
9	合计	3,630,186,459.14	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 216,526,390.00 元，占期末资产净值比例为 5.97%。

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	40,250,857.00	1.11
B	采矿业	140,129,729.72	3.87
C	制造业	2,032,194,337.32	56.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,321,773.73	2.96
E	建筑业	85,347,759.22	2.35
F	批发和零售业	12,000,433.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	112,115,454.02	3.09
H	住宿和餐饮业	3,670,878.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	178,057,761.17	4.91
J	金融业	736,783,114.52	20.33
K	房地产业	53,907,087.00	1.49

L	租赁和商务服务业	33,639,309.88	0.93
M	科学研究和技术服务业	35,126,398.66	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	20,593,944.30	0.57
R	文化、体育和娱乐业	4,865,038.31	0.13
S	综合	—	—
	合计	3,596,003,875.85	99.22

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,859,906.58	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	9,454.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,207.14	0.00
J	金融业	—	—
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,005,788.97	0.06

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	119,509	202,089,719.00	5.58
2	300750	宁德时代	502,175	114,892,618.25	3.17
3	601318	中国平安	2,062,049	95,679,073.60	2.64
4	600036	招商银行	2,356,212	77,189,505.12	2.13
5	000858	五 粮 液	369,472	60,434,535.04	1.67
6	000333	美的集团	935,839	55,139,633.88	1.52
7	002594	比亚迪	172,542	44,562,422.34	1.23
8	601166	兴业银行	2,768,983	43,334,583.95	1.20
9	600900	长江电力	1,863,257	41,103,449.42	1.13
10	600276	恒瑞医药	849,808	40,705,803.20	1.12
11	600030	中信证券	1,856,370	36,718,998.60	1.01
12	601899	紫金矿业	3,135,600	35,651,772.00	0.98
13	600887	伊利股份	1,211,364	34,305,828.48	0.95
14	300059	东方财富	2,415,216	34,296,067.20	0.95
15	601012	隆基绿能	1,154,250	33,092,347.50	0.91
16	601398	工商银行	6,675,600	32,176,392.00	0.89
17	600309	万华化学	358,523	31,492,660.32	0.87
18	000651	格力电器	857,527	31,308,310.77	0.86
19	002475	立讯精密	950,395	30,840,317.75	0.85
20	601328	交通银行	5,232,000	30,345,600.00	0.84
21	002415	海康威视	890,859	29,496,341.49	0.81
22	000568	泸州老窖	139,922	29,323,453.54	0.81
23	000725	京东方 A	7,137,500	29,192,375.00	0.81
24	300760	迈瑞医疗	92,282	27,666,143.60	0.76
25	000063	中兴通讯	606,600	27,624,564.00	0.76
26	601816	京沪高铁	4,673,700	24,583,662.00	0.68
27	603259	药明康德	390,648	24,341,276.88	0.67
28	002230	科大讯飞	352,348	23,945,570.08	0.66
29	300274	阳光电源	197,958	23,087,841.54	0.64
30	600028	中国石化	3,618,520	23,013,787.20	0.63
31	601668	中国建筑	3,991,000	22,908,340.00	0.63
32	300124	汇川技术	354,595	22,768,544.95	0.63
33	002714	牧原股份	520,575	21,942,236.25	0.61
34	601288	农业银行	6,081,700	21,468,401.00	0.59
35	002352	顺丰控股	466,177	21,019,920.93	0.58
36	000001	平安银行	1,847,272	20,744,864.56	0.57

