

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 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.....	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.....	14
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.....	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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.....	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§ 8 投资组合报告	44
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.....	44
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.....	67
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.....	67
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.....	67
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.....	67
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.....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	67
§ 9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	69
§ 10 开放式基金份额变动.....	69
§ 11 重大事件揭示.....	69
11.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
11.8 其他重大事件.....	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§ 13 备查文件目录.....	74
13.1 备查文件目录.....	74
13.2 存放地点.....	74
13.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银中证 800ETF
场内简称	工银 800、工银中证 800ETF
基金主代码	515830
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 1 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,153,108.00 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 7 月 17 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，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	工银瑞信基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95561
传真	010-66583158	021-62159217
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	福建省福州市湖东路 154 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼

邮政编码	100033	200120
法定代表人	赵桂才	高建平

2.4 信息披露方式

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

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日） -2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,695,458.38	4,406,025.99
本期利润	728,122.33	7,414,734.94
加权平均基金份额本期利润	0.1728	0.0811
本期加权平均净值利润率	3.16%	4.38%
本期基金份额净值增长率	1.57%	8.13%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	1,549,133.48	1,935,540.70
期末可供分配基金份额利润	0.4913	0.2374
期末基金资产净值	17,327,367.87	44,113,328.12
期末基金份额净值	5.4953	5.4106
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	9.82%	8.13%

注：1、上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。

2、本期已实现收益是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。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

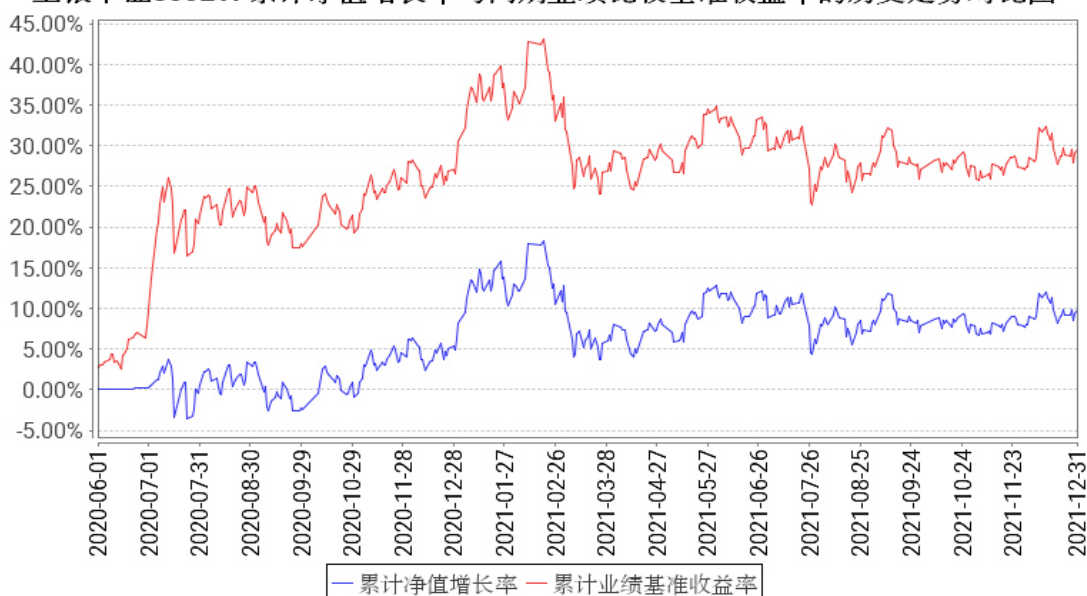
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.89%	0.69%	2.01%	0.73%	-0.12%	-0.04%
过去六个月	-1.67%	0.88%	-2.44%	0.93%	0.77%	-0.05%
过去一年	1.57%	1.02%	-0.76%	1.07%	2.33%	-0.05%
自基金合同生效起至今	9.82%	1.05%	29.56%	1.16%	-19.74%	-0.11%

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

工银中证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

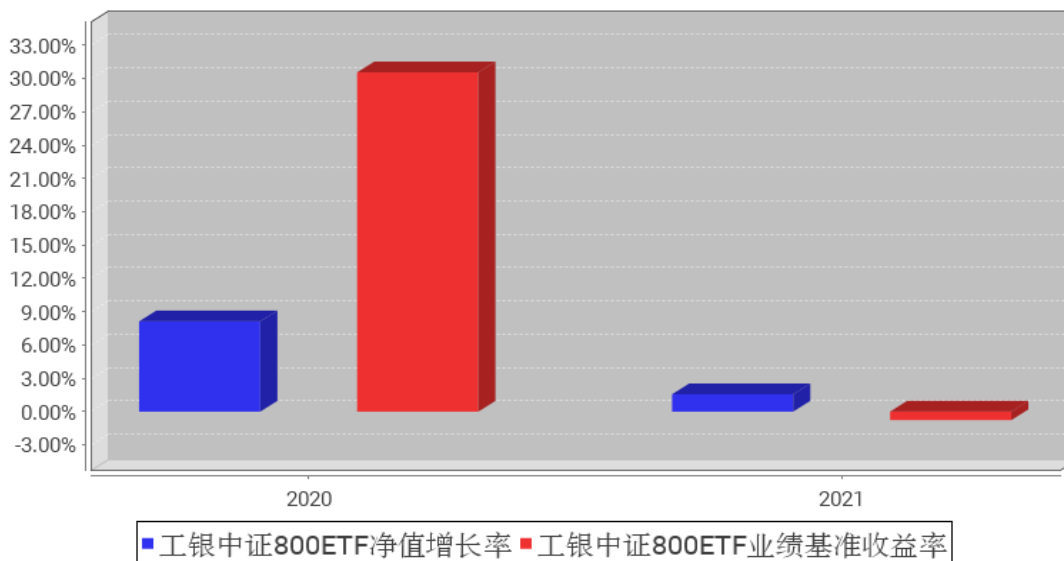


注：1、本基金基金合同于 2020 年 06 月 01 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

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

工银中证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

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

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管

理公司之一。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

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		
刘伟琳	指数投资中心投资副总监，本基金的基金经理	2020年6月1日	-	11年	博士；2010年加入工银瑞信，现任指数投资中心投资副总监、基金经理。2014年10月17日至今，担任工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金（自2018年4月17日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF））基金经理；2014年10月17日至今，担任工银瑞信沪深300指数证券投资基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金（自2020年2月18日起变更为工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2015年5月21日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金（自2020年11月26日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF））基金经理；2015年7月23日至2020年11月3日，担任工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理；2017年9月15日至2018年5月4日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理；2018年6月15日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金（LOF）基金经理；2019年5月20日至今，担任工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年8月21日至今，担任工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019年10月17日至今，担任工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年11月1日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年12月25日至今，担任

					工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至今，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 21 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 22 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 6 月 11 日至今，担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 22 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2021 年 8 月 5 日至今，担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 11 月 26 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
赵栩	指数投资中心副总经理，本基金的基金经理	2020 年 6 月 1 日	-	14 年	2008 年加入工银瑞信，现任指数投资中心副总经理、基金经理，2011 年 10 月 18 日至今，担任上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今，担任深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今，担任工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 27 日，担任工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，担任工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金经理；2017 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2018 年 12 月 7 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 19 日至今，

					担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 4 月 24 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金基金经理；2020 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至今，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 9 月 28 日至今，担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 5 日至今，担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信深证物联网 50 交易型开放式指数型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类投资组合的公平对待做了明确具体的规定，办法涵盖了公平交易的原则、适用范围、部门职责、具体程序和违规问责等。

在研究和投资决策环节，研究人员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等建立投资备选池，投资人员在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合，并确保

公平对待其管理的不同投资组合。

在交易执行环节，交易人员根据公司内部权限管理规定获得权限，并遵循价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施等执行原则，保证交易在不同投资组合间的利益公平。

同时本基金管理人在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于满足条件的指令，系统自动通过公平交易模块执行。

在监控和检查环节，风险管理人员对交易价格公允性等进行监控和分析，监察稽核人员定期对公平交易执行情况进行稽核。发现异常情况的，要求投资人员进行解释说明并核查其真实性、合理性。

本基金管理人通过上述措施全面落实公平交易要求，并持续地完善公平交易制度，确保公平对待各类投资人，保护投资人的利益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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 10 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，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

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成份股票的停牌；3) 指数成分股调整等。

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 1.57%，业绩比较基准收益率为-0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2021 年，A 股市场经历了较大的市场波动，市场风格也出现了一定的分化，后续波动和分化仍然会影响 2022 年的市场行情。展望 2022 年，经济增长压力仍在，但经济有望表现出一定的韧性，“稳增长”和“宽信用”的政策有望得到延续，货币政策上流动性得到边际改善的可能性仍在，对于 A 股市场也可能产生更为积极的促进作用。从板块来看，一方面基本面业绩增速相对有优势的行业或主题，未来仍可能保持较好的景气度，良好的成长性有望得到市场的持续关注，另一方面，前期部分板块已经得到一定的估值回调，未来存在估值修复的可能，其配置的性价比得到了一定的提升，但仍需注意包括美联储加息及缩表等海外因素对于 A 股市场的影响，市场的分化和风格的切换大概率仍会延续。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是严格的事前监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工相结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内。五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员和销售人员的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

