

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|-----------------------------------------|-----------|
| 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 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 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| 7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 58 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 60 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 60 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 60 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 60 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 60 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 60 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 61 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 61 |
| 8 基金份额持有人信息 | 62 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 62 |

| | |
|-----------------------------------------|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 62 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 62 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 63 |
| 9 开放式基金份额变动 | 63 |
| 10 重大事件揭示 | 63 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 63 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 63 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 63 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 64 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 64 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 64 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 64 |
| 10.8 其他重大事件 | 65 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 66 |
| 12 备查文件目录 | 66 |
| 12.1 备查文件目录 | 66 |
| 12.2 存放地点 | 67 |
| 12.3 查阅方式 | 67 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------------|-------------------|
| 基金名称 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银中证 800 指数型发起式 | |
| 基金主代码 | 014226 | |
| 交易代码 | 014226 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 10 月 10 日 | |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 14,043,652.77 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中银中证 800 指数型发起式 A | 中银中证 800 指数型发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 014226 | 014227 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,873,463.45 份 | 3,170,189.32 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 投资策略 | <p>本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，通过提请召开临时投资决策委员会，及时对投资组合进行相应调整。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本基金的标的指数为中证 800 指数。</p> <p>本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%</p> |
| 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 |

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 | | 中银基金管理有限公司 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张家文 | 滕菲菲 |
| | 联系电话 | 021-38848999 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | tengfeifei@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 95558 |
| 传真 | | 021-68873488 | 010-85230024 |
| 注册地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦45层 | 北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 |
| 办公地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层 | 北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100020 |
| 法定代表人 | | 章砚 | 方合英 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中银基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 层 |

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|-------------------|
| | 中银中证 800 指数型发起式 A | 中银中证 800 指数型发起式 C |
| 本期已实现收益 | -55.03 | -2,802.95 |
| 本期利润 | -62,102.69 | -14,767.83 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0057 | -0.0042 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.71% | -0.53% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.75% | -0.96% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 中银中证 800 指数型发起式 A | 中银中证 800 指数型发起式 C |
| 期末可供分配利润 | -2,271,756.19 | -687,884.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2089 | -0.2170 |

| | | |
|---------------------|------------------------------|-------------------|
| 期末基金资产净值 | 8,601,707.26 | 2,482,305.08 |
| 期末基金份额净值 | 0.7911 | 0.7830 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 中银中证 800 指数型发起式 A | 中银中证 800 指数型发起式 C |
| 基金份额累计净值增长率 | -6.25% | -6.91% |

注：1、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。

2、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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）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（已实现部分扣除未实现部分）。

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

中银中证 800 指数型发起式 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -3.12% | 0.51% | -4.02% | 0.54% | 0.90% | -0.03% |
| 过去三个月 | -1.98% | 0.75% | -3.09% | 0.79% | 1.11% | -0.04% |
| 过去六个月 | -0.75% | 0.92% | -1.64% | 0.98% | 0.89% | -0.06% |
| 过去一年 | -9.90% | 0.84% | -11.35% | 0.89% | 1.45% | -0.05% |
| 自基金合同生效日起 | -6.25% | 0.85% | -9.64% | 0.89% | 3.39% | -0.04% |

中银中证 800 指数型发起式 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -3.17% | 0.52% | -4.02% | 0.54% | 0.85% | -0.02% |
| 过去三个月 | -2.09% | 0.75% | -3.09% | 0.79% | 1.00% | -0.04% |
| 过去六个月 | -0.96% | 0.92% | -1.64% | 0.98% | 0.68% | -0.06% |
| 过去一年 | -10.26% | 0.84% | -11.35% | 0.89% | 1.09% | -0.05% |
| 自基金合同生效日起 | -6.91% | 0.85% | -9.64% | 0.89% | 2.73% | -0.04% |

3.2.2 自基金转型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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 10 月 10 日至 2024 年 6 月 30 日)

