

# 建信中证 800 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 4 月 17 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
9.4 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 .....	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4 基金投资策略的改变 .....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8 其他重大事件 .....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>77</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	78
13.3 查阅方式 .....	78

## § 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	18,157,721.00 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	17,347,402.04
本期利润	19,683,753.91
加权平均基金份额本期利润	0.2203
本期加权平均净值利润率	20.80%
本期基金份额净值增长率	30.15%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	5,473,773.69
期末可供分配基金份额利润	0.3015
期末基金资产净值	23,631,494.69
期末基金份额净值	1.3015
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	30.15%

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。

4、本基金基金合同于 2020 年 4 月 17 日生效，截至报告期末未满一年。

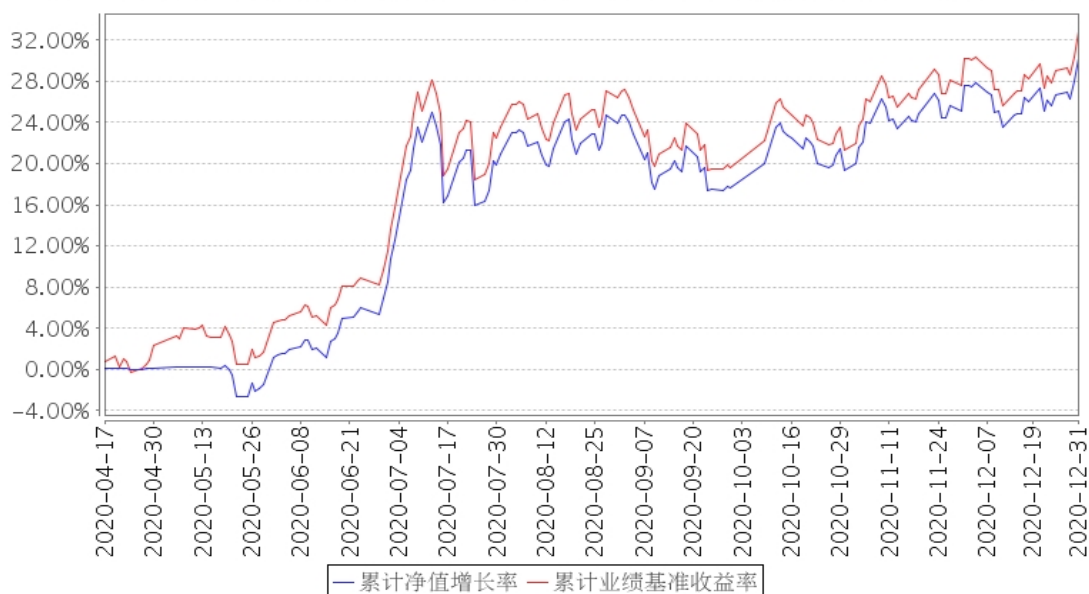
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	10.69%	0.98%	11.00%	1.01%	-0.31%	-0.03%
过去六个月	21.76%	1.32%	21.02%	1.35%	0.74%	-0.03%
自基金合同生效起至今	30.15%	1.18%	32.76%	1.23%	-2.61%	-0.05%

#### 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

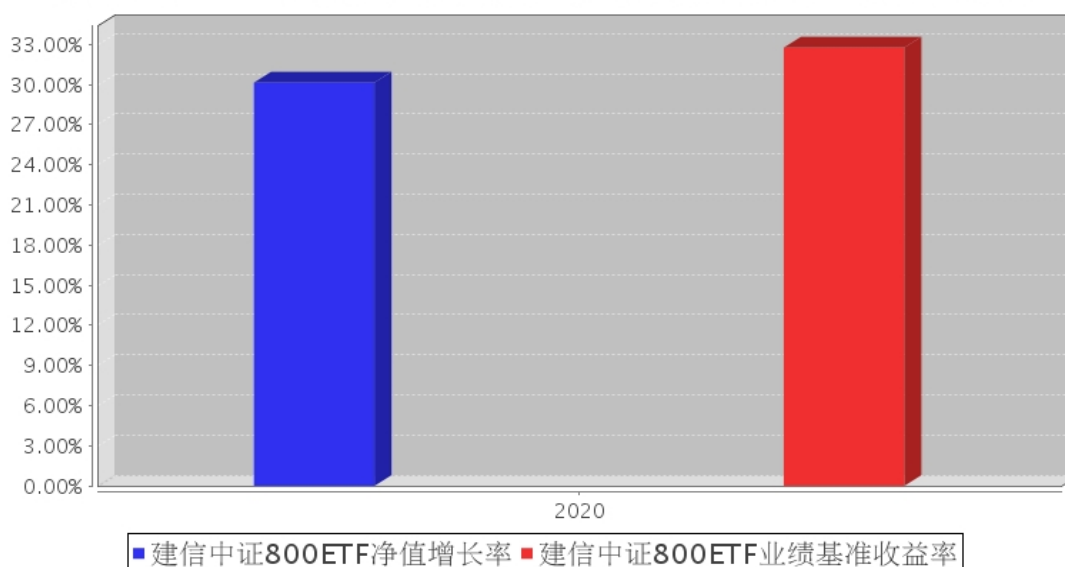
建信中证800ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2020 年 4 月 17 日生效，截至报告期末未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

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

建信中证800ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于2020年4月17日生效，自合同生效以来，本基金未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业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、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债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、建信稳定得利债券型证券投资基金、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、建信多因子量化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、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金 (LOF)、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 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、建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)、建信周盈安心理财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、建信裕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、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债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、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、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、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、建信安心回报 6 个月定期开放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、建信瑞福添利混合型证券投资基金、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、建信收益增强债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报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、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、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发起式联接基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、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、建信恒安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、建信高端医疗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、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣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、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、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、建信利率债策略纯债债券型证券投资基金共计 131 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4655.29 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	-	8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；2021年2月18日起任建信中证细分有色金属产业主题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。

## 4.2 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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 公平交易制度和控制方法

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。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

### 4.3.3 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 5 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

本基金为被动指数基金，跟踪的标的指数为中证 800 指数（000906.SH）。中证 800 指数由沪深 300 和中证 500 的成分股合并组成，综合反映 A 股市场大中型股票的整体表现。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。基金上市后遭遇了大比例的赎回，给基金的安全运作带来了较大的挑战，但在管理人的悉心运作下没有发生任何风险事故。从标的指数成分股的行业分布来看（以申万一级行业分类为标准，截止到 2020 年末），权重最大

的行业是非银金融、食品饮料、医药生物、银行、电子，权重分别为 12.04%、11.75%、9.91%、9.82%、8.82%，整体而言分布较为均衡。基金在构建组合时采用完全复制法，即以标的指数中各成分股的权重为主要依据确定组合的持仓结构。此外，本年度标的指数经历了两次成分股调整，管理人较好地采取了应对措施，在保证基金安全运作的前提下也较好的控制了跟踪误差。

#### 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 30.15%，波动率 1.18%，业绩比较基准收益率 32.76%，波动率 1.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年新冠疫情爆发后，欧美日等发达国家实施了大规模的货币和信用扩张，随着疫情的逐步缓解和接种疫苗人数的增多，全球经济有望在 2021 年进入上行周期。全球经济的回升将会使得中国出口增速保持高位，同时叠加价格水平的提升将会推动中国企业盈利进一步上行。在这样的背景下，权益市场的表现可能也比较值得期待。本管理人将依据基金合同，采用被动复制的策略，在保障基金安全运作的前提下将跟踪误差控制在较低水平。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门

自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

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

本报告期内，自 2020 年 8 月 6 日至 2020 年 12 月 31 日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续 20 个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

## § 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61490173_A124 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，</p>



	<p>在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	贺耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2021 年 03 月 22 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	946,801.66
结算备付金		29,288.24
存出保证金		135,429.72
交易性金融资产	7.4.7.2	22,636,243.27
其中：股票投资		22,636,243.27
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,316.35
应收利息	7.4.7.5	359.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		23,749,438.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-

应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,203.54
应付托管费		1,067.88
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	71,331.69
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	42,340.55
负债合计		117,943.66
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	18,157,721.00
未分配利润	7.4.7.10	5,473,773.69
所有者权益合计		23,631,494.69
负债和所有者权益总计		23,749,438.35

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3015 元，基金份额总额 18,157,721.00 份。

2、本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 12 月 31 日止期间。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入		20,647,548.22
1. 利息收入		416,252.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	332,539.20
债券利息收入		3.68
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）		17,493,826.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,910,505.73
基金投资收益	-	-

债券投资收益	7.4.7.13	6,234.67
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	1,188,091.16
股利收益	7.4.7.16	1,388,994.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,336,351.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	401,117.34
减：二、费用		963,794.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	101,482.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	33,827.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	740,893.21
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		4,553.86
7. 其他费用	7.4.7.20	83,036.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,683,753.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,683,753.91

### 7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	19,683,753.91	19,683,753.91
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）	-303,000,000.00	-14,209,980.22	-317,209,980.22
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	7,325,243.36	40,325,243.36
2. 基金赎回款	-336,000,000.00	-21,535,223.58	-357,535,223.58
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）	18,157,721.00	5,473,773.69	23,631,494.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴灵玲

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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“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]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。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 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，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 号核准，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》的有关规定，本基金的投资目标是在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期、稳健增值。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。本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2021 年 3 月 22 日批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本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 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具按如下原则确定公允价值并

进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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



#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率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；处置时其公允价值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。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基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。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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，本基金确定相关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。

(2) 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	946,801.66
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	946,801.66

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,299,891.40	22,636,243.27	2,336,351.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	20,299,891.40	22,636,243.27	2,336,351.87