37	601888	中国中免	185,896	20,547,084.88	0.57
38	002129	TCL 中环	615,195	20,424,474.00	0.56
39	000792	盐湖股份	1,033,500	19,812,195.00	0.55
40	601088	中国神华	628,200	19,317,150.00	0.53
41	002142	宁波银行	754,489	19,088,571.70	0.53
42	601138	工业富联	756,700	19,068,840.00	0.53
43	688981	中芯国际	372,800	18,833,856.00	0.52
44	600031	三一重工	1,130,072	18,793,097.36	0.52
45	300498	温氏股份	997,745	18,308,620.75	0.51
46	000002	万 科 A	1,295,600	18,164,312.00	0.50
47	600048	保利发展	1,368,083	17,826,121.49	0.49
48	600016	民生银行	4,729,300	17,734,875.00	0.49
49	600406	国电南瑞	764,064	17,649,878.40	0.49
50	600438	通威股份	514,200	17,642,202.00	0.49
51	600050	中国联通	3,632,500	17,436,000.00	0.48
52	600809	山西汾酒	92,741	17,163,576.87	0.47
53	600837	海通证券	1,839,500	16,960,190.00	0.47
54	600690	海尔智家	720,920	16,927,201.60	0.47
55	601601	中国太保	650,900	16,910,382.00	0.47
56	601728	中国电信	2,955,700	16,640,591.00	0.46
57	688111	金山办公	35,100	16,574,922.00	0.46
58	600919	江苏银行	2,251,600	16,549,260.00	0.46
59	600089	特变电工	739,900	16,492,371.00	0.46
60	300015	爱尔眼科	887,486	16,462,865.30	0.45
61	600436	片仔癀	57,387	16,433,341.32	0.45
62	600000	浦发银行	2,234,472	16,177,577.28	0.45
63	601857	中国石油	2,157,300	16,115,031.00	0.44
64	600941	中国移动	171,800	16,028,940.00	0.44
65	002371	北方华创	50,353	15,994,630.45	0.44
66	601988	中国银行	4,008,300	15,672,453.00	0.43
67	603501	韦尔股份	157,716	15,462,476.64	0.43
68	002304	洋河股份	114,800	15,078,980.00	0.42
69	601766	中国中车	2,313,130	15,035,345.00	0.41
70	603288	海天味业	317,795	14,888,695.75	0.41
71	601390	中国中铁	1,955,100	14,819,658.00	0.41
72	600905	三峡能源	2,721,500	14,614,455.00	0.40
73	300014	亿纬锂能	233,391	14,120,155.50	0.39
74	600150	中国船舶	425,100	13,990,041.00	0.39
75	000938	紫光股份	435,199	13,861,088.15	0.38
76	002466	天齐锂业	196,717	13,752,485.47	0.38
77	601688	华泰证券	979,600	13,489,092.00	0.37
78	603986	兆易创新	126,722	13,464,212.50	0.37
79	601225	陕西煤业	738,600	13,435,134.00	0.37

