

建信中证 800 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：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 17 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65

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.....	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	65
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.....	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信中证 800ETF
场内简称	ZZ800
基金主代码	515620
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 17 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,157,721.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 800 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	建信基金管理有限责任公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	010-65051166
传真	010-66228001	010-65059873
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码	100033	100004
法定代表人	孙志晨	沈如军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 4 月 17 日(基金合同生效日) - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,585,111.47
本期利润	7,696,918.17
加权平均基金份额本期利润	0.0326
本期加权平均净值利润率	3.25%
本期基金份额净值增长率	6.89%
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	2,684,799.66
期末可供分配基金份额利润	0.0357
期末基金资产净值	80,339,330.99
期末基金份额净值	1.0689
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	6.89%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果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（已实现部分相抵未实现部分）。

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

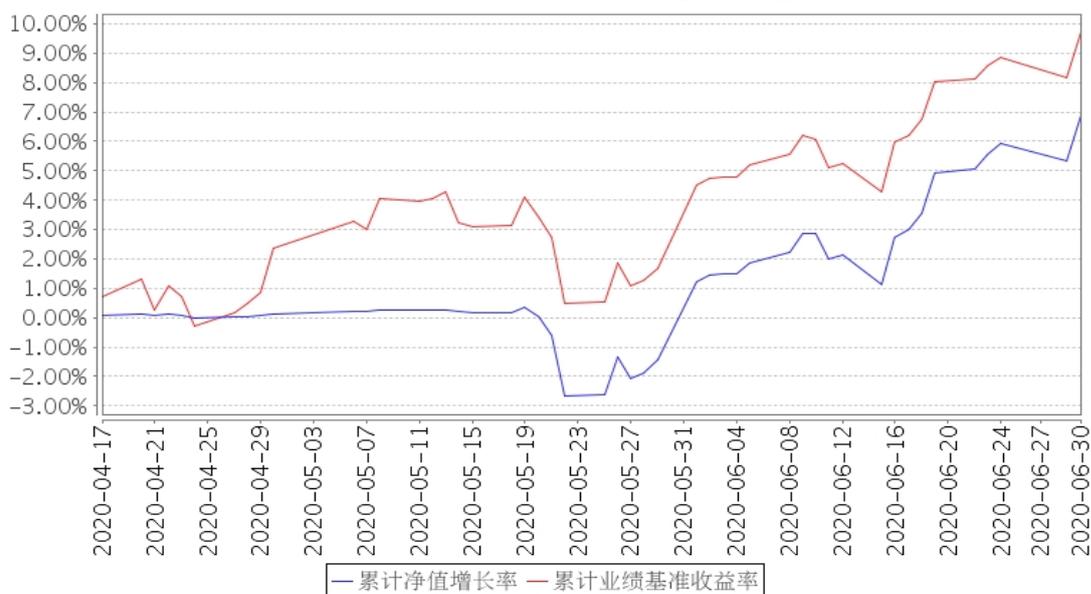
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.46%	0.85%	7.87%	0.87%	0.59%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.89%	0.71%	9.70%	0.85%	-2.81%	-0.14%

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

建信中证800ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2020 年 4 月 17 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双

债增强债券型证券投资基金、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期

混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 亿元。

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		
龚佳佳	本基金的基金经理	2020 年 4 月 17 日	-	7 年	龚佳佳先生，硕士。2012 年 7 月至 2014 年 10 月在诺安基金管理有限公司数量投资部担任研究员、基金经理助理；2014 年 10 月至 2015 年 3 月在工银瑞信基金管理有限公司指数投资部担任量化研究员；2015 年 3 月至 2018 年 5 月在华夏基金管理有限公司数量投资部担任研究员、投资经理；2018 年 5 月至今在建信基金管理公司金融工程及指数投资部历任基金经理助理、基金经理。2019 年 2 月 22 日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 7 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2019 年 8 月 23 日起任建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 6 日起任建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指

					数证券投资基金的基金经理; 2020 年 4 月 17 日起任建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2020 年 6 月 29 日起任建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注: ①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在认真控制投资风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 没有发生违反法律法规的行为。

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

为了公平对待投资人, 保护投资人利益, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为, 公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度, 制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块, 一旦出现不同基金同时买卖同一证券时, 系统自动切换至公平交易模块进行操作, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合, 制定并严格遵守相应的制度和流程, 通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内, 本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金管理人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的 5% 的情况有 2 次, 原因是投资组合投资策略需要, 未导致不公平交易和利益输送。

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

本基金跟踪的标的指数为中证 800 (000906.SH)，该指数由中证指数公司编制和维护。指数的成分股为沪深 300 和中证 500 成分股的并集，成分股采用自由流通市值加权。本基金成立于 2020 年 4 月 17 日，目前尚处于建仓期。在本报告期内，标的指数进行了一次成分股调整，管理人据此调整了基金组合。与此同时，管理人坚持持有人利益优先的原则，在做好风险控制的基础上还适度参与了打新股。后续待建仓期满后，管理人将继续在控制风险的基础上，力争将跟踪误差和跟踪偏离度都控制在合同约定的范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 6.89%，波动率 0.71%，业绩比较基准收益率 9.70%，波动率 0.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金成立于 2020 年 4 月 17 日，并于 2020 年 5 月 25 日在上交所上市。从成分股的分布看，指数在行业、市值等维度的分布都较为均衡。

今年上半年，由于新冠疫情在国内外扩散的影响，大陆及海外经济均受到了较大程度的影响，强周期的行业普遍受到了市场冷遇。同时，受益于科技兴国战略的科技股、受益于“抗疫”的生物医药股、受益于外资青睐的白酒消费股等获得了资金的疯狂追逐，与低估值的金融地产股的估值差越拉越大。

展望后市，随着新冠疫苗研发的推进，国内外经济的逐步恢复，估值优势明显的强周期行业有望获得资金流入迎来补涨。后续待基金建仓期结束后，管理人将在做好风险控制的基础上，尽量将跟踪误差和跟踪偏离度控制在合同约定的范围内。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《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》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的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），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融

工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信中证 800 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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,551,080.34
结算备付金		5,787,697.29
存出保证金		843,076.11
交易性金融资产	6.4.7.2	74,344,874.09
其中：股票投资		74,343,544.29
基金投资		-
债券投资		1,329.80
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,812.08
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		83,529,539.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		2,690,714.33
应付赎回款		-
应付管理人报酬		14,846.74
应付托管费		4,948.91
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	422,581.85

应交税费		10,534.09
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	46,583.00
负债合计		3,190,208.92
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	75,157,721.00
未分配利润	6.4.7.10	5,181,609.99
所有者权益合计		80,339,330.99
负债和所有者权益总计		83,529,539.91

注：1、报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0689 元，基金份额总额 75,157,721.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 06 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		8,432,283.82
1. 利息收入		403,227.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	319,513.92
债券利息收入		3.66
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		83,709.59
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,568,699.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,229,529.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,924.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	313,514.56
股利收益	6.4.7.16	1,019,730.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,111,806.70
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	348,550.17

减：二、费用		735,365.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	71,261.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,754.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	592,364.72
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		1,128.65
7. 其他费用	6.4.7.20	46,856.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,696,918.17
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,696,918.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）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）	321,157,721.00	-	321,157,721.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,696,918.17	7,696,918.17
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）	-246,000,000.00	-2,515,308.18	-248,515,308.18
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-246,000,000.00	-2,515,308.18	-248,515,308.18
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）	75,157,721.00	5,181,609.99	80,339,330.99

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>张军红</u>	<u>吴灵玲</u>	<u>丁颖</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

建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“ZZ800”）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]1805 号《关于准予建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金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《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 321,157,721.00 元（含募集股票市值），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 61490173_A15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 321,157,721.00 份基金份额，其中无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证自律监管决定书【2020】130 号号审核同意，本基金于 2020 年 5 月 25 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《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 800 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、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的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）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 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

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等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以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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，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等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。

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确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金管理人于基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上，方可进行收益分配。本基金收益分配比例的确定原则为，使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，且本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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

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、债券投资和资产支持证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、可交换债券、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、可交换债券、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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[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[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]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(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。

(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	2,551,080.34
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	2,551,080.34	

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	70,411,347.40	74,343,544.29	3,932,196.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,329.80	329.81
	银行间市场	-	-
	合计	1,329.80	329.81
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	70,412,347.39	74,344,874.09	3,932,526.70

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	4,611,280.00	-	-	

其中：股指期货投资	4,611,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,611,280.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2020 年 06 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) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IF2007	IF2007	2	2,470,800.00	105,360.00
IC2007	IC2007	2	2,319,760.00	73,920.00
总额合计	-	4	4,790,560.00	179,280.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	179,280.00
期货投资净额	-	-	-	-

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 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	683.52
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	2,006.90
应收债券利息	0.26
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	121.40
合计	2,812.08

