

泰康沪深 300 交易型开放式 指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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 2020 年 8 月 28 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	80
7.1 期末基金资产组合情况.....	80
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	80
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.....	82
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	90
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	92
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.....	92
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	92
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	93
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.....	93
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	93
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	93
7.12 投资组合报告附注.....	93
§8 基金份额持有人信息.....	96
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	96
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	96
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	96
§9 开放式基金份额变动.....	97
§10 重大事件揭示.....	98
10.1 基金份额持有人大会决议.....	98
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.....	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	98
10.4 基金投资策略的改变.....	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	98
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.....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	98
10.8 其他重大事件.....	100
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	102

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	102
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	102
§12 备查文件目录.....	103
12.1 备查文件目录.....	103
12.2 存放地点.....	103
12.3 查阅方式.....	103

§ 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	1,800,099,814.00 份
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020-03-23

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。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。</p> <p>本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。基于流动性管理的需要，本基金可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	陈玮光	张燕

人	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	李建红

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国 际大厦 5 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	-13,335,150.39
本期利润	184,975,834.95
加权平均基金份额本期利润	0.0643
本期加权平均净值利润率	2.66%
本期基金份额净值增长率	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-12,625,726.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0070
期末基金资产净值	7,559,085,608.04
期末基金份额净值	4.1993
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.29%

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) 本基金合同生效日为 2019 年 12 月 27 日，截止报告期末本基金未满一年。

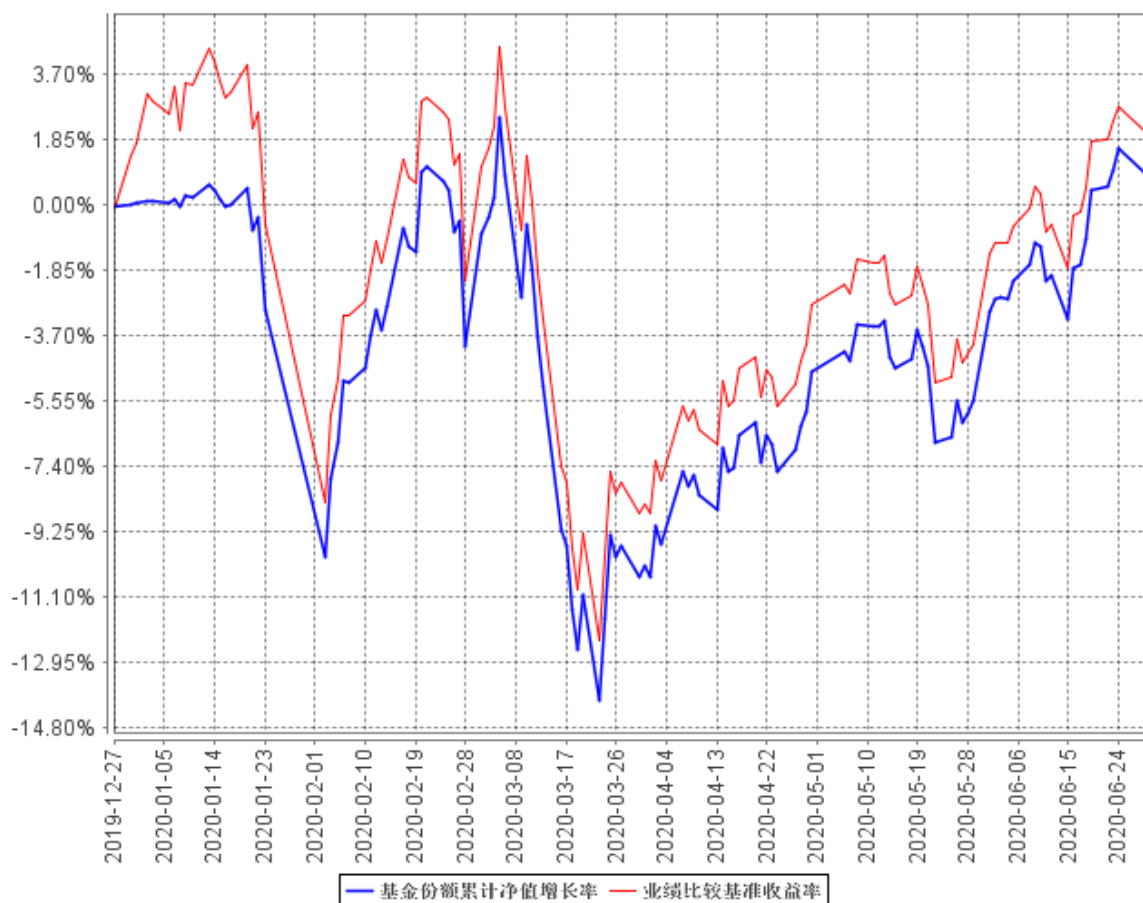
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.31%	0.90%	7.68%	0.90%	0.63%	0.00%
过去三个月	13.95%	0.90%	12.96%	0.90%	0.99%	0.00%
过去六个月	2.23%	1.46%	1.64%	1.52%	0.59%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.29%	1.44%	3.43%	1.51%	-1.14%	-0.07%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2019 年 12 月 27 日生效, 截止报告期末本基金未满一年。
- 2、按照本基金的基金合同规定, 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定, 建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2019 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 17000 亿元。除管理泰康委托的资产外，泰康资产管理的第三方业务总规模突破 9000 亿元，另类投资管理规模超过 3900 亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过 3800 亿元，其中企业年金管理规模超过 2600 亿元，是国内最大的企业年金投资管理人。

2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金、泰康信用精选债券型证券投资基金、泰康

安欣纯债债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、泰康润和两年定期开放债券型证券投资基金、泰康睿福优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、泰康招泰尊享一年持有期混合型证券投资基金、泰康瑞丰纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康长江经济带债券型证券投资基金、泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰康申润一年持有期混合型证券投资基金共 45 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	-	12	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。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守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

宏观经济方面，2020 年上半年经济受到疫情影响，呈现了先快速下行、再明显反弹的走势。国内疫情得到明显控制，但还是疫情还在深度发酵，中国的生产能力优势凸显，承担了世界工厂的角色，出口部门表现出较强的韧性；国内复工复产较为顺利，基建和地产支撑经济，消费和制造业表现较弱。通胀方面，CPI 高位回落，PPI 明显下行，随后有所企稳；货币条件方面，在宽货币宽信用政策的支持下，M2 和社融的增速持续上行，汇率总体稳定。

权益市场方面，一季度，伴随新冠疫情在国内外的发生发展，沪深 300 指数呈现宽幅震荡下行的走势，报告期内下跌 10.02%，同期中证 500 指数下跌 4.29%，中证 1000 指数下跌 2.51%。风险释放过程中，成长和小市值风格占优。二季度，伴随新冠疫情在国内得到较好控制，沪深 300 指数呈现震荡上行走势，报告期内上涨 12.96%，同期中证 500 指数上涨 16.32%，中证 1000 指数上涨 16.44%。伴随宽基指数的稳步上行，投资者风险偏好不断提升，各主题指数表现优异，呈现结构性牛市特征。

从估值水平看，当前沪深 300 指数估值仍位于历史估值中位数附近，上半年沪深 300 指数仅上涨 1.64%。我们认为巨大的估值差和累计涨幅差之下，沪深 300 指数具有较好的安全边际和配置价值。报告期内，基金运作过程中未发生风险事件，基金场内交易及申购赎回正常。报告期内跟踪误差主要来源来自基金份额的申购和赎回。

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 4.1993 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.23%；同期业绩比较基准增长率为 1.64%。

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，基本面将延续复苏，斜率有所放缓。基建和地产将延续 2 季度的良好表现，但由于政策对于房地产市场的前瞻性防范，预计走向过热的可能性不高；出口将继续呈现出韧性；消费和服务业在消费场景逐步打开、居民消费意愿逐步提升的背景下，预计存在一定的改善空间，但居民收入形成制约。政策预计延续相机抉择的基调，考虑到当前的基本面环境，政策进一步放松或明显收紧的概率都不大，总体可能较为平稳。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	24,608,008.02	10,970,000.90
结算备付金		80,717,769.79	-
存出保证金		12,302,958.30	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,444,096,821.97	152,824,405.00
其中：股票投资		7,429,961,321.97	152,824,405.00
基金投资		-	-
债券投资		14,135,500.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	7,000,000,000.00
应收证券清算款		1,932,930.49	-
应收利息	6.4.7.5	290,345.56	1,264,995.43
应收股利		1,375,893.44	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	2,105.41
资产总计		7,565,324,727.57	7,165,061,506.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,326,026.52	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,379,629.59	313,865.06
应付托管费		297,453.70	39,233.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	571,259.02	-
应交税费		19,949.61	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	644,801.09	23,539.88
负债合计		6,239,119.53	376,638.07
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,389,671,740.79	7,160,604,619.00
未分配利润	6.4.7.10	169,413,867.25	4,080,249.67
所有者权益合计		7,559,085,608.04	7,164,684,868.67
负债和所有者权益总计		7,565,324,727.57	7,165,061,506.74

注：(1) 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.1993 元，基金份额总额 1,800,099,814.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		206,488,638.35
1.利息收入		11,388,602.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	554,740.17
债券利息收入		1,781.49
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,716,245.73
证券出借利息收入		1,103,448.41
其他利息收入		12,386.27
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,463,986.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-92,692,261.51
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-678,770.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	15,103,052.92
股利收益	6.4.7.16	74,803,992.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	198,310,985.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	253,037.75

列)		
减：二、费用		21,512,803.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,847,442.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,730,930.33
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,702,169.34
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		64,997.47
7. 其他费用	6.4.7.20	1,167,263.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		184,975,834.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		184,975,834.95

注：本基金合同生效日为 2019 年 12 月 27 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,160,604,619.00	4,080,249.67	7,164,684,868.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	184,975,834.95	184,975,834.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	229,067,121.79	-19,642,217.37	209,424,904.42
其中：1. 基金申购款	1,477,852,398.07	-104,794,687.61	1,373,057,710.46
2. 基金赎回款	-1,248,785,276.28	85,152,470.24	-1,163,632,806.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	7,389,671,740.79	169,413,867.25	7,559,085,608.04
-----------------	------------------	----------------	------------------

注：本基金合同生效日为 2019 年 12 月 27 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，本基金以 2020 年 2 月 12 日为折算日，进行了基金份额折算，折算前基金份额总额为 7,160,604,619.00 份，折算后基金份额总额为 1,744,299,814.00 份。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]65 号核准，本基金 1,744,299,814.00 份基金份额于 2020 年 3 月 23 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，还可投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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,可根据法律法规的规定参与融资和转通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。本基金目前暂无金融负债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。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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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，但基于本金的性质和特点，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的基金份额净值低于面值，即基金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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1. 估值方法及关键假设

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

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

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证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、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

2. 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

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。

(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费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 2020年6月30日
活期存款	24,608,008.02
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：	24,608,008.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,232,328,532.60	7,429,961,321.97	197,632,789.37
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,649,275.60	14,135,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	13,649,275.60	14,135,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,245,977,808.20	7,444,096,821.97	198,119,013.77

注：股票投资项含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	

权益衍生工具	99,670,942.43	-	-	
股指期货	99,670,942.43	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	99,670,942.43	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2007	沪深300期货2007 合约	57	70,417,800.00	3,277,777.57
IF2012	沪深300期货2012 合约	27	32,634,900.00	103,980.00
总额合计				3,381,757.57
减：可抵销期货暂收款				3,381,757.57
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	5,464.75
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	41,878.10
应收债券利息	10,086.96
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	232,016.85

其他	898.90
合计	290,345.56

6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	571,259.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	571,259.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	124,032.40
指数使用费	520,768.69
合计	644,801.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,160,604,619.00	7,160,604,619.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
2020年2月12日 基金拆分/份额折算前	7,160,604,619.00	7,160,604,619.00
基金拆分/份额折算变动份额	-5,416,304,805.00	-

本期申购	360,000,000.00	1,477,852,398.07
本期赎回(以“-”号填列)	-304,200,000.00	-1,248,785,276.28
本期末	1,800,099,814.00	7,389,671,740.79