80	002027	分众传媒	1,922,500	13,092,225.00	0.36
81	002459	晶澳科技	313,780	13,084,626.00	0.36
82	002460	赣锋锂业	214,639	13,084,393.44	0.36
83	601169	北京银行	2,819,700	13,055,211.00	0.36
84	000338	潍柴动力	1,032,400	12,863,704.00	0.35
85	688012	中微公司	82,100	12,844,545.00	0.35
86	600570	恒生电子	289,413	12,818,101.77	0.35
87	601985	中国核电	1,794,200	12,649,110.00	0.35
88	600104	上汽集团	888,900	12,595,713.00	0.35
89	002050	三花智控	409,610	12,394,798.60	0.34
90	000625	长安汽车	945,865	12,230,034.45	0.34
91	002049	紫光国微	129,340	12,060,955.00	0.33
92	601211	国泰君安	858,300	12,007,617.00	0.33
93	600111	北方稀土	481,400	11,543,972.00	0.32
94	601919	中远海控	1,212,792	11,400,244.80	0.31
95	603019	中科曙光	222,640	11,332,376.00	0.31
96	000100	TCL 科技	2,858,630	11,263,002.20	0.31
97	603799	华友钴业	243,329	11,171,234.39	0.31
98	601628	中国人寿	316,743	11,073,335.28	0.31
99	002179	中航光电	242,172	10,982,500.20	0.30
100	600660	福耀玻璃	304,945	10,932,278.25	0.30
101	601229	上海银行	1,893,534	10,887,820.50	0.30
102	601818	光大银行	3,538,400	10,862,888.00	0.30
103	600585	海螺水泥	457,159	10,852,954.66	0.30
104	002812	恩捷股份	111,700	10,762,295.00	0.30
105	600009	上海机场	236,745	10,752,957.90	0.30
106	600893	航发动力	253,760	10,723,897.60	0.30
107	002271	东方雨虹	383,764	10,461,406.64	0.29
108	601989	中国重工	2,167,504	10,447,369.28	0.29
109	601658	邮储银行	2,116,100	10,347,729.00	0.29
110	300122	智飞生物	228,445	10,097,269.00	0.28
111	600958	东方证券	996,904	9,669,968.80	0.27
112	002555	三七互娱	295,500	9,629,040.00	0.27
113	600999	招商证券	706,180	9,582,862.60	0.26
114	600019	宝钢股份	1,697,700	9,541,074.00	0.26
115	000977	浪潮信息	196,328	9,521,908.00	0.26
116	600760	中航沈飞	210,032	9,451,440.00	0.26
117	300896	爱美客	20,600	9,165,970.00	0.25
118	002709	天赐材料	219,696	9,049,278.24	0.25
119	688036	传音控股	61,100	8,981,700.00	0.25
120	300316	晶盛机电	124,300	8,812,870.00	0.24
121	688599	天合光能	206,600	8,803,226.00	0.24
122	688008	澜起科技	151,500	8,699,130.00	0.24

123	600426	华鲁恒升	283,200	8,674,416.00	0.24
124	601186	中国铁建	875,900	8,627,615.00	0.24
125	601360	三六零	679,300	8,518,422.00	0.24
126	600584	长电科技	270,878	8,443,267.26	0.23
127	601006	大秦铁路	1,132,201	8,412,253.43	0.23
128	000661	长春高新	61,600	8,396,080.00	0.23
129	601600	中国铝业	1,511,800	8,299,782.00	0.23
130	000776	广发证券	562,400	8,272,904.00	0.23
131	002920	德赛西威	53,000	8,257,930.00	0.23
132	002410	广联达	253,455	8,234,752.95	0.23
133	600745	闻泰科技	165,717	8,103,561.30	0.22
134	300142	沃森生物	306,297	8,101,555.65	0.22
135	002241	歌尔股份	455,544	8,085,906.00	0.22
136	600547	山东黄金	344,177	8,081,275.96	0.22
137	601377	兴业证券	1,315,580	8,051,349.60	0.22
138	600588	用友网络	392,529	8,046,844.50	0.22
139	601939	建设银行	1,279,400	8,009,044.00	0.22
140	000166	申万宏源	1,715,800	7,926,996.00	0.22
141	601009	南京银行	985,023	7,880,184.00	0.22
142	600011	华能国际	838,300	7,762,658.00	0.21
143	600010	包钢股份	4,316,000	7,725,640.00	0.21
144	001979	招商蛇口	589,158	7,676,728.74	0.21
145	000596	古井贡酒	31,000	7,668,780.00	0.21
146	300450	先导智能	208,800	7,552,296.00	0.21
147	601669	中国电建	1,314,133	7,543,123.42	0.21
148	600085	同仁堂	130,653	7,520,386.68	0.21
149	300408	三环集团	255,833	7,508,698.55	0.21
150	600196	复星医药	242,400	7,490,160.00	0.21
151	002311	海大集团	158,197	7,409,947.48	0.20
152	601800	中国交建	676,015	7,375,323.65	0.20
153	603659	璞泰来	191,774	7,329,602.28	0.20
154	000963	华东医药	167,000	7,242,790.00	0.20
155	603993	洛阳钼业	1,345,900	7,173,647.00	0.20
156	600886	国投电力	566,688	7,168,603.20	0.20
157	000538	云南白药	136,557	7,166,511.36	0.20
158	300033	同花顺	40,715	7,136,525.20	0.20
159	000768	中航西飞	265,386	7,099,075.50	0.20
160	600600	青岛啤酒	67,432	6,987,978.16	0.19
161	600845	宝信软件	136,787	6,950,147.47	0.19
162	300782	卓胜微	71,000	6,860,730.00	0.19
163	601689	拓普集团	84,000	6,778,800.00	0.19
164	002252	上海莱士	900,500	6,762,755.00	0.19
165	002493	荣盛石化	578,385	6,732,401.40	0.19