6.4.7.6 其他资产

无。

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	422,581.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	422,581.85

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	-
应付指数使用费	35,000.00
预提费用	11,583.00
合计	46,583.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	321,157,721.00	321,157,721.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-246,000,000.00	-246,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	75,157,721.00	75,157,721.00

注：（1）如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

（2）本基金于2020年3月16日至2020年4月10日向社会公开募集。截至2020年4月17日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币307,458,000.00元，有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的认购金额为人民币13,699,721.00元，有效净认

购资金在募集期间产生的利息为人民币 77,727.97 元，不折合基金份额。以上实收基金合计为人民币 321,157,721.00 元，折合 321,157,721.00 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,585,111.47	4,111,806.70	7,696,918.17
本期基金份额交易产生的变动数	-900,311.81	-1,614,996.37	-2,515,308.18
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-900,311.81	-1,614,996.37	-2,515,308.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,684,799.66	2,496,810.33	5,181,609.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	311,862.71
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	7,295.75
其他	355.46
合计	319,513.92

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4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,372,269.83
股票投资收益——赎回差价收入	857,260.15
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	2,229,529.98

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4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日
----	--------------------------------------

	月 30 日
卖出股票成交总额	128,127,120.73
减：卖出股票成本总额	126,754,850.90
买卖股票差价收入	1,372,269.83

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4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	248,515,308.18
减：现金支付赎回款总额	100,704,255.18
减：赎回股票成本总额	146,953,792.85
赎回差价收入	857,260.15

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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4月17日（基金合同生效日）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	5,924.74
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	5,924.74

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4月17日（基金合同生效日）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	21,528.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,599.86
减：应收利息总额	3.55
买卖债券差价收入	5,924.74

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	313,514.56

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,019,730.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,019,730.50

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 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,932,526.70
股票投资	3,932,196.89
债券投资	329.81
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	179,280.00
权证投资	-
期货	179,280.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,111,806.70

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	348,494.17
其他	56.00
合计	348,550.17

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	592,364.72
银行间市场交易费用	-
合计	592,364.72

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	11,583.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	273.37
指数使用费	35,000.00
合计	46,856.37

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司

建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
--------------	-----------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中金公司	26,908,845.09	5.87

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中金公司	24,520.35	5.80	24,520.35	5.80

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4月17日（基金合同生效日）至2020年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	71,261.90
其中：支付销售机构的客户维护费	4,313.97

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 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 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,754.01

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	2,640	13,200.00	17,265.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020年6月22日	重大事项	1.72	2020年07月08日	1.89	10,700	18,486.63	18,404.00	-

002470	*ST 金正	2020 年 6 月 30 日	重大事项	2.27	2020 年 07 月 01 日	2.16	5,600	13,662.09	12,712.00	-
600317	营口港	2020 年 6 月 22 日	重大事项	2.21	2020 年 07 月 08 日	2.43	100	215.01	221.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程 度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督 和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制 上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内 控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督 察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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
AAA	-
AAA 以下	1,329.80
未评级	-
合计	1,329.80

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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利率风险进行管理。

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	2,551,080.34	-	-	-	2,551,080.34
结算备付金	5,787,697.29	-	-	-	5,787,697.29
存出保证金	843,076.11	-	-	-	843,076.11
交易性金融资产	-	-	1,329.80	74,343,544.29	74,344,874.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,812.08	2,812.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,181,853.74	-	1,329.80	74,346,356.37	83,529,539.91
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,690,714.33	2,690,714.33
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	14,846.74	14,846.74
应付托管费	-	-	-	4,948.91	4,948.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	422,581.85	422,581.85
应交税费	-	-	-	10,534.09	10,534.09
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	46,583.00	46,583.00
负债总计	-	-	-	3,190,208.92	3,190,208.92
利率敏感度缺口	9,181,853.74	-	1,329.80	71,156,147.45	80,339,330.99

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

注：于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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，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的股票，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。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	74,343,544.29	92.54
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,329.80	0.00
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	74,344,874.09	92.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 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人民币74,313,537.09元，属于第二层次的余额为人民币31,337.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将

相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 其他事项

无。

§ 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	74,343,544.29	89.00
	其中：股票	74,343,544.29	89.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,329.80	-
	其中：债券	1,329.80	0.00
	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	8,338,777.63	9.98
8	其他各项资产	845,888.19	1.01
9	合计	83,529,539.91	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	985,191.00	1.23
B	采矿业	1,745,210.00	2.17
C	制造业	38,115,165.81	47.44
D	电力、热力、燃气	1,526,832.80	1.90

	及水生产和供应业		
E	建筑业	1,338,690.00	1.67
F	批发和零售业	1,656,433.60	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,888,334.30	2.35
H	住宿和餐饮业	58,191.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,601,235.54	5.73
J	金融业	16,198,872.76	20.16
K	房地产业	2,693,915.60	3.35
L	租赁和商务服务业	1,072,236.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	496,911.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	168,963.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	88,710.00	0.11
Q	卫生和社会工作	770,701.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	628,697.00	0.78
S	综合	158,966.00	0.20
	合计	74,193,256.41	92.35

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,266.00	0.00
C	制造业	104,532.00	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,111.04	0.01
E	建筑业	694.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,055.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,072.00	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,967.84	0.00
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	546.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,677.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	367.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	150,287.88	0.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	39,800	2,841,720.00	3.54
2	600519	贵州茅台	1,800	2,633,184.00	3.28
3	600036	招商银行	37,813	1,275,054.36	1.59
4	000858	五 粮 液	7,400	1,266,288.00	1.58
5	600276	恒瑞医药	13,700	1,264,510.00	1.57
6	000333	美的集团	18,600	1,112,094.00	1.38
7	000651	格力电器	18,200	1,029,574.00	1.28
8	002475	立讯精密	14,839	761,982.65	0.95
9	600030	中信证券	31,200	752,232.00	0.94
10	601166	兴业银行	46,000	725,880.00	0.90
11	600887	伊利股份	22,300	694,199.00	0.86
12	000002	万 科 A	25,800	674,412.00	0.84
13	601398	工商银行	129,300	643,914.00	0.80
14	600900	长江电力	32,300	611,762.00	0.76
15	601328	交通银行	101,400	520,182.00	0.65
16	002371	北方华创	2,900	495,639.00	0.62
17	000725	京东方 A	102,800	480,076.00	0.60
18	000661	长春高新	1,100	478,830.00	0.60
19	300059	东方财富	23,640	477,528.00	0.59
20	002714	牧原股份	5,750	471,500.00	0.59
21	000001	平安银行	36,700	469,760.00	0.58
22	600585	海螺水泥	8,800	465,608.00	0.58

23	601888	中国中免	3,000	462,090.00	0.58
24	600000	浦发银行	43,300	458,114.00	0.57
25	600016	民生银行	78,400	444,528.00	0.55
26	000063	中兴通讯	10,300	413,339.00	0.51
27	002821	凯莱英	1,700	413,100.00	0.51
28	002415	海康威视	13,500	409,725.00	0.51
29	601688	华泰证券	21,700	407,960.00	0.51
30	600031	三一重工	21,700	407,092.00	0.51
31	603288	海天味业	3,267	406,414.80	0.51
32	601012	隆基股份	9,600	391,008.00	0.49
33	600048	保利地产	26,400	390,192.00	0.49
34	600837	海通证券	29,900	376,142.00	0.47
35	601668	中国建筑	77,500	369,675.00	0.46
36	603259	药明康德	3,820	369,012.00	0.46
37	601288	农业银行	106,000	358,280.00	0.45
38	300498	温氏股份	16,200	353,160.00	0.44
39	300033	同花顺	2,600	346,008.00	0.43
40	600570	恒生电子	3,160	340,332.00	0.42
41	300015	爱尔眼科	7,540	327,613.00	0.41
42	000100	TCL 科技	51,300	318,060.00	0.40
43	300142	沃森生物	5,900	308,924.00	0.38
44	002916	深南电路	1,840	308,236.80	0.38
45	601229	上海银行	36,500	302,950.00	0.38
46	600309	万华化学	5,700	284,943.00	0.35
47	601211	国泰君安	16,500	284,790.00	0.35
48	002142	宁波银行	10,600	278,462.00	0.35
49	603986	兆易创新	1,180	278,373.80	0.35
50	601601	中国太保	10,100	275,225.00	0.34
51	601988	中国银行	77,800	270,744.00	0.34
52	002352	顺丰控股	4,900	268,030.00	0.33
53	601169	北京银行	54,600	267,540.00	0.33
54	600588	用友网络	5,850	257,985.00	0.32
55	000568	泸州老窖	2,800	255,136.00	0.32
56	002594	比亚迪	3,500	251,300.00	0.31
57	601766	中国中车	44,800	249,536.00	0.31
58	000338	潍柴动力	18,100	248,332.00	0.31
59	600690	海尔智家	14,000	247,800.00	0.31
60	002410	广联达	3,500	243,950.00	0.30
61	000876	新 希 望	8,100	241,380.00	0.30
62	600009	上海机场	3,300	237,831.00	0.30
63	300122	智飞生物	2,300	230,345.00	0.29
64	600999	招商证券	10,300	226,085.00	0.28