监察稽核方面，一是定期对基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员

的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

（2）专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本基金在报告期内出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件，我司已向证监会递交解决方案，并说明有关情况。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）专字第 60802052_A01 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	工银瑞信中证 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	我们审计了工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的工银瑞信中证 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财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制。
形成审计意见的基础	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，我们独立于工银瑞信中证 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。
强调事项	我们提醒财务报表使用者关注财务报表附注 7.4.2 对编制基础的说明。工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层编制财务报表是为了向基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构披露及报送。因此，财务报表不适用于其他用途。本段内容不影响已发表的审计意见。
其他事项	我们的报告仅供基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构使用，而不应为除基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构以外的其他方使用。
其他信息	<p>工银瑞信中证 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，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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制财务报表（包括确定该编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可以接受的），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>治理层负责监督工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（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>

	(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。 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	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	825,547.67	600,537.58
结算备付金		35,678.38	118,192.02
存出保证金		28,167.59	207,264.13
交易性金融资产	7.4.7.2	16,540,949.25	43,167,081.82
其中: 股票投资		16,540,949.25	43,167,081.82
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		-	202,526.50
应收利息	7.4.7.5	118.72	234.79
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		17,430,461.61	44,295,836.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债:			
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		6,612.89	19,176.53
应付托管费		1,028.67	2,983.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,090.07	25,283.71
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	91,362.11	135,065.47
负债合计		103,093.74	182,508.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	15,778,234.39	40,798,364.28
未分配利润	7.4.7.10	1,549,133.48	3,314,963.84
所有者权益合计		17,327,367.87	44,113,328.12
负债和所有者权益总计		17,430,461.61	44,295,836.84

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 1 日，上年度可比期间财务报表的实际编制期间系 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止，下同。

2、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 5.4953 元，基金份额总额为 3,153,108.00 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		1,101,532.15	8,733,741.71
1. 利息收入		6,575.52	542,563.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,575.52	542,563.83
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,853,010.31	4,765,043.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,523,249.65	3,146,363.45
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	329,760.66	1,618,680.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,967,336.05	3,008,708.95
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	209,282.37	417,425.08
减：二、费用		373,409.82	1,319,006.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	104,075.66	437,968.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	16,189.53	68,128.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	155,956.22	606,639.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	97,188.41	206,269.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		728,122.33	7,414,734.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		728,122.33	7,414,734.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	40,798,364.28	3,314,963.84	44,113,328.12
二、本期经营活动产生的基金净	-	728,122.33	728,122.33

值变动数（本期利润）			
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）	-25,020,129.89	-2,493,952.69	-27,514,082.58
其中：1. 基金申购款	90,072,467.88	7,178,292.50	97,250,760.38
2. 基金赎回款	-115,092,597.77	-9,672,245.19	-124,764,842.96
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）	15,778,234.39	1,549,133.48	17,327,367.87
项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 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）	391,080,183.00	-	391,080,183.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,414,734.94	7,414,734.94
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）	-350,281,818.72	-4,099,771.10	-354,381,589.82
其中：1. 基金申购款	5,004,025.98	-139,253.31	4,864,772.67
2. 基金赎回款	-355,285,844.70	-3,960,517.79	-359,246,362.49
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	40,798,364.28	3,314,963.84	44,113,328.12

权益(基金净值)			
----------	--	--	--

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：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]1959 号《关于准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 6 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 391,080,183.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表 7.4.4 所述的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照 7.4.2 所述的编制基础编制，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

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等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配采用现金分红方式；

(3) 当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时，可进行收益分配；

(4) 基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率；

(5) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；

(6) 基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整，并于变更实施日前在指定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股

票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	825,547.67	600,537.58
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	825,547.67	600,537.58

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		16,499,576.35	16,540,949.25	41,372.90
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		16,499,576.35	16,540,949.25	41,372.90
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		40,158,372.87	43,167,081.82	3,008,708.95
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		40,158,372.87	43,167,081.82	3,008,708.95

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	88.39	75.07
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	16.36	57.20
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	13.97	102.52
合计	118.72	234.79

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,090.07	25,283.71
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,090.07	25,283.71

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	40,000.00	40,000.00
指数使用费	1,362.11	35,000.00
预提信息披露费	-	60,000.00
IOPV 服务费	50,000.00	-
应退替代款	-	65.47
合计	91,362.11	135,065.47

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,153,108.00	40,798,364.28
本期申购	18,000,000.00	90,072,467.88
本期赎回（以“-”号填列）	-23,000,000.00	-115,092,597.77
- 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	3,153,108.00	15,778,234.39

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,935,540.70	1,379,423.14	3,314,963.84
本期利润	3,695,458.38	-2,967,336.05	728,122.33
本期基金份额交易产生的变动数	-2,685,966.80	192,014.11	-2,493,952.69
其中：基金申购款	15,189,223.36	-8,010,930.86	7,178,292.50
基金赎回款	-17,875,190.16	8,202,944.97	-9,672,245.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,945,032.28	-1,395,898.80	1,549,133.48

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	3,873.27	63,364.83
定期存款利息收入	-	421,073.62
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,917.25	56,799.19
其他	785.00	1,326.19
合计	6,575.52	542,563.83

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年6月1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	2,022,768.02	3,274,677.52
股票投资收益——赎回差价收入	1,500,481.63	-128,314.07
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	3,523,249.65	3,146,363.45

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	63,412,713.37	169,645,128.99
减：卖出股票成本总额	61,389,945.35	166,370,451.47
买卖股票差价收入	2,022,768.02	3,274,677.52

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年6月1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	124,764,842.96	359,246,362.49
减：现金支付赎回款总额	56,351,775.96	161,408,429.49
减：赎回股票成本总额	66,912,585.37	197,966,247.07
赎回差价收入	1,500,481.63	-128,314.07

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

无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 6 月 1 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	329,760.66	1,618,680.40
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	329,760.66	1,618,680.40

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 6 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,967,336.05	3,008,708.95
股票投资	-2,967,336.05	3,008,708.95

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	-2,967,336.05	3,008,708.95

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年6月1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	209,282.37	318,617.39
其他	-	98,807.69
合计	209,282.37	417,425.08

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年6月1日(基金合同生效日)至 2020年12月31日
交易所市场交易费用	155,956.22	606,639.86
银行间市场交易费用	-	-
合计	155,956.22	606,639.86

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年6月1日(基金合同生效日)至 2020年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	-	60,000.00
证券出借违约金	-	-
IOPV 服务费	50,000.00	22,950.82
开户费	-	400.00
银行费用	250.00	1,765.00
指数使用费	6,938.41	81,153.85
合计	97,188.41	206,269.67

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

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金于 2022 年 2 月 28 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开工银瑞信中证 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》，以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。有关基金份额持有人大会的详细情况参见本基金的相关公告。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
兴业银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

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

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 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	104,075.66	437,968.79
其中：支付销售机构的客户维护费	4,722.12	5,163.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 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	16,189.53	68,128.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.07% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	825,547.67	3,873.27	600,537.58	152,323.17

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 8,053.00 股兴业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 153,329.12 元，占基金资产净值的比例为 0.88%；本基金持有 19,500.00 股工商银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 90,285.00 元，占基金资产净值的比例为 0.52%。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有 24,853.00 股兴业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 518,682.11 元，占基金资产净值的比例为 1.18%；本基金持有 57,700.00 股工商银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 287,923.00 元，占基金资产净值的比例为 0.65%。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

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	停牌日	停牌原	期末	复牌日	复牌	数量	期末	期末	备注
------	-----	-----	-----	----	-----	----	----	----	----	----

码	称	期	因	估值单价	期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	
002683	广东宏大	2021 年 12 月 20 日	重大事 项	30.12	2022 年 1 月 4 日	31.00	300	9,174.74	9,036.00	-

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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并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监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、信用风险管理团队、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时，对于每一战略环节、业务环节，公司都制定了系统化的风险管理程序，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由三大防线共同筑成的风险管理体系。其中：

(1) 各业务部门是风险管理的第一道防线，将管控好风险作为开展业务的前提和保障，落实各项风险管理措施，承担风险管理的第一责任。第一道防线按照法律法规的规定，制定本业务条线的制度和流程，对经营和业务流程中的风险主动识别、评估和控制，收集和报告风险点，针对薄弱环节及时进行完善。通过对业务和产品相关制度、流程、系统的自我评估、自我检查、自我完善、自我培训，履行业务经营过程中的自我风险控制职能。

(2) 风险管理部、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流

程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查等，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

同时，公司董事会确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对重大事件、重大决策的风险评估意见和风险管理报告进行审议，审批重大风险的解决方案；公司管理层根据董事会的风险管理战略，制定并确保公司风险管理制度得以全面、有效执行，在董事会授权范围内批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案，组织各业务部门开展风险管控工作。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人通过信用评级团队和中央交易室建立了内部评级体系和交易对手库，对债券发行主体及债券进行内部评级并跟踪进行评级调整，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