166	000733	振华科技	69,400	6,651,990.00	0.18
167	600926	杭州银行	565,000	6,638,750.00	0.18
168	601100	恒立液压	101,888	6,554,455.04	0.18
169	600015	华夏银行	1,211,000	6,551,510.00	0.18
170	600795	国电电力	1,698,500	6,505,255.00	0.18
171	002180	纳思达	189,200	6,480,100.00	0.18
172	600176	中国巨石	457,496	6,478,143.36	0.18
173	300347	泰格医药	99,907	6,447,997.78	0.18
174	600732	爱旭股份	208,540	6,412,605.00	0.18
175	000157	中联重科	947,600	6,396,300.00	0.18
176	600674	川投能源	424,300	6,385,715.00	0.18
177	603369	今世缘	119,318	6,299,990.40	0.17
178	002236	大华股份	316,822	6,257,234.50	0.17
179	600115	中国东航	1,302,100	6,197,996.00	0.17
180	600029	南方航空	1,027,000	6,192,810.00	0.17
181	000425	徐工机械	898,542	6,083,129.34	0.17
182	601066	中信建投	247,400	5,987,080.00	0.17
183	000301	东方盛虹	502,500	5,939,550.00	0.16
184	601995	中金公司	166,700	5,921,184.00	0.16
185	601788	光大证券	371,900	5,909,491.00	0.16
186	601633	长城汽车	234,700	5,907,399.00	0.16
187	300496	中科创达	61,200	5,896,620.00	0.16
188	601336	新华保险	159,150	5,851,945.50	0.16
189	601117	中国化学	698,700	5,785,236.00	0.16
190	601868	中国能建	2,464,300	5,766,462.00	0.16
191	600346	恒力石化	400,900	5,744,897.00	0.16
192	601877	正泰电器	204,150	5,644,747.50	0.16
193	002074	国轩高科	203,400	5,617,908.00	0.16
194	002202	金风科技	527,164	5,598,481.68	0.15
195	600741	华域汽车	299,970	5,537,446.20	0.15
196	601111	中国国航	665,514	5,483,835.36	0.15
197	002001	新 和 成	352,860	5,434,044.00	0.15
198	688126	沪硅产业	259,900	5,431,910.00	0.15
199	601618	中国中冶	1,362,500	5,409,125.00	0.15
200	300454	深信服	47,600	5,390,700.00	0.15
201	002821	凯莱英	45,540	5,367,344.40	0.15
202	688223	晶科能源	380,300	5,347,018.00	0.15
203	002841	视源股份	79,900	5,340,516.00	0.15
204	600989	宝丰能源	419,900	5,294,939.00	0.15
205	688396	华润微	100,700	5,277,687.00	0.15
206	603806	福斯特	141,874	5,276,294.06	0.15
207	600188	兖矿能源	174,618	5,224,570.56	0.14
208	601838	成都银行	426,200	5,203,902.00	0.14