注：1. 申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2019 年 11 月 15 日至 2019 年 12 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 7,158,504,619.00 元(含募集股票市值)。根据《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购基金资金产生的利息收入 2,102,106.31 元，其中 2,100,000.00 元为注册登记机构实际记录结转基金份额金额，折合 2,100,000.00 份基金份额。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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	890,463.67	3,189,786.00	4,080,249.67
本期利润	-13,335,150.39	198,310,985.34	184,975,834.95
本期基金份额交易产生的变动数	-181,040.25	-19,461,177.12	-19,642,217.37
其中：基金申购款	-5,950,014.96	-98,844,672.65	-104,794,687.61
基金赎回款	5,768,974.71	79,383,495.53	85,152,470.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,625,726.97	182,039,594.22	169,413,867.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	104,724.07
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	450,016.10
其他	-
合计	554,740.17

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-33,742,304.55
股票投资收益——赎回差价收入	-58,949,956.96
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	-92,692,261.51

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	1,214,029,314.39
减：卖出股票成本总额	1,247,771,618.94
买卖股票差价收入	-33,742,304.55

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,163,632,806.04
减：现金支付赎回款总额	400,977,446.04
减：赎回股票成本总额	821,605,316.96
赎回差价收入	-58,949,956.96

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-678,770.62
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	-678,770.62
----	-------------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	80,702,118.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	81,332,329.54
减：应收利息总额	48,559.42
买卖债券差价收入	-678,770.62

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	15,103,052.92

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	74,803,992.40
其中：证券出借权益补偿收入	3,194,009.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	74,803,992.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	194,929,227.77
——股票投资	194,443,003.37
——债券投资	486,224.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	3,381,757.57
——权证投资	-
股指期货投资	3,381,757.57
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	198,310,985.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	253,037.75
合计	253,037.75

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,702,169.34
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	4,702,169.34

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	10,059.96
指数使用费	1,038,558.20
银行费用	4,272.99
合计	1,167,263.59

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,847,442.67
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,730,930.33

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金份额。

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

泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同生效日为 2020 年 6 月 30 日，本报告期末及上年度末，本基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	24,608,008.02	104,724.07

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有招商银行（代码 600036）A 股普通股 5,184,725 股，期末估值为 174,828,927.00 元；其中转融通出借招商银行（代码 600036）A 股普通股 90,000 股，期末估值为 3,034,800.00 元。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	网下新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-

688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	网下 新股 流通 受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾 量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	网下 新股 流通 受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
300847	中船 汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	网下 新股 流通 受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	网下 新股 流通 受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	网下 新股 流通 受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特 智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	网下 新股 流通 受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	网下 新股 流通 受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
000063	中兴 通讯	2020 年 4 月 7 日	2020 年 10 月 9 日	大宗 交易 流通 受限	37.69	38.16	350,000	13,191,500.00	13,356,000.00	-
002007	华兰 生物	2020 年 5 月 21 日	2020 年 11 月 23 日	大宗 交易 流通 受限	38.10	46.76	228,000	8,686,800.00	10,661,280.00	-
002602	世纪 华通	2020 年 5 月 8 日	2020 年 11 月 9 日	大宗 交易 流通 受限	13.18	14.30	500,000	6,590,000.00	7,150,000.00	-
002456	欧菲 光	2020 年 6 月 10 日	2020 年 12 月 11 日	大宗 交易 流通 受限	15.44	16.61	420,000	6,484,800.00	6,976,200.00	-

603799	华友钴业	2020年6月1日	2020年12月2日	大宗交易流通受限	29.55	35.21	149,000	4,402,950.00	5,246,290.00	-
603658	安图生物	2020年6月29日	2020年12月30日	大宗交易流通受限	158.80	150.47	30,000	4,764,000.00	4,514,100.00	-
002468	申通快递	2020年6月30日	2020年12月31日	大宗交易流通受限	15.15	15.35	140,000	2,121,000.00	2,149,000.00	-
688169	石头科技	2020年2月13日	2020年8月21日	新股锁定期流通受限	271.12	365.14	5,382	1,459,167.84	1,965,183.48	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020年6月12日	2020年7月13日	网上新债流通受限	100.00	100.00	11,555	1,155,500.00	1,155,500.00	-
128114	正邦转债	2020年6月17日	2020年7月15日	网上新债流通受限	100.00	100.00	3,976	397,600.00	397,600.00	-

注：1. 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。

2. 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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:张)	期末估值总额
2020060300000343	002311	海大集团	2020年6月3日	2020年7月1日	47.59	10,000	475,900.00
2020060300000375	002739	万达电影	2020年6月3日	2020年7月1日	15.27	10,000	152,700.00
2020060300000388	300059	东方财富	2020年6月3日	2020年7月1日	20.20	60,000	1,212,000.00
2020060300000464	600390	五矿资本	2020年6月3日	2020年7月1日	7.06	64,800	457,488.00
2020060300000526	600516	方大炭素	2020年6月3日	2020年7月1日	6.28	14,600	91,688.00
2020060300000987	002024	苏宁易购	2020年6月3日	2020年7月1日	8.77	50,900	446,393.00
2020060300000989	002673	西部证券	2020年6月3日	2020年7月1日	8.16	19,000	155,040.00
2020060300000991	600795	国电电力	2020年6月3日	2020年7月1日	1.85	215,200	398,120.00
2020060300000993	300142	沃森生物	2020年6月3日	2020年7月1日	52.36	10,600	555,016.00

2020060300001207	600498	烽火通信	2020年6月3日	2020年7月1日	28.91	54,400	1,572,704.00
2020060400000341	000876	新希望	2020年6月4日	2020年7月2日	29.80	14,600	435,080.00
2020060400000379	002120	韵达股份	2020年6月4日	2020年7月2日	24.45	20,000	489,000.00
2020060400000469	002475	立讯精密	2020年6月4日	2020年7月2日	51.35	60,000	3,081,000.00
2020060400002113	600795	国电电力	2020年6月4日	2020年7月2日	1.85	101,700	188,145.00
2020060400002499	600297	广汇汽车	2020年6月4日	2020年7月2日	3.19	58,000	185,020.00
2020060400002501	002460	赣锋锂业	2020年6月4日	2020年7月2日	53.57	10,000	535,700.00
2020060400002509	600487	亨通光电	2020年6月4日	2020年7月2日	16.41	49,000	804,090.00
2020060400002513	600482	中国动力	2020年6月4日	2020年7月2日	15.70	49,000	769,300.00
2020060400002517	000063	中兴通讯	2020年6月4日	2020年7月2日	40.13	130,400	5,232,952.00
2020060400002523	601066	中信建投	2020年6月4日	2020年7月2日	39.38	26,000	1,023,880.00
2020060400003438	600516	方大炭素	2020年6月4日	2020年7月2日	6.28	5,840	36,675.20
2020060500000394	002252	上海莱士	2020年6月5日	2020年7月3日	8.46	22,100	186,966.00
2020060500000567	601668	中国建筑	2020年6月5日	2020年7月3日	4.77	10,000	47,700.00
2020060500000692	600183	生益科技	2020年6月5日	2020年7月	29.27	14,300	418,561.00

			日	3日			
2020060500003288	002007	华 兰 生物	2020年 6月5 日	2020 年7月 3日	50.11	25,000	1,252,750.00
2020060500008018	000063	中 兴 通讯	2020年 6月5 日	2020 年7月 3日	40.13	53,600	2,150,968.00
2020060500008020	600196	复 星 医药	2020年 6月5 日	2020 年7月 3日	33.85	60,000	2,031,000.00
2020060500008022	600703	三 安 光电	2020年 6月5 日	2020 年7月 3日	25.00	140,000	3,500,000.00
2020060500008024	601066	中 信 建投	2020年 6月5 日	2020 年7月 3日	39.38	26,300	1,035,694.00
2020060800000296	000100	TCL 科 技	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	6.20	80,000	496,000.00
2020060800000378	000783	长 江 证券	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	6.74	10,000	67,400.00
2020060800000442	002044	美 年 健康	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	14.41	32,200	464,002.00
2020060800000490	002230	科 大 讯飞	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	37.43	11,300	422,959.00
2020060800000568	002466	天 齐 锂业	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	22.95	31,000	711,450.00
2020060800000642	300124	汇 川 技术	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	37.99	10,000	379,900.00
2020060800000703	600795	国 电 电力	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	1.85	205,100	379,435.00
2020060800000717	601766	中 国 中车	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	5.57	64,100	357,037.00
2020060800000774	600029	南 方 航空	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	5.17	10,000	51,700.00
2020060800000859	600487	亨 通	2020年	2020	16.41	18,700	306,867.00

		光电	6 月 8 日	年 7 月 6 日			
2020060800000869	600660	福耀玻璃	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	20.87	92,300	1,926,301.00
2020060800000925	601989	中国重工	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	4.00	92,000	368,000.00
2020060800000934	600309	万华化学	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	49.99	70,600	3,529,294.00
2020060800000951	600690	海尔智家	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	17.70	23,100	408,870.00
2020060800001103	600208	新湖中宝	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	2.98	124,500	371,010.00
2020060800001117	600585	海螺水泥	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	52.91	62,000	3,280,420.00
2020060800001132	600170	上海建工	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	3.07	122,100	374,847.00
2020060800001136	600104	上汽集团	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	16.99	33,800	574,262.00
2020060800001147	600028	中国石化	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	3.91	211,100	825,401.00
2020060800001157	600028	中国石化	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	3.91	90,100	352,291.00
2020060800001178	600000	浦发银行	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	10.58	10,000	105,800.00
2020060800001272	600489	中金黄金	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	9.14	52,000	475,280.00
2020060800001284	600111	北方稀土	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	9.32	41,700	388,644.00
2020060800001291	600498	烽火通信	2020 年 6 月 8 日	2020 年 7 月 6 日	28.91	20,000	578,200.00

2020060800001295	600030	中信 证券	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	24.11	2,300	55,453.00
2020060800002855	600118	中国 卫星	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	30.83	10,000	308,300.00
2020060800002923	000100	TCL科 技	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	6.20	68,000	421,600.00
2020060800003119	601828	美凯 龙	2020年 6月8 日	2020 年7月 6日	10.59	19,800	209,682.00
2020060900000318	002044	美年 健康	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	14.41	22,000	317,020.00
2020060900000358	002230	科大 讯飞	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	37.43	10,000	374,300.00
2020060900000510	600795	国电 电力	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	1.85	139,000	257,150.00
2020060900000532	600004	白云 机场	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	15.24	60,000	914,400.00
2020060900000590	600690	海尔 智家	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	17.70	15,000	265,500.00
2020060900000679	600297	广汇 汽车	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	3.19	77,000	245,630.00
2020060900000686	600522	中天 科技	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	11.45	36,200	414,490.00
2020060900000694	600118	中国 卫星	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	30.83	24,100	743,003.00
2020060900001297	600010	包钢 股份	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	1.08	40,300	43,524.00
2020060900002915	600522	中天 科技	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	11.45	180,500	2,066,725.00
2020060900004011	600183	生益 科技	2020年 6月9 日	2020 年7月 7日	29.27	70,000	2,048,900.00

			日	7日			
2020060900005097	300124	汇川技术	2020年6月9日	2020年7月7日	37.99	50,000	1,899,500.00
2020060900005201	002468	申通快递	2020年6月9日	2020年7月7日	16.41	10,000	164,100.00
2020061000000232	000723	美锦能源	2020年6月10日	2020年7月8日	6.26	60,000	375,600.00
2020061000000236	002044	美年健康	2020年6月10日	2020年7月8日	14.41	22,000	317,020.00
2020061000000248	002230	科大讯飞	2020年6月10日	2020年7月8日	37.43	10,000	374,300.00
2020061000000306	300433	蓝思科技	2020年6月10日	2020年7月8日	28.04	10,700	300,028.00
2020061000000317	600795	国电电力	2020年6月10日	2020年7月8日	1.85	122,100	225,885.00
2020061000000322	600570	恒生电子	2020年6月10日	2020年7月8日	107.70	12,200	1,313,940.00
2020061000000327	600068	葛洲坝	2020年6月10日	2020年7月8日	5.95	42,200	251,090.00
2020061000000369	600690	海尔智家	2020年6月10日	2020年7月8日	17.70	14,700	260,190.00
2020061000000394	601669	中国电建	2020年6月10日	2020年7月8日	3.46	73,100	252,926.00
2020061100000121	000568	泸州老窖	2020年6月11日	2020年7月9日	91.12	13,600	1,239,232.00
2020061100000135	000876	新希望	2020年6月11日	2020年7月9日	29.80	10,000	298,000.00
2020061100000141	000938	紫光股份	2020年6月11日	2020年7月9日	42.98	25,800	1,108,884.00
2020061100000153	002008	大族	2020年	2020	35.95	25,400	913,130.00