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所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	825,547.67	-	-	-	-	-	825,547.67
结算备付金	35,678.38	-	-	-	-	-	35,678.38
存出保证金	28,167.59	-	-	-	-	-	28,167.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	16,540,949.25	16,540,949.25
应收利息	-	-	-	-	-	118.72	118.72
资产总计	889,393.64	-	-	-	-	16,541,067.97	17,430,461.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,612.89	6,612.89
应付托管费	-	-	-	-	-	1,028.67	1,028.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,090.07	4,090.07
其他负债	-	-	-	-	-	91,362.11	91,362.11
负债总计	-	-	-	-	-	103,093.74	103,093.74
利率敏感度缺口	889,393.64	-	-	-	-	16,437,974.23	17,327,367.87
上年度末 2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	600,537.58	-	-	-	-	-	600,537.58
结算备付金	118,192.02	-	-	-	-	-	118,192.02
存出保证金	207,264.13	-	-	-	-	-	207,264.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	43,167,081.82	43,167,081.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	202,526.50	202,526.50

应收利息	-	-	-	-	234.79	234.79
资产总计	925,993.73	-	-	-	43,369,843.11	44,295,836.84
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	19,176.53	19,176.53
应付托管费	-	-	-	-	2,983.01	2,983.01
应付交易费用	-	-	-	-	25,283.71	25,283.71
其他负债	-	-	-	-	135,065.47	135,065.47
负债总计	-	-	-	-	182,508.72	182,508.72
利率敏感度缺口	925,993.73	-	-	-	43,187,334.39	44,113,328.12

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

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，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	16,540,949.25	95.46	43,167,081.82	97.85
交易性金融资产	-	-	-	-

一基金投资				
交易性金融资产				
一贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产一				
权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,540,949.25	95.46	43,167,081.82	97.85

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	822,072.07	1,694,833.62
	业绩比较基准减少 5%	-822,072.07	-1,694,833.62

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

(1) 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

a. 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 16,531,913.25 元，属于第二层次的余额为人民币 9,036.00 元，无属于第三层次的余额（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 43,080,903.44 元，属于第二层次的余额为人民币 27,449.94 元，属于第三层次的余额为人民币 58,728.44 元）。

b. 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。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（上年度：无）。

(2) 承诺事项

无。

(3) 其他事项

无。

§ 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	16,540,949.25	94.90
	其中：股票	16,540,949.25	94.90
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	861,226.05	4.94
8	其他各项资产	28,286.31	0.16
9	合计	17,430,461.61	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	177,084.20	1.02
B	采矿业	420,911.70	2.43

C	制造业	9,860,462.91	56.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	442,904.50	2.56
E	建筑业	281,740.72	1.63
F	批发和零售业	190,774.12	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	414,539.62	2.39
H	住宿和餐饮业	25,419.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	733,624.90	4.23
J	金融业	2,867,727.52	16.55
K	房地产业	316,428.00	1.83
L	租赁和商务服务业	216,419.86	1.25
M	科学研究和技术服务业	229,242.68	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	34,274.90	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,860.00	0.05
Q	卫生和社会工作	144,152.12	0.83
R	文化、体育和娱乐业	86,311.00	0.50
S	综合	27,306.00	0.16
	合计	16,477,183.75	95.09

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

2、由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,359.65	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,655.47	0.02
E	建筑业	3,297.51	0.02
F	批发和零售业	2,759.30	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和	-	-

	信息技术服务业		
J	金融业	37,320.75	0.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,997.76	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,375.06	0.04
S	综合	-	-
	合计	63,765.50	0.37

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	600519	贵州茅台	400	820,000.00	4.73
2	300750	宁德时代	800	470,400.00	2.71
3	600036	招商银行	6,900	336,099.00	1.94
4	601318	中国平安	6,000	302,460.00	1.75
5	000858	五粮液	1,200	267,192.00	1.54
6	601012	隆基股份	2,400	206,880.00	1.19
7	000333	美的集团	2,700	199,287.00	1.15
8	300059	东方财富	4,580	169,963.80	0.98
9	601166	兴业银行	8,053	153,329.12	0.88
10	600900	长江电力	6,300	143,010.00	0.83
11	600887	伊利股份	3,400	140,964.00	0.81
12	002415	海康威视	2,600	136,032.00	0.79
13	002594	比亚迪	500	134,060.00	0.77
14	002475	立讯精密	2,700	132,840.00	0.77
15	603259	药明康德	1,120	132,809.60	0.77
16	600276	恒瑞医药	2,540	128,803.40	0.74
17	600030	中信证券	4,700	124,127.00	0.72

18	601888	中国中免	556	121,991.96	0.70
19	300760	迈瑞医疗	300	114,240.00	0.66
20	000568	泸州老窖	400	101,548.00	0.59
21	600809	山西汾酒	320	101,049.60	0.58
22	000651	格力电器	2,600	96,278.00	0.56
23	603501	韦尔股份	300	93,231.00	0.54
24	600309	万华化学	900	90,900.00	0.52
25	601398	工商银行	19,500	90,285.00	0.52
26	000001	平安银行	5,400	88,992.00	0.51
27	300274	阳光电源	600	87,480.00	0.50
28	600436	片仔癀	200	87,430.00	0.50
29	000725	京东方 A	16,700	84,335.00	0.49
30	002142	宁波银行	2,160	82,684.80	0.48
31	601899	紫金矿业	8,000	77,600.00	0.45
32	002714	牧原股份	1,440	76,838.40	0.44
33	002352	顺丰控股	1,100	75,812.00	0.44
34	603288	海天味业	718	75,468.98	0.44
35	600031	三一重工	3,300	75,240.00	0.43
36	002812	恩捷股份	300	75,120.00	0.43
37	000002	万科 A	3,800	75,088.00	0.43
38	300014	亿纬锂能	600	70,908.00	0.41
39	601328	交通银行	15,300	70,533.00	0.41
40	002241	歌尔股份	1,300	70,330.00	0.41
41	300124	汇川技术	1,000	68,600.00	0.40
42	600438	通威股份	1,500	67,440.00	0.39
43	600837	海通证券	5,400	66,204.00	0.38
44	002304	洋河股份	400	65,892.00	0.38
45	601919	中远海控	3,470	64,854.30	0.37
46	002466	天齐锂业	600	64,200.00	0.37
47	300015	爱尔眼科	1,504	63,589.12	0.37
48	600406	国电南瑞	1,580	63,247.40	0.37
49	600690	海尔智家	2,100	62,769.00	0.36
50	600048	保利发展	4,000	62,520.00	0.36
51	000063	中兴通讯	1,800	60,300.00	0.35
52	688981	中芯国际	1,105	58,553.95	0.34
53	601668	中国建筑	11,700	58,500.00	0.34
54	601288	农业银行	19,500	57,330.00	0.33
55	002460	赣锋锂业	400	57,140.00	0.33
56	603986	兆易创新	320	56,272.00	0.32
57	600000	浦发银行	6,500	55,445.00	0.32
58	603799	华友钴业	500	55,155.00	0.32
59	600111	北方稀土	1,200	54,960.00	0.32

60	000661	长春高新	200	54,280.00	0.31
61	002129	中环股份	1,300	54,275.00	0.31
62	600016	民生银行	13,800	53,820.00	0.31
63	600104	上汽集团	2,600	53,638.00	0.31
64	002271	东方雨虹	1,000	52,680.00	0.30
65	601816	京沪高铁	10,900	52,647.00	0.30
66	002230	科大讯飞	1,000	52,510.00	0.30
67	600585	海螺水泥	1,300	52,390.00	0.30
68	600745	闻泰科技	400	51,720.00	0.30
69	601601	中国太保	1,900	51,528.00	0.30
70	300142	沃森生物	900	50,580.00	0.29
71	601688	华泰证券	2,818	50,047.68	0.29
72	300122	智飞生物	400	49,840.00	0.29
73	300498	温氏股份	2,500	48,150.00	0.28
74	000100	TCL 科技	7,800	48,126.00	0.28
75	000338	潍柴动力	2,600	46,514.00	0.27
76	002027	分众传媒	5,600	45,864.00	0.26
77	002049	紫光国微	200	45,000.00	0.26
78	601211	国泰君安	2,500	44,725.00	0.26
79	300450	先导智能	600	44,622.00	0.26
80	600893	航发动力	700	44,422.00	0.26
81	002821	凯莱英	100	43,500.00	0.25
82	600570	恒生电子	680	42,262.00	0.24
83	601766	中国中车	6,800	41,412.00	0.24
84	601088	中国神华	1,800	40,536.00	0.23
85	600050	中国联通	10,300	40,479.00	0.23
86	600763	通策医疗	200	39,800.00	0.23
87	688599	天合光能	500	39,450.00	0.23
88	000776	广发证券	1,600	39,344.00	0.23
89	601229	上海银行	5,500	39,215.00	0.23
90	300347	泰格医药	300	38,340.00	0.22
91	600919	江苏银行	6,570	38,303.10	0.22
92	603290	斯达半导	100	38,100.00	0.22
93	600660	福耀玻璃	800	37,712.00	0.22
94	002459	晶澳科技	400	37,080.00	0.21
95	002311	海大集团	500	36,650.00	0.21
96	601169	北京银行	8,200	36,408.00	0.21
97	600905	三峡能源	4,800	36,048.00	0.21
98	600999	招商证券	2,040	36,006.00	0.21
99	601988	中国银行	11,700	35,685.00	0.21
100	002709	天赐材料	310	35,541.50	0.21
101	600010	宝钢股份	12,700	35,433.00	0.20