65	002241	歌尔股份	7,700	226,072.00	0.28
66	601899	紫金矿业	50,700	223,080.00	0.28
67	002304	洋河股份	2,100	220,794.00	0.27
68	600703	三安光电	8,800	220,000.00	0.27
69	600104	上汽集团	12,900	219,171.00	0.27
70	002555	三七互娱	4,600	215,280.00	0.27
71	002230	科大讯飞	5,700	213,351.00	0.27
72	601818	光大银行	58,800	210,504.00	0.26
73	002027	分众传媒	36,400	202,748.00	0.25
74	600745	闻泰科技	1,600	201,520.00	0.25
75	001979	招商蛇口	12,100	198,924.00	0.25
76	000596	古井贡酒	1,300	195,312.00	0.24
77	600919	江苏银行	34,000	192,780.00	0.24
78	600028	中国石化	49,300	192,763.00	0.24
79	002007	华兰生物	3,640	182,400.40	0.23
80	000538	云南白药	1,900	178,239.00	0.22
81	300413	芒果超媒	2,700	176,040.00	0.22
82	600547	山东黄金	4,800	175,776.00	0.22
83	601088	中国神华	12,200	175,192.00	0.22
84	300347	泰格医药	1,700	173,196.00	0.22
85	000166	申万宏源	34,100	172,205.00	0.21
86	600406	国电南瑞	8,500	172,125.00	0.21
87	000895	双汇发展	3,700	170,533.00	0.21
88	300014	亿纬锂能	3,562	170,441.70	0.21
89	600436	片仔癀	1,000	170,250.00	0.21
90	600050	中国联通	34,400	166,496.00	0.21
91	601628	中国人寿	6,100	165,981.00	0.21
92	600438	通威股份	9,500	165,110.00	0.21
93	300003	乐普医疗	4,500	164,340.00	0.20
94	000938	紫光股份	3,800	163,324.00	0.20
95	601009	南京银行	22,200	162,726.00	0.20
96	002129	中环股份	7,100	159,466.00	0.20
97	300136	信维通信	3,000	159,060.00	0.20
98	000776	广发证券	11,200	158,144.00	0.20
99	603160	汇顶科技	700	156,030.00	0.19
100	002460	赣锋锂业	2,900	155,353.00	0.19
101	601006	大秦铁路	21,900	154,176.00	0.19
102	002773	康弘药业	3,100	153,760.00	0.19
103	600196	复星医药	4,500	152,325.00	0.19
104	601390	中国中铁	30,100	151,102.00	0.19
105	601857	中国石油	35,900	150,421.00	0.19
106	002271	东方雨虹	3,700	150,331.00	0.19

107	600019	宝钢股份	32,900	150,024.00	0.19
108	002841	视源股份	1,500	149,280.00	0.19
109	603019	中科曙光	3,840	147,456.00	0.18
110	002044	美年健康	10,200	146,982.00	0.18
111	300601	康泰生物	900	145,944.00	0.18
112	002938	鹏鼎控股	2,900	145,174.00	0.18
113	600809	山西汾酒	1,000	145,000.00	0.18
114	000977	浪潮信息	3,700	144,966.00	0.18
115	002311	海大集团	3,000	142,770.00	0.18
116	002001	新 和 成	4,900	142,590.00	0.18
117	601186	中国铁建	17,000	142,460.00	0.18
118	300253	卫宁健康	6,210	142,457.40	0.18
119	603501	韦尔股份	700	141,365.00	0.18
120	002050	三花智控	6,350	139,065.00	0.17
121	600015	华夏银行	22,700	138,924.00	0.17
122	002624	完美世界	2,400	138,336.00	0.17
123	002602	世纪华通	9,000	137,790.00	0.17
124	300433	蓝思科技	4,900	137,396.00	0.17
125	601336	新华保险	3,100	137,268.00	0.17
126	002032	苏 泊 尔	1,900	134,900.00	0.17
127	601989	中国重工	33,500	134,000.00	0.17
128	601933	永辉超市	14,000	131,320.00	0.16
129	000157	中联重科	19,800	127,314.00	0.16
130	002368	太极股份	2,900	126,701.00	0.16
131	300124	汇川技术	3,300	125,367.00	0.16
132	600958	东方证券	13,200	125,268.00	0.16
133	002456	欧菲光	6,800	125,052.00	0.16
134	002127	南极电商	5,900	124,903.00	0.16
135	002236	大华股份	6,400	122,944.00	0.15
136	600183	生益科技	4,200	122,934.00	0.15
137	600352	浙江龙盛	9,600	122,784.00	0.15
138	002920	德赛西威	2,000	122,660.00	0.15
139	600741	华域汽车	5,800	120,582.00	0.15
140	002008	大族激光	3,300	118,635.00	0.15
141	601377	兴业证券	17,200	117,820.00	0.15
142	002024	苏宁易购	13,300	116,641.00	0.15
143	600201	生物股份	4,100	114,144.00	0.14
144	600383	金地集团	8,200	112,340.00	0.14
145	601138	工业富联	7,400	112,110.00	0.14
146	300558	贝达药业	800	111,984.00	0.14
147	601788	光大证券	6,900	110,814.00	0.14
148	600346	恒力石化	7,900	110,600.00	0.14

149	603444	吉比特	200	109,802.00	0.14
150	600660	福耀玻璃	5,200	108,524.00	0.14
151	000860	顺鑫农业	1,900	108,262.00	0.13
152	600739	辽宁成大	5,700	107,901.00	0.13
153	601901	方正证券	15,200	107,616.00	0.13
154	002463	沪电股份	4,300	107,414.00	0.13
155	601225	陕西煤业	14,800	106,708.00	0.13
156	601155	新城控股	3,400	106,216.00	0.13
157	000425	徐工机械	17,700	104,607.00	0.13
158	600522	中天科技	9,100	104,195.00	0.13
159	002185	华天科技	7,700	104,181.00	0.13
160	600340	华夏幸福	4,500	102,870.00	0.13
161	601877	正泰电器	3,900	102,765.00	0.13
162	300628	亿联网络	1,500	102,390.00	0.13
163	002202	金风科技	10,200	101,694.00	0.13
164	600109	国金证券	8,900	101,549.00	0.13
165	002439	启明星辰	2,400	100,968.00	0.13
166	300285	国瓷材料	3,000	100,530.00	0.13
167	000783	长江证券	14,700	99,078.00	0.12
168	002120	韵达股份	4,050	99,022.50	0.12
169	600529	山东药玻	1,700	98,600.00	0.12
170	002925	盈趣科技	1,700	98,498.00	0.12
171	002736	国信证券	8,700	98,310.00	0.12
172	601669	中国电建	28,400	98,264.00	0.12
173	300088	长信科技	8,700	97,440.00	0.12
174	603799	华友钴业	2,500	97,150.00	0.12
175	300012	华测检测	4,900	96,824.00	0.12
176	603993	洛阳钼业	26,100	95,787.00	0.12
177	601800	中国交建	13,000	95,420.00	0.12
178	600079	人福医药	3,500	95,270.00	0.12
179	601108	财通证券	9,200	94,300.00	0.12
180	300408	三环集团	3,400	94,180.00	0.12
181	000768	中航飞机	5,300	94,022.00	0.12
182	601555	东吴证券	11,500	93,840.00	0.12
183	601985	中国核电	22,900	93,661.00	0.12
184	002131	利欧股份	24,200	93,412.00	0.12
185	000069	华侨城 A	15,400	93,324.00	0.12
186	002385	大北农	10,200	92,922.00	0.12
187	600089	特变电工	13,700	92,749.00	0.12
188	600521	华海药业	2,720	92,289.60	0.11
189	603369	今世缘	2,300	91,517.00	0.11
190	600010	包钢股份	84,300	91,044.00	0.11