		激光	6月11日	2020年7月9日			
2020061100000158	002044	美年健康	2020年6月11日	2020年7月9日	14.41	34,700	500,027.00
2020061100000176	002230	科大讯飞	2020年6月11日	2020年7月9日	37.43	11,400	426,702.00
2020061100000185	002241	歌尔股份	2020年6月11日	2020年7月9日	29.36	14,000	411,040.00
2020061100000271	300142	沃森生物	2020年6月11日	2020年7月9日	52.36	27,800	1,455,608.00
2020061100000327	601236	红塔证券	2020年6月11日	2020年7月9日	19.40	10,700	207,580.00
2020061100000337	600221	海航控股	2020年6月11日	2020年7月9日	1.50	245,300	367,950.00
2020061100000355	600068	葛洲坝	2020年6月11日	2020年7月9日	5.95	66,900	398,055.00
2020061100000380	600660	福耀玻璃	2020年6月11日	2020年7月9日	20.87	51,300	1,070,631.00
2020061100000438	600690	海尔智家	2020年6月11日	2020年7月9日	17.70	23,600	417,720.00
2020061100000451	601669	中国电建	2020年6月11日	2020年7月9日	3.46	117,000	404,820.00
2020061100000472	601117	中国化学	2020年6月11日	2020年7月9日	5.48	73,200	401,136.00
2020061100000485	600208	新湖中宝	2020年6月11日	2020年7月9日	2.98	73,300	218,434.00
2020061100000501	600436	片仔癀	2020年6月11日	2020年7月9日	170.25	13,600	2,315,400.00
2020061100000524	600118	中国卫星	2020年6月11日	2020年7月9日	30.83	43,500	1,341,105.00

2020061100000525	601162	天 风 证 券	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	6.06	89,000	539,340.00
2020061100002430	600703	三 安 光 电	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	25.00	105,500	2,637,500.00
2020061100002432	601766	中 国 中 车	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	5.57	390,000	2,172,300.00
2020061100002434	002460	赣 锋 锂 业	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	53.57	50,000	2,678,500.00
2020061100002440	601088	中 国 神 华	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	14.36	429,300	6,164,748.00
2020061100004759	002120	韵 达 股 份	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	24.45	6,000	146,700.00
2020061200000158	002241	歌 尔 股 份	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	29.36	20,300	596,008.00
2020061200000161	002352	顺 丰 控 股	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	54.70	17,000	929,900.00
2020061200000205	300059	东 方 财 富	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	20.20	40,000	808,000.00
2020061200000223	600795	国 电 电 力	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	1.85	58,600	108,410.00
2020061200000230	600221	海 航 控 股	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	1.50	10,000	15,000.00
2020061200000248	600690	海 尔 智 家	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	17.70	13,000	230,100.00
2020061200000283	601727	上 海 电 气	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	5.04	49,000	246,960.00
2020061200000598	000786	北 新 建 材	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 10 日	21.33	110,500	2,356,965.00
2020061500003974	300033	同 花 顺	2020 年 6 月 15 日	2020 年 7 月	133.08	10,000	1,330,800.00

			日	13 日			
2020061600007008	601319	中 国 人保	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	6.44	33,400	215,096.00
2020061600007018	600010	包 钢 股份	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	1.08	154,100	166,428.00
2020061600007020	600100	同 方 股份	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	7.29	21,800	158,922.00
2020061600007022	600516	方 大 炭素	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	6.28	19,300	121,204.00
2020061600008154	600276	恒 瑞 医药	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	92.30	39,000	3,599,700.00
2020061600008156	002352	顺 丰 控股	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	54.70	90,600	4,955,820.00
2020061600008158	601992	金 隅 集团	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	3.06	52,600	160,956.00
2020061600008404	002475	立 讯 精密	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	51.35	17,998	924,197.30
2020061700000502	000063	中 兴 通讯	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	40.13	10,000	401,300.00
2020061700000503	000063	中 兴 通讯	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	40.13	20,000	802,600.00
2020061700000505	000063	中 兴 通讯	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	40.13	12,400	497,612.00
2020061700000511	000066	中 国 长城	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	13.20	100,000	1,320,000.00
2020061700001078	600795	国 电 电力	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	1.85	220,600	408,110.00
2020061700001413	600221	海 航 控股	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	1.50	122,600	183,900.00
2020061700001576	600068	葛 洲	2020 年	2020	5.95	21,000	124,950.00

		坝	6月17日	2020年7月15日			
2020061700001706	600352	浙江龙盛	2020年6月17日	2020年7月15日	12.79	38,500	492,415.00
2020061700003137	002129	中环股份	2020年6月17日	2020年7月15日	22.46	66,300	1,489,098.00
2020061700003140	002129	中环股份	2020年6月17日	2020年7月1日	22.46	20,000	449,200.00
2020061700004033	002236	大华股份	2020年6月17日	2020年7月15日	19.21	60,000	1,152,600.00
2020061700004426	600297	广汇汽车	2020年6月17日	2020年7月15日	3.19	74,700	238,293.00
2020061700004763	600010	包钢股份	2020年6月17日	2020年7月1日	1.08	1,000,000	1,080,000.00
2020061700005204	002555	三七互娱	2020年6月17日	2020年7月1日	46.80	12,200	570,960.00
2020061700005395	002714	牧原股份	2020年6月17日	2020年7月1日	82.00	10,000	820,000.00
2020061700006186	300628	亿联网络	2020年6月17日	2020年7月1日	68.26	17,600	1,201,376.00
2020061700012171	600588	用友网络	2020年6月17日	2020年7月1日	44.10	21,600	952,560.00
2020061700012173	603986	兆易创新	2020年6月17日	2020年7月1日	235.91	10,000	2,359,100.00
2020061700012333	600030	中信证券	2020年6月17日	2020年7月15日	24.11	130,000	3,134,300.00
2020061700012335	000858	五粮液	2020年6月17日	2020年7月15日	171.12	20,000	3,422,400.00
2020061700012337	000002	万科A	2020年6月17日	2020年7月15日	26.14	110,000	2,875,400.00

2020061700012339	600036	招商银行	2020年 6月17 日	2020 年7月 15日	33.72	90,000	3,034,800.00
2020061700012341	601318	中国平安	2020年 6月17 日	2020 年7月 15日	71.40	40,000	2,856,000.00
2020061700012343	600276	恒瑞医药	2020年 6月17 日	2020 年7月 15日	92.30	30,000	2,769,000.00
2020061800000127	000063	中兴通讯	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	40.13	100,000	4,013,000.00
2020061800000135	000066	中国长城	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	13.20	60,000	792,000.00
2020061800000166	000651	格力电器	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	56.57	156,000	8,824,920.00
2020061800000196	000858	五粮液	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	171.12	44,100	7,546,392.00
2020061800000362	002466	天齐锂业	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	22.95	36,700	842,265.00
2020061800000367	002475	立讯精密	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	51.35	100,000	5,135,000.00
2020061800000382	002555	三七互娱	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	46.80	15,000	702,000.00
2020061800000402	002714	牧原股份	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	82.00	21,000	1,722,000.00
2020061800000404	002714	牧原股份	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	82.00	10,000	820,000.00
2020061800000410	002714	牧原股份	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	82.00	10,000	820,000.00
2020061800000423	002739	万达电影	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	15.27	92,800	1,417,056.00
2020061800000484	300136	信维通信	2020年 6月18	2020 年7月	53.02	30,000	1,590,600.00

			日	16日			
2020061800000557	601985	中国 核电	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	4.09	87,000	355,830.00
2020061800000564	600188	兖州 煤业	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	8.76	11,500	100,740.00
2020061800000568	600011	华能 国际	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	4.22	85,800	362,076.00
2020061800000571	600050	中国 联通	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	4.84	72,900	352,836.00
2020061800000586	601328	交通 银行	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	5.13	100,000	513,000.00
2020061800000608	600016	民生 银行	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	5.67	90,200	511,434.00
2020061800000655	600050	中国 联通	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	4.84	104,500	505,780.00
2020061800000695	600795	国电 电力	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	1.85	22,400	41,440.00
2020061800000708	600011	华能 国际	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	4.22	122,800	518,216.00
2020061800000744	600000	浦发 银行	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	10.58	48,700	515,246.00
2020061800000761	600690	海尔 智家	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	17.70	59,600	1,054,920.00
2020061800000781	600886	国投 电力	2020年 6月18 日	2020 年7月 16日	7.86	45,800	359,988.00
2020061800000844	601997	贵阳 银行	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	7.16	171,800	1,230,088.00
2020061800000856	601997	贵阳 银行	2020年 6月18 日	2020 年7月 2日	7.16	60,000	429,600.00
2020061800000863	600196	复星	2020年	2020	33.85	10,000	338,500.00

		医药	6月18日	2020年7月2日			
2020061800000871	601997	贵阳银行	2020年6月18日	2020年7月16日	7.16	47,700	341,532.00
2020061800000959	600886	国投电力	2020年6月18日	2020年7月2日	7.86	65,500	514,830.00
2020061800000976	600848	上海临港	2020年6月18日	2020年7月16日	21.47	46,400	996,208.00
2020061800000991	601018	宁波港	2020年6月18日	2020年7月16日	3.57	97,100	346,647.00
2020061800000997	601066	中信建投	2020年6月18日	2020年7月16日	39.38	11,100	437,118.00
2020061800001003	600010	包钢股份	2020年6月18日	2020年7月16日	1.08	800,000	864,000.00
2020061800001009	600516	方大炭素	2020年6月18日	2020年7月16日	6.28	185,300	1,163,684.00
2020061800001012	601162	天风证券	2020年6月18日	2020年7月16日	6.06	159,600	967,176.00
2020061800001015	600111	北方稀土	2020年6月18日	2020年7月16日	9.32	48,500	452,020.00
2020061800001017	600188	兖州煤业	2020年6月18日	2020年7月16日	8.76	28,500	249,660.00
2020061800002368	000629	攀钢钒钛	2020年6月18日	2020年7月16日	2.01	23,400	47,034.00
2020061800002370	002230	科大讯飞	2020年6月18日	2020年7月16日	37.43	10,000	374,300.00
2020061800003162	600498	烽火通信	2020年6月18日	2020年7月2日	28.91	15,900	459,669.00
2020061800003164	000876	新希望	2020年6月18日	2020年7月16日	29.80	253,100	7,542,380.00

2020061900000192	000100	TCL 科技	2020年6月19日	2020年7月17日	6.20	100,000	620,000.00
2020061900000198	000425	徐工机械	2020年6月19日	2020年7月17日	5.91	116,000	685,560.00
2020061900000207	000625	长安汽车	2020年6月19日	2020年7月17日	11.00	78,000	858,000.00
2020061900000211	000651	格力电器	2020年6月19日	2020年7月17日	56.57	37,000	2,093,090.00
2020061900000235	000938	紫光股份	2020年6月19日	2020年7月3日	42.98	24,700	1,061,606.00
2020061900000238	000977	浪潮信息	2020年6月19日	2020年7月3日	39.18	30,000	1,175,400.00
2020061900000345	002555	三七互娱	2020年6月19日	2020年7月17日	46.80	54,800	2,564,640.00
2020061900000358	002958	青农商行	2020年6月19日	2020年7月17日	4.43	168,100	744,683.00
2020061900000360	002714	牧原股份	2020年6月19日	2020年7月3日	82.00	10,000	820,000.00
2020061900000379	300059	东方财富	2020年6月19日	2020年7月3日	20.20	25,000	505,000.00
2020061900000380	300059	东方财富	2020年6月19日	2020年7月17日	20.20	50,000	1,010,000.00
2020061900000388	300122	智飞生物	2020年6月19日	2020年7月17日	100.15	27,700	2,774,155.00
2020061900000413	300413	芒果超媒	2020年6月19日	2020年7月17日	65.20	14,000	912,800.00
2020061900000414	300413	芒果超媒	2020年6月19日	2020年7月3日	65.20	12,000	782,400.00
2020061900000438	600066	宇通客车	2020年6月19日	2020年7月	12.20	18,300	223,260.00