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

应收活期存款利息	277.49
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	14.52
应收债券利息	-
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	67.10
合计	359.11

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	71,331.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	71,331.69

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	2,340.55
预提费用	40,000.00
合计	42,340.55

#### 7.4.7.9 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12月31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	33,000,000.00	33,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-336,000,000.00	-336,000,000.00
- 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	18,157,721.00	18,157,721.00

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，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 77,727.97 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，全部折算为基金份额归基金份额持有人所有。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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	17,347,402.04	2,336,351.87	19,683,753.91
本期基金份额交易产生的变动数	-10,376,686.62	-3,833,293.60	-14,209,980.22
其中：基金申购款	8,927,331.08	-1,602,087.72	7,325,243.36
基金赎回款	-19,304,017.70	-2,231,205.88	-21,535,223.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,970,715.42	-1,496,941.73	5,473,773.69

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日
活期存款利息收入	320,487.07
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	8,977.25
其他	3,074.88
合计	332,539.20

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,109,705.16

股票投资收益——赎回差价收入	6,800,800.57
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	14,910,505.73

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	181,617,934.75
减：卖出股票成本总额	173,508,229.59
买卖股票差价收入	8,109,705.16

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	357,535,223.58
减：现金支付赎回款总额	146,773,792.58
减：赎回股票成本总额	203,960,630.43
赎回差价收入	6,800,800.57

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	6,234.67

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	6,234.67

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,838.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,599.85
减：应收利息总额	3.83
买卖债券差价收入	6,234.67

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。



## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 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12月31日
股指期货投资收益	1,188,091.16

## 7.4.7.16 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12月31日
股票投资产生的股利收益	1,388,994.98
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	1,388,994.98

## 7.4.7.17 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12月31日
1. 交易性金融资产	2,336,351.87
股票投资	2,336,351.87
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	2,336,351.87

## 7.4.7.18 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12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	401,061.34
其他	56.00
合计	401,117.34

## 7.4.7.19 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12月31 日
交易所市场交易费用	740,893.21
银行间市场交易费用	-
合计	740,893.21

## 7.4.7.20 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12 月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,992.63
指数使用费	41,044.14
合计	83,036.77

## 7.4.7.21 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构

” )	
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
中金公司	47,691,123.27	8.65

###### 7.4.10.1.2 债券交易

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12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
中金公司	2,310.20	5.86

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

## 7.4.10.1.5 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12月31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	43,454.69	8.54	43,454.69	60.92

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月17日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	6,352.40

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。

## 7.4.10.2.2 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12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

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

## 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股未上市	4.59	5.46	2,400	11,016.00	13,104.00	-

注：上述可流通日取自截至审计报告日的上市公司相关公告。

## 7.4.12.2 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
300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项	3.23	2021年01月07日	3.40	1,900	9,770.08	6,137.00	-

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

## 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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。



#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	946,801.66	-	-	-	946,801.66
结算备付金	29,288.24	-	-	-	29,288.24
存出保证金	135,429.72	-	-	-	135,429.72
交易性金融资产	-	-	-	22,636,243.27	22,636,243.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,316.35	1,316.35
应收利息	-	-	-	359.11	359.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,111,519.62	-	-	22,637,918.73	23,749,438.35
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,203.54	3,203.54
应付托管费	-	-	-	1,067.88	1,067.88

应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	71,331.69	71,331.69
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	42,340.55	42,340.55
负债总计	-	-	117,943.66	117,943.66
利率敏感度缺口	1,111,519.62	-	-	22,519,975.07

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	22,636,243.27	95.79
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	22,636,243.27	95.79

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 22,630,106.27 元，属于第二层次的余额为人民币 6,137.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

###### 7.4.14.1.2.2 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。

## 7.4.14.1.2.3 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。

## 7.4.14.2 承诺事项

无。

## 7.4.14.3 其他事项

于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2020 年 10 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日。

2021 年 3 月 3 日，基金管理人发布《关于以通讯方式召开建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》通知基金份额持有人就《关于终止建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行投票表决，投票表决起止时间为 2021 年 3 月 11 日至 2021 年 4 月 5 日，本基金是否清算将取决于基金份额持有人大会的决议结果。

## 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	22,636,243.27	95.31
	其中：股票	22,636,243.27	95.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	976,089.90	4.11
8	其他各项资产	137,105.18	0.58
9	合计	23,749,438.35	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	260,168.00	1.10
B	采矿业	545,122.00	2.31
C	制造业	12,601,881.36	53.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	412,499.90	1.75
E	建筑业	344,685.00	1.46
F	批发和零售业	314,522.40	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	546,212.20	2.31
H	住宿和餐饮业	18,794.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	933,578.70	3.95
J	金融业	4,862,527.57	20.58
K	房地产业	654,767.90	2.77
L	租赁和商务服务业	368,147.80	1.56
M	科学研究和技术服务业	218,838.40	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	47,120.90	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,950.00	0.11
Q	卫生和社会工作	326,154.14	1.38
R	文化、体育和娱乐业	131,912.00	0.56
S	综合	24,361.00	0.10
	合计	22,636,243.27	95.79

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	9,700	843,706.00	3.57
2	600519	贵州茅台	400	799,200.00	3.38
3	000858	五粮液	1,700	496,145.00	2.10
4	000333	美的集团	4,400	433,136.00	1.83
5	600036	招商银行	8,913	391,726.35	1.66
6	600276	恒瑞医药	3,300	367,818.00	1.56
7	000651	格力电器	4,400	272,536.00	1.15
8	601166	兴业银行	13,000	271,310.00	1.15
9	600887	伊利股份	5,500	244,035.00	1.03
10	600030	中信证券	7,700	226,380.00	0.96
11	601888	中国中免	800	225,960.00	0.96
12	601012	隆基股份	2,400	221,280.00	0.94
13	002475	立讯精密	3,839	215,444.68	0.91
14	300059	东方财富	6,140	190,340.00	0.81
15	000002	万科A	6,100	175,070.00	0.74
16	002594	比亚迪	900	174,870.00	0.74
17	603288	海天味业	867	173,868.18	0.74
18	000001	平安银行	8,700	168,258.00	0.71
19	002415	海康威视	3,300	160,083.00	0.68
20	000568	泸州老窖	700	158,312.00	0.67
21	601398	工商银行	31,500	157,185.00	0.67
22	600900	长江电力	8,200	157,112.00	0.66
23	600031	三一重工	4,421	154,646.58	0.65
24	603259	药明康德	1,120	150,886.40	0.64
25	000725	京东方A	24,300	145,800.00	0.62
26	002352	顺丰控股	1,600	141,168.00	0.60
27	600309	万华化学	1,500	136,560.00	0.58
28	000661	长春高新	300	134,673.00	0.57
29	002714	牧原股份	1,650	127,215.00	0.54
30	601601	中国太保	3,100	119,040.00	0.50
31	002304	洋河股份	500	117,995.00	0.50
32	601899	紫金矿业	12,400	115,196.00	0.49
33	600809	山西汾酒	300	112,587.00	0.48
34	601328	交通银行	24,600	110,208.00	0.47
35	600585	海螺水泥	2,100	108,402.00	0.46
36	300015	爱尔眼科	1,446	108,290.94	0.46
37	600000	浦发银行	10,600	102,608.00	0.43

38	600048	保利地产	6,300	99,666.00	0.42
39	600690	海尔智家	3,400	99,314.00	0.42
40	601688	华泰证券	5,300	95,453.00	0.40
41	002142	宁波银行	2,700	95,418.00	0.40
42	601668	中国建筑	18,800	93,436.00	0.40
43	603501	韦尔股份	400	92,440.00	0.39
44	600438	通威股份	2,400	92,256.00	0.39
45	002460	赣锋锂业	900	91,080.00	0.39
46	002027	分众传媒	9,200	90,804.00	0.38
47	000100	TCL 科技	12,600	89,208.00	0.38
48	300122	智飞生物	600	88,746.00	0.38
49	600837	海通证券	6,900	88,734.00	0.38
50	600016	民生银行	16,600	86,320.00	0.37
51	300124	汇川技术	900	83,970.00	0.36
52	688008	澜起科技	1,000	82,880.00	0.35
53	601288	农业银行	25,800	81,012.00	0.34
54	300347	泰格医药	500	80,805.00	0.34
55	000063	中兴通讯	2,400	80,760.00	0.34
56	600570	恒生电子	760	79,724.00	0.34
57	300014	亿纬锂能	962	78,403.00	0.33
58	600104	上汽集团	3,200	78,208.00	0.33
59	600999	招商证券	3,330	77,722.20	0.33
60	002241	歌尔股份	2,000	74,640.00	0.32
61	300498	温氏股份	4,000	72,920.00	0.31
62	601211	国泰君安	4,100	71,873.00	0.30
63	002410	广联达	900	70,866.00	0.30
64	601229	上海银行	9,000	70,560.00	0.30
65	000338	潍柴动力	4,300	67,897.00	0.29
66	600436	片仔癀	248	66,342.48	0.28
67	300274	阳光电源	900	65,052.00	0.28
68	601169	北京银行	13,300	64,372.00	0.27
69	600588	用友网络	1,450	63,611.50	0.27
70	688012	中微公司	400	63,036.00	0.27
71	600660	福耀玻璃	1,300	62,465.00	0.26
72	002230	科大讯飞	1,500	61,305.00	0.26
73	688036	传音控股	400	60,856.00	0.26
74	600009	上海机场	800	60,528.00	0.26
75	601988	中国银行	18,900	60,102.00	0.25
76	002821	凯莱英	200	59,828.00	0.25
77	600196	复星医药	1,100	59,389.00	0.25
78	601766	中国中车	10,900	57,879.00	0.24
79	601628	中国人寿	1,500	57,585.00	0.24