191	600867	通化东宝	5,200	90,636.00	0.11
192	300144	宋城演艺	5,060	87,538.00	0.11
193	000066	中国长城	6,600	87,120.00	0.11
194	600143	金发科技	6,600	86,922.00	0.11
195	000963	华东医药	3,400	86,020.00	0.11
196	002465	海格通信	6,600	85,404.00	0.11
197	600161	天坛生物	1,884	85,401.72	0.11
198	600029	南方航空	16,400	84,788.00	0.11
199	600298	安琪酵母	1,700	84,116.00	0.10
200	600487	亨通光电	5,100	83,691.00	0.10
201	002493	荣盛石化	6,800	83,640.00	0.10
202	000009	中国宝安	9,800	83,398.00	0.10
203	300482	万孚生物	800	83,200.00	0.10
204	000625	长安汽车	7,500	82,500.00	0.10
205	002212	南洋股份	3,100	82,398.00	0.10
206	002157	正邦科技	4,700	82,156.00	0.10
207	000636	风华高科	2,800	81,732.00	0.10
208	603658	安图生物	500	81,220.00	0.10
209	600795	国电电力	43,600	80,660.00	0.10
210	603882	金域医学	900	80,550.00	0.10
211	002074	国轩高科	3,000	80,520.00	0.10
212	601099	太平洋	25,300	80,201.00	0.10
213	601100	恒立液压	1,000	80,200.00	0.10
214	300418	昆仑万维	3,200	79,872.00	0.10
215	600893	航发动力	3,400	79,832.00	0.10
216	600061	国投资本	6,200	78,926.00	0.10
217	002690	美亚光电	1,500	78,900.00	0.10
218	600705	中航资本	19,900	78,804.00	0.10
219	600886	国投电力	10,000	78,600.00	0.10
220	603939	益丰药房	860	78,260.00	0.10
221	002466	天齐锂业	3,400	78,030.00	0.10
222	603517	绝味食品	1,100	77,814.00	0.10
223	600926	杭州银行	8,700	77,604.00	0.10
224	002075	沙钢股份	6,200	77,500.00	0.10
225	601607	上海医药	4,200	77,196.00	0.10
226	300315	掌趣科技	10,500	76,965.00	0.10
227	600606	绿地控股	12,400	76,632.00	0.10
228	601128	常熟银行	10,200	76,602.00	0.10
229	000028	国药一致	1,700	76,517.00	0.10
230	002223	鱼跃医疗	2,100	76,440.00	0.10
231	000988	华工科技	3,100	75,733.00	0.09
232	600498	烽火通信	2,600	75,166.00	0.09

233	601162	天风证券	12,300	74,538.00	0.09
234	600426	华鲁恒升	4,200	74,256.00	0.09
235	002179	中航光电	1,800	73,818.00	0.09
236	002273	水晶光电	4,300	73,702.00	0.09
237	600111	北方稀土	7,900	73,628.00	0.09
238	600637	东方明珠	7,600	73,340.00	0.09
239	002607	中公教育	2,600	72,150.00	0.09
240	601111	中国国航	10,900	72,049.00	0.09
241	002422	科伦药业	3,400	71,400.00	0.09
242	600176	中国巨石	7,800	71,370.00	0.09
243	601066	中信建投	1,800	70,884.00	0.09
244	300168	万达信息	3,200	70,624.00	0.09
245	000975	银泰黄金	4,500	70,560.00	0.09
246	300271	华宇软件	2,500	70,525.00	0.09
247	600115	东方航空	16,600	70,052.00	0.09
248	300207	欣旺达	3,700	69,930.00	0.09
249	300496	中科创达	900	69,930.00	0.09
250	002373	千方科技	2,900	69,571.00	0.09
251	600011	华能国际	16,300	68,786.00	0.09
252	002340	格林美	13,800	68,586.00	0.09
253	600233	圆通速递	4,700	68,432.00	0.09
254	000786	北新建材	3,200	68,256.00	0.08
255	600332	白云山	2,100	67,893.00	0.08
256	600118	中国卫星	2,200	67,826.00	0.08
257	601360	三六零	3,700	67,747.00	0.08
258	002156	通富微电	2,700	67,635.00	0.08
259	601727	上海电气	13,400	67,536.00	0.08
260	601816	京沪高铁	10,800	67,284.00	0.08
261	000513	丽珠集团	1,400	67,214.00	0.08
262	000547	航天发展	4,900	66,983.00	0.08
263	000656	金科股份	8,200	66,912.00	0.08
264	601600	中国铝业	24,200	66,792.00	0.08
265	002414	高德红外	2,280	66,758.40	0.08
266	002019	亿帆医药	2,900	66,613.00	0.08
267	600271	航天信息	4,100	66,584.00	0.08
268	601618	中国中冶	26,300	66,013.00	0.08
269	600132	重庆啤酒	900	65,700.00	0.08
270	000728	国元证券	7,800	65,520.00	0.08
271	603899	晨光文具	1,200	65,520.00	0.08
272	002507	涪陵榨菜	1,800	64,818.00	0.08
273	002252	上海莱士	7,600	64,296.00	0.08
274	600699	均胜电子	2,700	64,287.00	0.08

275	600885	宏发股份	1,600	64,192.00	0.08
276	000703	恒逸石化	7,000	63,910.00	0.08
277	003816	中国广核	21,500	63,640.00	0.08
278	600221	海航控股	42,400	63,600.00	0.08
279	601799	星宇股份	500	63,500.00	0.08
280	603233	大参林	780	63,351.60	0.08
281	000750	国海证券	14,500	62,930.00	0.08
282	601838	成都银行	7,900	62,884.00	0.08
283	300595	欧普康视	900	62,406.00	0.08
284	000961	中南建设	7,000	62,300.00	0.08
285	600489	中金黄金	6,800	62,152.00	0.08
286	002353	杰瑞股份	2,000	62,000.00	0.08
287	601919	中远海控	17,800	61,766.00	0.08
288	300024	机器人	4,500	61,515.00	0.08
289	300017	网宿科技	7,200	61,128.00	0.08
290	000021	深科技	2,800	61,124.00	0.08
291	002250	联化科技	2,800	61,040.00	0.08
292	600068	葛洲坝	10,200	60,690.00	0.08
293	002797	第一创业	8,700	60,204.00	0.07
294	600177	雅戈尔	10,100	60,196.00	0.07
295	002174	游族网络	2,300	59,984.00	0.07
296	002138	顺络电子	2,400	59,880.00	0.07
297	600066	宇通客车	4,900	59,780.00	0.07
298	601997	贵阳银行	8,300	59,428.00	0.07
299	600801	华新水泥	2,500	59,275.00	0.07
300	002603	以岭药业	1,900	59,261.00	0.07
301	002601	龙蟠佰利	3,200	59,200.00	0.07
302	300630	普利制药	800	59,160.00	0.07
303	600845	宝信软件	1,000	59,080.00	0.07
304	600895	张江高科	2,900	59,073.00	0.07
305	002195	二三四五	20,900	58,729.00	0.07
306	300058	蓝色光标	7,500	58,500.00	0.07
307	000050	深天马 A	3,800	58,368.00	0.07
308	601998	中信银行	11,300	58,195.00	0.07
309	000869	张裕 A	1,700	58,055.00	0.07
310	603833	欧派家居	500	57,950.00	0.07
311	600390	五矿资本	8,200	57,892.00	0.07
312	600486	扬农化工	700	57,750.00	0.07
313	603858	步长制药	2,000	57,700.00	0.07
314	603338	浙江鼎力	760	57,585.20	0.07
315	600315	上海家化	1,200	57,480.00	0.07
316	300316	晶盛机电	2,300	56,902.00	0.07

317	600380	健康元	3,500	56,840.00	0.07
318	600004	白云机场	3,700	56,388.00	0.07
319	300070	碧水源	6,900	56,028.00	0.07
320	300357	我武生物	900	56,025.00	0.07
321	002500	山西证券	8,540	55,851.60	0.07
322	300618	寒锐钴业	900	55,818.00	0.07
323	002511	中顺洁柔	2,500	55,750.00	0.07
324	002152	广电运通	4,300	55,642.00	0.07
325	002572	索菲亚	2,300	55,591.00	0.07
326	601198	东兴证券	5,100	55,590.00	0.07
327	600667	太极实业	4,700	55,554.00	0.07
328	002867	周大生	2,500	55,425.00	0.07
329	600535	天士力	3,400	55,148.00	0.07
330	601881	中国银河	4,800	55,056.00	0.07
331	000998	隆平高科	3,300	54,945.00	0.07
332	600037	歌华有线	3,600	54,720.00	0.07
333	000401	冀东水泥	3,400	54,536.00	0.07
334	600410	华胜天成	4,000	54,400.00	0.07
335	000630	铜陵有色	28,100	54,233.00	0.07
336	600155	华创阳安	4,500	53,955.00	0.07
337	600642	申能股份	9,100	53,781.00	0.07
338	300009	安科生物	3,000	53,700.00	0.07
339	600219	南山铝业	26,400	53,592.00	0.07
340	000623	吉林敖东	3,400	53,482.00	0.07
341	600516	方大炭素	8,500	53,380.00	0.07
342	600018	上港集团	12,700	53,340.00	0.07
343	300010	豆神教育	2,700	52,839.00	0.07
344	601018	宁波港	14,700	52,479.00	0.07
345	601231	环旭电子	2,400	52,416.00	0.07
346	601233	桐昆股份	4,100	52,316.00	0.06
347	600998	九州通	2,800	52,136.00	0.06
348	002926	华西证券	4,900	52,087.00	0.06
349	600126	杭钢股份	5,000	52,000.00	0.06
350	603707	健友股份	800	51,656.00	0.06
351	600085	同仁堂	1,900	51,528.00	0.06
352	603659	璞泰来	500	51,510.00	0.06
353	000739	普洛药业	2,200	51,238.00	0.06
354	600362	江西铜业	3,800	51,148.00	0.06
355	601319	中国人保	7,900	50,876.00	0.06
356	002653	海思科	1,900	50,559.00	0.06
357	600655	豫园股份	5,700	50,502.00	0.06
358	300212	易华录	900	50,400.00	0.06