			日	17日			
2020061900000441	600188	兖州煤业	2020年6月19日	2020年7月3日	8.76	10,000	87,600.00
2020061900000443	600011	华能国际	2020年6月19日	2020年7月17日	4.22	70,200	296,244.00
2020061900000444	600016	民生银行	2020年6月19日	2020年7月17日	5.67	52,800	299,376.00
2020061900000460	600926	杭州银行	2020年6月19日	2020年7月17日	8.92	77,000	686,840.00
2020061900000483	600050	中国联通	2020年6月19日	2020年7月3日	4.84	29,800	144,232.00
2020061900000489	600050	中国联通	2020年6月19日	2020年7月17日	4.84	60,800	294,272.00
2020061900000505	601555	东吴证券	2020年6月19日	2020年7月3日	8.16	75,000	612,000.00
2020061900000506	601898	中煤能源	2020年6月19日	2020年7月3日	3.80	70,900	269,420.00
2020061900000511	601633	长城汽车	2020年6月19日	2020年7月3日	7.72	14,600	112,712.00
2020061900000522	600016	民生银行	2020年6月19日	2020年7月3日	5.67	25,900	146,853.00
2020061900000524	601100	恒立液压	2020年6月19日	2020年7月17日	80.20	12,000	962,400.00
2020061900000526	601878	浙商证券	2020年6月19日	2020年7月17日	9.91	50,900	504,419.00
2020061900000532	600352	浙江龙盛	2020年6月19日	2020年7月17日	12.79	23,200	296,728.00
2020061900000536	600352	浙江龙盛	2020年6月19日	2020年7月3日	12.79	11,300	144,527.00
2020061900000541	600000	浦发	2020年	2020	10.58	13,900	147,062.00

		银行	6月19日	2020年7月3日			
2020061900000548	600867	通化东宝	2020年6月19日	2020年7月17日	17.43	58,000	1,010,940.00
2020061900000556	600011	华能国际	2020年6月19日	2020年7月3日	4.22	34,400	145,168.00
2020061900000565	601919	中远海控	2020年6月19日	2020年7月17日	3.47	142,000	492,740.00
2020061900000585	600176	中国巨石	2020年6月19日	2020年7月17日	9.15	75,000	686,250.00
2020061900000599	601216	君正集团	2020年6月19日	2020年7月17日	2.54	100,000	254,000.00
2020061900000612	600606	绿地控股	2020年6月19日	2020年7月17日	6.18	125,000	772,500.00
2020061900000632	600000	浦发银行	2020年6月19日	2020年7月17日	10.58	28,400	300,472.00
2020061900000641	600958	东方证券	2020年6月19日	2020年7月17日	9.49	76,000	721,240.00
2020061900000650	601985	中国核电	2020年6月19日	2020年7月3日	4.09	188,200	769,738.00
2020061900000653	601018	宁波港	2020年6月19日	2020年7月17日	3.57	11,600	41,412.00
2020061900000669	600233	圆通速递	2020年6月19日	2020年7月17日	14.56	54,000	786,240.00
2020061900000676	600438	通威股份	2020年6月19日	2020年7月17日	17.38	61,000	1,060,180.00
2020061900001273	002456	欧菲光	2020年6月19日	2020年7月17日	18.39	11,800	217,002.00
2020061900001275	601857	中国石油	2020年6月19日	2020年7月17日	4.19	22,000	92,180.00

2020061900001277	600221	海航控股	2020年6月19日	2020年7月17日	1.50	109,200	163,800.00
2020061900001279	600516	方大炭素	2020年6月19日	2020年7月17日	6.28	19,300	121,204.00
2020061900001281	600487	亨通光电	2020年6月19日	2020年7月17日	16.41	44,700	733,527.00
2020061900001303	603799	华友钴业	2020年6月19日	2020年7月17日	38.86	51,000	1,981,860.00
2020061900001575	600438	通威股份	2020年6月19日	2020年7月17日	17.38	60,000	1,042,800.00
2020061900001577	601919	中远海控	2020年6月19日	2020年7月17日	3.47	106,000	367,820.00
2020061900001579	600297	广汇汽车	2020年6月19日	2020年7月17日	3.19	117,000	373,230.00
2020061900001581	002044	美年健康	2020年6月19日	2020年7月17日	14.41	70,000	1,008,700.00
2020061900001583	600004	白云机场	2020年6月19日	2020年7月17日	15.24	53,000	807,720.00
2020061900001585	300144	宋城演艺	2020年6月19日	2020年7月17日	17.30	30,000	519,000.00
2020061900001587	601808	中海油服	2020年6月19日	2020年7月17日	13.14	23,000	302,220.00
2020061900001589	600968	海油发展	2020年6月19日	2020年7月17日	2.33	169,000	393,770.00
2020061900001591	002773	康弘药业	2020年6月19日	2020年7月17日	49.60	21,000	1,041,600.00
2020061900001593	600655	豫园股份	2020年6月19日	2020年7月17日	8.86	79,000	699,940.00
2020061900001595	001979	招商蛇口	2020年6月19日	2020年7月17日	16.44	47,000	772,680.00

			日	17日			
2020061900001597	002153	石基信息	2020年6月19日	2020年7月17日	39.03	26,000	1,014,780.00
2020061900001599	000671	阳光城	2020年6月19日	2020年7月17日	6.34	88,000	557,920.00
2020061900001601	000858	五粮液	2020年6月19日	2020年7月17日	171.12	60,000	10,267,200.00
2020061900001603	600183	生益科技	2020年6月19日	2020年7月17日	29.27	26,000	761,020.00
2020061900001605	000425	徐工机械	2020年6月19日	2020年7月17日	5.91	107,000	632,370.00
2020061900001607	000625	长安汽车	2020年6月19日	2020年7月17日	11.00	67,000	737,000.00
2020061900001609	300136	信维通信	2020年6月19日	2020年7月17日	53.02	21,000	1,113,420.00
2020061900001611	300003	乐普医疗	2020年6月19日	2020年7月17日	36.52	20,000	730,400.00
2020061900001613	002007	华兰生物	2020年6月19日	2020年7月17日	50.11	16,000	801,760.00
2020061900001615	002241	歌尔股份	2020年6月19日	2020年7月17日	29.36	44,000	1,291,840.00
2020061900001617	600760	中航沈飞	2020年6月19日	2020年7月17日	32.82	23,300	764,706.00
2020061900001619	002602	世纪华通	2020年6月19日	2020年7月17日	15.31	44,700	684,357.00
2020061900001621	603259	药明康德	2020年6月19日	2020年7月17日	96.60	11,000	1,062,600.00
2020062200011396	002602	世纪华通	2020年6月22日	2020年7月20日	15.31	60,000	918,600.00
2020062200011398	300408	三环	2020年	2020	27.70	41,000	1,135,700.00

		集团	6月22日	年7月20日			
2020062200011400	300059	东方财富	2020年6月22日	2020年7月20日	20.20	56,000	1,131,200.00
2020062200011402	600176	中国巨石	2020年6月22日	2020年7月20日	9.15	67,000	613,050.00
2020062200011404	300136	信维通信	2020年6月22日	2020年7月20日	53.02	20,000	1,060,400.00
2020062200011406	600183	生益科技	2020年6月22日	2020年7月20日	29.27	26,500	775,655.00
2020062200011408	600196	复星医药	2020年6月22日	2020年7月20日	33.85	26,000	880,100.00
2020062200011410	600111	北方稀土	2020年6月22日	2020年7月20日	9.32	50,000	466,000.00
2020062200011412	600109	国金证券	2020年6月22日	2020年7月20日	11.41	41,000	467,810.00
2020062200011414	600066	宇通客车	2020年6月22日	2020年7月20日	12.20	69,000	841,800.00
2020062200011416	000895	双汇发展	2020年6月22日	2020年7月20日	46.09	20,000	921,800.00
2020062200011418	000858	五粮液	2020年6月22日	2020年7月20日	171.12	60,000	10,267,200.00
2020062200011420	600050	中国联通	2020年6月22日	2020年7月20日	4.84	119,000	575,960.00
2020062200011422	000425	徐工机械	2020年6月22日	2020年7月20日	5.91	100,000	591,000.00
2020062200011424	002422	科伦药业	2020年6月22日	2020年7月20日	21.00	40,000	840,000.00
2020062200011426	002271	东方雨虹	2020年6月22日	2020年7月20日	40.63	22,000	893,860.00

2020062200011428	000703	恒逸石化	2020年6月22日	2020年7月20日	9.13	67,000	611,710.00
2020062200011430	600015	华夏银行	2020年6月22日	2020年7月20日	6.12	95,000	581,400.00
2020062200011432	601818	光大银行	2020年6月22日	2020年7月20日	3.58	137,000	490,460.00
2020062200011434	601006	大秦铁路	2020年6月22日	2020年7月20日	7.04	89,000	626,560.00
2020062200011436	601211	国泰君安	2020年6月22日	2020年7月20日	17.26	51,000	880,260.00
2020062200011438	600867	通化东宝	2020年6月22日	2020年7月20日	17.43	33,000	575,190.00
2020062200011440	002236	大华股份	2020年6月22日	2020年7月20日	19.21	50,000	960,500.00
2020062200012416	002024	苏宁易购	2020年6月22日	2020年7月20日	8.77	11,300	99,101.00
2020062200012418	600028	中国石化	2020年6月22日	2020年7月6日	3.91	63,000	246,330.00
2020062200012420	600795	国电电力	2020年6月22日	2020年7月6日	1.85	149,300	276,205.00
2020062200012824	601808	中海油服	2020年6月22日	2020年7月20日	13.14	10,800	141,912.00
2020062200012826	601878	浙商证券	2020年6月22日	2020年7月20日	9.91	43,000	426,130.00
2020062200012828	603799	华友钴业	2020年6月22日	2020年7月20日	38.86	10,200	396,372.00
2020062200012830	002179	中航光电	2020年6月22日	2020年7月20日	41.01	24,000	984,240.00
2020062200012832	600958	东方证券	2020年6月22日	2020年7月	9.49	66,000	626,340.00

			日	20 日			
2020062200012834	601939	建设银行	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	6.31	95,000	599,450.00
2020062200012836	600606	绿地控股	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	6.18	113,000	698,340.00
2020062200012838	603288	海天味业	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	124.40	10,000	1,244,000.00
2020062200012840	600837	海通证券	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	12.58	68,000	855,440.00
2020062200012842	603019	中科曙光	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	38.40	21,000	806,400.00
2020062200012844	601998	中信银行	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	5.15	100,000	515,000.00
2020062200012846	600352	浙江龙盛	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	12.79	66,000	844,140.00
2020062200012848	600309	万华化学	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	49.99	18,000	899,820.00
2020062200012850	600219	南山铝业	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	2.03	245,000	497,350.00
2020062200012852	600655	豫园股份	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	8.86	75,000	664,500.00
2020062200012854	600919	江苏银行	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	5.67	103,000	584,010.00
2020062200012856	601919	中远海控	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	3.47	159,000	551,730.00
2020062200012858	600271	航天信息	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	16.24	49,000	795,760.00
2020062300000177	000066	中国长城	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	13.20	59,100	780,120.00
2020062300000180	000166	申万	2020 年	2020	5.05	300,000	1,515,000.00