80	002841	视源股份	500	57,515.00	0.24
81	601818	光大银行	14,300	57,057.00	0.24
82	600703	三安光电	2,100	56,721.00	0.24
83	002812	恩捷股份	400	56,712.00	0.24
84	002271	东方雨虹	1,450	56,260.00	0.24
85	600763	通策医疗	200	55,304.00	0.23
86	603986	兆易创新	280	55,300.00	0.23
87	000596	古井贡酒	200	54,400.00	0.23
88	002371	北方华创	300	54,222.00	0.23
89	601088	中国神华	3,000	54,030.00	0.23
90	300142	沃森生物	1,400	53,984.00	0.23
91	601919	中远海控	4,400	53,724.00	0.23
92	600893	航发动力	900	53,415.00	0.23
93	600346	恒力石化	1,900	53,143.00	0.22
94	600406	国电南瑞	2,000	53,140.00	0.22
95	300601	康泰生物	300	52,350.00	0.22
96	300413	芒果超媒	700	50,750.00	0.21
97	002493	荣盛石化	1,800	49,698.00	0.21
98	601390	中国中铁	9,100	47,957.00	0.20
99	000768	中航西飞	1,300	47,684.00	0.20
100	603799	华友钴业	600	47,580.00	0.20
101	000876	新希望	2,100	47,040.00	0.20
102	600919	江苏银行	8,500	46,410.00	0.20
103	601336	新华保险	800	46,376.00	0.20
104	002311	海大集团	700	45,850.00	0.19
105	000538	云南白药	400	45,440.00	0.19
106	600019	宝钢股份	7,500	44,625.00	0.19
107	600958	东方证券	3,800	44,194.00	0.19
108	300628	亿联网络	600	43,872.00	0.19
109	000625	长安汽车	2,000	43,760.00	0.19
110	601009	南京银行	5,400	43,632.00	0.18
111	600741	华域汽车	1,500	43,230.00	0.18
112	000166	申万宏源	8,100	42,768.00	0.18
113	600584	长电科技	1,000	42,570.00	0.18
114	000776	广发证券	2,600	42,328.00	0.18
115	600028	中国石化	10,500	42,315.00	0.18
116	000895	双汇发展	900	42,246.00	0.18
117	601377	兴业证券	4,800	41,664.00	0.18
118	601633	长城汽车	1,100	41,591.00	0.18
119	002129	中环股份	1,600	40,800.00	0.17
120	000157	中联重科	4,100	40,590.00	0.17
121	002001	新和成	1,200	40,416.00	0.17



122	002049	紫光国微	300	40,143.00	0.17
123	603882	金城医学	310	39,717.20	0.17
124	002007	华兰生物	940	39,705.60	0.17
125	600745	闻泰科技	400	39,600.00	0.17
126	603993	洛阳钼业	6,300	39,375.00	0.17
127	002179	中航光电	500	39,145.00	0.17
128	600926	杭州银行	2,600	38,792.00	0.16
129	601901	方正证券	3,700	38,369.00	0.16
130	300012	华测检测	1,400	38,318.00	0.16
131	601939	建设银行	6,100	38,308.00	0.16
132	600547	山东黄金	1,620	38,264.40	0.16
133	002050	三花智控	1,550	38,207.50	0.16
134	600176	中国巨石	1,900	37,924.00	0.16
135	601066	中信建投	900	37,800.00	0.16
136	600050	中国联通	8,400	37,464.00	0.16
137	600426	华鲁恒升	1,000	37,300.00	0.16
138	001979	招商蛇口	2,800	37,212.00	0.16
139	300433	蓝思科技	1,200	36,732.00	0.16
140	601857	中国石油	8,800	36,520.00	0.15
141	000786	北新建材	890	35,644.50	0.15
142	002202	金风科技	2,500	35,625.00	0.15
143	002736	国信证券	2,600	35,464.00	0.15
144	601877	正泰电器	900	35,244.00	0.15
145	002074	国轩高科	900	35,208.00	0.15
146	002008	大族激光	820	35,055.00	0.15
147	603369	今世缘	600	34,428.00	0.15
148	601989	中国重工	8,200	34,358.00	0.15
149	002555	三七互娱	1,100	34,353.00	0.15
150	601006	大秦铁路	5,300	34,238.00	0.14
151	600109	国金证券	2,100	34,167.00	0.14
152	002601	龙蟠佰利	1,100	33,847.00	0.14
153	601225	陕西煤业	3,600	33,624.00	0.14
154	300408	三环集团	900	33,525.00	0.14
155	601788	光大证券	1,800	33,336.00	0.14
156	600872	中炬高新	500	33,325.00	0.14
157	000547	航天发展	1,200	33,000.00	0.14
158	601186	中国铁建	4,100	32,390.00	0.14
159	002236	大华股份	1,600	31,824.00	0.13
160	688009	中国通号	5,400	31,644.00	0.13
161	601100	恒立液压	280	31,640.00	0.13
162	300285	国瓷材料	700	31,577.00	0.13
163	688099	晶晨股份	400	31,492.00	0.13

164	600089	特变电工	3,100	31,465.00	0.13
165	600352	浙江龙盛	2,300	31,326.00	0.13
166	002568	百润股份	300	31,287.00	0.13
167	002600	领益智造	2,600	31,174.00	0.13
168	603160	汇顶科技	200	31,110.00	0.13
169	300207	欣旺达	1,000	30,710.00	0.13
170	600015	华夏银行	4,800	30,000.00	0.13
171	300003	乐普医疗	1,100	29,898.00	0.13
172	003816	中国广核	10,600	29,892.00	0.13
173	600600	青岛啤酒	300	29,820.00	0.13
174	002938	鹏鼎控股	600	29,802.00	0.13
175	002624	完美世界	1,000	29,500.00	0.12
176	000783	长江证券	3,500	29,400.00	0.12
177	000860	顺鑫农业	400	29,016.00	0.12
178	601233	桐昆股份	1,400	28,826.00	0.12
179	603019	中科曙光	840	28,753.20	0.12
180	002384	东山精密	1,100	28,600.00	0.12
181	000066	中国长城	1,500	28,485.00	0.12
182	002044	美年健康	2,500	28,325.00	0.12
183	601360	三六零	1,800	28,278.00	0.12
184	600183	生益科技	1,000	28,160.00	0.12
185	688088	虹软科技	400	27,968.00	0.12
186	601155	新城控股	800	27,864.00	0.12
187	601108	财通证券	2,200	27,830.00	0.12
188	603833	欧派家居	206	27,707.00	0.12
189	601555	东吴证券	2,800	27,608.00	0.12
190	603658	安图生物	190	27,584.20	0.12
191	601985	中国核电	5,600	27,552.00	0.12
192	600143	金发科技	1,600	27,424.00	0.12
193	002185	华天科技	2,000	27,240.00	0.12
194	600383	金地集团	2,000	27,000.00	0.11
195	000938	紫光股份	1,320	26,994.00	0.11
196	600739	辽宁成大	1,100	26,752.00	0.11
197	300699	光威复材	300	26,715.00	0.11
198	002690	美亚光电	600	26,568.00	0.11
199	603899	晨光文具	300	26,568.00	0.11
200	600486	扬农化工	200	26,400.00	0.11
201	601669	中国电建	6,800	26,384.00	0.11
202	002456	欧菲光	2,000	26,360.00	0.11
203	000069	华侨城 A	3,700	26,233.00	0.11
204	300144	宋城演艺	1,460	25,871.20	0.11
205	002797	第一创业	2,600	25,870.00	0.11

206	300676	华大基因	200	25,712.00	0.11
207	002024	苏宁易购	3,300	25,443.00	0.11
208	002385	大北农	2,600	25,116.00	0.11
209	300136	信维通信	700	25,116.00	0.11
210	600132	重庆啤酒	210	24,987.90	0.11
211	601099	太平洋	6,100	24,888.00	0.11
212	300033	同花顺	200	24,796.00	0.10
213	601138	工业富联	1,800	24,642.00	0.10
214	601878	浙商证券	1,600	24,480.00	0.10
215	601933	永辉超市	3,400	24,412.00	0.10
216	002414	高德红外	580	24,215.00	0.10
217	000977	浪潮信息	900	24,192.00	0.10
218	603290	斯达半导	100	24,090.00	0.10
219	600795	国电电力	10,600	23,850.00	0.10
220	600522	中天科技	2,200	23,848.00	0.10
221	600029	南方航空	4,000	23,840.00	0.10
222	002340	格林美	3,400	23,766.00	0.10
223	000636	风华高科	700	23,590.00	0.10
224	600111	北方稀土	1,800	23,562.00	0.10
225	002602	世纪华通	3,300	23,463.00	0.10
226	600760	中航沈飞	300	23,454.00	0.10
227	688002	睿创微纳	211	23,421.00	0.10
228	300496	中科创达	200	23,400.00	0.10
229	600161	天坛生物	561	23,393.70	0.10
230	601800	中国交建	3,200	23,232.00	0.10
231	600316	洪都航空	400	22,748.00	0.10
232	000425	徐工机械	4,200	22,554.00	0.10
233	000963	华东医药	830	22,044.80	0.09
234	600885	宏发股份	400	21,688.00	0.09
235	600886	国投电力	2,500	21,600.00	0.09
236	600705	中航资本	4,900	21,462.00	0.09
237	000728	国元证券	2,390	21,414.40	0.09
238	601600	中国铝业	5,886	21,366.18	0.09
239	601838	成都银行	2,000	21,340.00	0.09
240	002507	涪陵榨菜	500	21,150.00	0.09
241	601966	玲珑轮胎	600	21,102.00	0.09
242	002607	中公教育	600	21,078.00	0.09
243	601168	西部矿业	1,700	21,046.00	0.09
244	600201	生物股份	1,000	20,890.00	0.09
245	002709	天赐材料	200	20,760.00	0.09
246	600845	宝信软件	300	20,694.00	0.09
247	603589	口子窖	300	20,670.00	0.09