359	600170	上海建工	16,400	50,348.00	0.06
360	600879	航天电子	7,800	50,232.00	0.06
361	600153	建发股份	6,200	50,220.00	0.06
362	002030	达安基因	1,840	50,195.20	0.06
363	002013	中航机电	6,350	50,165.00	0.06
364	002673	西部证券	6,100	49,776.00	0.06
365	600884	杉杉股份	4,220	49,753.80	0.06
366	601878	浙商证券	5,000	49,550.00	0.06
367	601117	中国化学	9,000	49,320.00	0.06
368	600760	中航沈飞	1,500	49,230.00	0.06
369	002739	万达电影	3,200	48,864.00	0.06
370	002557	洽洽食品	900	48,771.00	0.06
371	600167	联美控股	3,400	48,756.00	0.06
372	600415	小商品城	10,000	48,700.00	0.06
373	600811	东方集团	11,000	48,620.00	0.06
374	002146	荣盛发展	6,000	48,600.00	0.06
375	600216	浙江医药	2,500	48,150.00	0.06
376	002078	太阳纸业	5,000	47,600.00	0.06
377	600804	鹏博士	5,300	47,594.00	0.06
378	600297	广汇汽车	14,900	47,531.00	0.06
379	600208	新湖中宝	15,900	47,382.00	0.06
380	600728	佳都科技	5,200	47,372.00	0.06
381	600369	西南证券	10,300	47,277.00	0.06
382	600848	上海临港	2,200	47,234.00	0.06
383	002153	石基信息	1,200	46,836.00	0.06
384	001914	招商积余	1,500	46,095.00	0.06
385	300274	阳光电源	3,200	46,048.00	0.06
386	600909	华安证券	6,700	45,761.00	0.06
387	601658	邮储银行	10,000	45,700.00	0.06
388	002387	维信诺	3,200	45,696.00	0.06
389	000686	东北证券	5,400	45,630.00	0.06
390	000581	威孚高科	2,200	45,496.00	0.06
391	600674	川投能源	4,900	45,423.00	0.06
392	300002	神州泰岳	7,300	45,187.00	0.06
393	002382	蓝帆医疗	1,500	45,165.00	0.06
394	002028	思源电气	2,200	45,012.00	0.06
395	000997	新大陆	2,800	44,744.00	0.06
396	600511	国药股份	1,100	44,737.00	0.06
397	002242	九阳股份	1,200	44,724.00	0.05
398	600460	士兰微	3,000	44,040.00	0.05
399	300001	特锐德	2,100	43,974.00	0.05
400	000999	华润三九	1,500	43,785.00	0.05

401	600325	华发股份	6,200	43,772.00	0.05
402	600779	水井坊	700	43,694.00	0.05
403	300251	光线传媒	4,000	43,640.00	0.05
404	002508	老板电器	1,400	43,554.00	0.05
405	600827	百联股份	3,000	43,350.00	0.05
406	600418	江淮汽车	4,900	43,267.00	0.05
407	600528	中铁工业	4,900	43,218.00	0.05
408	600446	金证股份	2,200	42,680.00	0.05
409	002268	卫士通	2,000	42,680.00	0.05
410	300244	迪安诊断	1,200	42,360.00	0.05
411	601021	春秋航空	1,200	42,288.00	0.05
412	002375	亚厦股份	4,100	41,902.00	0.05
413	600598	北大荒	2,600	41,860.00	0.05
414	601689	拓普集团	1,500	41,850.00	0.05
415	600733	北汽蓝谷	6,500	41,795.00	0.05
416	002958	青农商行	9,400	41,642.00	0.05
417	600027	华电国际	12,100	41,382.00	0.05
418	600959	江苏有线	11,000	41,360.00	0.05
419	002317	众生药业	2,400	41,184.00	0.05
420	300115	长盈精密	1,800	41,130.00	0.05
421	600038	中直股份	1,000	41,070.00	0.05
422	300166	东方国信	3,300	40,953.00	0.05
423	000564	供销大集	9,100	40,859.00	0.05
424	603000	人民网	2,058	40,810.14	0.05
425	603866	桃李面包	800	40,712.00	0.05
426	601168	西部矿业	7,000	40,600.00	0.05
427	600260	凯乐科技	3,000	40,560.00	0.05
428	600256	广汇能源	15,000	40,500.00	0.05
429	603156	养元饮品	1,880	40,420.00	0.05
430	000878	云南铜业	3,800	40,318.00	0.05
431	002080	中材科技	2,600	40,300.00	0.05
432	603883	老百姓	400	40,016.00	0.05
433	603806	福斯特	800	39,928.00	0.05
434	002124	天邦股份	3,100	39,835.00	0.05
435	000627	天茂集团	7,600	39,596.00	0.05
436	600820	隧道股份	7,000	39,550.00	0.05
437	002281	光迅科技	1,200	39,432.00	0.05
438	002081	金螳螂	5,000	39,300.00	0.05
439	600704	物产中大	9,300	39,153.00	0.05
440	002396	星网锐捷	1,100	38,863.00	0.05
441	600839	四川长虹	13,500	38,745.00	0.05
442	600673	东阳光	5,600	38,696.00	0.05

443	000671	阳光城	6,100	38,674.00	0.05
444	600497	驰宏锌锗	11,200	38,528.00	0.05
445	002558	巨人网络	2,200	38,280.00	0.05
446	300296	利亚德	6,300	38,241.00	0.05
447	600572	康恩贝	6,900	37,950.00	0.05
448	600008	首创股份	12,600	37,926.00	0.05
449	600549	厦门钨业	3,200	37,888.00	0.05
450	600482	中国动力	2,400	37,680.00	0.05
451	000800	一汽解放	3,500	37,590.00	0.05
452	601992	金隅集团	12,200	37,332.00	0.05
453	600583	海油工程	8,200	37,310.00	0.05
454	002709	天赐材料	1,100	37,169.00	0.05
455	000729	燕京啤酒	5,400	36,990.00	0.05
456	600718	东软集团	3,200	36,800.00	0.05
457	601179	中国西电	7,600	36,784.00	0.05
458	600977	中国电影	2,800	36,764.00	0.05
459	002670	国盛金控	4,000	36,600.00	0.05
460	000158	常山北明	3,500	36,540.00	0.05
461	600859	王府井	800	36,440.00	0.05
462	000877	天山股份	2,400	36,240.00	0.05
463	002468	申通快递	2,200	36,102.00	0.04
464	603605	珀莱雅	200	36,004.00	0.04
465	002056	横店东磁	3,200	36,000.00	0.04
466	600171	上海贝岭	2,063	35,854.94	0.04
467	002831	裕同科技	1,300	35,763.00	0.04
468	002294	信立泰	1,200	35,592.00	0.04
469	600862	中航高科	2,100	35,532.00	0.04
470	600021	上海电力	4,800	35,520.00	0.04
471	600875	东方电气	4,000	35,400.00	0.04
472	000060	中金岭南	9,500	35,340.00	0.04
473	300026	红日药业	6,400	35,328.00	0.04
474	600060	海信视像	2,900	35,235.00	0.04
475	600881	亚泰集团	12,100	35,211.00	0.04
476	002217	合力泰	6,700	35,175.00	0.04
477	002221	东华能源	4,000	35,160.00	0.04
478	600567	山鹰纸业	11,900	35,105.00	0.04
479	601633	长城汽车	4,500	34,740.00	0.04
480	000090	天健集团	5,000	34,550.00	0.04
481	603712	七一二	900	34,542.00	0.04
482	603228	景旺电子	980	34,486.20	0.04
483	600160	巨化股份	5,000	34,450.00	0.04
484	600597	光明乳业	2,300	34,178.00	0.04