209	601901	方正证券	785,400	5,136,516.00	0.14
210	300661	圣邦股份	62,280	5,115,056.40	0.14
211	601615	明阳智能	301,700	5,092,696.00	0.14
212	000876	新 希 望	430,808	5,031,837.44	0.14
213	688303	大全能源	122,200	4,942,990.00	0.14
214	600460	士兰微	162,300	4,912,821.00	0.14
215	600039	四川路桥	498,440	4,889,696.40	0.13
216	605117	德业股份	32,620	4,878,321.00	0.13
217	300413	芒果超媒	142,211	4,865,038.31	0.13
218	000895	双汇发展	197,600	4,839,224.00	0.13
219	603392	万泰生物	72,437	4,836,618.49	0.13
220	002648	卫星化学	320,560	4,795,577.60	0.13
221	002736	国信证券	549,156	4,794,131.88	0.13
222	600233	圆通速递	328,800	4,787,328.00	0.13
223	601607	上海医药	212,300	4,757,643.00	0.13
224	603260	合盛硅业	67,700	4,740,354.00	0.13
225	000786	北新建材	192,718	4,723,518.18	0.13
226	300769	德方纳米	42,440	4,678,161.20	0.13
227	003816	中国广核	1,502,101	4,671,534.11	0.13
228	002007	华兰生物	207,787	4,656,506.67	0.13
229	300207	欣旺达	284,300	4,639,776.00	0.13
230	300999	金龙鱼	113,100	4,522,869.00	0.12
231	002601	龙佰集团	272,320	4,493,280.00	0.12
232	300751	迈为股份	26,420	4,475,019.60	0.12
233	300433	蓝思科技	378,186	4,447,467.36	0.12
234	601238	广汽集团	421,600	4,393,072.00	0.12
235	300759	康龙化成	113,300	4,337,124.00	0.12
236	600383	金地集团	600,516	4,329,720.36	0.12
237	601021	春秋航空	74,800	4,298,756.00	0.12
238	600332	白云山	133,249	4,247,978.12	0.12
239	600132	重庆啤酒	46,000	4,239,360.00	0.12
240	600763	通策医疗	42,650	4,131,079.00	0.11
241	300223	北京君正	45,700	4,035,767.00	0.11
242	600219	南山铝业	1,334,000	4,028,680.00	0.11
243	300763	锦浪科技	37,900	3,945,390.00	0.11
244	600875	东方电气	211,200	3,938,880.00	0.11
245	000983	山西焦煤	431,300	3,924,830.00	0.11
246	002756	永兴材料	61,520	3,851,767.20	0.11
247	600362	江西铜业	198,200	3,761,836.00	0.10
248	601865	福莱特	97,300	3,747,023.00	0.10
249	000723	美锦能源	495,000	3,732,300.00	0.10
250	601699	潞安环能	227,200	3,707,904.00	0.10
251	600754	锦江酒店	86,700	3,670,878.00	0.10

252	600918	中泰证券	530,113	3,663,080.83	0.10
253	601878	浙商证券	367,900	3,634,852.00	0.10
254	601872	招商轮船	616,700	3,570,693.00	0.10
255	601319	中国人保	609,700	3,560,648.00	0.10
256	603290	斯达半导	16,300	3,507,760.00	0.10
257	601998	中信银行	585,500	3,501,290.00	0.10
258	600061	国投资本	488,849	3,480,604.88	0.10
259	000617	中油资本	479,100	3,463,893.00	0.10
260	000069	华侨城 A	783,200	3,446,080.00	0.10
261	000408	藏格矿业	151,100	3,410,327.00	0.09
262	603486	科沃斯	43,620	3,392,327.40	0.09
263	300628	亿联网络	96,235	3,374,961.45	0.09
264	600803	新奥股份	177,300	3,365,154.00	0.09
265	601799	星宇股份	27,100	3,349,560.00	0.09
266	603833	欧派家居	34,880	3,341,504.00	0.09
267	600884	杉杉股份	216,600	3,279,324.00	0.09
268	688363	华熙生物	36,581	3,261,561.96	0.09
269	300601	康泰生物	128,120	3,252,966.80	0.09
270	688005	容百科技	60,200	3,252,004.00	0.09
271	002938	鹏鼎控股	132,589	3,220,586.81	0.09
272	603899	晨光股份	70,842	3,162,386.88	0.09
273	600183	生益科技	221,700	3,148,140.00	0.09
274	300919	中伟股份	51,100	3,078,775.00	0.08
275	000708	中信特钢	192,400	3,047,616.00	0.08
276	002916	深南电路	39,027	2,941,464.99	0.08
277	601898	中煤能源	347,000	2,928,680.00	0.08
278	603185	弘元绿能	39,140	2,917,887.00	0.08
279	601881	中国银河	245,304	2,847,979.44	0.08
280	600018	上港集团	529,100	2,777,775.00	0.08
281	688561	奇安信	51,900	2,688,939.00	0.07
282	000877	天山股份	328,400	2,673,176.00	0.07
283	601216	君正集团	646,500	2,650,650.00	0.07
284	002120	韵达股份	275,860	2,637,221.60	0.07
285	002064	华峰化学	377,800	2,591,708.00	0.07
286	002414	高德红外	327,310	2,543,198.70	0.07
287	601155	新城控股	171,001	2,464,124.41	0.07
288	600025	华能水电	343,000	2,445,590.00	0.07
289	600606	绿地控股	808,429	2,223,179.75	0.06
290	300957	贝泰妮	24,300	2,159,784.00	0.06
291	603195	公牛集团	21,996	2,112,935.76	0.06
292	688187	时代电气	49,300	2,063,698.00	0.06
293	688065	凯赛生物	33,100	2,060,806.00	0.06
294	601698	中国卫通	80,900	1,608,292.00	0.04