248	002463	沪电股份	1,100	20,669.00	0.09
249	000656	金科股份	2,900	20,561.00	0.09
250	603195	公牛集团	100	20,529.00	0.09
251	000703	恒逸石化	1,600	20,480.00	0.09
252	300529	健帆生物	300	20,346.00	0.09
253	600079	人福医药	600	20,328.00	0.09
254	002916	深南电路	188	20,315.28	0.09
255	600066	宇通客车	1,200	20,304.00	0.09
256	600699	均胜电子	800	20,288.00	0.09
257	600219	南山铝业	6,400	20,224.00	0.09
258	002078	太阳纸业	1,400	20,202.00	0.09
259	603392	万泰生物	100	20,153.00	0.09
260	600529	山东药玻	400	20,060.00	0.08
261	601799	星宇股份	100	20,050.00	0.08
262	002013	中航机电	1,750	20,037.50	0.08
263	002625	光启技术	900	20,025.00	0.08
264	000750	国海证券	3,400	19,924.00	0.08
265	000708	中信特钢	900	19,611.00	0.08
266	300088	长信科技	2,200	19,558.00	0.08
267	300630	普利制药	466	19,520.74	0.08
268	601111	中国国航	2,600	19,474.00	0.08
269	600061	国投资本	1,400	19,362.00	0.08
270	603345	安井食品	100	19,287.00	0.08
271	601607	上海医药	1,000	19,200.00	0.08
272	002212	天融信	900	18,909.00	0.08
273	600340	华夏幸福	1,450	18,748.50	0.08
274	002157	正邦科技	1,100	18,744.00	0.08
275	600115	东方航空	4,000	18,720.00	0.08
276	600606	绿地控股	3,200	18,656.00	0.08
277	603486	科沃斯	210	18,582.90	0.08
278	002030	达安基因	540	18,522.00	0.08
279	002252	上海莱士	2,500	18,500.00	0.08
280	002131	利欧股份	6,100	18,483.00	0.08
281	601128	常熟银行	2,500	18,450.00	0.08
282	600884	杉杉股份	1,020	18,390.60	0.08
283	601162	天风证券	3,000	18,300.00	0.08
284	300223	北京君正	200	18,298.00	0.08
285	601997	贵阳银行	2,300	18,285.00	0.08
286	600862	中航高科	600	18,060.00	0.08
287	300316	晶盛机电	600	18,048.00	0.08
288	002683	宏大爆破	500	17,975.00	0.08
289	600177	雅戈尔	2,500	17,975.00	0.08

290	600362	江西铜业	900	17,955.00	0.08
291	300482	万孚生物	200	17,842.00	0.08
292	000998	隆平高科	900	17,829.00	0.08
293	601727	上海电气	3,300	17,820.00	0.08
294	603605	珀莱雅	100	17,800.00	0.08
295	002075	沙钢股份	1,600	17,552.00	0.07
296	601816	京沪高铁	3,100	17,546.00	0.07
297	600460	士兰微	700	17,500.00	0.07
298	002353	杰瑞股份	500	17,500.00	0.07
299	002422	科伦药业	900	17,496.00	0.07
300	601618	中国中冶	6,400	17,472.00	0.07
301	600011	华能国际	3,900	17,472.00	0.07
302	600867	通化东宝	1,300	17,394.00	0.07
303	002500	山西证券	1,940	17,363.00	0.07
304	300168	万达信息	800	17,352.00	0.07
305	002465	海格通信	1,600	17,328.00	0.07
306	000009	中国宝安	2,300	17,319.00	0.07
307	601198	东兴证券	1,300	17,316.00	0.07
308	000988	华工科技	740	17,160.60	0.07
309	603806	福斯特	200	17,080.00	0.07
310	600637	东方明珠	1,900	16,986.00	0.07
311	000630	铜陵有色	6,600	16,962.00	0.07
312	002080	中材科技	700	16,926.00	0.07
313	300146	汤臣倍健	700	16,905.00	0.07
314	600010	包钢股份	14,400	16,848.00	0.07
315	002920	德赛西威	200	16,828.00	0.07
316	002250	联化科技	700	16,793.00	0.07
317	600487	亨通光电	1,200	16,788.00	0.07
318	601021	春秋航空	300	16,629.00	0.07
319	002120	韵达股份	1,050	16,485.00	0.07
320	600733	北汽蓝谷	1,900	16,473.00	0.07
321	600068	葛洲坝	2,500	16,450.00	0.07
322	300595	欧普康视	200	16,384.00	0.07
323	002508	老板电器	400	16,312.00	0.07
324	603338	浙江鼎力	160	16,190.40	0.07
325	600369	西南证券	3,000	16,140.00	0.07
326	600118	中国卫星	500	16,090.00	0.07
327	600909	华安证券	2,000	16,000.00	0.07
328	300418	昆仑万维	800	15,960.00	0.07
329	603866	桃李面包	270	15,957.00	0.07
330	601990	南京证券	1,300	15,951.00	0.07
331	002299	圣农发展	600	15,924.00	0.07

332	002032	苏泊尔	200	15,598.00	0.07
333	002444	巨星科技	500	15,555.00	0.07
334	002572	索菲亚	600	15,540.00	0.07
335	601216	君正集团	3,100	15,345.00	0.06
336	300357	我武生物	200	15,340.00	0.06
337	300070	碧水源	2,000	15,300.00	0.06
338	002673	西部证券	1,500	15,210.00	0.06
339	000021	深科技	800	15,208.00	0.06
340	603737	三棵树	100	15,150.00	0.06
341	002156	通富微电	600	15,144.00	0.06
342	601881	中国银河	1,200	15,012.00	0.06
343	000961	中南建设	1,700	15,011.00	0.06
344	600489	中金黄金	1,700	14,977.00	0.06
345	002926	华西证券	1,200	14,976.00	0.06
346	600879	航天电子	2,000	14,960.00	0.06
347	000623	吉林敖东	900	14,823.00	0.06
348	688321	微芯生物	400	14,804.00	0.06
349	600511	国药股份	300	14,793.00	0.06
350	002138	顺络电子	600	14,712.00	0.06
351	300001	特锐德	500	14,680.00	0.06
352	600418	江淮汽车	1,200	14,676.00	0.06
353	600390	五矿资本	2,100	14,658.00	0.06
354	002739	万达电影	810	14,644.80	0.06
355	600332	白云山	500	14,625.00	0.06
356	600155	华创阳安	1,100	14,509.00	0.06
357	600498	烽火通信	600	14,448.00	0.06
358	002773	康弘药业	300	14,445.00	0.06
359	002791	坚朗五金	100	14,400.00	0.06
360	601658	邮储银行	3,000	14,340.00	0.06
361	300271	华宇软件	600	14,322.00	0.06
362	600516	方大炭素	2,000	14,140.00	0.06
363	600779	水井坊	170	14,113.40	0.06
364	002223	鱼跃医疗	500	14,105.00	0.06
365	603816	顾家家居	200	14,102.00	0.06
366	002081	金螳螂	1,500	14,085.00	0.06
367	300474	景嘉微	200	13,982.00	0.06
368	300463	迈克生物	300	13,980.00	0.06
369	600380	健康元	1,000	13,910.00	0.06
370	601998	中信银行	2,700	13,797.00	0.06
371	603638	艾迪精密	200	13,788.00	0.06
372	600415	小商品城	2,500	13,775.00	0.06
373	600372	中航电子	700	13,755.00	0.06

374	002670	国盛金控	1,000	13,750.00	0.06
375	300244	迪安诊断	400	13,712.00	0.06
376	300024	机器人	1,100	13,530.00	0.06
377	000039	中集集团	900	13,491.00	0.06
378	600549	厦门钨业	800	13,480.00	0.06
379	600598	北大荒	700	13,475.00	0.06
380	002373	千方科技	700	13,384.00	0.06
381	600535	天士力	900	13,311.00	0.06
382	601615	明阳智能	700	13,286.00	0.06
383	002019	亿帆医药	700	13,251.00	0.06
384	603087	甘李药业	100	13,222.00	0.06
385	300009	安科生物	900	13,212.00	0.06
386	601319	中国人保	2,000	13,140.00	0.06
387	002124	天邦股份	900	13,140.00	0.06
388	002064	华峰化学	1,300	13,117.00	0.06
389	600765	中航重机	521	13,025.00	0.06
390	000878	云南铜业	900	13,023.00	0.06
391	601236	红塔证券	700	13,013.00	0.06
392	600918	中泰证券	700	12,950.00	0.05
393	600166	福田汽车	4,100	12,915.00	0.05
394	601117	中国化学	2,200	12,914.00	0.05
395	300315	掌趣科技	2,500	12,775.00	0.05
396	000686	东北证券	1,300	12,766.00	0.05
397	002603	以岭药业	500	12,750.00	0.05
398	002273	水晶光电	1,100	12,749.00	0.05
399	000401	冀东水泥	900	12,735.00	0.05
400	002958	青农商行	2,500	12,725.00	0.05
401	600998	九州通	700	12,712.00	0.05
402	600233	圆通速递	1,100	12,650.00	0.05
403	000975	银泰黄金	1,460	12,570.60	0.05
404	600038	中直股份	200	12,542.00	0.05
405	002511	中顺洁柔	600	12,522.00	0.05
406	600655	豫园股份	1,400	12,446.00	0.05
407	600271	航天信息	987	12,436.20	0.05
408	603156	养元饮品	480	12,403.20	0.05
409	300017	网宿科技	1,800	12,402.00	0.05
410	600801	华新水泥	600	12,378.00	0.05
411	300618	寒锐钴业	130	12,338.30	0.05
412	300115	长盈精密	500	12,325.00	0.05
413	600153	建发股份	1,500	12,315.00	0.05
414	002056	横店东磁	810	12,303.90	0.05
415	600667	太极实业	1,300	12,285.00	0.05