485	600094	大名城	5,700	33,915.00	0.04
486	002429	兆驰股份	6,800	33,660.00	0.04
487	300474	景嘉微	500	33,650.00	0.04
488	002458	益生股份	2,200	33,594.00	0.04
489	002939	长城证券	2,700	33,264.00	0.04
490	002818	富森美	2,700	33,210.00	0.04
491	000709	河钢股份	16,200	33,048.00	0.04
492	600026	中远海能	5,100	32,946.00	0.04
493	600580	卧龙电驱	2,900	32,596.00	0.04
494	000629	攀钢钒钛	16,200	32,562.00	0.04
495	002233	塔牌集团	2,700	32,481.00	0.04
496	600273	嘉化能源	3,700	32,338.00	0.04
497	601966	玲珑轮胎	1,600	32,320.00	0.04
498	000970	中科三环	3,300	32,274.00	0.04
499	600967	内蒙一机	3,100	32,209.00	0.04
500	601005	重庆钢铁	21,500	32,035.00	0.04
501	300133	华策影视	4,400	31,900.00	0.04
502	002004	华邦健康	5,900	31,742.00	0.04
503	600392	盛和资源	4,500	31,725.00	0.04
504	000960	锡业股份	3,700	31,672.00	0.04
505	600282	南钢股份	9,800	31,654.00	0.04
506	601916	浙商银行	8,000	31,520.00	0.04
507	603816	顾家家居	700	31,507.00	0.04
508	601216	君正集团	12,400	31,496.00	0.04
509	600039	四川路桥	8,200	31,324.00	0.04
510	000598	兴蓉环境	6,800	31,280.00	0.04
511	000778	新兴铸管	9,100	31,213.00	0.04
512	300182	捷成股份	7,800	31,122.00	0.04
513	002085	万丰奥威	4,800	31,104.00	0.04
514	600064	南京高科	3,200	31,104.00	0.04
515	600645	中源协和	1,100	31,075.00	0.04
516	600755	厦门国贸	4,700	31,020.00	0.04
517	002648	卫星石化	1,900	30,913.00	0.04
518	600563	法拉电子	500	30,900.00	0.04
519	603568	伟明环保	1,330	30,856.00	0.04
520	600195	中牧股份	1,900	30,837.00	0.04
521	600466	蓝光发展	5,700	30,723.00	0.04
522	000690	宝新能源	6,500	30,680.00	0.04
523	601238	广汽集团	3,400	30,600.00	0.04
524	600566	济川药业	1,200	30,552.00	0.04
525	002183	怡亚通	5,700	30,552.00	0.04
526	600754	锦江酒店	1,100	30,525.00	0.04

527	300113	顺网科技	1,200	30,480.00	0.04
528	000400	许继电气	2,300	30,360.00	0.04
529	601975	招商南油	12,700	30,353.00	0.04
530	600737	中粮糖业	3,900	30,342.00	0.04
531	002191	劲嘉股份	3,400	30,294.00	0.04
532	601577	长沙银行	3,800	30,172.00	0.04
533	601118	海南橡胶	6,200	30,132.00	0.04
534	002399	海普瑞	1,200	30,048.00	0.04
535	000402	金融街	4,500	29,880.00	0.04
536	002635	安洁科技	1,200	29,880.00	0.04
537	000681	视觉中国	1,600	29,792.00	0.04
538	600188	兖州煤业	3,400	29,784.00	0.04
539	000723	美锦能源	4,700	29,422.00	0.04
540	002506	协鑫集成	11,200	29,232.00	0.04
541	600166	福田汽车	16,200	29,160.00	0.04
542	002945	华林证券	2,100	29,001.00	0.04
543	000983	西山煤电	7,720	28,950.00	0.04
544	000039	中集集团	4,000	28,920.00	0.04
545	601808	中海油服	2,200	28,908.00	0.04
546	000967	盈峰环境	3,500	28,875.00	0.04
547	600435	北方导航	3,800	28,728.00	0.04
548	000930	中粮科技	4,200	28,686.00	0.04
549	000738	航发控制	2,100	28,665.00	0.04
550	300324	旋极信息	4,300	28,638.00	0.04
551	002110	三钢闽光	4,300	28,638.00	0.04
552	601098	中南传媒	2,700	28,566.00	0.04
553	601106	中国一重	10,100	28,381.00	0.04
554	600633	浙数文化	2,900	28,362.00	0.04
555	000830	鲁西化工	3,800	28,348.00	0.04
556	000089	深圳机场	3,700	28,342.00	0.04
557	601860	紫金银行	6,700	28,341.00	0.04
558	600056	中国医药	2,000	28,300.00	0.04
559	600373	中文传媒	2,400	28,272.00	0.04
560	300180	华峰超纤	3,300	28,248.00	0.04
561	002038	双鹭药业	2,200	28,182.00	0.04
562	600388	龙净环保	3,200	28,160.00	0.04
563	600376	首开股份	4,800	28,128.00	0.04
564	600808	马钢股份	10,900	28,122.00	0.04
565	600729	重庆百货	900	28,098.00	0.03
566	000415	渤海租赁	9,400	28,012.00	0.03
567	600398	海澜之家	4,800	27,936.00	0.03
568	600649	城投控股	4,700	27,918.00	0.03

569	002807	江阴银行	7,100	27,903.00	0.03
570	601333	广深铁路	12,400	27,900.00	0.03
571	000825	太钢不锈	8,400	27,888.00	0.03
572	600643	爱建集团	3,500	27,825.00	0.03
573	000563	陕国投 A	7,500	27,825.00	0.03
574	600258	首旅酒店	1,800	27,666.00	0.03
575	002407	多氟多	2,600	27,664.00	0.03
576	000025	特力 A	1,500	27,495.00	0.03
577	600120	浙江东方	4,000	27,480.00	0.03
578	600675	中华企业	6,700	27,269.00	0.03
579	603486	科沃斯	900	27,189.00	0.03
580	601236	红塔证券	1,400	27,160.00	0.03
581	000012	南玻 A	5,400	27,108.00	0.03
582	002064	华峰氨纶	5,300	26,871.00	0.03
583	601866	中远海发	14,600	26,864.00	0.03
584	002372	伟星新材	2,300	26,749.00	0.03
585	000501	鄂武商 A	1,700	26,656.00	0.03
586	002010	传化智联	4,900	26,656.00	0.03
587	002583	海能达	3,500	26,565.00	0.03
588	601718	际华集团	8,000	26,560.00	0.03
589	000883	湖北能源	7,500	26,400.00	0.03
590	000078	海王生物	6,300	26,397.00	0.03
591	002092	中泰化学	5,800	26,274.00	0.03
592	002203	海亮股份	3,000	26,250.00	0.03
593	000685	中山公用	3,400	26,180.00	0.03
594	000062	深圳华强	1,800	26,172.00	0.03
595	000932	华菱钢铁	6,900	26,013.00	0.03
596	600022	山东钢铁	20,100	25,929.00	0.03
597	002839	张家港行	4,500	25,920.00	0.03
598	603077	和邦生物	19,600	25,872.00	0.03
599	601898	中煤能源	6,800	25,840.00	0.03
600	600500	中化国际	5,100	25,806.00	0.03
601	600928	西安银行	4,900	25,774.00	0.03
602	600776	东方通信	1,700	25,653.00	0.03
603	000559	万向钱潮	5,300	25,652.00	0.03
604	000027	深圳能源	5,520	25,612.80	0.03
605	000519	中兵红箭	2,700	25,434.00	0.03
606	000959	首钢股份	5,900	25,370.00	0.03
607	600372	中航电子	1,900	25,308.00	0.03
608	000807	云铝股份	5,800	25,288.00	0.03
609	600316	洪都航空	1,600	25,280.00	0.03
610	600989	宝丰能源	3,000	25,260.00	0.03

611	600266	城建发展	4,980	25,248.60	0.03
612	002155	湖南黄金	3,200	25,216.00	0.03
613	601698	中国卫通	1,400	25,214.00	0.03
614	000488	晨鸣纸业	5,100	25,194.00	0.03
615	600062	华润双鹤	1,900	25,118.00	0.03
616	000301	东方盛虹	4,500	25,020.00	0.03
617	600025	华能水电	6,600	25,014.00	0.03
618	000031	大悦城	4,900	24,941.00	0.03
619	002048	宁波华翔	1,600	24,704.00	0.03
620	002440	闰土股份	2,700	24,678.00	0.03
621	002745	木林森	1,600	24,656.00	0.03
622	601699	潞安环能	4,400	24,508.00	0.03
623	000987	越秀金控	2,100	24,486.00	0.03
624	600515	海航基础	4,700	24,440.00	0.03
625	601000	唐山港	10,900	24,307.00	0.03
626	002815	崇达技术	1,200	24,276.00	0.03
627	000528	柳工	3,800	23,978.00	0.03
628	002625	光启技术	3,300	23,925.00	0.03
629	002901	大博医疗	200	23,858.00	0.03
630	600073	上海梅林	2,500	23,725.00	0.03
631	600782	新钢股份	5,800	23,664.00	0.03
632	601615	明阳智能	1,900	23,655.00	0.03
633	600908	无锡银行	4,800	23,568.00	0.03
634	002936	郑州银行	6,850	23,564.00	0.03
635	002640	跨境通	3,600	23,364.00	0.03
636	600777	新潮能源	15,100	22,952.00	0.03
637	002390	信邦制药	5,000	22,800.00	0.03
638	000156	华数传媒	2,100	22,743.00	0.03
639	300072	三聚环保	5,300	22,684.00	0.03
640	002701	奥瑞金	5,400	22,626.00	0.03
641	002424	贵州百灵	2,700	22,410.00	0.03
642	601717	郑煤机	3,800	22,382.00	0.03
643	600312	平高电气	3,000	22,260.00	0.03
644	601958	金钼股份	3,600	22,248.00	0.03
645	000758	中色股份	5,300	22,154.00	0.03
646	000898	鞍钢股份	9,000	22,050.00	0.03
647	600291	西水股份	2,436	22,045.80	0.03
648	000887	中鼎股份	2,800	21,980.00	0.03
649	600640	号百控股	1,100	21,945.00	0.03
650	002563	森马服饰	3,100	21,855.00	0.03
651	600138	中青旅	2,200	21,714.00	0.03
652	000813	德展健康	3,500	21,700.00	0.03