102	600019	宝钢股份	4,900	35,084.00	0.20
103	601669	中国电建	4,300	34,744.00	0.20
104	002371	北方华创	100	34,702.00	0.20
105	600196	复星医药	700	34,258.00	0.20
106	601633	长城汽车	700	33,978.00	0.20
107	603806	福斯特	260	33,943.00	0.20
108	600958	东方证券	2,300	33,902.00	0.20
109	603444	吉比特	80	33,748.00	0.19
110	601390	中国中铁	5,700	33,003.00	0.19
111	300782	卓胜微	100	32,680.00	0.19
112	601985	中国核电	3,900	32,370.00	0.19
113	601877	正泰电器	600	32,334.00	0.19
114	600588	用友网络	900	32,292.00	0.19
115	000166	申万宏源	6,300	32,256.00	0.19
116	000625	长安汽车	2,120	32,202.80	0.19
117	603659	璞泰来	200	32,122.00	0.19
118	002410	广联达	500	31,990.00	0.18
119	000895	双汇发展	1,000	31,550.00	0.18
120	000538	云南白药	300	31,395.00	0.18
121	600028	中国石化	7,400	31,302.00	0.18
122	300408	三环集团	700	31,220.00	0.18
123	601658	邮储银行	6,100	31,110.00	0.18
124	601818	光大银行	9,200	30,544.00	0.18
125	600132	重庆啤酒	200	30,264.00	0.17
126	603486	科沃斯	200	30,190.00	0.17
127	002179	中航光电	300	30,168.00	0.17
128	002493	荣盛石化	1,650	29,964.00	0.17
129	601377	兴业证券	3,000	29,640.00	0.17
130	000768	中航西飞	800	29,200.00	0.17
131	002340	格林美	2,700	27,945.00	0.16
132	300316	晶盛机电	400	27,800.00	0.16
133	600346	恒力石化	1,200	27,564.00	0.16
134	601628	中国人寿	900	27,081.00	0.16
135	002008	大族激光	500	27,000.00	0.16
136	601225	陕西煤业	2,200	26,840.00	0.15
137	601600	中国铝业	4,400	26,796.00	0.15
138	601989	中国重工	6,300	26,586.00	0.15
139	601857	中国石油	5,400	26,514.00	0.15
140	601138	工业富联	2,200	26,224.00	0.15
141	002001	新和成	840	26,140.80	0.15
142	688099	晶晨股份	200	26,040.00	0.15
143	600741	华域汽车	900	25,470.00	0.15

144	002050	三花智控	1,000	25,300.00	0.15
145	300433	蓝思科技	1,100	25,278.00	0.15
146	688012	中微公司	199	25,193.40	0.15
147	688008	澜起科技	300	25,161.00	0.15
148	601009	南京银行	2,800	25,088.00	0.14
149	600426	华鲁恒升	800	25,040.00	0.14
150	000733	振华科技	200	24,856.00	0.14
151	600150	中国船舶	1,000	24,790.00	0.14
152	002202	金风科技	1,500	24,705.00	0.14
153	600176	中国巨石	1,357	24,697.40	0.14
154	000596	古井贡酒	100	24,400.00	0.14
155	601100	恒立液压	296	24,212.80	0.14
156	001979	招商蛇口	1,800	24,012.00	0.14
157	605358	立昂微	200	24,002.00	0.14
158	600522	中天科技	1,400	23,744.00	0.14
159	003035	南网能源	2,852	23,643.08	0.14
160	688002	睿创微纳	300	23,571.00	0.14
161	601615	明阳智能	900	23,490.00	0.14
162	002236	大华股份	1,000	23,480.00	0.14
163	600009	上海机场	500	23,345.00	0.13
164	600011	华能国际	2,400	23,256.00	0.13
165	600563	法拉电子	100	23,240.00	0.13
166	300763	锦浪科技	100	23,155.00	0.13
167	300413	芒果超媒	400	22,888.00	0.13
168	000723	美锦能源	1,400	22,722.00	0.13
169	600884	杉杉股份	690	22,611.30	0.13
170	300037	新宙邦	200	22,600.00	0.13
171	600157	永泰能源	12,400	22,568.00	0.13
172	600885	宏发股份	300	22,392.00	0.13
173	600399	抚顺特钢	900	22,293.00	0.13
174	603882	金域医学	200	22,274.00	0.13
175	600760	中航沈飞	320	21,772.80	0.13
176	603993	洛阳钼业	3,900	21,762.00	0.13
177	600584	长电科技	700	21,714.00	0.13
178	601939	建设银行	3,700	21,682.00	0.13
179	002384	东山精密	800	21,680.00	0.13
180	000786	北新建材	600	21,498.00	0.12
180	000977	浪潮信息	600	21,498.00	0.12
181	002602	世纪华通	2,540	21,310.60	0.12
182	601006	大秦铁路	3,300	21,120.00	0.12
183	600989	宝丰能源	1,200	20,832.00	0.12
184	003816	中国广核	6,600	20,658.00	0.12

185	600926	杭州银行	1,600	20,512.00	0.12
186	601066	中信建投	700	20,475.00	0.12
187	601799	星宇股份	100	20,425.00	0.12
188	601117	中国化学	1,700	20,400.00	0.12
189	601360	三六零	1,600	20,352.00	0.12
190	601186	中国铁建	2,600	20,280.00	0.12
191	000009	中国宝安	1,400	20,202.00	0.12
192	000963	华东医药	500	20,100.00	0.12
193	000157	中联重科	2,800	20,076.00	0.12
194	002601	龙佰集团	700	20,013.00	0.12
195	002013	中航机电	1,100	19,998.00	0.12
196	601868	中国能建	7,254	19,803.42	0.11
197	600600	青岛啤酒	200	19,800.00	0.11
198	300601	康泰生物	200	19,708.00	0.11
199	601555	东吴证券	2,210	19,580.60	0.11
200	601336	新华保险	500	19,440.00	0.11
201	603019	中科曙光	700	19,299.00	0.11
202	600547	山东黄金	1,020	19,196.40	0.11
203	600029	南方航空	2,800	19,068.00	0.11
204	600015	华夏银行	3,400	19,040.00	0.11
205	002555	三七互娱	700	18,914.00	0.11
206	002385	大北农	1,800	18,882.00	0.11
207	300088	长信科技	1,400	18,592.00	0.11
208	002736	国信证券	1,600	18,368.00	0.11
209	300595	欧普康视	320	18,358.40	0.11
210	600886	国投电力	1,600	18,352.00	0.11
211	000876	新希望	1,200	18,252.00	0.11
212	601238	广汽集团	1,200	18,228.00	0.11
213	002791	坚朗五金	100	18,159.00	0.10
214	600298	安琪酵母	300	18,108.00	0.10
215	601901	方正证券	2,300	18,032.00	0.10
216	600085	同仁堂	400	17,992.00	0.10
217	000425	徐工机械	3,000	17,970.00	0.10
218	603267	鸿远电子	100	17,944.00	0.10
219	300363	博腾股份	200	17,890.00	0.10
220	600862	中航高科	500	17,880.00	0.10
221	600352	浙江龙盛	1,400	17,682.00	0.10
222	688561	奇安信	200	17,584.00	0.10
223	600754	锦江酒店	300	17,580.00	0.10
224	002007	华兰生物	600	17,484.00	0.10
225	601865	福莱特	300	17,382.00	0.10
226	000938	紫光股份	760	17,366.00	0.10