416	002831	裕同科技	400	12,248.00	0.05
417	601916	浙商银行	3,000	12,240.00	0.05
418	002558	巨人网络	700	12,201.00	0.05
419	000513	丽珠集团	300	12,150.00	0.05
420	600208	新湖中宝	3,900	12,090.00	0.05
421	600170	上海建工	4,000	12,040.00	0.05
422	603927	中科软	300	12,027.00	0.05
423	000723	美锦能源	1,800	12,024.00	0.05
424	000540	中天金融	3,800	11,970.00	0.05
425	601238	广汽集团	900	11,961.00	0.05
426	600895	张江高科	700	11,928.00	0.05
427	600018	上港集团	2,600	11,882.00	0.05
428	000050	深天马 A	800	11,792.00	0.05
429	002195	二三四五	5,200	11,752.00	0.05
430	002152	广电运通	1,100	11,748.00	0.05
431	000739	普洛药业	500	11,640.00	0.05
432	601231	环旭电子	600	11,604.00	0.05
433	002939	长城证券	900	11,583.00	0.05
434	600392	盛和资源	1,300	11,557.00	0.05
435	603858	步长制药	500	11,535.00	0.05
436	601689	拓普集团	300	11,529.00	0.05
437	002966	苏州银行	1,500	11,520.00	0.05
438	000830	鲁西化工	900	11,502.00	0.05
439	600642	申能股份	2,200	11,484.00	0.05
440	002506	协鑫集成	2,700	11,475.00	0.05
441	000738	航发控制	500	11,465.00	0.05
442	603883	老百姓	180	11,309.40	0.05
443	000807	云铝股份	1,500	11,295.00	0.05
444	600409	三友化工	1,100	11,275.00	0.05
445	600008	首创股份	3,970	11,235.10	0.05
446	002372	伟星新材	600	11,220.00	0.05
447	000729	燕京啤酒	1,300	11,076.00	0.05
448	600497	驰宏锌锗	2,300	11,040.00	0.05
449	601992	金隅集团	3,700	10,989.00	0.05
450	000690	宝新能源	1,500	10,950.00	0.05
451	600580	卧龙电驱	700	10,920.00	0.05
452	000983	山西焦煤	1,920	10,828.80	0.05
453	300058	蓝色光标	1,800	10,800.00	0.05
454	002557	洽洽食品	200	10,770.00	0.05
455	600563	法拉电子	100	10,755.00	0.05
456	600482	中国动力	600	10,752.00	0.05
457	000997	新大陆	700	10,696.00	0.05



458	601456	国联证券	500	10,665.00	0.05
459	600150	中国船舶	600	10,614.00	0.04
460	000060	中金岭南	2,200	10,604.00	0.04
461	600297	广汇汽车	3,700	10,582.00	0.04
462	002382	蓝帆医疗	500	10,545.00	0.04
463	600528	中铁工业	1,200	10,488.00	0.04
464	600256	广汇能源	3,700	10,471.00	0.04
465	603198	迎驾贡酒	300	10,470.00	0.04
466	002648	卫星石化	400	10,448.00	0.04
467	600315	上海家化	300	10,419.00	0.04
468	601866	中远海发	3,500	10,395.00	0.04
469	600754	锦江酒店	200	10,306.00	0.04
470	600827	百联股份	700	10,220.00	0.04
471	600167	联美控股	900	10,215.00	0.04
472	002745	木林森	700	10,213.00	0.04
473	600027	华电国际	3,000	10,200.00	0.04
474	300296	利亚德	1,600	10,176.00	0.04
475	601872	招商轮船	1,800	10,170.00	0.04
476	002191	劲嘉股份	1,100	10,153.00	0.04
477	002221	东华能源	1,000	10,140.00	0.04
478	000960	锡业股份	900	10,080.00	0.04
479	600704	物产中大	2,300	10,051.00	0.04
480	002028	思源电气	500	10,030.00	0.04
481	600848	上海临港	500	10,010.00	0.04
482	600875	东方电气	1,000	9,970.00	0.04
483	002429	兆驰股份	1,600	9,920.00	0.04
484	603317	天味食品	120	9,868.80	0.04
485	600728	佳都科技	1,300	9,867.00	0.04
486	600811	东方集团	2,700	9,855.00	0.04
487	601717	郑煤机	900	9,837.00	0.04
488	600260	凯乐科技	900	9,810.00	0.04
489	300212	易华录	320	9,808.00	0.04
490	002146	荣盛发展	1,500	9,795.00	0.04
491	600859	王府井	300	9,774.00	0.04
492	600160	巨化股份	1,200	9,732.00	0.04
493	600967	内蒙一机	800	9,728.00	0.04
494	000012	南玻A	1,300	9,594.00	0.04
495	600839	四川长虹	3,300	9,570.00	0.04
496	600085	同仁堂	400	9,560.00	0.04
497	600515	海航基础	1,400	9,450.00	0.04
498	600325	华发股份	1,500	9,315.00	0.04
499	000581	威孚高科	400	9,276.00	0.04

500	002387	维信诺	810	9,234.00	0.04
501	002092	中泰化学	1,500	9,225.00	0.04
502	002396	星网锐捷	400	9,224.00	0.04
503	002174	游族网络	700	9,212.00	0.04
504	300002	神州泰岳	1,800	9,198.00	0.04
505	600820	隧道股份	1,700	9,197.00	0.04
506	002085	万丰奥威	1,400	9,184.00	0.04
507	601865	福莱特	230	9,177.00	0.04
508	000028	国药一致	200	9,160.00	0.04
509	000685	中山公用	1,100	9,130.00	0.04
510	000671	阳光城	1,400	9,128.00	0.04
511	000877	天山股份	600	9,060.00	0.04
512	600881	亚泰集团	2,900	8,990.00	0.04
513	300166	东方国信	820	8,979.00	0.04
514	002233	塔牌集团	700	8,918.00	0.04
515	002595	豪迈科技	300	8,895.00	0.04
516	600410	华胜天成	1,000	8,860.00	0.04
517	000627	天茂集团	1,800	8,766.00	0.04
518	600567	山鹰国际	2,900	8,758.00	0.04
519	603712	七一二	210	8,746.50	0.04
520	600804	鹏博士	1,300	8,736.00	0.04
521	002281	光迅科技	300	8,712.00	0.04
522	600737	中粮糖业	900	8,712.00	0.04
523	600026	中远海能	1,300	8,684.00	0.04
524	601577	长沙银行	900	8,568.00	0.04
525	002807	江阴银行	2,000	8,560.00	0.04
526	000709	河钢股份	3,800	8,512.00	0.04
527	600908	无锡银行	1,400	8,512.00	0.04
528	002294	信立泰	300	8,499.00	0.04
529	600258	首旅酒店	400	8,488.00	0.04
530	002390	信邦制药	1,000	8,480.00	0.04
531	600004	白云机场	600	8,478.00	0.04
532	000629	攀钢钒钛	3,900	8,463.00	0.04
533	002705	新宝股份	200	8,450.00	0.04
534	603228	景旺电子	280	8,442.00	0.04
535	600282	南钢股份	2,700	8,424.00	0.04
536	000930	中粮科技	1,000	8,420.00	0.04
537	002268	卫士通	500	8,350.00	0.04
538	600718	东软集团	800	8,328.00	0.04
539	002004	华邦健康	1,500	8,310.00	0.04
540	601179	中国西电	1,800	8,298.00	0.04
541	600064	南京高科	800	8,216.00	0.03

542	000887	中鼎股份	700	8,197.00	0.03
543	600989	宝丰能源	700	8,190.00	0.03
544	600216	浙江医药	600	8,160.00	0.03
545	600597	光明乳业	500	8,130.00	0.03
546	000932	华菱钢铁	1,700	8,126.00	0.03
547	600446	金证股份	500	8,105.00	0.03
548	600435	北方导航	900	8,100.00	0.03
549	600188	兖州煤业	800	8,056.00	0.03
550	000027	深圳能源	1,320	8,038.80	0.03
551	600060	海信视像	700	8,036.00	0.03
552	002563	森马服饰	800	8,016.00	0.03
553	600755	厦门国贸	1,200	8,016.00	0.03
554	600572	康恩贝	1,700	8,007.00	0.03
555	601005	重庆钢铁	5,300	7,844.00	0.03
556	002368	太极股份	300	7,833.00	0.03
557	601975	招商南油	3,100	7,781.00	0.03
558	000970	中科三环	820	7,749.00	0.03
559	603000	人民网	458	7,740.20	0.03
560	000778	新兴铸管	2,100	7,728.00	0.03
561	000598	兴蓉环境	1,600	7,680.00	0.03
562	002128	露天煤业	700	7,658.00	0.03
563	000301	东方盛虹	800	7,584.00	0.03
564	000999	华润三九	300	7,482.00	0.03
565	601106	中国一重	2,500	7,475.00	0.03
566	002701	奥瑞金	1,500	7,410.00	0.03
567	002110	三钢闽光	1,100	7,403.00	0.03
568	600273	嘉化能源	800	7,392.00	0.03
569	300072	三聚环保	1,300	7,384.00	0.03
570	600158	中体产业	600	7,356.00	0.03
571	000089	深圳机场	900	7,353.00	0.03
572	300026	红日药业	1,600	7,328.00	0.03
573	000967	盈峰环境	900	7,326.00	0.03
574	601698	中国卫通	400	7,256.00	0.03
575	601118	海南橡胶	1,500	7,230.00	0.03
576	000400	许继电气	500	7,230.00	0.03
577	000825	太钢不锈	2,000	7,220.00	0.03
578	600039	四川路桥	1,600	7,216.00	0.03
579	601077	渝农商行	1,600	7,200.00	0.03
580	600120	浙江东方	1,200	7,164.00	0.03
581	300376	易事特	900	7,164.00	0.03
582	601699	潞安环能	1,100	7,150.00	0.03
583	000090	天健集团	1,200	7,128.00	0.03