653	002434	万里扬	2,500	21,700.00	0.03
654	601608	中信重工	6,300	21,546.00	0.03
655	000046	泛海控股	5,700	21,489.00	0.03
656	000008	神州高铁	7,300	21,462.00	0.03
657	600409	三友化工	4,600	21,436.00	0.03
658	002595	豪迈科技	1,100	21,406.00	0.03
659	300459	金科文化	6,200	21,390.00	0.03
660	002444	巨星科技	1,800	21,384.00	0.03
661	002244	滨江集团	5,000	21,350.00	0.03
662	600259	广晟有色	700	21,000.00	0.03
663	601228	广州港	6,900	20,976.00	0.03
664	002002	鸿达兴业	5,800	20,938.00	0.03
665	002266	浙富控股	5,400	20,898.00	0.03
666	600557	康缘药业	1,500	20,880.00	0.03
667	600507	方大特钢	4,000	20,760.00	0.03
668	600863	内蒙华电	8,400	20,664.00	0.03
669	000708	中信特钢	1,200	20,508.00	0.03
670	002505	大康农业	9,100	20,475.00	0.03
671	600158	中体产业	2,500	20,450.00	0.03
672	600765	中航重机	2,000	20,440.00	0.03
673	600751	海航科技	6,500	20,345.00	0.03
674	601077	渝农商行	4,300	20,296.00	0.03
675	600970	中材国际	3,800	20,064.00	0.02
676	000826	启迪环境	2,700	20,034.00	0.02
677	600545	卓郎智能	4,200	19,866.00	0.02
678	002249	大洋电机	5,500	19,855.00	0.02
679	600478	科力远	4,200	19,782.00	0.02
680	603198	迎驾贡酒	900	19,593.00	0.02
681	000712	锦龙股份	1,552	19,400.00	0.02
682	000061	农产品	2,600	19,266.00	0.02
683	601200	上海环境	1,600	19,200.00	0.02
684	600717	天津港	4,340	19,182.80	0.02
685	002423	中粮资本	2,200	19,140.00	0.02
686	603885	吉祥航空	2,100	19,110.00	0.02
687	002946	新乳业	1,100	19,085.00	0.02
688	601928	凤凰传媒	2,800	19,040.00	0.02
689	600125	铁龙物流	3,400	18,972.00	0.02
690	000732	泰禾集团	3,700	18,833.00	0.02
691	002665	首航高科	7,700	18,788.00	0.02
692	600823	世茂股份	4,200	18,774.00	0.02
693	601598	中国外运	5,800	18,734.00	0.02
694	600835	上海机电	1,100	18,623.00	0.02

695	600348	阳泉煤业	4,400	18,568.00	0.02
696	601880	大连港	10,700	18,404.00	0.02
697	600648	外高桥	1,300	18,382.00	0.02
698	002589	瑞康医药	3,400	18,224.00	0.02
699	600307	酒钢宏兴	11,700	18,018.00	0.02
700	601611	中国核建	2,900	17,922.00	0.02
701	000718	苏宁环球	5,800	17,922.00	0.02
702	603888	新华网	800	17,888.00	0.02
703	600582	天地科技	6,100	17,873.00	0.02
704	000990	诚志股份	1,400	17,766.00	0.02
705	600901	江苏租赁	3,400	17,714.00	0.02
706	600639	浦东金桥	1,100	17,578.00	0.02
707	000717	韶钢松山	4,600	17,480.00	0.02
708	001872	招商港口	1,200	17,460.00	0.02
709	600329	中新药业	1,000	17,320.00	0.02
710	000543	皖能电力	4,300	17,286.00	0.02
711	600664	哈药股份	5,600	17,248.00	0.02
712	600968	海油发展	7,400	17,242.00	0.02
713	603983	丸美股份	200	17,206.00	0.02
714	000848	承德露露	2,450	17,150.00	0.02
715	600141	兴发集团	1,900	17,005.00	0.02
716	601678	滨化股份	4,000	16,960.00	0.02
717	600748	上实发展	3,300	16,863.00	0.02
718	300134	大富科技	1,200	16,776.00	0.02
719	002408	齐翔腾达	2,700	16,767.00	0.02
720	600017	日照港	6,700	16,683.00	0.02
721	300376	易事特	3,200	16,640.00	0.02
722	600277	亿利洁能	5,100	16,626.00	0.02
723	603377	东方时尚	1,000	16,560.00	0.02
724	603515	欧普照明	600	16,422.00	0.02
725	600869	智慧能源	4,100	16,400.00	0.02
726	603650	彤程新材	700	16,289.00	0.02
727	002948	青岛银行	3,200	16,288.00	0.02
728	601828	美凯龙	1,500	15,885.00	0.02
729	002416	爱施德	2,200	15,796.00	0.02
730	002544	杰赛科技	1,200	15,780.00	0.02
731	300257	开山股份	1,200	15,684.00	0.02
732	002941	新疆交建	1,100	15,565.00	0.02
733	002128	露天煤业	2,000	15,500.00	0.02
734	601869	长飞光纤	500	15,405.00	0.02
735	002302	西部建设	1,600	15,360.00	0.02
736	600565	迪马股份	5,500	15,345.00	0.02

737	000537	广宇发展	2,100	15,330.00	0.02
738	603786	科博达	200	15,070.00	0.02
739	600053	九鼎投资	500	14,920.00	0.02
740	002491	通鼎互联	2,900	14,848.00	0.02
741	603766	隆鑫通用	3,800	14,706.00	0.02
742	600787	中储股份	3,300	14,487.00	0.02
743	000553	安道麦 A	1,600	14,432.00	0.02
744	600694	大商股份	600	14,394.00	0.02
745	601019	山东出版	2,300	14,375.00	0.02
746	002957	科瑞技术	600	14,340.00	0.02
747	601298	青岛港	2,500	14,200.00	0.02
748	002093	国脉科技	1,600	14,160.00	0.02
749	600350	山东高速	2,300	14,122.00	0.02
750	300197	铁汉生态	5,500	13,970.00	0.02
751	600770	综艺股份	2,900	13,920.00	0.02
752	601212	白银有色	5,400	13,770.00	0.02
753	000600	建投能源	2,700	13,743.00	0.02
754	603260	合盛硅业	500	13,670.00	0.02
755	601139	深圳燃气	2,100	13,650.00	0.02
756	600339	中油工程	6,000	13,620.00	0.02
757	603328	依顿电子	1,300	13,559.00	0.02
758	603056	德邦股份	1,000	13,530.00	0.02
759	600299	安迪苏	1,100	13,442.00	0.02
760	002419	天虹股份	1,400	13,370.00	0.02
761	600657	信达地产	3,200	13,184.00	0.02
762	601016	节能风电	6,100	12,932.00	0.02
763	002118	紫鑫药业	2,900	12,876.00	0.02
764	002470	*ST 金正	5,600	12,712.00	0.02
765	600006	东风汽车	3,100	12,493.00	0.02
766	600707	彩虹股份	2,700	12,312.00	0.02
767	601801	皖新传媒	2,200	12,232.00	0.02
768	600575	淮河能源	5,800	12,122.00	0.02
769	600428	中远海特	3,900	12,012.00	0.01
770	600338	西藏珠峰	1,200	12,000.00	0.01
771	002503	搜于特	4,200	11,802.00	0.01
772	000937	冀中能源	3,900	11,778.00	0.01
773	002285	世联行	4,200	11,718.00	0.01
774	600757	长江传媒	2,300	11,707.00	0.01
775	600985	淮北矿业	1,500	11,685.00	0.01
776	601865	福莱特	600	11,280.00	0.01
777	002051	中工国际	1,500	10,920.00	0.01
778	600623	华谊集团	2,100	10,836.00	0.01