227	601800	中国交建	2,000	17,160.00	0.10
228	300285	国瓷材料	400	17,028.00	0.10
229	600256	广汇能源	2,600	17,004.00	0.10
230	002938	鹏鼎控股	400	16,972.00	0.10
231	300699	光威复材	200	16,896.00	0.10
232	603456	九洲药业	300	16,878.00	0.10
233	600383	金地集团	1,300	16,861.00	0.10
234	002268	卫士通	300	16,782.00	0.10
235	300253	卫宁健康	1,000	16,760.00	0.10
236	603195	公牛集团	100	16,730.00	0.10
237	000988	华工科技	600	16,716.00	0.10
238	601788	光大证券	1,100	16,423.00	0.09
239	603369	今世缘	300	16,320.00	0.09
240	300628	亿联网络	200	16,290.00	0.09
241	002841	视源股份	200	16,280.00	0.09
242	002409	雅克科技	200	16,234.00	0.09
243	000069	华侨城 A	2,300	16,192.00	0.09
244	601916	浙商银行	4,600	16,100.00	0.09
245	600038	中直股份	200	16,060.00	0.09
246	300529	健帆生物	300	15,990.00	0.09
247	600918	中泰证券	1,600	15,952.00	0.09
248	688208	道通科技	200	15,880.00	0.09
249	300003	乐普医疗	700	15,841.00	0.09
250	000783	长江证券	2,100	15,834.00	0.09
251	600487	亨通光电	1,040	15,724.80	0.09
252	600392	盛和资源	800	15,696.00	0.09
253	688036	传音控股	100	15,690.00	0.09
254	601108	财通证券	1,400	15,568.00	0.09
255	600795	国电电力	4,900	15,533.00	0.09
256	601111	中国国航	1,700	15,521.00	0.09
257	600115	中国东航	3,000	15,480.00	0.09
258	000301	东方盛虹	800	15,472.00	0.09
258	688521	芯原股份	200	15,472.00	0.09
259	601636	旗滨集团	900	15,390.00	0.09
260	601618	中国中冶	4,000	15,320.00	0.09
261	002138	顺络电子	400	15,272.00	0.09
262	002185	华天科技	1,200	15,252.00	0.09
263	300474	景嘉微	100	15,220.00	0.09
264	600141	兴发集团	400	15,152.00	0.09
265	600765	中航重机	300	15,147.00	0.09
266	300058	蓝色光标	1,400	15,022.00	0.09
267	002252	上海莱士	2,200	15,004.00	0.09

268	601168	西部矿业	1,100	14,971.00	0.09
269	002028	思源电气	300	14,763.00	0.09
270	600109	国金证券	1,300	14,729.00	0.09
271	601966	玲珑轮胎	400	14,620.00	0.08
272	601155	新城控股	500	14,565.00	0.08
273	300033	同花顺	100	14,458.00	0.08
274	601838	成都银行	1,200	14,400.00	0.08
275	002180	纳思达	300	14,328.00	0.08
276	000630	铜陵有色	4,100	14,268.00	0.08
277	603589	口子窖	200	14,174.00	0.08
278	000066	中国长城	1,000	14,160.00	0.08
279	600183	生益科技	600	14,130.00	0.08
280	300759	康龙化成	100	14,127.00	0.08
281	600516	方大炭素	1,300	14,066.00	0.08
282	000998	隆平高科	600	13,956.00	0.08
283	600418	江淮汽车	800	13,920.00	0.08
284	002797	第一创业	1,900	13,908.00	0.08
285	603893	瑞芯微	100	13,690.00	0.08
286	600332	白云山	400	13,680.00	0.08
287	603517	绝味食品	200	13,666.00	0.08
288	002080	中材科技	400	13,608.00	0.08
289	300146	汤臣倍健	500	13,480.00	0.08
290	002212	天融信	700	13,419.00	0.08
291	300223	北京君正	100	13,400.00	0.08
292	600362	江西铜业	600	13,398.00	0.08
293	600233	圆通速递	800	13,344.00	0.08
294	000519	中兵红箭	500	13,335.00	0.08
295	000728	国元证券	1,730	13,321.00	0.08
296	002624	完美世界	650	13,201.50	0.08
297	603260	合盛硅业	100	13,197.00	0.08
298	600529	山东药玻	300	13,170.00	0.08
299	600489	中金黄金	1,600	13,168.00	0.08
300	600486	扬农化工	100	13,120.00	0.08
301	601077	渝农商行	3,400	13,090.00	0.08
302	603899	晨光文具	200	12,902.00	0.07
303	300144	宋城演艺	900	12,888.00	0.07
304	688126	沪硅产业	499	12,884.18	0.07
305	688396	华润微	199	12,855.40	0.07
306	600875	东方电气	600	12,852.00	0.07
307	300308	中际旭创	300	12,750.00	0.07
308	000703	恒逸石化	1,200	12,744.00	0.07
309	300136	信维通信	500	12,660.00	0.07

310	300999	金龙鱼	200	12,586.00	0.07
311	600143	金发科技	1,000	12,580.00	0.07
312	000708	中信特钢	600	12,288.00	0.07
313	002120	韵达股份	600	12,276.00	0.07
314	002557	洽洽食品	200	12,272.00	0.07
315	002444	巨星科技	400	12,204.00	0.07
316	002916	深南电路	100	12,182.00	0.07
317	600845	宝信软件	200	12,166.00	0.07
318	000738	航发控制	400	12,112.00	0.07
319	002414	高德红外	500	12,105.00	0.07
319	002673	西部证券	1,500	12,105.00	0.07
320	600733	北汽蓝谷	1,200	12,024.00	0.07
321	000039	中集集团	700	12,012.00	0.07
322	002353	杰瑞股份	300	12,000.00	0.07
323	002568	百润股份	200	11,966.00	0.07
324	601607	上海医药	600	11,922.00	0.07
325	000636	风华高科	400	11,920.00	0.07
326	600705	中航产融	3,000	11,910.00	0.07
327	601990	南京证券	1,200	11,892.00	0.07
328	601878	浙商证券	900	11,862.00	0.07
329	600482	中国动力	600	11,820.00	0.07
330	603833	欧派家居	80	11,800.00	0.07
331	002600	领益智造	1,600	11,776.00	0.07
332	002044	美年健康	1,500	11,775.00	0.07
333	600188	兖矿能源	500	11,765.00	0.07
334	000932	华菱钢铁	2,300	11,753.00	0.07
335	600061	国投资本	1,428	11,738.16	0.07
336	000960	锡业股份	600	11,718.00	0.07
337	600739	辽宁成大	600	11,712.00	0.07
338	000547	航天发展	700	11,690.00	0.07
339	603077	和邦生物	3,400	11,594.00	0.07
340	600161	天坛生物	400	11,584.00	0.07
341	300418	昆仑万维	500	11,575.00	0.07
342	300677	英科医疗	200	11,568.00	0.07
343	688005	容百科技	100	11,558.00	0.07
344	603127	昭衍新药	100	11,543.00	0.07
345	300357	我武生物	200	11,460.00	0.07
346	300724	捷佳伟创	100	11,430.00	0.07
347	002439	启明星辰	400	11,412.00	0.07
348	600872	中炬高新	300	11,391.00	0.07
349	601021	春秋航空	200	11,360.00	0.07
350	002223	鱼跃医疗	300	11,340.00	0.07

350	002507	涪陵榨菜	300	11,340.00	0.07
351	600549	厦门钨业	500	11,315.00	0.07
352	300296	利亚德	1,100	11,275.00	0.07
353	601728	中国电信	2,600	11,258.00	0.06
354	000807	云铝股份	1,000	11,170.00	0.06
355	600079	人福医药	493	11,102.36	0.06
356	601016	节能风电	1,700	11,067.00	0.06
357	603939	益丰药房	200	11,022.00	0.06
358	600699	均胜电子	500	10,985.00	0.06
359	002465	海格通信	1,000	10,920.00	0.06
360	600521	华海药业	500	10,830.00	0.06
361	002508	老板电器	300	10,806.00	0.06
362	603160	汇顶科技	100	10,777.00	0.06
363	601696	中银证券	800	10,760.00	0.06
364	603613	国联股份	100	10,750.00	0.06
365	601689	拓普集团	200	10,600.00	0.06
366	601128	常熟银行	1,600	10,576.00	0.06
367	000739	普洛药业	300	10,527.00	0.06
368	601198	东兴证券	900	10,467.00	0.06
369	002273	水晶光电	600	10,434.00	0.06
370	600988	赤峰黄金	700	10,430.00	0.06
371	600018	上港集团	1,900	10,412.00	0.06
372	600637	东方明珠	1,100	10,395.00	0.06
373	300383	光环新网	700	10,388.00	0.06
374	002030	达安基因	516	10,350.96	0.06
375	002078	太阳纸业	900	10,341.00	0.06
376	600177	雅戈尔	1,500	10,335.00	0.06
377	600642	申能股份	1,400	10,318.00	0.06
378	300866	安克创新	100	10,250.00	0.06
379	600704	物产中大	1,700	10,064.00	0.06
380	600536	中国软件	200	9,986.00	0.06
381	600497	驰宏锌锗	2,000	9,980.00	0.06
382	601216	君正集团	1,900	9,937.00	0.06
383	600879	航天电子	1,200	9,888.00	0.06
384	603218	日月股份	300	9,885.00	0.06
385	600201	生物股份	600	9,810.00	0.06
386	601995	中金公司	200	9,806.00	0.06
387	002603	以岭药业	500	9,800.00	0.06
388	002372	伟星新材	400	9,728.00	0.06
389	601162	天风证券	2,400	9,720.00	0.06
390	002156	通富微电	500	9,715.00	0.06
391	000983	山西焦煤	1,170	9,675.90	0.06