584	000990	诚志股份	600	7,116.00	0.03
585	600398	海澜之家	1,100	7,062.00	0.03
586	000488	晨鸣纸业	1,100	7,062.00	0.03
587	600673	东阳光	1,400	7,042.00	0.03
588	002155	湖南黄金	820	6,978.20	0.03
589	002217	合力泰	1,700	6,970.00	0.03
590	002936	郑州银行	1,550	6,913.00	0.03
591	600782	新钢股份	1,500	6,885.00	0.03
592	601333	广深铁路	3,100	6,882.00	0.03
593	600500	中化国际	1,300	6,851.00	0.03
594	300133	华策影视	1,100	6,798.00	0.03
595	000563	陕国投 A	1,800	6,786.00	0.03
596	601860	紫金银行	1,600	6,736.00	0.03
597	002839	张家港行	1,100	6,710.00	0.03
598	601000	唐山港	2,700	6,696.00	0.03
599	603077	和邦生物	4,700	6,674.00	0.03
600	600928	西安银行	1,200	6,672.00	0.03
601	601098	中南传媒	700	6,671.00	0.03
602	600195	中牧股份	518	6,635.58	0.03
603	000528	柳工	900	6,624.00	0.03
604	002317	众生药业	600	6,612.00	0.03
605	000758	中色股份	1,300	6,604.00	0.03
606	601598	中国外运	1,500	6,600.00	0.03
607	000883	湖北能源	1,700	6,596.00	0.03
608	601200	上海环境	600	6,540.00	0.03
609	600266	城建发展	1,280	6,502.40	0.03
610	600171	上海贝岭	463	6,491.26	0.03
611	600466	蓝光发展	1,400	6,482.00	0.03
612	001914	招商积余	300	6,459.00	0.03
613	600376	首开股份	1,100	6,457.00	0.03
614	000402	金融街	1,000	6,450.00	0.03
615	300180	华峰超纤	1,090	6,441.90	0.03
616	600037	歌华有线	700	6,440.00	0.03
617	002925	盈趣科技	100	6,433.00	0.03
618	002244	滨江集团	1,400	6,426.00	0.03
619	000559	万向钱潮	1,200	6,420.00	0.03
620	600021	上海电力	900	6,408.00	0.03
621	002242	九阳股份	200	6,408.00	0.03
622	603708	家家悦	300	6,390.00	0.03
623	601808	中海油服	500	6,385.00	0.03
624	000898	鞍钢股份	2,100	6,384.00	0.03
625	600126	杭钢股份	1,200	6,348.00	0.03

626	002266	浙富控股	1,400	6,300.00	0.03
627	603568	伟明环保	330	6,246.90	0.03
628	600507	方大特钢	900	6,246.00	0.03
629	002048	宁波华翔	400	6,228.00	0.03
630	002153	石基信息	200	6,218.00	0.03
631	600388	龙净环保	700	6,216.00	0.03
632	603650	彤程新材	200	6,200.00	0.03
633	600970	中材国际	900	6,192.00	0.03
634	601016	节能风电	1,800	6,174.00	0.03
635	600073	上海梅林	600	6,174.00	0.03
636	600348	阳泉煤业	1,100	6,171.00	0.03
637	300182	捷成股份	1,900	6,137.00	0.03
638	002183	怡亚通	1,400	6,104.00	0.03
639	600729	重庆百货	210	6,069.00	0.03
640	600566	济川药业	300	6,069.00	0.03
641	600901	江苏租赁	1,100	6,061.00	0.03
642	601718	际华集团	2,000	6,060.00	0.03
643	002038	双鹭药业	600	6,060.00	0.03
644	600373	中文传媒	600	6,054.00	0.03
645	600259	广晟有色	200	6,034.00	0.03
646	600643	爱建集团	800	6,016.00	0.03
647	000519	中兵红箭	600	6,012.00	0.03
648	600022	山东钢铁	4,200	6,006.00	0.03
649	600649	城投控股	1,100	5,973.00	0.03
650	600959	江苏有线	1,800	5,958.00	0.03
651	600546	山煤国际	700	5,957.00	0.03
652	601608	中信重工	1,500	5,940.00	0.03
653	002203	海亮股份	800	5,912.00	0.03
654	300010	豆神教育	600	5,856.00	0.02
655	002249	大洋电机	1,300	5,850.00	0.02
656	601611	中国核建	800	5,824.00	0.02
657	002505	鹏都农牧	2,300	5,819.00	0.02
658	601778	晶科科技	800	5,808.00	0.02
659	600025	华能水电	1,300	5,798.00	0.02
660	000959	首钢股份	1,500	5,745.00	0.02
661	600056	中国医药	400	5,732.00	0.02
662	600312	平高电气	800	5,712.00	0.02
663	600633	浙数文化	700	5,698.00	0.02
664	000564	供销大集	2,200	5,698.00	0.02
665	603885	吉祥航空	500	5,685.00	0.02
666	600053	九鼎投资	290	5,669.50	0.02
667	600006	东风汽车	600	5,664.00	0.02

668	002640	跨境通	1,100	5,654.00	0.02
669	002010	传化智联	1,200	5,652.00	0.02
670	000078	海王生物	1,400	5,614.00	0.02
671	002440	闰土股份	600	5,592.00	0.02
672	601958	金钼股份	900	5,589.00	0.02
673	600808	马钢股份	2,100	5,586.00	0.02
674	002458	益生股份	500	5,575.00	0.02
675	601696	中银证券	200	5,536.00	0.02
676	002583	海能达	900	5,526.00	0.02
677	600141	兴发集团	500	5,515.00	0.02
678	000826	启迪环境	800	5,408.00	0.02
679	601880	大连港	2,800	5,404.00	0.02
680	600863	内蒙华电	2,100	5,397.00	0.02
681	600675	中华企业	1,600	5,376.00	0.02
682	002434	万里扬	600	5,352.00	0.02
683	002867	周大生	200	5,330.00	0.02
684	002946	新乳业	300	5,283.00	0.02
685	000031	大悦城	1,200	5,280.00	0.02
686	000415	渤海租赁	2,200	5,280.00	0.02
687	600329	中新药业	300	5,256.00	0.02
688	600094	大名城	1,300	5,226.00	0.02
689	603983	丸美股份	100	5,221.00	0.02
690	002399	海普瑞	300	5,166.00	0.02
691	300113	顺网科技	300	5,145.00	0.02
692	002468	申通快递	500	5,040.00	0.02
693	002544	杰赛科技	300	5,034.00	0.02
694	002408	齐翔腾达	600	5,016.00	0.02
695	600717	天津港	1,040	4,971.20	0.02
696	000158	常山北明	800	4,960.00	0.02
697	603515	欧普照明	160	4,833.60	0.02
698	000718	苏宁环球	1,400	4,802.00	0.02
699	002002	鸿达兴业	1,600	4,800.00	0.02
700	300459	金科文化	1,500	4,785.00	0.02
701	601127	小康股份	280	4,782.40	0.02
702	002948	青岛银行	800	4,744.00	0.02
703	600776	东方通信	400	4,740.00	0.02
704	002589	瑞康医药	900	4,707.00	0.02
705	002424	贵州百灵	600	4,698.00	0.02
706	000717	韶钢松山	1,100	4,697.00	0.02
707	603868	飞科电器	100	4,678.00	0.02
708	600707	彩虹股份	700	4,662.00	0.02
709	000501	鄂武商 A	400	4,660.00	0.02

710	300324	旋极信息	1,100	4,653.00	0.02
711	600339	中油工程	1,500	4,620.00	0.02
712	600307	酒钢宏兴	2,800	4,620.00	0.02
713	600823	世茂股份	1,000	4,610.00	0.02
714	000046	泛海控股	1,400	4,592.00	0.02
715	002945	华林证券	300	4,521.00	0.02
716	600985	淮北矿业	400	4,476.00	0.02
717	002416	爱施德	600	4,476.00	0.02
718	002375	亚厦股份	600	4,464.00	0.02
719	601928	凤凰传媒	700	4,431.00	0.02
720	600748	上实发展	900	4,419.00	0.02
721	002941	新疆交建	400	4,400.00	0.02
722	000869	张裕A	100	4,360.00	0.02
723	002815	崇达技术	300	4,332.00	0.02
724	000008	神州高铁	1,700	4,318.00	0.02
725	600582	天地科技	1,400	4,312.00	0.02
726	600968	海油发展	1,800	4,302.00	0.02
727	000156	华数传媒	500	4,280.00	0.02
728	600131	国网信通	300	4,269.00	0.02
729	000061	农产品	600	4,230.00	0.02
730	600338	西藏珠峰	400	4,192.00	0.02
731	600648	外高桥	300	4,191.00	0.02
732	000543	皖能电力	1,000	4,180.00	0.02
733	603225	新凤鸣	300	4,170.00	0.02
734	600664	哈药股份	1,300	4,147.00	0.02
735	300257	开山股份	300	4,095.00	0.02
736	600869	远东股份	1,000	3,990.00	0.02
737	000600	建投能源	700	3,927.00	0.02
738	600645	中源协和	200	3,922.00	0.02
739	000681	视觉中国	300	3,900.00	0.02
740	600835	上海机电	200	3,892.00	0.02
741	603377	东方时尚	200	3,872.00	0.02
742	601298	青岛港	600	3,858.00	0.02
743	002503	搜于特	1,700	3,808.00	0.02
744	603056	德邦股份	300	3,807.00	0.02
745	603888	新华网	200	3,800.00	0.02
746	600556	天下秀	300	3,795.00	0.02
747	000937	冀中能源	900	3,744.00	0.02
748	600639	浦东金桥	300	3,720.00	0.02
749	600350	山东高速	600	3,708.00	0.02
750	601228	广州港	1,100	3,696.00	0.02
751	600787	中储股份	800	3,688.00	0.02