		宏源	6月23日	2020年7月21日			
2020062300000184	000651	格力电器	2020年6月23日	2020年7月21日	56.57	10,000	565,700.00
2020062300000239	001979	招商蛇口	2020年6月23日	2020年7月7日	16.44	213,700	3,513,228.00
2020062300000241	001979	招商蛇口	2020年6月23日	2020年7月21日	16.44	23,500	386,340.00
2020062300000253	002044	美年健康	2020年6月23日	2020年7月7日	14.41	45,200	651,332.00
2020062300000255	002044	美年健康	2020年6月23日	2020年7月21日	14.41	28,600	412,126.00
2020062300000268	002129	中环股份	2020年6月23日	2020年7月7日	22.46	30,000	673,800.00
2020062300000270	002129	中环股份	2020年6月23日	2020年7月21日	22.46	76,600	1,720,436.00
2020062300000285	002236	大华股份	2020年6月23日	2020年7月7日	19.21	10,000	192,100.00
2020062300000328	002939	长城证券	2020年6月23日	2020年7月21日	12.32	46,000	566,720.00
2020062300000375	300059	东方财富	2020年6月23日	2020年7月21日	20.20	63,700	1,286,740.00
2020062300000376	300059	东方财富	2020年6月23日	2020年7月21日	20.20	60,000	1,212,000.00
2020062300000396	300059	东方财富	2020年6月23日	2020年7月21日	20.20	450,000	9,090,000.00
2020062300000504	300433	蓝思科技	2020年6月23日	2020年7月7日	28.04	10,000	280,400.00
2020062300000550	601985	中国核电	2020年6月23日	2020年7月21日	4.09	94,500	386,505.00

2020062300000579	600016	民生 银行	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	5.67	68,600	388,962.00
2020062300000583	600050	中国 联通	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	4.84	77,800	376,552.00
2020062300000589	601898	中煤 能源	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	3.80	22,000	83,600.00
2020062300000594	600109	国金 证券	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	11.41	80,000	912,800.00
2020062300000603	600109	国金 证券	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	11.41	33,000	376,530.00
2020062300000604	601018	宁波 港	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	3.57	24,400	87,108.00
2020062300000611	601727	上海 电气	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	5.04	146,500	738,360.00
2020062300000617	603288	海天 味业	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	124.40	50,000	6,220,000.00
2020062300000635	600299	安迪 苏	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	12.22	29,200	356,824.00
2020062300000642	600089	特变 电工	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	6.77	31,500	213,255.00
2020062300000645	601212	白银 有色	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	2.55	149,100	380,205.00
2020062300000668	600482	中国 动力	2020年 6月23 日	2020 年7月 21日	15.70	24,400	383,080.00
2020062300000743	600398	海澜 之家	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	5.82	73,400	427,188.00
2020062300000757	600487	亨通 光电	2020年 6月23 日	2020 年7月 7日	16.41	35,100	575,991.00
2020062300000767	600000	浦发 银行	2020年 6月23 日	2020 年7月	10.58	36,900	390,402.00

			日	21 日			
2020062300000772	601985	中国核电	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	4.09	185,900	760,331.00
2020062300000795	601788	光大证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	16.06	200,000	3,212,000.00
2020062300000807	601727	上海电气	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	5.04	76,200	384,048.00
2020062300000825	603019	中科曙光	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	38.40	15,600	599,040.00
2020062300000841	600516	方大炭素	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.28	42,100	264,388.00
2020062300000848	601727	上海电气	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	5.04	185,000	932,400.00
2020062300000853	601162	天风证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	6.06	168,900	1,023,534.00
2020062300000857	601788	光大证券	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	16.06	43,500	698,610.00
2020062300001732	600276	恒瑞医药	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	92.30	43,000	3,968,900.00
2020062300001734	600795	国电电力	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	1.85	99,100	183,335.00
2020062400000223	000100	TCL 科技	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	6.20	42,500	263,500.00
2020062400000612	601236	红塔证券	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	19.40	39,600	768,240.00
2020062400000701	000963	华东医药	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	25.30	10,000	253,000.00
2020062400000745	000977	浪潮信息	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	39.18	50,000	1,959,000.00
2020062400000892	600177	雅戈	2020 年	2020	5.96	30,000	178,800.00

		尔	6月24日	年7月22日			
2020062400001019	600061	国投资 资本	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	12.73	44,200	562,666.00
2020062400001075	600089	特变 电工	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	6.77	17,600	119,152.00
2020062400001168	002044	美年 健康	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	14.41	36,700	528,847.00
2020062400001173	002044	美年 健康	2020年 6月24日	2020 年7月 22日	14.41	11,000	158,510.00
2020062400001266	601108	财通 证券	2020年 6月24日	2020 年7月 22日	10.25	37,400	383,350.00
2020062400001648	603019	中 科 曙光	2020年 6月24日	2020 年7月 22日	38.40	10,000	384,000.00
2020062400001959	600170	上 海 建工	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	3.07	111,200	341,384.00
2020062400002277	601881	中 国 银河	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	11.47	107,900	1,237,613.00
2020062400002545	002602	世 纪 华通	2020年 6月24日	2020 年7月 22日	15.31	20,000	306,200.00
2020062400002557	600848	上 海 临港	2020年 6月24日	2020 年7月 22日	21.47	28,200	605,454.00
2020062400002579	600703	三 安 光电	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	25.00	60,300	1,507,500.00
2020062400002590	002714	牧 原 股份	2020年 6月24日	2020 年7月 22日	82.00	66,800	5,477,600.00
2020062400002597	600977	中 国 电影	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	13.13	35,300	463,489.00
2020062400002761	300122	智 飞 生物	2020年 6月24日	2020 年7月 8日	100.15	15,900	1,592,385.00

2020062400002892	300408	三 环 集团	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	27.70	30,000	831,000.00
2020062400002894	300408	三 环 集团	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	27.70	10,000	277,000.00
2020062400006371	600061	国 投 资本	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	12.73	15,800	201,134.00
2020062400006373	000725	京 东 方 A	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 8 日	4.67	29,300	136,831.00
2020062400006521	603288	海 天 味业	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	124.40	25,000	3,110,000.00
2020062400006523	002230	科 大 讯飞	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	37.43	10,000	374,300.00
2020062400006525	600795	国 电 电力	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	1.85	93,400	172,790.00
2020062900000202	000100	TCL 科 技	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	6.20	60,000	372,000.00
2020062900000203	000100	TCL 科 技	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	6.20	23,800	147,560.00
2020062900000242	000651	格 力 电器	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	56.57	13,800	780,666.00
2020062900000336	001979	招 商 蛇口	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	16.44	15,400	253,176.00
2020062900000357	002044	美 年 健康	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	14.41	14,200	204,622.00
2020062900000398	002129	中 环 股份	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	22.46	30,400	682,784.00
2020062900000402	002129	中 环 股份	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	22.46	19,800	444,708.00
2020062900000457	002304	洋 河 股份	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月	105.14	73,300	7,706,762.00

			日	27 日			
2020062900000543	002602	世纪华通	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	15.31	100,000	1,531,000.00
2020062900000652	300122	智飞生物	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	100.15	10,000	1,001,500.00
2020062900000658	300142	沃森生物	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	52.36	20,000	1,047,200.00
2020062900000736	300408	三环集团	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	27.70	30,000	831,000.00
2020062900000740	300433	蓝思科技	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	28.04	35,400	992,616.00
2020062900000791	300628	亿联网络	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	68.26	16,100	1,098,986.00
2020062900000812	600655	豫园股份	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	8.86	39,200	347,312.00
2020062900000826	601985	中国核电	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	4.09	70,100	286,709.00
2020062900000849	600588	用友网络	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	44.10	30,000	1,323,000.00
2020062900000865	600795	国电电力	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	1.85	42,900	79,365.00
2020062900000884	600016	民生银行	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	5.67	108,600	615,762.00
2020062900000895	601006	大秦铁路	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	7.04	40,500	285,120.00
2020062900000921	601108	财通证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	10.25	192,700	1,975,175.00
2020062900000924	601138	工业富联	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	15.15	10,000	151,500.00
2020062900000930	601198	东兴	2020 年	2020	10.90	18,100	197,290.00

		证券	6月29日	年7月13日			
2020062900000934	600588	用友网络	2020年6月29日	2020年7月13日	44.10	42,000	1,852,200.00
2020062900000954	600010	包钢股份	2020年6月29日	2020年7月27日	1.08	75,000	81,000.00
2020062900000980	601992	金隅集团	2020年6月29日	2020年7月13日	3.06	68,700	210,222.00
2020062900001012	601992	金隅集团	2020年6月29日	2020年7月13日	3.06	199,800	611,388.00
2020062900001037	601766	中国中车	2020年6月29日	2020年7月13日	5.57	80,500	448,385.00
2020062900001074	603019	中科曙光	2020年6月29日	2020年7月27日	38.40	10,000	384,000.00
2020062900001084	600170	上海建工	2020年6月29日	2020年7月13日	3.07	300,700	923,149.00
2020062900001116	601012	隆基股份	2020年6月29日	2020年7月27日	40.73	12,000	488,760.00
2020062900001157	600487	亨通光电	2020年6月29日	2020年7月13日	16.41	15,600	255,996.00
2020062900001164	600999	招商证券	2020年6月29日	2020年7月6日	21.95	50,000	1,097,500.00
2020062900001205	601212	白银有色	2020年6月29日	2020年7月13日	2.55	37,500	95,625.00
2020062900001208	601985	中国核电	2020年6月29日	2020年7月13日	4.09	110,700	452,763.00
2020062900001244	600999	招商证券	2020年6月29日	2020年7月13日	21.95	30,000	658,500.00
2020062900001247	601985	中国核电	2020年6月29日	2020年7月13日	4.09	40,100	164,009.00

2020062900001255	601138	工业富联	2020年6月29日	2020年7月13日	15.15	100,000	1,515,000.00
2020062900001280	601198	东兴证券	2020年6月29日	2020年7月27日	10.90	25,900	282,310.00
2020062900001300	601138	工业富联	2020年6月29日	2020年7月13日	15.15	12,000	181,800.00
2020062900001316	600297	广汇汽车	2020年6月29日	2020年7月13日	3.19	128,600	410,234.00
2020062900001326	601881	中国银河	2020年6月29日	2020年7月13日	11.47	53,500	613,645.00
2020062900001343	600297	广汇汽车	2020年6月29日	2020年7月13日	3.19	50,100	159,819.00
2020062900001345	601992	金隅集团	2020年6月29日	2020年7月27日	3.06	93,100	284,886.00
2020062900002828	600010	包钢股份	2020年6月29日	2020年7月13日	1.08	523,300	565,164.00
2020062900002830	601319	中国人保	2020年6月29日	2020年7月27日	6.44	32,400	208,656.00
2020062900003326	002241	歌尔股份	2020年6月29日	2020年7月13日	29.36	110,300	3,238,408.00
2020063000000489	000425	徐工机械	2020年6月30日	2020年7月14日	5.91	11,300	66,783.00
2020063000000661	000709	河钢股份	2020年6月30日	2020年7月14日	2.04	37,000	75,480.00
2020063000000985	001979	招商蛇口	2020年6月30日	2020年7月14日	16.44	70,600	1,160,664.00
2020063000000988	001979	招商蛇口	2020年6月30日	2020年7月14日	16.44	26,600	437,304.00
2020063000001003	002008	大族激光	2020年6月30日	2020年7月	35.95	10,000	359,500.00

			日	14日			
2020063000001032	002024	苏宁易购	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	8.77	33,000	289,410.00
2020063000001059	002044	美年健康	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	14.41	27,700	399,157.00
2020063000001201	002120	韵达股份	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	24.45	41,000	1,002,450.00
2020063000001366	002241	歌尔股份	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	29.36	96,000	2,818,560.00
2020063000001367	002236	大华股份	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	19.21	10,000	192,100.00
2020063000001648	002463	沪电股份	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	24.98	30,000	749,400.00
2020063000001665	002475	立讯精密	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	51.35	210,000	10,783,500.00
2020063000001841	002773	康弘药业	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	49.60	12,000	595,200.00
2020063000001883	002958	青农商行	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	4.43	65,000	287,950.00
2020063000001886	002958	青农商行	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	4.43	115,100	509,893.00
2020063000001936	300014	亿纬锂能	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	47.85	10,000	478,500.00
2020063000002034	300136	信维通信	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	53.02	26,300	1,394,426.00
2020063000002039	300144	宋城演艺	2020年 6月30 日	2020 年7月 28日	17.30	11,400	197,220.00
2020063000002273	601377	兴业证券	2020年 6月30 日	2020 年7月 14日	6.85	140,000	959,000.00
2020063000002276	601377	兴业	2020年	2020	6.85	300,000	2,055,000.00