392	002299	圣农发展	400	9,668.00	0.06
393	600039	四川路桥	800	9,632.00	0.06
394	603338	浙江鼎力	120	9,631.20	0.06
395	600027	华电国际	1,800	9,630.00	0.06
396	002092	中泰化学	1,000	9,540.00	0.06
397	600369	西南证券	1,800	9,522.00	0.05
398	002422	科伦药业	500	9,465.00	0.05
399	002056	横店东磁	500	9,435.00	0.05
400	300017	网宿科技	1,400	9,366.00	0.05
401	002131	利欧股份	3,800	9,348.00	0.05
402	600732	爱旭股份	400	9,344.00	0.05
403	000629	攀钢钒钛	2,400	9,336.00	0.05
404	600606	绿地控股	2,145	9,309.30	0.05
405	002739	万达电影	600	9,288.00	0.05
406	600655	豫园股份	900	9,270.00	0.05
407	000623	吉林敖东	500	9,235.00	0.05
408	600803	新奥股份	500	9,180.00	0.05
409	600160	巨化股份	710	9,166.10	0.05
410	000830	鲁西化工	600	9,156.00	0.05
411	000825	太钢不锈	1,300	9,152.00	0.05
412	600580	卧龙电驱	500	9,145.00	0.05
413	000050	深天马 A	700	9,114.00	0.05
413	300168	万达信息	700	9,114.00	0.05
413	601997	贵阳银行	1,400	9,114.00	0.05
414	002191	劲嘉股份	600	9,078.00	0.05
415	002936	郑州银行	2,871	9,072.36	0.05
416	000997	新大陆	500	9,060.00	0.05
417	002683	宏大爆破	300	9,036.00	0.05
418	600170	上海建工	2,500	9,000.00	0.05
419	300251	光线传媒	700	8,995.00	0.05
420	002373	千方科技	600	8,970.00	0.05
421	600372	中航电子	400	8,956.00	0.05
422	600166	福田汽车	2,600	8,944.00	0.05
423	000027	深圳能源	1,100	8,910.00	0.05
424	002572	索菲亚	400	8,880.00	0.05
425	002926	华西证券	900	8,865.00	0.05
426	603392	万泰生物	40	8,860.00	0.05
427	600066	宇通客车	800	8,816.00	0.05
428	688088	虹软科技	200	8,812.00	0.05
429	300630	普利制药	160	8,806.40	0.05
430	002249	大洋电机	1,000	8,790.00	0.05
431	300676	华大基因	100	8,780.00	0.05

432	600867	通化东宝	800	8,768.00	0.05
433	002506	协鑫集成	2,300	8,740.00	0.05
434	000887	中鼎股份	400	8,724.00	0.05
435	002203	海亮股份	700	8,701.00	0.05
436	002157	正邦科技	900	8,694.00	0.05
437	603712	七一二	200	8,660.00	0.05
438	002024	苏宁易购	2,100	8,652.00	0.05
439	300009	安科生物	660	8,639.40	0.05
440	000750	国海证券	2,100	8,631.00	0.05
441	300070	碧水源	1,200	8,628.00	0.05
442	002408	齐翔腾达	820	8,610.00	0.05
443	002065	东华软件	1,100	8,580.00	0.05
444	002266	浙富控股	1,200	8,544.00	0.05
445	603156	养元饮品	300	8,523.00	0.05
446	600909	华安证券	1,570	8,493.70	0.05
447	002002	鸿达兴业	1,400	8,484.00	0.05
447	300212	易华录	240	8,484.00	0.05
448	002985	北摩高科	70	8,432.20	0.05
449	603233	大参林	200	8,422.00	0.05
450	603568	伟明环保	230	8,401.90	0.05
451	600008	首创环保	2,450	8,354.50	0.05
452	002064	华峰化学	800	8,352.00	0.05
453	600236	桂冠电力	1,300	8,346.00	0.05
454	300115	长盈精密	420	8,332.80	0.05
455	002152	广电运通	700	8,330.00	0.05
456	600348	华阳股份	700	8,295.00	0.05
457	002294	信立泰	300	8,196.00	0.05
458	600153	建发股份	900	8,163.00	0.05
459	600118	中国卫星	300	8,145.00	0.05
460	600764	中国海防	200	8,132.00	0.05
461	600859	王府井	300	8,100.00	0.05
461	601933	永辉超市	2,000	8,100.00	0.05
462	600315	上海家化	200	8,082.00	0.05
463	000656	金科股份	1,800	8,064.00	0.05
464	000513	丽珠集团	200	8,042.00	0.05
465	600271	航天信息	600	8,034.00	0.05
466	000970	中科三环	500	8,025.00	0.05
467	000878	云南铜业	600	8,022.00	0.05
468	300618	寒锐钴业	100	8,018.00	0.05
469	300558	贝达药业	100	7,983.00	0.05
470	603707	健友股份	190	7,980.00	0.05
471	000012	南玻 A	800	7,944.00	0.05

472	600535	天士力	500	7,925.00	0.05
473	000021	深科技	500	7,920.00	0.05
473	002500	山西证券	1,200	7,920.00	0.05
474	601699	潞安环能	700	7,917.00	0.05
475	002607	中公教育	1,000	7,860.00	0.05
476	601998	中信银行	1,700	7,854.00	0.05
477	600258	首旅酒店	300	7,839.00	0.05
478	601881	中国银河	700	7,833.00	0.05
479	000400	许继电气	300	7,830.00	0.05
479	300026	红日药业	1,000	7,830.00	0.05
480	300024	机器人	700	7,819.00	0.05
481	600316	洪都航空	200	7,812.00	0.05
482	601005	重庆钢铁	3,700	7,733.00	0.04
483	000975	银泰黄金	880	7,726.40	0.04
484	600801	华新水泥	400	7,720.00	0.04
485	600171	上海贝岭	300	7,698.00	0.04
486	300182	捷成股份	1,200	7,596.00	0.04
487	002127	南极电商	1,100	7,590.00	0.04
488	002745	木林森	500	7,565.00	0.04
489	002221	东华能源	600	7,554.00	0.04
490	601872	招商轮船	1,840	7,544.00	0.04
491	601319	中国人保	1,600	7,520.00	0.04
492	002690	美亚光电	200	7,492.00	0.04
493	002195	二三四五	3,200	7,488.00	0.04
494	688009	中国通号	1,500	7,470.00	0.04
495	300001	特锐德	300	7,461.00	0.04
496	600848	上海临港	500	7,435.00	0.04
497	600998	九州通	500	7,360.00	0.04
498	300315	掌趣科技	1,500	7,290.00	0.04
499	600415	小商品城	1,500	7,275.00	0.04
500	000537	广宇发展	300	7,230.00	0.04
501	600498	烽火通信	400	7,192.00	0.04
502	002250	联化科技	400	7,188.00	0.04
503	603658	安图生物	130	7,157.80	0.04
504	600208	新湖中宝	2,400	7,152.00	0.04
505	000690	宝新能源	1,200	7,104.00	0.04
505	600673	东阳光	800	7,104.00	0.04
506	600863	内蒙华电	1,800	7,092.00	0.04
507	002396	星网锐捷	300	7,071.00	0.04
508	002019	亿帆医药	400	7,048.00	0.04
509	300376	易事特	700	7,035.00	0.04
510	603087	甘李药业	100	7,034.00	0.04

511	000686	东北证券	800	7,024.00	0.04
512	603638	艾迪精密	220	7,022.40	0.04
513	688321	微芯生物	200	7,002.00	0.04
514	600155	华创阳安	700	6,972.00	0.04
515	603198	迎驾贡酒	100	6,945.00	0.04
516	600390	五矿资本	1,300	6,916.00	0.04
517	002505	鹏都农牧	1,800	6,876.00	0.04
518	000060	中金岭南	1,400	6,874.00	0.04
519	600970	中材国际	600	6,858.00	0.04
520	000999	华润三九	200	6,848.00	0.04
520	600500	中化国际	800	6,848.00	0.04
521	600216	浙江医药	400	6,832.00	0.04
522	601866	中远海发	2,100	6,825.00	0.04
523	601778	晶科科技	800	6,824.00	0.04
524	600718	东软集团	500	6,780.00	0.04
525	000729	燕京啤酒	800	6,776.00	0.04
526	002831	裕同科技	200	6,738.00	0.04
527	300244	迪安诊断	200	6,714.00	0.04
528	600985	淮北矿业	600	6,708.00	0.04
529	002511	中顺洁柔	400	6,684.00	0.04
530	600728	佳都科技	800	6,664.00	0.04
531	600839	四川长虹	2,000	6,620.00	0.04
532	600025	华能水电	1,000	6,590.00	0.04
533	600517	国网英大	900	6,561.00	0.04
534	600131	国网信通	300	6,555.00	0.04
535	601992	金隅集团	2,300	6,532.00	0.04
536	000930	中粮科技	600	6,522.00	0.04
537	002532	天山铝业	800	6,520.00	0.04
538	002004	华邦健康	900	6,516.00	0.04
538	002382	蓝帆医疗	400	6,516.00	0.04
539	002048	宁波华翔	300	6,489.00	0.04
540	002939	长城证券	500	6,475.00	0.04
541	600667	太极实业	800	6,464.00	0.04
542	000581	威孚高科	300	6,462.00	0.04
543	601231	环旭电子	400	6,424.00	0.04
544	600380	健康元	500	6,420.00	0.04
545	603225	新风鸣	431	6,400.35	0.04
546	300271	华宇软件	500	6,350.00	0.04
547	300072	三聚环保	800	6,344.00	0.04
548	000540	中天金融	2,400	6,336.00	0.04
549	000990	诚志股份	400	6,328.00	0.04
550	603858	步长制药	300	6,327.00	0.04