295	601808	中海油服	112,100	1,555,948.00	0.04
296	000800	一汽解放	175,300	1,467,261.00	0.04
297	605499	东鹏饮料	8,300	1,435,070.00	0.04
298	300979	华利集团	28,800	1,403,712.00	0.04
299	601236	红塔证券	179,320	1,335,934.00	0.04
300	001289	龙源电力	28,900	650,250.00	0.02

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
3	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
4	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
5	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
6	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
7	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
8	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
9	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
10	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
11	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
12	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
13	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
14	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
15	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
16	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
17	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
18	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
19	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
20	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
21	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
22	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
23	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
24	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
25	873576	天力复合	1,800	16,830.00	0.00
26	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
27	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
28	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
29	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
30	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
31	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
32	837592	华信永道	1,400	14,532.00	0.00

33	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
34	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
35	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
36	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
37	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
38	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
39	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
40	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
41	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
42	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
43	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
44	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
45	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
46	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
47	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
48	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
49	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
50	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
51	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
52	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
53	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
54	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
55	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
56	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
57	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
58	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
59	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	15,451,459.04	0.43
2	000858	五粮液	9,608,218.00	0.26
3	002555	三七互娱	8,203,245.00	0.23
4	600028	中国石化	7,242,633.00	0.20
5	000333	美的集团	7,094,154.98	0.20
6	600941	中国移动	6,949,715.00	0.19
7	002594	比亚迪	6,715,352.00	0.18
8	600905	三峡能源	5,760,813.00	0.16
9	600732	爱旭股份	5,682,900.00	0.16

10	300059	东方财富	5,362,556.93	0.15
11	601607	上海医药	4,952,283.00	0.14
12	688223	晶科能源	4,647,963.50	0.13
13	000983	山西焦煤	4,442,083.00	0.12
14	601899	紫金矿业	4,403,505.00	0.12
15	600754	锦江酒店	4,202,501.00	0.12
16	601818	光大银行	4,150,441.00	0.11
17	002415	海康威视	4,121,080.00	0.11
18	000651	格力电器	4,033,354.00	0.11
19	002371	北方华创	3,996,943.00	0.11
20	300760	迈瑞医疗	3,911,529.00	0.11