		证券	6月30日	年7月14日			
2020063000002339	601828	美凯龙	2020年6月30日	2020年7月28日	10.59	18,900	200,151.00
2020063000002349	601229	上海银行	2020年6月30日	2020年7月14日	8.30	35,000	290,500.00
2020063000002488	600028	中国石化	2020年6月30日	2020年7月14日	3.91	55,400	216,614.00
2020063000002533	600068	葛洲坝	2020年6月30日	2020年7月14日	5.95	168,000	999,600.00
2020063000002598	601901	方正证券	2020年6月30日	2020年7月14日	7.08	43,000	304,440.00
2020063000002624	601555	东吴证券	2020年6月30日	2020年7月14日	8.16	187,700	1,531,632.00
2020063000002644	601555	东吴证券	2020年6月30日	2020年7月14日	8.16	39,000	318,240.00
2020063000002657	601198	东兴证券	2020年6月30日	2020年7月14日	10.90	93,200	1,015,880.00
2020063000002710	600089	特变电工	2020年6月30日	2020年7月14日	6.77	11,200	75,824.00
2020063000002725	601155	新城控股	2020年6月30日	2020年7月28日	31.24	15,700	490,468.00
2020063000002757	601888	中国中免	2020年6月30日	2020年7月28日	154.03	29,100	4,482,273.00
2020063000002873	600011	华能国际	2020年6月30日	2020年7月14日	4.22	165,000	696,300.00
2020063000002896	601998	中信银行	2020年6月30日	2020年7月28日	5.15	80,000	412,000.00
2020063000002919	601919	中远海控	2020年6月30日	2020年7月14日	3.47	199,000	690,530.00

2020063000002934	600010	包 钢 股份	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	1.08	160,100	172,908.00
2020063000002944	601888	中 国 中免	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	154.03	11,300	1,740,539.00
2020063000002961	601888	中 国 中免	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	154.03	52,000	8,009,560.00
2020063000002977	600390	五 矿 资本	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	7.06	64,800	457,488.00
2020063000002994	600438	通 威 股份	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	17.38	14,300	248,534.00
2020063000003015	600438	通 威 股份	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	17.38	28,700	498,806.00
2020063000003088	600745	闻 泰 科技	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	125.95	56,400	7,103,580.00
2020063000003095	600085	同 仁 堂	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	27.12	18,700	507,144.00
2020063000003211	601766	中 国 中车	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	5.57	39,100	217,787.00
2020063000003221	600867	通 化 东宝	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	17.43	87,900	1,532,097.00
2020063000003382	600176	中 国 巨石	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	9.15	21,600	197,640.00
2020063000003404	600977	中 国 电影	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	13.13	15,600	204,828.00
2020063000003408	600177	雅 戈 尔	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	5.96	87,000	518,520.00
2020063000003422	600170	上 海 建工	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	3.07	23,000	70,610.00
2020063000003452	600196	复 星 医药	2020 年 6 月 30	2020 年 7 月	33.85	25,300	856,405.00

			日	14 日			
2020063000003466	600196	复星医药	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	33.85	30,000	1,015,500.00
2020063000003482	600398	海澜之家	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	5.82	34,600	201,372.00
2020063000003570	601818	光大银行	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	3.58	81,000	289,980.00
2020063000003584	600208	新湖中宝	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	2.98	67,600	201,448.00
2020063000003595	600585	海螺水泥	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	52.91	18,400	973,544.00
2020063000003605	600390	五矿资本	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	7.06	36,000	254,160.00
2020063000003624	601117	中国化学	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	5.48	182,100	997,908.00
2020063000003634	601601	中国太保	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	27.25	395,900	10,788,275.00
2020063000003644	603156	养元饮品	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	21.50	23,700	509,550.00
2020063000003686	601216	君正集团	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	2.54	321,900	817,626.00
2020063000003691	600893	航发动力	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	23.48	21,400	502,472.00
2020063000003763	601377	兴业证券	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	6.85	100,000	685,000.00
2020063000003767	600016	民生银行	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	5.67	38,500	218,295.00
2020063000003790	603369	今世缘	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	39.79	13,200	525,228.00
2020063000003821	600928	西安	2020 年	2020	5.26	57,000	299,820.00

		银行	6月30日	2020年7月14日			
2020063000003822	601138	工业富联	2020年6月30日	2020年7月14日	15.15	66,000	999,900.00
2020063000003842	600438	通威股份	2020年6月30日	2020年7月28日	17.38	29,100	505,758.00
2020063000003861	600999	招商证券	2020年6月30日	2020年7月28日	21.95	15,000	329,250.00
2020063000003876	601669	中国电建	2020年6月30日	2020年7月14日	3.46	269,000	930,740.00
2020063000003906	600208	新湖中宝	2020年6月30日	2020年7月14日	2.98	129,000	384,420.00
2020063000003931	603019	中科曙光	2020年6月30日	2020年7月14日	38.40	10,000	384,000.00
2020063000004061	600221	海航控股	2020年6月30日	2020年7月28日	1.50	954,600	1,431,900.00
2020063000004068	601888	中国中免	2020年6月30日	2020年7月28日	154.03	20,000	3,080,600.00
2020063000004085	600999	招商证券	2020年6月30日	2020年7月28日	21.95	262,100	5,753,095.00
2020063000004099	600010	宝钢股份	2020年6月30日	2020年7月28日	1.08	100,000	108,000.00
2020063000008264	000858	五粮液	2020年6月30日	2020年7月28日	171.12	57,000	9,753,840.00
2020063000008370	601319	中国人保	2020年6月30日	2020年7月28日	6.44	36,700	236,348.00
合计						33,539,238	501,850,084.50

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。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	14,135,500.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	14,135,500.00	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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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 2020 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超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 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 2020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	24,608,008.02	-	-	-	24,608,008.02
结算备付金	80,717,769.79	-	-	-	80,717,769.79
存出保证金	1,997,688.30	-	-	10,305,270.00	12,302,958.30
交易性金融资产	-	-14,135,500.00	7,429,961,321.97	-	7,444,096,821.97
应收证券清算款	-	-	-	1,932,930.49	1,932,930.49
应收利息	-	-	-	290,345.56	290,345.56
应收股利	-	-	-	1,375,893.44	1,375,893.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	107,323,466.11	-14,135,500.00	7,443,865,761.46	-	7,565,324,727.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,326,026.52	2,326,026.52
应付管理人报酬	-	-	-	2,379,629.59	2,379,629.59
应付托管费	-	-	-	297,453.70	297,453.70
应付交易费用	-	-	-	571,259.02	571,259.02
应交税费	-	-	-	19,949.61	19,949.61
其他负债	-	-	-	644,801.09	644,801.09
负债总计	-	-	-	6,239,119.53	6,239,119.53

利率敏感度缺口	107,323,466.11	-	14,135,500.00	7,437,626,641.93	7,559,085,608.04
上年度末 2019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	10,970,000.90	-	-	-	10,970,000.90
交易性金融资产	-	-	-	152,824,405.00	152,824,405.00
买入返售金融资产	7,000,000,000.00	-	-	-	7,000,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,264,995.43	1,264,995.43
其他资产	-	-	-	2,105.41	2,105.41
资产总计	7,010,970,000.90	-	-	154,091,505.84	7,165,061,506.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	313,865.06	313,865.06
应付托管费	-	-	-	39,233.13	39,233.13
其他负债	-	-	-	23,539.88	23,539.88
负债总计	-	-	-	376,638.07	376,638.07
利率敏感度缺口	7,010,970,000.90	-	-	153,714,867.77	7,164,684,868.67

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下调0.25%	190,922.40	0.00
	市场利率上调0.25%	-187,889.17	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。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 2020年6月30日		上年度末 2019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	7,429,961,321.97	98.29	152,824,405.00	2.13
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	7,429,961,321.97	98.29	152,824,405.00	2.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准中的权益指数 上涨 5%	385,949,672.54	0.00
业绩比较基准中的权益指数 下降 5%	-385,949,672.54	0.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 7,390,077,743.66 元，属于第二层次的余额为 54,018,312.28 元，无属于第三层次的余额。(2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 152,824,405.00 元，无属于第二、第三层次的余额。)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2019 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日，本基金申购基金份额的对价总额为 1,328,021,029.38 元，其中包括以股票支付的申购款 809,733,225.95 元和以现金支付的申购款 518,287,803.43 元。

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,429,961,321.97	98.21
	其中：股票	7,429,961,321.97	98.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,135,500.00	0.19
	其中：债券	14,135,500.00	0.19
	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	105,325,777.81	1.39
8	其他各项资产	15,902,127.79	0.21
9	合计	7,565,324,727.57	100.00

注：（1）本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 501,850,084.50 元，占期末资产净值比例为 6.64%

（3）股票投资项含可退替代款的估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	110,648,094.80	1.46
B	采矿业	179,565,364.80	2.38
C	制造业	3,558,105,846.54	47.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	151,484,723.12	2.00
E	建筑业	147,487,802.28	1.95
F	批发和零售业	76,646,876.88	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	208,799,354.98	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	304,191,116.48	4.02
J	金融业	2,105,868,207.06	27.86
K	房地产业	278,563,577.58	3.69

L	租赁和商务服务业	106,368,255.96	1.41
M	科学研究和技术服务业	50,378,542.20	0.67
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	9,504,375.00	0.13
Q	卫生和社会工作	90,698,475.00	1.20
R	文化、体育和娱乐业	48,349,428.10	0.64
S	综合	-	-
	合计	7,426,660,040.78	98.25

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,097,017.07	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,731.77	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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,300,515.16	0.04

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	5,445,413	388,802,488.20	5.14
2	600519	贵州茅台	252,307	369,094,864.16	4.88
3	600036	招商银行	5,184,725	174,828,927.00	2.31
4	600276	恒瑞医药	1,866,842	172,309,516.60	2.28
5	000858	五粮液	975,846	166,986,767.52	2.21
6	000333	美的集团	2,463,940	147,318,972.60	1.95
7	000651	格力电器	2,419,033	136,844,696.81	1.81
8	002475	立讯精密	2,106,756	108,181,920.60	1.43
9	600030	中信证券	4,281,500	103,226,965.00	1.37
10	601166	兴业银行	6,265,183	98,864,587.74	1.31
11	600887	伊利股份	3,049,571	94,933,145.23	1.26
12	000002	万科 A	3,422,600	89,466,764.00	1.18
13	601398	工商银行	17,622,700	87,761,046.00	1.16
14	600900	长江电力	4,423,357	83,778,381.58	1.11
15	601888	中国中免	489,632	75,418,016.96	1.00
16	601328	交通银行	13,807,400	70,831,962.00	0.94
17	300059	东方财富	3,242,040	65,489,208.00	0.87
18	600585	海螺水泥	1,206,900	63,857,079.00	0.84
19	000725	京东方 A	13,614,200	63,578,314.00	0.84
20	600000	浦发银行	5,901,872	62,441,805.76	0.83
21	000001	平安银行	4,876,100	62,414,080.00	0.83
22	000661	长春高新	142,600	62,073,780.00	0.82
23	002714	牧原股份	753,380	61,777,160.00	0.82
24	603288	海天味业	488,242	60,737,304.80	0.80
25	600016	民生银行	10,694,200	60,636,114.00	0.80
26	002415	海康威视	1,878,900	57,024,615.00	0.75
27	600031	三一重工	2,968,912	55,696,789.12	0.74
28	601688	华泰证券	2,960,200	55,651,760.00	0.74
29	601012	隆基股份	1,327,400	54,065,002.00	0.72
30	000063	中兴通讯	1,355,800	53,718,754.00	0.71
31	600048	保利地产	3,596,883	53,161,930.74	0.70
32	600837	海通证券	4,068,200	51,177,956.00	0.68
33	603259	药明康德	521,517	50,378,542.20	0.67