752	600517	国网英大	600	3,648.00	0.02
753	601139	深圳燃气	500	3,620.00	0.02
754	600291	西水股份	636	3,606.12	0.02
755	600062	华润双鹤	300	3,597.00	0.02
756	600277	亿利洁能	1,200	3,588.00	0.02
757	000813	德展健康	800	3,544.00	0.01
758	002302	西部建设	400	3,512.00	0.01
759	002653	海思科	200	3,504.00	0.01
760	600545	卓郎智能	1,000	3,500.00	0.01
761	002635	安洁科技	200	3,446.00	0.01
762	603260	合盛硅业	100	3,344.00	0.01
763	600575	淮河能源	1,400	3,248.00	0.01
764	600657	信达地产	800	3,240.00	0.01
765	001872	招商港口	200	3,184.00	0.01
766	600871	石化油服	1,600	3,136.00	0.01
767	000537	广宇发展	500	3,135.00	0.01
768	000553	安道麦 A	400	3,128.00	0.01
769	300134	大富科技	300	3,099.00	0.01
770	002419	天虹股份	400	3,056.00	0.01
771	603355	莱克电气	100	3,023.00	0.01
772	000732	泰禾集团	900	2,943.00	0.01
773	002093	国脉科技	400	2,916.00	0.01
774	600623	华谊集团	500	2,900.00	0.01
775	603379	三美股份	150	2,865.00	0.01
776	000062	深圳华强	230	2,861.20	0.01
777	002051	中工国际	400	2,836.00	0.01
778	002818	富森美	200	2,826.00	0.01
779	601828	美凯龙	320	2,716.80	0.01
780	600903	贵州燃气	200	2,540.00	0.01
781	600640	号百控股	200	2,450.00	0.01
782	601869	长飞光纤	90	2,433.60	0.01
783	603328	依顿电子	300	2,385.00	0.01
784	601801	皖新传媒	500	2,375.00	0.01
785	600299	安迪苏	200	2,302.00	0.01
786	601003	柳钢股份	400	2,076.00	0.01
787	002957	科瑞技术	100	2,045.00	0.01
788	601512	中新集团	200	1,988.00	0.01
789	002423	中粮资本	200	1,936.00	0.01
790	601969	海南矿业	300	1,794.00	0.01
791	603256	宏和科技	200	1,766.00	0.01
792	600917	重庆燃气	200	1,372.00	0.01
793	601068	中铝国际	300	1,068.00	0.00



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

无。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	600519	贵州茅台	15,174,971.60	64.22
2	601318	中国平安	14,745,617.00	62.40
3	600036	招商银行	6,598,371.06	27.92
4	000858	五粮液	5,953,810.00	25.19
5	000333	美的集团	5,750,018.10	24.33
6	600276	恒瑞医药	5,659,324.60	23.95
7	000651	格力电器	5,481,637.00	23.20
8	601166	兴业银行	4,365,781.00	18.47
9	600030	中信证券	3,788,052.00	16.03
10	600887	伊利股份	3,404,223.20	14.41
11	000002	万科A	3,208,430.93	13.58
12	002475	立讯精密	3,137,856.93	13.28
13	600900	长江电力	2,814,632.65	11.91
14	600016	民生银行	2,674,434.00	11.32
15	601328	交通银行	2,661,744.00	11.26
16	603288	海天味业	2,638,433.23	11.16
17	000001	平安银行	2,635,551.00	11.15
18	601398	工商银行	2,470,329.00	10.45
19	601288	农业银行	2,456,067.00	10.39
20	000661	长春高新	2,391,356.00	10.12
21	601888	中国中免	2,322,096.00	9.83
22	600000	浦发银行	2,270,291.99	9.61
23	600585	海螺水泥	2,266,452.19	9.59
24	002415	海康威视	2,241,535.73	9.49
25	600031	三一重工	2,228,879.49	9.43
26	600048	保利地产	2,072,861.00	8.77
27	300498	温氏股份	2,021,616.00	8.55
28	300059	东方财富	2,020,039.00	8.55
29	000725	京东方A	1,984,466.00	8.40
30	601668	中国建筑	1,944,678.00	8.23
31	600837	海通证券	1,934,372.00	8.19
32	002714	牧原股份	1,925,000.63	8.15
33	000063	中兴通讯	1,881,660.00	7.96

34	603986	兆易创新	1,826,179.48	7.73
35	603259	药明康德	1,730,825.80	7.32
36	600436	片仔癀	1,719,773.66	7.28
37	601012	隆基股份	1,683,596.00	7.12
38	601601	中国太保	1,677,355.00	7.10
39	601688	华泰证券	1,664,547.00	7.04
40	600309	万华化学	1,634,576.00	6.92
41	002142	宁波银行	1,568,107.00	6.64
42	600009	上海机场	1,521,654.00	6.44
43	000100	TCL 科技	1,402,277.00	5.93
44	300015	爱尔眼科	1,374,762.58	5.82
45	601211	国泰君安	1,372,175.99	5.81
46	601169	北京银行	1,364,524.00	5.77
47	000338	潍柴动力	1,329,532.00	5.63
48	601988	中国银行	1,318,000.00	5.58
49	600588	用友网络	1,303,444.00	5.52
50	000568	泸州老窖	1,297,891.00	5.49
51	002304	洋河股份	1,285,317.86	5.44
52	000876	新 希 望	1,270,031.00	5.37
53	002594	比亚迪	1,256,378.00	5.32
54	600104	上汽集团	1,246,255.00	5.27
55	600570	恒生电子	1,232,935.93	5.22
56	601229	上海银行	1,221,855.00	5.17
57	601939	建设银行	1,204,683.00	5.10
58	300142	沃森生物	1,181,586.00	5.00
59	600745	闻泰科技	1,179,016.00	4.99
60	002230	科大讯飞	1,175,119.99	4.97
61	601766	中国中车	1,125,803.00	4.76
62	600703	三安光电	1,124,364.00	4.76
63	601818	光大银行	1,100,396.00	4.66
64	600690	海尔智家	1,098,238.00	4.65
65	002241	歌尔股份	1,073,308.00	4.54
66	002027	分众传媒	1,069,340.68	4.53
67	601899	紫金矿业	1,065,806.00	4.51
68	600919	江苏银行	1,064,249.00	4.50
69	600028	中国石化	1,059,214.00	4.48
70	300122	智飞生物	1,058,496.84	4.48
71	601088	中国神华	1,031,602.00	4.37
72	300347	泰格医药	1,018,837.00	4.31
73	001979	招商蛇口	1,011,210.44	4.28
74	000538	云南白药	996,722.00	4.22
75	002007	华兰生物	971,583.00	4.11

76	600999	招商证券	971,063.80	4.11
77	002352	顺丰控股	947,622.00	4.01
78	000895	双汇发展	944,293.00	4.00
79	601628	中国人寿	943,271.00	3.99
80	002271	东方雨虹	940,203.00	3.98
81	300003	乐普医疗	919,219.73	3.89
82	300124	汇川技术	893,566.00	3.78
83	600050	中国联通	889,468.00	3.76
84	601009	南京银行	882,212.91	3.73
85	600406	国电南瑞	882,163.00	3.73
86	601390	中国中铁	828,763.00	3.51
87	002555	三七互娱	827,158.00	3.50
88	601186	中国铁建	823,657.00	3.49
89	000166	申万宏源	818,734.00	3.46
90	000776	广发证券	818,534.00	3.46
91	600547	山东黄金	813,126.00	3.44
92	300014	亿纬锂能	810,030.00	3.43
93	600019	宝钢股份	806,051.00	3.41
94	601857	中国石油	777,459.00	3.29
95	601006	大秦铁路	772,876.00	3.27
96	600196	复星医药	765,773.00	3.24
97	002410	广联达	745,345.00	3.15
98	600015	华夏银行	742,050.00	3.14
99	600438	通威股份	727,607.00	3.08
100	002311	海大集团	724,867.39	3.07
101	002371	北方华创	723,045.00	3.06
102	000938	紫光股份	714,739.00	3.02
103	603019	中科曙光	712,107.00	3.01
104	000157	中联重科	709,033.04	3.00
105	002460	赣锋锂业	706,001.00	2.99
106	300601	康泰生物	699,346.00	2.96
107	601989	中国重工	691,606.00	2.93
108	002044	美年健康	690,985.00	2.92
109	601336	新华保险	685,185.00	2.90
110	600741	华域汽车	675,283.00	2.86
111	002129	中环股份	670,304.60	2.84
112	601933	永辉超市	661,390.00	2.80
113	600183	生益科技	656,391.00	2.78
114	600584	长电科技	654,438.00	2.77
115	600958	东方证券	651,811.00	2.76
116	603517	绝味食品	650,313.00	2.75
117	002049	紫光国微	649,021.00	2.75