中银中证 800 指数型发起式 A



中银中证 800 指数型发起式 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中银基金管理有限公司,由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理(英国)有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司,致力于长期参与中国基金业的发展,努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2024 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等一百余只开放式证券投资基金,同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 赵建忠 | 基金经理 | 2021-12-07 | - | 18 | 中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),金融学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司,曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015年6月至今任中银中证100基金基金经理,2015年6月至今任国企ETF基金基金经理,2015年6月至今任中银300E基金基金经理,2016年8月至2018年2月任中银宏利基金基金经理,2016年8月至2018年2月任中银丰利基金基金经理,2020年4月至2024年6月任中银100基金基金经理,2020年7月至2022年8月任中银800基金基金经理,2020年8月至今任中银黄金基金基金经理,2020年9月至今任中银上海金ETF联接基金基金经理,2020年11月至2024年2月任中银中证100ETF联接基金基金经理,2021年12月至今任中银中证800基金(原目标ETF基金)基金经理,2024年3月至今任中银中证央企红利50基金基金经理。具备基金、期货从业资格。 |

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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。

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

1、宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家通胀多回落，经济动能在限制性利率水平下趋弱。美国通胀波动回落，经济动能有所减弱，失业率升高，6 月 CPI 同比较 2023 年 12 月回落 0.4 个百分点至 3.0%，6 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 1.4 个百分点至 48.5%，6 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月回落 1.7 个百分点至 48.8%，6 月失业率较 2023 年 12 月抬升 0.4 个百分点至 4.1%，美联储在上半年维持政策目标利率在 5.5% 高位不变。欧元区经济表现分化，服务业表现依然好于制造业，5 月失业率较 2023 年 12 月回落 0.1 个百分点至 6.0%，6 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月回升 1.4 个百分点至 45.8%，6 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 4.0 个百分点至 52.8%，欧央行在 6 月转为降息、当月降息 25bps。日本经济延续复苏不过斜率偏慢，通胀小幅抬升，6 月 CPI 同比较 2023 年 12 月抬升 0.2 个百分点至 2.8%，6 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月回升 2.1 个百分点至 50.0%，6 月服务业 PMI

较 2023 年 12 月回落 2.1 个百分点至 49.4%，日本央行退出负利率政策。综合来看，全球经济下半年仍有一定下行压力，在欧央行开启降息周期后，美联储货币政策也有望转向放松。

国内经济方面，经济内生修复动能仍待提振，国内经济数据边际走弱，出口与制造业韧性较强，基建投资与消费走弱，地产维持负增长，CPI 与 PPI 在低位徘徊。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 在荣枯线附近波动，6 月值较 2023 年 12 月值走高 0.5 个百分点至 49.5%，同步指标工业增加值 6 月同比增长 5.3%，较 2023 年 12 月回落 1.5 个百分点。从经济增长动力来看，出口仍有韧性，而投资与消费均走弱：6 月美元计价出口增速较 2023 年 12 月回升 6.5 个百分点至 8.6%，6 月社会消费品零售总额增速较 2023 年 12 月回落 5.4 个百分点至 2.0%，基建投资走弱，制造业投资提振，房地产投资延续负增长，1-6 月固定资产投资增速较 2023 年末回升 0.9 个百分点至 3.9%。通胀方面，CPI 维持在低位，6 月同比增速从 2023 年 12 月的-0.3%小幅提振 0.5 个百分点至 0.2%，PPI 负值收窄，6 月同比增速从 2023 年 12 月的-2.7%回升 1.9 个百分点至-0.8%。