34	601668	中国建筑	10,542,500	50,287,725.00	0.67
35	300498	温氏股份	2,241,786	48,870,934.80	0.65
36	601288	农业银行	14,431,000	48,776,780.00	0.65
37	600570	恒生电子	419,479	45,177,888.30	0.60
38	300015	爱尔眼科	1,012,140	43,977,483.00	0.58
39	000100	TCL 科技	6,805,000	42,191,000.00	0.56
40	601229	上海银行	4,998,334	41,486,172.20	0.55
41	300142	沃森生物	773,000	40,474,280.00	0.54
42	002142	宁波银行	1,509,708	39,660,029.16	0.52
43	600309	万华化学	789,323	39,458,256.77	0.52
44	601211	国泰君安	2,266,500	39,119,790.00	0.52
45	603986	兆易创新	165,744	39,100,667.04	0.52
46	601601	中国太保	1,368,200	37,283,450.00	0.49
47	601988	中国银行	10,592,800	36,862,944.00	0.49
48	601169	北京银行	7,440,200	36,456,980.00	0.48
49	002352	顺丰控股	665,477	36,401,591.90	0.48
50	600588	用友网络	817,122	36,035,080.20	0.48
51	600009	上海机场	483,810	34,868,186.70	0.46
52	601766	中国中车	6,106,430	34,012,815.10	0.45
53	600690	海尔智家	1,902,600	33,676,020.00	0.45
54	000568	泸州老窖	367,972	33,529,608.64	0.44
55	002241	歌尔股份	1,140,879	33,496,207.44	0.44
56	000338	潍柴动力	2,408,300	33,041,876.00	0.44
57	002594	比亚迪	455,600	32,712,080.00	0.43
58	300122	智飞生物	322,300	32,278,345.00	0.43
59	002304	洋河股份	303,600	31,920,504.00	0.42
60	002410	广联达	454,353	31,668,404.10	0.42
61	000876	新希望	1,059,469	31,572,176.20	0.42
62	600999	招商证券	1,437,000	31,542,150.00	0.42
63	600703	三安光电	1,231,300	30,782,500.00	0.41
64	601899	紫金矿业	6,905,100	30,382,440.00	0.40
65	600104	上汽集团	1,760,300	29,907,497.00	0.40
66	002555	三七互娱	637,300	29,825,640.00	0.39
67	002230	科大讯飞	774,300	28,982,049.00	0.38
68	002027	分众传媒	5,169,500	28,794,115.00	0.38
69	601818	光大银行	8,013,000	28,686,540.00	0.38
70	600745	闻泰科技	226,088	28,475,783.60	0.38
71	300601	康泰生物	168,931	27,393,850.96	0.36
72	300347	泰格医药	263,400	26,835,192.00	0.36

73	002007	华兰生物	549,792	26,786,277.12	0.35
74	600919	江苏银行	4,639,900	26,308,233.00	0.35
75	600028	中国石化	6,707,020	26,224,448.20	0.35
76	001979	招商蛇口	1,590,540	26,148,477.60	0.35
77	600436	片仔癀	151,900	25,860,975.00	0.34
78	000538	云南白药	256,765	24,087,124.65	0.32
79	600547	山东黄金	652,480	23,893,817.60	0.32
80	601088	中国神华	1,657,000	23,794,520.00	0.31
81	600406	国电南瑞	1,163,000	23,550,750.00	0.31
82	300413	芒果超媒	358,700	23,387,240.00	0.31
83	000895	双汇发展	501,400	23,109,526.00	0.31
84	000166	申万宏源	4,537,700	22,915,385.00	0.30
85	300003	乐普医疗	625,900	22,857,868.00	0.30
86	601628	中国人寿	838,100	22,804,701.00	0.30
87	600050	中国联通	4,677,000	22,636,680.00	0.30
88	600438	通威股份	1,294,300	22,494,934.00	0.30
89	002271	东方雨虹	551,743	22,417,318.09	0.30
90	300014	亿纬锂能	463,000	22,154,550.00	0.29
91	000938	紫光股份	514,293	22,104,313.14	0.29
92	601009	南京银行	3,013,523	22,089,123.59	0.29
93	002129	中环股份	980,600	22,024,276.00	0.29
94	601939	建设银行	3,381,400	21,336,634.00	0.28
95	002371	北方华创	124,500	21,278,295.00	0.28
96	601006	大秦铁路	2,991,201	21,058,055.04	0.28
97	000776	广发证券	1,487,500	21,003,500.00	0.28
98	300136	信维通信	389,500	20,651,290.00	0.27
99	002460	赣锋锂业	384,600	20,603,022.00	0.27
100	603160	汇顶科技	92,295	20,572,555.50	0.27
101	600196	复星医药	606,700	20,536,795.00	0.27
102	601390	中国中铁	4,090,200	20,532,804.00	0.27
103	600019	宝钢股份	4,483,600	20,445,216.00	0.27
104	601857	中国石油	4,874,200	20,422,898.00	0.27
105	603019	中科曙光	524,140	20,126,976.00	0.27
106	000977	浪潮信息	507,928	19,900,619.04	0.26
107	002044	美年健康	1,380,000	19,885,800.00	0.26
108	300124	汇川技术	522,330	19,843,316.70	0.26
109	002050	三花智控	902,710	19,769,349.00	0.26
110	601186	中国铁建	2,313,800	19,389,644.00	0.26
111	600809	山西汾酒	131,829	19,115,205.00	0.25

112	600015	华夏银行	3,088,400	18,901,008.00	0.25
113	002311	海大集团	396,773	18,882,427.07	0.25
114	002001	新和成	647,500	18,842,250.00	0.25
115	002624	完美世界	325,800	18,779,112.00	0.25
116	002602	世纪华通	1,250,200	18,635,562.00	0.25
117	601336	新华保险	419,000	18,553,320.00	0.25
118	300433	蓝思科技	660,603	18,523,308.12	0.25
119	601989	中国重工	4,581,904	18,327,616.00	0.24
120	601933	永辉超市	1,923,328	18,040,816.64	0.24
121	603501	韦尔股份	87,240	17,618,118.00	0.23
122	002236	大华股份	906,659	17,416,919.39	0.23
123	600958	东方证券	1,801,800	17,099,082.00	0.23
124	000157	中联重科	2,602,800	16,736,004.00	0.22
125	600183	生益科技	571,500	16,727,805.00	0.22
126	600352	浙江龙盛	1,306,600	16,711,414.00	0.22
127	002456	欧菲光	946,700	16,662,213.00	0.22
128	600741	华域汽车	791,970	16,465,056.30	0.22
129	002024	苏宁易购	1,871,800	16,415,686.00	0.22
130	601377	兴业证券	2,356,700	16,143,395.00	0.21
131	601788	光大证券	979,500	15,730,770.00	0.21
132	600383	金地集团	1,134,400	15,541,280.00	0.21
133	002008	大族激光	429,042	15,424,059.90	0.20
134	002463	沪电股份	607,300	15,170,354.00	0.20
135	601138	工业富联	1,000,500	15,157,575.00	0.20
136	600346	恒力石化	1,063,800	14,893,200.00	0.20
137	000860	顺鑫农业	260,200	14,826,196.00	0.20
138	600660	福耀玻璃	703,645	14,685,071.15	0.19
139	601901	方正证券	2,065,900	14,626,572.00	0.19
140	300408	三环集团	523,133	14,490,784.10	0.19
141	601225	陕西煤业	2,006,400	14,466,144.00	0.19
142	300033	同花顺	108,315	14,414,560.20	0.19
143	002120	韵达股份	583,360	14,263,152.00	0.19
144	601877	正泰电器	540,900	14,252,715.00	0.19
145	601155	新城控股	453,601	14,170,495.24	0.19
146	600522	中天科技	1,230,100	14,084,645.00	0.19
147	002736	国信证券	1,237,656	13,985,512.80	0.19
148	000425	徐工机械	2,364,300	13,973,013.00	0.18
149	600340	华夏幸福	605,700	13,846,302.00	0.18
150	600109	国金证券	1,213,100	13,841,471.00	0.18

151	002202	金风科技	1,385,564	13,814,073.08	0.18
152	300144	宋城演艺	787,317	13,620,584.10	0.18
153	601669	中国电建	3,853,333	13,332,532.18	0.18
154	000783	长江证券	1,950,600	13,147,044.00	0.17
155	002841	视源股份	132,100	13,146,592.00	0.17
156	603993	洛阳钼业	3,557,400	13,055,658.00	0.17
157	601800	中国交建	1,773,315	13,016,132.10	0.17
158	601108	财通证券	1,263,600	12,951,900.00	0.17
159	601985	中国核电	3,122,700	12,771,843.00	0.17
160	603799	华友钴业	342,264	12,756,529.04	0.17
161	601555	东吴证券	1,561,040	12,738,086.40	0.17
162	600089	特变电工	1,861,300	12,601,001.00	0.17
163	603369	今世缘	315,318	12,546,503.22	0.17
164	000069	华侨城 A	2,065,800	12,518,748.00	0.17
165	600867	通化东宝	715,926	12,478,590.18	0.17
166	000768	中航飞机	697,600	12,375,424.00	0.16
167	600010	包钢股份	11,434,500	12,349,260.00	0.16
168	002493	荣盛石化	950,700	11,693,610.00	0.15
169	000066	中国长城	884,300	11,672,760.00	0.15
170	600029	南方航空	2,226,000	11,508,420.00	0.15
171	600606	绿地控股	1,836,900	11,352,042.00	0.15
172	002179	中航光电	276,800	11,351,568.00	0.15
173	600487	亨通光电	686,520	11,265,793.20	0.15
174	000963	华东医药	438,600	11,096,580.00	0.15
175	002157	正邦科技	627,400	10,966,952.00	0.15
176	600795	国电电力	5,912,800	10,938,680.00	0.14
177	600061	国投资本	850,961	10,832,733.53	0.14
178	000625	长安汽车	978,964	10,768,604.00	0.14
179	600705	中航资本	2,701,100	10,696,356.00	0.14
180	600886	国投电力	1,360,839	10,696,194.54	0.14
181	601100	恒立液压	133,100	10,674,620.00	0.14
182	601607	上海医药	579,858	10,657,790.04	0.14
183	002422	科伦药业	506,600	10,638,600.00	0.14
184	600893	航发动力	452,700	10,629,396.00	0.14
185	600926	杭州银行	1,190,300	10,617,476.00	0.14
186	002466	天齐锂业	444,180	10,193,931.00	0.13
187	600498	烽火通信	352,500	10,190,775.00	0.13
188	600111	北方稀土	1,092,600	10,183,032.00	0.13
189	601162	天风证券	1,680,000	10,180,800.00	0.13

190	603899	晨光文具	186,342	10,174,273.20	0.13
191	603658	安图生物	64,800	10,167,012.00	0.13
192	601066	中信建投	257,000	10,120,660.00	0.13
193	600637	东方明珠	1,030,100	9,940,465.00	0.13
194	601111	中国国航	1,501,414	9,924,346.54	0.13
195	600176	中国巨石	1,056,100	9,663,315.00	0.13
196	002607	中公教育	342,500	9,504,375.00	0.13
197	600115	东方航空	2,244,300	9,470,946.00	0.13
198	002601	龙蟠佰利	509,300	9,422,050.00	0.12
199	600011	华能国际	2,213,000	9,338,860.00	0.12
200	601360	三六零	509,200	9,323,452.00	0.12
201	300628	亿联网络	136,000	9,283,360.00	0.12
202	601727	上海电气	1,841,090	9,279,093.60	0.12
203	601816	京沪高铁	1,483,900	9,244,697.00	0.12
204	600233	圆通速递	634,100	9,232,496.00	0.12
205	600118	中国卫星	298,000	9,187,340.00	0.12
206	600271	航天信息	560,404	9,100,960.96	0.12
207	600332	白云山	281,300	9,094,429.00	0.12
208	601600	中国铝业	3,280,800	9,055,008.00	0.12
209	000786	北新建材	424,360	9,051,598.80	0.12
210	601618	中国中冶	3,578,100	8,981,031.00	0.12
211	000656	金科股份	1,077,100	8,789,136.00	0.12
212	003816	中国广核	2,962,900	8,770,184.00	0.12
213	601838	成都银行	1,088,600	8,665,256.00	0.11
214	600221	海航控股	5,775,600	8,663,400.00	0.11
215	000596	古井贡酒	57,500	8,638,800.00	0.11
216	002252	上海莱士	1,018,600	8,617,356.00	0.11
217	000728	国元证券	1,017,200	8,544,480.00	0.11
218	600489	中金黄金	932,800	8,525,792.00	0.11
219	000703	恒逸石化	927,640	8,469,353.20	0.11
220	601919	中远海控	2,428,840	8,428,074.80	0.11
221	000961	中南建设	933,900	8,311,710.00	0.11
222	600177	雅戈尔	1,390,300	8,286,188.00	0.11
223	600068	葛洲坝	1,391,600	8,280,020.00	0.11
224	600066	宇通客车	667,000	8,137,400.00	0.11
225	601997	贵阳银行	1,134,700	8,124,452.00	0.11
226	600390	五矿资本	1,135,400	8,015,924.00	0.11
227	601998	中信银行	1,546,200	7,962,930.00	0.11
228	600004	白云机场	521,200	7,943,088.00	0.11