118	002602	世纪华通	648,531.00	2.74
119	300413	芒果超媒	642,475.00	2.72
120	002050	三花智控	642,430.00	2.72
121	002024	苏宁易购	639,392.00	2.71
122	002001	新和成	631,666.00	2.67
123	300136	信维通信	623,380.00	2.64
124	300253	卫宁健康	617,549.00	2.61
125	601155	新城控股	616,937.53	2.61
126	002236	大华股份	607,363.73	2.57
127	002127	南极电商	607,334.00	2.57
128	603501	韦尔股份	605,503.00	2.56
129	600352	浙江龙盛	596,743.00	2.53
130	601901	方正证券	596,259.00	2.52
131	002463	沪电股份	582,913.63	2.47
132	000425	徐工机械	578,556.00	2.45
133	603899	晨光文具	577,191.00	2.44
134	601225	陕西煤业	576,860.00	2.44
135	002624	完美世界	576,144.39	2.44
136	600346	恒力石化	575,672.00	2.44
137	300144	宋城演艺	574,482.00	2.43
138	600383	金地集团	574,360.00	2.43
139	002202	金风科技	573,923.00	2.43
140	601877	正泰电器	572,687.88	2.42
141	600522	中天科技	560,951.00	2.37
142	002736	国信证券	560,809.91	2.37
143	300529	健帆生物	551,606.00	2.33
144	601377	兴业证券	549,056.00	2.32
145	002456	欧菲光	548,564.00	2.32
146	002384	东山精密	543,368.00	2.30
147	002812	恩捷股份	542,749.00	2.30
148	600201	生物股份	541,857.00	2.29
149	600089	特变电工	535,739.00	2.27
150	600809	山西汾酒	534,242.00	2.26
151	603160	汇顶科技	529,435.00	2.24
152	600660	福耀玻璃	526,799.00	2.23
153	300408	三环集团	517,508.74	2.19
154	000066	中国长城	508,588.00	2.15
155	000069	华侨城 A	507,805.00	2.15
156	000783	长江证券	507,764.00	2.15
157	600763	通策医疗	507,110.00	2.15
158	600340	华夏幸福	503,642.00	2.13
159	002008	大族激光	500,410.00	2.12

160	000513	丽珠集团	500,396.00	2.12
161	601669	中国电建	497,976.00	2.11
162	002439	启明星辰	496,323.00	2.10
163	600893	航发动力	488,887.00	2.07
164	300383	光环新网	487,826.00	2.06
165	000768	中航西飞	487,350.00	2.06
166	300012	华测检测	486,908.00	2.06
167	002821	凯莱英	486,490.00	2.06
168	600079	人福医药	485,665.00	2.06
169	601985	中国核电	484,639.00	2.05
170	002385	大北农	484,487.00	2.05
171	600109	国金证券	478,634.00	2.03
172	600886	国投电力	476,279.00	2.02
173	603993	洛阳钼业	476,245.00	2.02
174	002075	沙钢股份	476,164.00	2.01
175	600536	中国软件	475,180.00	2.01

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。

#### 8.4.2 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	6,281,724.00	26.58
2	000333	美的集团	5,716,850.00	24.19
3	000651	格力电器	5,274,826.00	22.32
4	002475	立讯精密	3,378,274.80	14.30
5	000002	万科A	3,150,448.00	13.33
6	000001	平安银行	2,557,966.00	10.82
7	000661	长春高新	2,514,834.00	10.64
8	300059	东方财富	2,195,242.10	9.29
9	002415	海康威视	2,194,812.00	9.29
10	000725	京东方A	2,051,525.00	8.68
11	002714	牧原股份	1,956,980.00	8.28
12	300498	温氏股份	1,838,066.00	7.78
13	000063	中兴通讯	1,731,250.00	7.33
14	002142	宁波银行	1,598,296.00	6.76
15	000100	TCL 科技	1,470,580.00	6.22
16	300015	爱尔眼科	1,463,077.00	6.19
17	002555	三七互娱	1,440,412.00	6.10
18	002304	洋河股份	1,353,878.00	5.73
19	000568	泸州老窖	1,349,321.00	5.71

20	002594	比亚迪	1,343,175.00	5.68
21	000338	潍柴动力	1,278,966.00	5.41
22	300142	沃森生物	1,262,513.60	5.34
23	002001	新和成	1,219,595.00	5.16
24	002241	歌尔股份	1,211,408.00	5.13
25	000876	新希望	1,184,640.00	5.01
26	000895	双汇发展	1,175,971.01	4.98
27	002230	科大讯飞	1,130,221.24	4.78
28	002027	分众传媒	1,115,614.00	4.72
29	300122	智飞生物	1,105,039.00	4.68
30	000538	云南白药	1,085,537.28	4.59
31	300253	卫宁健康	1,066,552.00	4.51
32	300347	泰格医药	1,018,364.00	4.31
33	002007	华兰生物	995,313.00	4.21
34	002352	顺丰控股	983,880.00	4.16
35	001979	招商蛇口	974,941.00	4.13
36	002271	东方雨虹	943,348.00	3.99
37	300124	汇川技术	917,522.00	3.88
38	300033	同花顺	867,145.00	3.67
39	300014	亿纬锂能	858,270.00	3.63
40	002460	赣锋锂业	848,376.00	3.59
41	000166	申万宏源	815,623.00	3.45
42	300003	乐普医疗	809,781.00	3.43
43	002075	沙钢股份	808,974.00	3.42
44	000776	广发证券	804,722.00	3.41
45	002410	广联达	769,700.00	3.26
46	601939	建设银行	763,738.00	3.23
47	002129	中环股份	737,893.34	3.12
48	002311	海大集团	703,027.00	2.97
49	300601	康泰生物	682,919.00	2.89
50	000157	中联重科	677,331.00	2.87
51	002371	北方华创	674,336.00	2.85
52	002127	南极电商	669,666.00	2.83
53	300413	芒果超媒	663,171.00	2.81
54	002050	三花智控	661,923.90	2.80
55	002044	美年健康	661,296.32	2.80
56	002074	国轩高科	659,073.00	2.79
57	300207	欣旺达	654,562.00	2.77
58	300136	信维通信	652,561.00	2.76
59	000938	紫光股份	650,465.00	2.75
60	002049	紫光国微	646,421.00	2.74
61	002024	苏宁易购	633,596.00	2.68

62	002456	欧菲光	628,324.00	2.66
63	002273	水晶光电	623,492.00	2.64
64	002236	大华股份	608,405.00	2.57
65	002602	世纪华通	606,035.00	2.56
66	300144	宋城演艺	584,614.00	2.47
67	600809	山西汾酒	575,421.00	2.43
68	002624	完美世界	561,269.00	2.38
69	002736	国信证券	554,673.00	2.35
70	000975	银泰黄金	553,900.00	2.34
71	002202	金风科技	551,688.00	2.33
72	000425	徐工机械	540,330.00	2.29
73	002463	沪电股份	536,038.00	2.27
74	002384	东山精密	534,280.00	2.26
75	300529	健帆生物	531,040.99	2.25
76	002812	恩捷股份	530,691.68	2.25
77	300433	蓝思科技	530,546.00	2.25
78	002821	凯莱英	519,188.00	2.20
79	300408	三环集团	517,732.00	2.19
80	002008	大族激光	510,009.20	2.16
81	000783	长江证券	509,403.00	2.16
82	000423	东阿阿胶	505,492.50	2.14
83	000513	丽珠集团	501,869.86	2.12
84	000069	华侨城 A	496,614.00	2.10
85	603501	韦尔股份	493,772.00	2.09
86	600763	通策医疗	491,878.00	2.08
87	000066	中国长城	489,493.00	2.07
88	300012	华测检测	484,354.00	2.05
89	300383	光环新网	483,877.00	2.05
90	000768	中航西飞	479,686.00	2.03
91	002493	荣盛石化	477,604.11	2.02

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	370,310,446.11
卖出股票收入（成交）总额	181,617,934.75

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。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代 码	名 称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					1,188,091.16
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

无。



## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	135,429.72
2	应收证券清算款	1,316.35
3	应收股利	-
4	应收利息	359.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,105.18

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
685	26,507.62	420,200.00	2.31	17,737,521.00	97.69

### 9.2 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	高仲远	2,181,007.00	12.01
2	刘增申	386,947.00	2.13
3	方正证券股份有限公司	350,200.00	1.93
4	吴敬泽	300,000.00	1.65
5	惠月红	298,000.00	1.64
6	郑逸新	280,000.00	1.54
7	张敬红	250,242.00	1.38
8	丛阳	200,000.00	1.10
9	杨惠强	200,000.00	1.10
10	江亮	200,000.00	1.10
11	戴大柱	200,000.00	1.10

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 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

注：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。

## § 10 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	33,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	336,000,000.00

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）	-
本报告期期末基金份额总额	18,157,721.00

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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），本年度审计费用为人民币 40000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	305,941,171.23	55.46%	284,935.56	55.99%	-
长江证券	1	190,672,834.01	34.56%	173,681.45	34.13%	-
中金公司	4	47,691,123.27	8.65%	43,454.69	8.54%	-
天风证券	1	7,340,307.01	1.33%	6,835.97	1.34%	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	18,354.13	46.54%	-	-	-	-

长江证券	-	-	480,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	2,310.20	5.86%	-	-	-	-
天风证券	18,774.02	47.60%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增东海证券股份有限公司为建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-08-07
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
4	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
5	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
6	建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-18
7	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
8	建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-11

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

单位：份

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	2020 年 10 月 21 日-2020 年 10 月 21 日	-	15,000,000.00	15,000,000.00	-	-

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 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

2021 年 3 月 30 日