779	600996	贵广网络	1,500	10,695.00	0.01
780	600874	创业环保	1,600	10,624.00	0.01
781	603556	海兴电力	700	10,108.00	0.01
782	603868	飞科电器	200	9,866.00	0.01
783	000785	居然之家	1,200	9,504.00	0.01
784	600058	五矿发展	1,400	8,456.00	0.01
785	601003	柳钢股份	1,900	8,417.00	0.01
786	601127	小康股份	1,000	8,310.00	0.01
787	601512	中新集团	700	8,050.00	0.01
788	600903	贵州燃气	800	7,872.00	0.01
789	603355	莱克电气	300	7,467.00	0.01
790	603225	新风鸣	700	6,986.00	0.01
791	600335	国机汽车	1,500	6,930.00	0.01
792	601969	海南矿业	1,400	6,832.00	0.01
793	603317	天味食品	120	6,669.60	0.01
794	603379	三美股份	300	6,441.00	0.01
795	601811	新华文轩	600	6,102.00	0.01
796	603025	大豪科技	700	5,089.00	0.01
797	600917	重庆燃气	700	4,998.00	0.01
798	603256	宏和科技	400	4,576.00	0.01
799	601068	中铝国际	1,100	4,301.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603087	甘李药业	408	40,922.40	0.05
2	600763	通策医疗	100	16,677.00	0.02
3	002049	紫光国微	200	14,550.00	0.02
4	600956	新天绿能	2,026	10,211.04	0.01
5	600536	中国软件	100	7,920.00	0.01
6	300529	健帆生物	110	7,645.00	0.01
7	002812	恩捷股份	100	6,580.00	0.01
8	300308	中际旭创	100	6,300.00	0.01
9	600584	长电科技	200	6,254.00	0.01
10	000423	东阿阿胶	100	3,581.00	0.00
11	002180	纳思达	100	3,291.00	0.00
12	002384	东山精密	100	2,995.00	0.00
13	600100	同方股份	400	2,916.00	0.00
14	300383	光环新网	100	2,607.00	0.00
15	600663	陆家嘴	204	2,286.84	0.00
16	603877	太平鸟	138	1,959.60	0.00
17	600150	中国船舶	100	1,744.00	0.00

18	002672	东江环保	100	901.00	0.00
19	300159	新研股份	200	782.00	0.00
20	000426	兴业矿业	100	688.00	0.00
21	000006	深振业 A	100	681.00	0.00
22	002411	延安必康	100	676.00	0.00
23	601872	招商轮船	100	583.00	0.00
24	300199	翰宇药业	100	556.00	0.00
25	600098	广州发展	100	549.00	0.00
26	002573	清新环境	100	546.00	0.00
27	002358	森源电气	100	499.00	0.00
28	000766	通化金马	100	482.00	0.00
29	002366	台海核电	100	423.00	0.00
30	600499	科达制造	100	412.00	0.00
31	300297	蓝盾股份	100	401.00	0.00
32	601001	大同煤业	100	392.00	0.00
33	300027	华谊兄弟	100	367.00	0.00
34	600939	重庆建工	100	359.00	0.00
35	600023	浙能电力	100	351.00	0.00
36	002482	广田集团	100	335.00	0.00
37	002437	誉衡药业	100	323.00	0.00
38	000761	本钢板材	100	320.00	0.00
39	000413	东旭光电	100	267.00	0.00
40	601326	秦港股份	100	251.00	0.00
41	600317	营口港	100	221.00	0.00
42	600759	洲际油气	100	186.00	0.00
43	000980	*ST 众泰	100	153.00	0.00
44	002280	*ST 联络	100	144.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	13,937,145.00	17.35
2	600519	贵州茅台	13,508,152.60	16.81
3	600036	招商银行	6,269,670.06	7.80
4	600276	恒瑞医药	5,348,900.60	6.66
5	000858	五粮液	5,102,816.00	6.35
6	000333	美的集团	4,995,429.10	6.22
7	000651	格力电器	4,885,136.00	6.08
8	601166	兴业银行	4,153,662.00	5.17
9	600030	中信证券	3,492,457.00	4.35
10	600887	伊利股份	3,128,590.20	3.89
11	000002	万科 A	2,814,877.93	3.50

12	600900	长江电力	2,661,082.65	3.31
13	002475	立讯精密	2,592,795.93	3.23
14	600016	民生银行	2,539,464.00	3.16
15	601328	交通银行	2,506,571.00	3.12
16	601288	农业银行	2,306,538.00	2.87
17	000001	平安银行	2,294,212.00	2.86
18	601398	工商银行	2,264,126.00	2.82
19	603288	海天味业	2,244,907.23	2.79
20	600000	浦发银行	2,158,296.99	2.69
21	600585	海螺水泥	2,090,524.19	2.60
22	600031	三一重工	2,047,960.49	2.55
23	600048	保利地产	1,950,499.00	2.43
24	002415	海康威视	1,926,759.73	2.40
25	601668	中国建筑	1,896,568.00	2.36
26	300498	温氏股份	1,828,561.00	2.28
27	600837	海通证券	1,791,094.00	2.23
28	601888	中国中免	1,789,855.00	2.23
29	002714	牧原股份	1,743,749.63	2.17
30	000063	中兴通讯	1,721,830.00	2.14
31	000725	京东方 A	1,704,445.00	2.12
32	300059	东方财富	1,644,081.00	2.05

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	4,168,087.00	5.19
2	000333	美的集团	3,951,087.00	4.92
3	000651	格力电器	3,863,150.00	4.81
4	002475	立讯精密	2,222,605.00	2.77
5	000002	万科 A	2,189,537.00	2.73
6	000001	平安银行	1,782,167.00	2.22
7	002415	海康威视	1,475,535.00	1.84
8	002714	牧原股份	1,423,367.00	1.77
9	000725	京东方 A	1,377,948.00	1.72
10	300498	温氏股份	1,370,314.00	1.71
11	300059	东方财富	1,368,361.10	1.70
12	000661	长春高新	1,340,841.00	1.67
13	000063	中兴通讯	1,261,274.00	1.57
14	002555	三七互娱	1,196,976.00	1.49
15	002142	宁波银行	1,098,955.00	1.37
16	000100	TCL 科技	1,036,457.00	1.29

17	002001	新和成	1,035,003.00	1.29
18	300015	爱尔眼科	952,075.00	1.19
19	002594	比亚迪	926,153.00	1.15
20	000338	潍柴动力	901,577.00	1.12

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	330,420,214.15
卖出股票收入（成交）总额	128,127,120.73

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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）	1,329.80	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,329.80	0.00

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	113583	益丰转债	10	1,329.80	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

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

无。

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	IF2007	2	2,470,800.00	105,360.00	-
IC2007	IC2007	2	2,319,760.00	73,920.00	-
公允价值变动总额合计(元)					179,280.00
股指期货投资本期收益(元)					313,514.56
股指期货投资本期公允价值变动(元)					179,280.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。由于中证 800 指数为沪深 300 指数和中证 500 指数的并集，因此，基金留存了部分现金头寸投资了沪深 300 和中证 500 股指期货。以便于更有效地进行流动性管理，更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

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	843,076.11

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,812.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	845,888.19

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,114	35,552.38	606,000.00	0.81	74,551,721.00	99.19

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	袁丽	1,000,000.00	1.33
2	周振斗	1,000,000.00	1.33
3	周蕾	1,000,000.00	1.33

4	高建隆	909,700.00	1.21
5	李亨堃	845,800.00	1.13
6	杨德鸣	500,000.00	0.67
7	胡雯	500,000.00	0.67
8	何宁	500,000.00	0.67
9	姚忠东	500,000.00	0.67
10	中山凯沃能暖通空调有限公司	500,000.00	0.67
11	王萍	500,000.00	0.67

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月17日） 基金份额总额	321,157,721.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	246,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	75,157,721.00

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
华创证券	2	236,757,921.55	51.64%	220,503.55	52.18%	-
长江证券	1	190,672,834.01	41.59%	173,681.45	41.10%	-
中金公司	4	26,908,845.09	5.87%	24,520.35	5.80%	-
天风证券	1	4,162,256.99	0.91%	3,876.50	0.92%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度

保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人；

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

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
华创证券	18,354.13	48.14%	-	-	-	-
长江证券	-	-	480,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	1,000.00	2.62%	-	-	-	-
天风证券	18,774.02	49.24%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-20
2	建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	指定报刊和/或公司网站	2020-05-20
3	建信基金管理有限责任公司关于旗下建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金投资重大关联方证券的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-07
4	建信基金管理有限责任公司关于调整建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-28

5	关于建信上证社会责任 ETF 等多只基金增加扩位证券简称的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-13
---	---------------------------------	-------------	------------

§ 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

无。

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

- 1、中国证监会批准建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 28 日