229	601198	东兴证券	690,300	7,524,270.00	0.10
230	600085	同仁堂	276,800	7,506,816.00	0.10
231	601881	中国银河	647,004	7,421,135.88	0.10
232	002508	老板电器	237,300	7,382,403.00	0.10
233	600018	上港集团	1,752,400	7,360,080.00	0.10
234	603833	欧派家居	63,200	7,324,880.00	0.10
235	600219	南山铝业	3,587,400	7,282,422.00	0.10
236	600516	方大炭素	1,146,686	7,201,188.08	0.10
237	601231	环旭电子	329,100	7,187,544.00	0.10
238	002673	西部证券	878,100	7,165,296.00	0.09
239	601018	宁波港	1,984,400	7,084,308.00	0.09
240	002146	荣盛发展	874,000	7,079,400.00	0.09
241	600362	江西铜业	523,700	7,049,002.00	0.09
242	600998	九州通	376,360	7,007,823.20	0.09
243	600655	豫园股份	781,500	6,924,090.00	0.09
244	600760	中航沈飞	210,900	6,921,738.00	0.09
245	601319	中国人保	1,074,000	6,916,560.00	0.09
246	600170	上海建工	2,232,600	6,854,082.00	0.09
247	601117	中国化学	1,243,400	6,813,832.00	0.09
248	601878	浙商证券	672,600	6,665,466.00	0.09
249	002773	康弘药业	132,600	6,576,960.00	0.09
250	600369	西南证券	1,424,400	6,537,996.00	0.09
251	600297	广汇汽车	2,038,900	6,504,091.00	0.09
252	600848	上海临港	302,600	6,496,822.00	0.09
253	601021	春秋航空	183,900	6,480,636.00	0.09
254	600208	新湖中宝	2,169,100	6,463,918.00	0.09
255	002938	鹏鼎控股	127,653	6,390,309.18	0.08
256	002739	万达电影	418,400	6,388,968.00	0.08
257	002153	石基信息	161,256	6,293,821.68	0.08
258	002958	青农商行	1,395,760	6,183,216.80	0.08
259	601658	邮储银行	1,350,700	6,172,699.00	0.08
260	600038	中直股份	149,198	6,127,561.86	0.08
261	600674	川投能源	659,700	6,115,419.00	0.08
262	002032	苏泊尔	83,300	5,914,300.00	0.08
263	002939	长城证券	470,300	5,794,096.00	0.08
264	600027	华电国际	1,643,000	5,619,060.00	0.07
265	603156	养元饮品	255,520	5,493,680.00	0.07
266	002558	巨人网络	306,900	5,340,060.00	0.07
267	000671	阳光城	822,800	5,216,552.00	0.07

268	000627	天茂集团	994,300	5,180,303.00	0.07
269	601992	金隅集团	1,680,100	5,141,106.00	0.07
270	600482	中国动力	325,900	5,116,630.00	0.07
271	600583	海油工程	1,109,500	5,048,225.00	0.07
272	600977	中国电影	377,200	4,952,636.00	0.07
273	002468	申通快递	306,900	4,887,829.00	0.06
274	601633	长城汽车	607,900	4,692,988.00	0.06
275	000709	河钢股份	2,118,100	4,320,924.00	0.06
276	601216	君正集团	1,691,300	4,295,902.00	0.06
277	601916	浙商银行	1,079,200	4,252,048.00	0.06
278	601238	广汽集团	463,500	4,171,500.00	0.06
279	601577	长沙银行	513,200	4,074,808.00	0.05
280	601808	中海油服	299,900	3,940,686.00	0.05
281	600188	兖州煤业	445,200	3,899,952.00	0.05
282	601236	红塔证券	200,100	3,881,940.00	0.05
283	600398	海澜之家	662,900	3,858,078.00	0.05
284	000723	美锦能源	615,200	3,851,152.00	0.05
285	002916	深南电路	21,749	3,643,392.48	0.05
286	601698	中国卫通	199,200	3,587,592.00	0.05
287	600372	中航电子	266,800	3,553,776.00	0.05
288	600928	西安银行	672,000	3,534,720.00	0.05
289	601898	中煤能源	922,200	3,504,360.00	0.05
290	600025	华能水电	911,900	3,456,101.00	0.05
291	600989	宝丰能源	408,800	3,442,096.00	0.05
292	000708	中信特钢	176,800	3,021,512.00	0.04
293	601077	渝农商行	577,300	2,724,856.00	0.04
294	600968	海油发展	1,032,800	2,406,424.00	0.03
295	601828	美凯龙	203,600	2,156,124.00	0.03
296	601298	青岛港	348,600	1,980,048.00	0.03
297	603260	合盛硅业	71,600	1,957,544.00	0.03
298	002945	华林证券	137,600	1,900,256.00	0.03
299	601212	白银有色	745,000	1,899,750.00	0.03
300	600299	安迪苏	147,300	1,800,006.00	0.02

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

金额单位：人民币元

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

1	688169	石头科技	5,382	1,965,183.48	0.03
2	600100	同方股份	75,200	548,208.00	0.01
3	688568	中科星图	11,020	178,634.20	-
4	000629	攀钢钒钛	80,700	162,207.00	-
5	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	-
6	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	-
7	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	-
8	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	-
9	300842	帝科股份	455	18,527.60	-
10	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	-
11	300839	博汇股份	502	11,751.82	-
12	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	-
13	300845	捷安高科	470	8,286.10	-
14	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	-
15	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	-
16	300846	首都在线	1,131	3,811.47	-

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	601318	中国平安	482,837,991.80	6.74
2	600519	贵州茅台	291,219,717.20	4.06
3	600036	招商银行	205,939,861.83	2.87
4	000651	格力电器	195,780,393.11	2.73
5	000333	美的集团	174,529,665.69	2.44
6	000858	五粮液	160,581,113.54	2.24
7	601166	兴业银行	146,525,437.72	2.05
8	600276	恒瑞医药	142,976,157.54	2.00
9	600030	中信证券	110,672,941.43	1.54
10	600887	伊利股份	102,679,554.14	1.43
11	601398	工商银行	99,009,598.70	1.38
12	000001	平安银行	95,836,743.82	1.34
13	002475	立讯精密	85,778,960.17	1.20
14	600900	长江电力	82,582,061.35	1.15

15	002352	顺丰控股	82,398,111.56	1.15
16	600016	民生银行	81,265,997.01	1.13
17	601328	交通银行	80,580,424.45	1.12
18	002415	海康威视	80,221,245.50	1.12
19	300498	温氏股份	79,477,829.59	1.11
20	000063	中兴通讯	75,755,554.39	1.06

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	002352	顺丰控股	53,260,624.74	0.74
2	000651	格力电器	33,660,913.59	0.47
3	000858	五粮液	32,616,187.47	0.46
4	000333	美的集团	31,426,685.08	0.44
5	000876	新希望	28,736,821.12	0.40
6	002916	深南电路	25,938,698.87	0.36
7	601318	中国平安	25,257,475.35	0.35
8	000063	中兴通讯	24,838,273.21	0.35
9	601166	兴业银行	24,197,715.00	0.34
10	600519	贵州茅台	23,837,113.84	0.33
11	000661	长春高新	23,367,834.80	0.33
12	601288	农业银行	20,230,528.00	0.28
13	002475	立讯精密	18,664,353.44	0.26
14	000001	平安银行	15,898,181.69	0.22
15	000002	万科 A	15,860,885.00	0.22
16	600016	民生银行	14,811,450.00	0.21
17	002007	华兰生物	14,477,892.40	0.20
18	002415	海康威视	13,733,852.26	0.19
19	300498	温氏股份	13,140,780.05	0.18
20	600570	恒生电子	12,208,949.32	0.17

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	8,297,300,942.47
卖出股票收入（成交）总额	1,214,029,314.39

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

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

（3）不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,135,500.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,135,500.00	0.19

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128088	深南转债	80,000	12,582,400.00	0.17
2	128112	歌尔转2	11,555	1,155,500.00	0.02
3	128114	正邦转债	3,976	397,600.00	0.01

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2007	沪深 300 期货 2007 合约	57	70,417,800.00	3,277,777.57	-
IF2012	沪深 300 期货 2012 合约	27	32,634,900.00	103,980.00	-
公允价值变动总额合计（元）					3,381,757.57
股指期货投资本期收益（元）					15,103,052.92
股指期货投资本期公允价值变动（元）					3,381,757.57

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,302,958.30
2	应收证券清算款	1,932,930.49
3	应收股利	1,375,893.44
4	应收利息	290,345.56

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,902,127.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128088	深南转债	12,582,400.00	0.17

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	000858	五粮液	41,257,032.00	0.55	转融通证券出借
2	002475	立讯精密	19,923,697.30	0.26	转融通证券出借
3	000651	格力电器	12,264,376.00	0.16	转融通证券出借
4	600276	恒瑞医药	10,337,600.00	0.14	转融通证券出借
5	600030	中信证券	3,189,753.00	0.04	转融通证券出借
6	600036	招商银行	3,034,800.00	0.04	转融通证券出借
7	601318	中国平安	2,856,000.00	0.04	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688169	石头科技	1,965,183.48	0.03	新股锁定期流通受限
2	688568	中科星图	178,634.20	0.00	网下新股流通受限
3	600100	同方股份	158,922.00	0.00	转融通证券出借
4	688377	迪威尔	129,619.48	0.00	网下新股流通受限
5	000629	攀钢钒钛	47,034.00	0.00	转融通证券出借

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,967	606,707.05	1,797,471,632.00	99.85%	2,628,182.00	0.15%

8.2 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%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	7,160,604,619.00
本报告期基金总申购份额	360,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	304,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-5,416,304,805.00
本报告期末基金份额总额	1,800,099,814.00

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	3,315,402,655.86	35.06%	906,152.82	35.11%	-
方正证券	2	2,078,437,545.56	21.98%	570,813.26	22.11%	-
广发证券	2	2,052,618,895.46	21.71%	551,937.89	21.38%	-
中信建投	4	1,962,825,343.10	20.76%	539,131.69	20.89%	-
中金公司	2	46,241,050.00	0.49%	13,164.16	0.51%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

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

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

3、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源上海、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，国盛证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中信建投上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个，华泰证

券上海、深圳证券交易所交易单元各 2 个为上年度新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	115,265,167.98	92.87%	3,309,000,000.00	23.72%	-	-
方正证券	8,846,295.75	7.13%	8,105,000,000.00	58.10%	-	-
广发证券	-	-	65,000,000.00	0.47%	-	-
中信建投	-	-	2,471,500,000.00	17.72%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

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	泰康资产管理有限责任公司关于泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金可投资科创板股票的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 12 日
2	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2020 年 3 月 18 日
3	泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站及基金管	2020 年 3 月 18 日

		理人网站	
--	--	------	--

§ 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	20200101-20200630	4,301,290,000.00	-	3,253,509,134.00	1,047,780,866.00	58.21%
	2	20200101-20200630	1,700,510,000.00	-	1,286,271,053.00	414,238,947.00	23.01%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。</p>							

注：1: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。

2:泰康资产管理有限责任公司以 2020 年 2 月 12 日为折算日对泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金进行了基金份额折算，根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.24359689，报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的机构折算后基金份额分别为 1047780866 份及 414238947 份。

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》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

泰康资产管理有限责任公司

2020 年 8 月 31 日