551	002153	石基信息	220	6,322.80	0.04
552	000598	兴蓉环境	1,000	6,320.00	0.04
553	600511	国药股份	200	6,306.00	0.04
554	300482	万孚生物	160	6,300.80	0.04
555	002701	奥瑞金	900	6,300.00	0.04
556	600282	南钢股份	1,700	6,290.00	0.04
556	601898	中煤能源	1,000	6,290.00	0.04
557	600329	中新药业	200	6,282.00	0.04
558	002032	苏泊尔	100	6,224.00	0.04
559	600297	广汇汽车	2,300	6,141.00	0.04
560	601179	中国西电	1,100	6,105.00	0.04
561	002174	游族网络	400	6,096.00	0.04
562	002966	苏州银行	900	6,093.00	0.04
563	002010	传化智联	700	6,090.00	0.04
563	600409	三友化工	700	6,090.00	0.04
564	002368	太极股份	220	6,058.80	0.03
565	600158	中体产业	400	6,048.00	0.03
566	600895	张江高科	400	6,024.00	0.03
567	002430	杭氧股份	200	6,002.00	0.03
568	000401	冀东水泥	500	5,980.00	0.03
569	600967	内蒙一机	500	5,975.00	0.03
570	002183	怡亚通	900	5,958.00	0.03
571	002128	电投能源	400	5,940.00	0.03
572	600567	山鹰国际	1,800	5,922.00	0.03
573	600820	隧道股份	1,100	5,918.00	0.03
574	000709	河钢股份	2,400	5,904.00	0.03
575	002434	万里扬	400	5,896.00	0.03
576	300463	迈克生物	200	5,838.00	0.03
577	002075	沙钢股份	1,000	5,830.00	0.03
578	600598	北大荒	400	5,824.00	0.03
579	600782	新钢股份	1,100	5,808.00	0.03
580	601717	郑煤机	500	5,795.00	0.03
581	002958	青农商行	1,500	5,790.00	0.03
582	002925	盈趣科技	170	5,785.10	0.03
583	600755	厦门国贸	800	5,768.00	0.03
584	000883	湖北能源	1,100	5,764.00	0.03
585	002670	国盛金控	600	5,760.00	0.03
586	600528	中铁工业	700	5,747.00	0.03
587	600446	金证股份	400	5,728.00	0.03
588	601236	红塔证券	480	5,721.60	0.03
589	600566	济川药业	200	5,668.00	0.03
590	600737	中粮糖业	600	5,640.00	0.03

591	000778	新兴铸管	1,300	5,629.00	0.03
592	601456	国联证券	400	5,588.00	0.03
593	002595	豪迈科技	200	5,552.00	0.03
594	600022	山东钢铁	3,100	5,549.00	0.03
595	601880	辽港股份	3,200	5,536.00	0.03
596	600572	康恩贝	1,100	5,500.00	0.03
597	601577	长沙银行	700	5,467.00	0.03
598	600507	方大特钢	700	5,460.00	0.03
599	600707	彩虹股份	800	5,456.00	0.03
600	600663	陆家嘴	500	5,430.00	0.03
601	600325	华发股份	900	5,418.00	0.03
602	600060	海信视像	400	5,380.00	0.03
603	600435	北方导航	500	5,340.00	0.03
604	600827	百联股份	400	5,332.00	0.03
605	603885	吉祥航空	300	5,325.00	0.03
606	002233	塔牌集团	500	5,290.00	0.03
607	002124	天邦股份	820	5,280.80	0.03
608	601118	海南橡胶	1,000	5,280.00	0.03
609	000987	越秀金控	600	5,220.00	0.03
609	002146	荣盛发展	1,200	5,220.00	0.03
609	601106	中国一重	1,500	5,220.00	0.03
610	002390	信邦制药	700	5,194.00	0.03
611	002155	湖南黄金	500	5,180.00	0.03
612	000800	一汽解放	500	5,145.00	0.03
613	600021	上海电力	400	5,128.00	0.03
614	600811	东方集团	1,700	5,117.00	0.03
615	603866	桃李面包	180	5,112.00	0.03
616	600906	财达证券	400	5,104.00	0.03
617	000488	晨鸣纸业	700	5,068.00	0.03
618	601200	上海环境	400	5,036.00	0.03
619	603650	彤程新材	100	5,032.00	0.03
620	603605	珀莱雅	24	4,999.44	0.03
621	600373	中文传媒	400	4,944.00	0.03
622	002705	新宝股份	200	4,940.00	0.03
623	600195	中牧股份	377	4,927.39	0.03
624	603927	中科软	180	4,924.80	0.03
625	600259	广晟有色	100	4,924.00	0.03
626	000898	鞍钢股份	1,300	4,875.00	0.03
627	002429	兆驰股份	1,000	4,860.00	0.03
628	600808	马钢股份	1,300	4,797.00	0.03
629	002440	闰土股份	500	4,795.00	0.03
630	300741	华宝股份	100	4,785.00	0.03

631	002110	三钢闽光	700	4,760.00	0.03
632	600026	中远海能	800	4,736.00	0.03
633	601000	唐山港	1,700	4,675.00	0.03
634	600064	南京高科	500	4,670.00	0.03
635	002281	光迅科技	200	4,658.00	0.03
636	002242	九阳股份	200	4,640.00	0.03
636	002387	维信诺	500	4,640.00	0.03
637	000877	天山股份	300	4,593.00	0.03
638	002416	爱施德	400	4,552.00	0.03
639	600908	无锡银行	800	4,536.00	0.03
639	601991	大唐发电	1,400	4,536.00	0.03
640	600167	联美控股	500	4,505.00	0.03
641	601808	中海油服	300	4,500.00	0.03
642	600398	海澜之家	700	4,487.00	0.03
643	601718	际华集团	1,500	4,470.00	0.03
644	601608	中信重工	1,000	4,460.00	0.03
645	000559	万向钱潮	700	4,459.00	0.03
646	000685	中山公用	500	4,425.00	0.03
647	000089	深圳机场	600	4,392.00	0.03
647	002085	万丰奥威	800	4,392.00	0.03
648	000758	中色股份	800	4,368.00	0.03
649	600597	光明乳业	300	4,356.00	0.03
650	600037	歌华有线	500	4,340.00	0.03
651	603000	人民网	300	4,326.00	0.02
652	002038	双鹭药业	400	4,324.00	0.02
653	300166	东方国信	400	4,320.00	0.02
654	002081	金螳螂	700	4,256.00	0.02
654	601333	广深铁路	1,900	4,256.00	0.02
655	000528	柳工	551	4,248.21	0.02
656	000671	阳光城	1,400	4,228.00	0.02
657	000158	常山北明	600	4,152.00	0.02
658	000961	中南建设	1,000	4,140.00	0.02
659	600120	浙江东方	930	4,110.60	0.02
660	000090	天健集团	700	4,109.00	0.02
661	600546	山煤国际	500	4,105.00	0.02
662	000415	渤海租赁	1,400	4,074.00	0.02
663	300133	华策影视	600	4,062.00	0.02
664	300869	康泰医学	100	4,055.00	0.02
665	001914	招商积余	200	4,052.00	0.02
666	601598	中国外运	900	4,032.00	0.02
667	000959	首钢股份	700	4,011.00	0.02
667	600062	华润双鹤	300	4,011.00	0.02