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	17,089,427.62	0.47
2	000858	五粮液	10,633,742.16	0.29
3	002602	世纪华通	7,938,193.00	0.22
4	000333	美的集团	7,629,768.00	0.21
5	600900	长江电力	7,618,075.13	0.21
6	002594	比亚迪	7,460,328.00	0.21
7	002555	三七互娱	7,380,776.00	0.20
8	300059	东方财富	5,926,896.00	0.16
9	600519	贵州茅台	5,652,609.50	0.16
10	002415	海康威视	4,761,317.00	0.13
11	002008	大族激光	4,631,365.26	0.13
12	000651	格力电器	4,460,805.00	0.12
13	300760	迈瑞医疗	4,317,617.00	0.12
14	002475	立讯精密	4,170,723.00	0.11
15	000725	京东方 A	4,168,627.00	0.11
16	603882	金域医学	4,157,204.00	0.11
17	002371	北方华创	4,127,233.00	0.11
18	000568	泸州老窖	3,896,844.00	0.11
19	002600	领益智造	3,887,325.00	0.11
20	002352	顺丰控股	3,850,096.00	0.11

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	384,845,529.28
卖出股票收入（成交）总额	359,922,887.54

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

招商银行股份有限公司因个人经营贷款挪用至房地产市场等行为在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚，因发卡授信不审慎等行为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衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格等行为在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的行政处罚，因债券承销业务严重违反审慎经营规则、未依法履行其他职责等行为在本报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,057,456.31
2	应收清算款	92,971.64
3	应收股利	317,120.86
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	110,730.86
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,578,279.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	1,143,950.00	0.03	转融通流通受限
2	000333	美的集团	765,960.00	0.02	转融通流通受限
3	600900	长江电力	132,360.00	0.00	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	----------	--------	----------

			允价值	值比例（%）	
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.01	网下新股流通受限
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.00	网下新股流通受限
3	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定期流通受限
4	301292	海科新源	116,421.76	0.00	网下新股流通受限
5	688472	阿特斯	106,687.44	0.00	新股锁定期流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,889	303,461.34	866,251,851.00	98.81	10,447,963.00	1.19

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

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
招商银行股份有限公司-泰康沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	9,753,986.00	1.11

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	泰康人寿保险有限责任公司—个人分红产品	628,349,466.00	71.67
2	泰康人寿保险有限责任公司—传统保险产品	144,042,647.00	16.43
3	泰康养老保险股份有限公司—自有资金	20,478,000.00	2.34
4	安信证券股份有限公司	8,609,900.00	0.98
5	广发证券股份有限公司	7,260,194.00	0.83
6	国泰君安证券股份有限公司	6,600,543.00	0.75
7	泰康养老保险股份有限公司—万能甲保险投资账户	6,238,100.00	0.71
8	招商证券股份有限公司	5,058,697.00	0.58
9	东方证券股份有限公司	4,486,722.00	0.51

10	泰康养老保险股份有限公司—分红型保险投资账户	3,886,100.00	0.44
11	招商银行股份有限公司—泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	9,753,986.00	1.11

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 12 月 27 日） 基金份额总额	7,160,604,619.00
本报告期期初基金份额总额	882,099,814.00
本报告期基金总申购份额	100,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	106,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	876,699,814.00

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券	4	330,713,118.95	45.11	167,906.04	55.44	—
广发证券	4	235,746,353.67	32.16	63,976.52	21.12	—
华泰证券	6	166,631,842.11	22.73	70,968.73	23.43	—
安信证券	4	—	—	—	—	—
财通证券	2	—	—	—	—	—

长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	6	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	4	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；

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

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

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

本报告期内本基金减少租用 60 个交易单元，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，开源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，浙商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投证券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，德邦证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，信达证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，

汇丰前海证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，西部证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东北证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华西证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国金证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华鑫证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，财通证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，民生证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华安证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	250,308.63	23.12	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	832,313.12	76.88	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证	-	-	-	-	-	-

券						
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海证券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-

投证券						
中邮证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第四季度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
2	泰康基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 03 月 17 日
3	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 03 月 22 日
4	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日
5	泰康基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
6	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第一季度报告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
7	关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 05 月 24 日
8	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 05 月 25 日
9	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告	《上海证券报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 06 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101 - 20230630	628,349,466.00	0.00	0.00	628,349,466.00	71.67

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

泰康基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日