668	603317	天味食品	149	3,994.69	0.02
669	601611	中国核建	400	3,988.00	0.02
670	000402	金融街	700	3,962.00	0.02
670	600376	首开股份	700	3,962.00	0.02
671	600307	酒钢宏兴	1,800	3,960.00	0.02
672	600582	天地科技	900	3,942.00	0.02
673	002563	森马服饰	500	3,865.00	0.02
674	001965	招商公路	500	3,835.00	0.02
675	601098	中南传媒	400	3,828.00	0.02
676	601975	招商南油	1,900	3,819.00	0.02
677	000718	苏宁环球	800	3,768.00	0.02
678	600556	天下秀	300	3,705.00	0.02
679	000028	国药一致	100	3,698.00	0.02
680	000967	盈峰环境	500	3,665.00	0.02
681	603883	老百姓	74	3,654.12	0.02
682	003022	联泓新科	100	3,644.00	0.02
683	600959	江苏有线	1,100	3,619.00	0.02
684	600126	杭钢股份	700	3,591.00	0.02
685	600901	江苏租赁	700	3,563.00	0.02
686	002867	周大生	200	3,556.00	0.02
687	000563	陕国投 A	1,100	3,553.00	0.02
688	600056	中国医药	300	3,543.00	0.02
689	600968	海油发展	1,200	3,516.00	0.02
690	600717	天津港	828	3,469.32	0.02
691	600776	东方通信	300	3,453.00	0.02
691	603228	景旺电子	100	3,453.00	0.02
692	000062	深圳华强	200	3,446.00	0.02
693	601958	金铂股份	500	3,425.00	0.02
694	002399	海普瑞	200	3,420.00	0.02
695	600006	东风汽车	500	3,405.00	0.02
696	002458	益生股份	300	3,393.00	0.02
697	600643	爱建集团	500	3,380.00	0.02
698	002815	崇达技术	200	3,370.00	0.02
699	601860	紫金银行	1,000	3,350.00	0.02
700	600266	城建发展	740	3,330.00	0.02
701	000717	韶钢松山	700	3,325.00	0.02
702	000937	冀中能源	600	3,306.00	0.02
703	601869	长飞光纤	100	3,274.00	0.02
704	002244	滨江集团	700	3,262.00	0.02
705	002423	中粮资本	400	3,240.00	0.02
706	601928	凤凰传媒	400	3,236.00	0.02
707	000869	张裕 A	100	3,186.00	0.02

708	600835	上海机电	200	3,184.00	0.02
709	300257	开山股份	200	3,176.00	0.02
710	600787	中储股份	500	3,120.00	0.02
711	002424	贵州百灵	400	3,040.00	0.02
712	600095	湘财股份	300	3,036.00	0.02
713	600928	西安银行	700	3,010.00	0.02
714	002375	亚厦股份	400	2,996.00	0.02
715	601698	中国卫通	200	2,878.00	0.02
716	600649	城投控股	700	2,877.00	0.02
717	600339	中油工程	900	2,772.00	0.02
718	600623	华谊集团	300	2,730.00	0.02
719	002468	申通快递	300	2,727.00	0.02
720	601139	深圳燃气	300	2,649.00	0.02
721	600648	外高桥	200	2,646.00	0.02
722	000031	大悦城	700	2,611.00	0.02
723	600729	重庆百货	100	2,602.00	0.02
724	600377	宁沪高速	300	2,586.00	0.01
725	601828	美凯龙	290	2,554.90	0.01
726	600639	浦东金桥	200	2,554.00	0.01
727	000156	华数传媒	300	2,538.00	0.01
728	600299	安迪苏	200	2,464.00	0.01
729	002302	西部建设	300	2,409.00	0.01
730	601969	海南矿业	200	2,402.00	0.01
731	600871	石化油服	1,100	2,354.00	0.01
732	601228	广州港	700	2,331.00	0.01
733	603379	三美股份	100	2,278.00	0.01
734	601298	青岛港	400	2,276.00	0.01
735	000046	泛海控股	1,200	2,256.00	0.01
736	601156	东航物流	100	2,188.00	0.01
737	603515	欧普照明	100	2,076.00	0.01
738	603056	德邦股份	200	2,046.00	0.01
739	002653	海思科	100	2,040.00	0.01
740	001872	招商港口	120	2,034.00	0.01
741	600823	世茂股份	600	1,968.00	0.01
742	600657	信达地产	500	1,865.00	0.01
743	002948	青岛银行	400	1,852.00	0.01
744	600956	新天绿能	100	1,721.00	0.01
745	000553	安道麦 A	200	1,688.00	0.01
746	600917	重庆燃气	200	1,678.00	0.01
747	601665	齐鲁银行	300	1,674.00	0.01
748	603708	家家悦	100	1,664.00	0.01
749	600466	蓝光发展	800	1,632.00	0.01

750	601568	北元集团	200	1,626.00	0.01
751	002946	新乳业	100	1,594.00	0.01
752	601003	柳钢股份	300	1,566.00	0.01
753	600350	山东高速	300	1,548.00	0.01
754	001203	大中矿业	100	1,508.00	0.01
755	601187	厦门银行	200	1,380.00	0.01
756	002945	华林证券	100	1,366.00	0.01
757	603355	莱克电气	40	1,172.80	0.01
758	600903	贵州燃气	100	968.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601825	沪农商行	5,529	37,320.75	0.22
2	601921	浙版传媒	662	6,375.06	0.04
3	001209	洪兴股份	160	4,364.80	0.03
4	605069	正和生态	208	3,997.76	0.02
5	001210	金房节能	103	3,655.47	0.02
6	605598	上海港湾	207	3,297.51	0.02
7	605599	菜百股份	205	2,759.30	0.02
8	605566	福莱茵特	65	1,994.85	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	1,878,163.00	4.26
2	000333	美的集团	1,530,383.00	3.47
3	000651	格力电器	961,087.00	2.18
4	002415	海康威视	938,125.00	2.13
5	300059	东方财富	918,227.00	2.08
6	000661	长春高新	880,475.00	2.00
7	000568	泸州老窖	841,127.00	1.91
8	002594	比亚迪	832,886.00	1.89
9	000001	平安银行	818,291.00	1.85
10	000002	万科 A	721,306.00	1.64
11	002714	牧原股份	715,202.00	1.62
12	002475	立讯精密	701,934.00	1.59
13	000725	京东方 A	696,057.00	1.58
14	600519	贵州茅台	661,594.00	1.50
15	300015	爱尔眼科	589,917.00	1.34

16	002371	北方华创	555,442.00	1.26
17	002460	赣锋锂业	551,245.00	1.25
18	002352	顺丰控股	549,342.00	1.25
19	300750	宁德时代	521,484.00	1.18
20	002142	宁波银行	471,431.58	1.07

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

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	2,517,489.44	5.71
2	000333	美的集团	2,028,152.00	4.60
3	000651	格力电器	1,273,720.00	2.89
4	300059	东方财富	1,206,767.20	2.74
5	002415	海康威视	1,155,094.00	2.62
6	002594	比亚迪	1,082,331.00	2.45
7	000568	泸州老窖	1,042,067.91	2.36
8	000001	平安银行	1,022,046.00	2.32
9	000661	长春高新	967,987.00	2.19
10	002475	立讯精密	934,243.01	2.12
11	000002	万科 A	901,936.00	2.04
12	002714	牧原股份	886,272.00	2.01
13	000725	京东方 A	853,693.00	1.94
14	002352	顺丰控股	733,436.00	1.66
15	300015	爱尔眼科	690,600.00	1.57
16	002460	赣锋锂业	678,829.00	1.54
17	600519	贵州茅台	638,303.00	1.45
18	002371	北方华创	615,672.00	1.40
19	002142	宁波银行	581,056.00	1.32
20	300122	智飞生物	573,583.00	1.30

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

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	52,593,500.78
卖出股票收入（成交）总额	63,412,713.37

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

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

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	28,167.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	118.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,286.31

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

无。

§ 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

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 (%)
226	13,951.81	1,919,166.00	60.87	1,233,942.00	39.13

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	中信证券股份有限公司	1,919,166.00	60.87
2	张威	49,961.00	1.58
3	牛旭明	40,000.00	1.27
4	曹辉	39,969.00	1.27
5	周瑾	39,969.00	1.27
6	蔡亚东	37,223.00	1.18

7	朱利权	33,973.00	1.08
8	陶筑平	29,976.00	0.95
9	葛志涛	26,382.00	0.84
10	段群先	25,780.00	0.82

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 6 月 1 日）基 金份额总额	391,080,183.00
本报告期期初基金份额总额	8,153,108.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	23,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,153,108.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

1、基金管理人：

基金管理人于 2021 年 1 月 16 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，王海璐女士自 2021 年 1 月 15 日起不再担任工银瑞信基金管理有限公司总经理，朱碧艳女士自 2021 年 1 月 15 日起代任工银瑞信基金管理有限公司董事长、总经理。

基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，赵桂才先生自 2021 年 2 月 5 日起担任工银瑞信基金管理有限公司董事长，并代任总经理、法定代表人。

基金管理人于 2021 年 7 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告》，赵桂才先生自 2021 年 7 月 6 日起担任工银瑞信基金管理有限公司法定代表人。

基金管理人于 2021 年 7 月 24 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告》，高翀先生自 2021 年 7 月 22 日起担任工银瑞信基金管理有限公司总经理。

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 40,000.00 元，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	4	115,698,733.88	100.00%	82,296.82	100.00%	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并

根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

本报告期内本基金新增东方证券 2 个交易单元。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 16 日
2	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 2 月 6 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 3 月 31 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下	中国证监会规定的媒介	2021 年 5 月 27 日

	上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告		
5	工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 7 月 8 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 7 月 24 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 11 月 17 日
8	工银瑞信基金管理有限公司住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 12 月 21 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210309-20210309, 20210602-20210607, 20210622-20211231	1,547,442.00	22,640,069.00	22,268,345.00	1,919,166.00	60.87
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中, 存在基金规模大幅波动的风险, 以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》的规定, 对《基金合同》和《托管协议》进行了修订, 并在投资范围中增加存托凭证, 修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 3 月 31 日起生效, 详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日