2、行情回顾

年初市场信心走弱、地缘风险上升叠加公募基金赎回压力大、雪球产品敲入等因素共振，各大指数下跌较多。2 月受到汇金等资金增持和监管政策的利好影响，流动性带来的冲击被逐步消化，市场在春节前开始呈现触底反弹的态势；再加上 AI 领域的催化，市场情绪转好。期间强势的红利和成长板块有所回调，而两会政策相关的机会和受益于内外需改善的板块表现相对较好。5 月中旬以来基本面预期下修，三季度外需可能回落，叠加投资者担心国内高频经济数据反映出的需求不振和对政策效果的疑虑，市场持续调整。从风格来看，大盘价值相对占优。从各行业来看，银行（17.02%）、煤炭（11.96%）、公用事业（11.76%）等行业表现较好，综合（-33.34%）、计算机（-24.88%）、商贸零售（-24.59%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为-1.52%；中证 100 涨跌幅 1.44%；上证国企指数涨跌幅 7.81%，中证 800 指数涨跌-1.76%，央企红利 50 指数涨跌 11.07%。

3. 运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.75%，同期业绩比较基准收益率为-1.64%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-0.96%，同期业绩比较基准收益率为-1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A 股市场预计将在构建底部形态的同时，展现结构性投资机会。市场整体估值合

理，建议投资者关注大市值、低估值企业；科技板块因政策支持和新质生产力的推动，有望成为增长点。同时也需警惕企业盈利不及预期、海外市场波动以及政策落地效果的不确定性。在资产荒背景下，红利板块的稳定股息和潜在资本利得使其成为重要的配置方向。出海板块和科技产业链也因应全球经济形势和国内政策导向而受到关注。

本基金将严格按照契约规定，采用完全复制投资策略，被动跟踪指数，保持跟踪误差在较小范围内。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，力争为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由基金运营、风险管理、研究及投资相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。当改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，会计师事务所应对基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本报告期末 A 类基金份额可供分配利润为-2,271,756.19 元,C 类基金份额可供分配利润为-687,884.24 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无需要说明的相关情况。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害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

本托管人认为，中银基金管理有限公司在中银中证 800 指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 470,543.74 | 492,462.61 |
| 结算备付金 | | 8,384.51 | 6,247.19 |
| 存出保证金 | 6.4.7.2 | 1,471.33 | 532.28 |
| 交易性金融资产 | | 10,679,169.07 | 10,748,409.44 |
| 其中：股票投资 | | 10,070,004.30 | 10,137,525.71 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 609,164.77 | 610,883.73 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 212,453.62 | 137,549.79 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 11,372,022.27 | 11,385,201.31 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 129,686.31 | 0.01 |
| 应付赎回款 | | 138,471.89 | 125,826.29 |
| 应付管理人报酬 | | 4,244.49 | 4,092.12 |
| 应付托管费 | | 471.62 | 454.69 |
| 应付销售服务费 | | 896.89 | 717.98 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 14,238.73 | 31,991.05 |
| 负债合计 | | 288,009.93 | 163,082.14 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 14,043,652.77 | 14,104,987.63 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -2,959,640.43 | -2,882,868.46 |
| 净资产合计 | | 11,084,012.34 | 11,222,119.17 |
| 负债和净资产总计 | | 11,372,022.27 | 11,385,201.31 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 14,043,652.77 份，其中 A 类基金份额净值 0.7911 元，基金份额 10,873,463.45 份；C 类基金份额净值 0.7830 元，基金份额 3,170,189.32 份。

6.2 利润表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 |
|----|-----|-----------------------|----------------------------|
|----|-----|-----------------------|----------------------------|

| | | 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|-------------------|------------------|
| 一、营业总收入 | | -32,236.31 | 92,760.47 |
| 1.利息收入 | | 711.18 | 754.74 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 711.18 | 754.74 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 40,864.11 | 90,411.09 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -93,296.92 | -22,183.50 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 5,538.80 | 6,739.62 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 128,622.23 | 105,854.97 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -74,012.54 | 813.58 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 200.94 | 781.06 |
| 减：二、营业总支出 | | 44,634.21 | 40,607.94 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 25,693.72 | 22,241.15 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 2,854.88 | 2,471.26 |
| 3. 销售服务费 | | 5,526.15 | 693.66 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 10,559.46 | 15,201.87 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -76,870.52 | 52,152.53 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -76,870.52 | 52,152.53 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -76,870.52 | 52,152.53 |

6.3 净资产变动表

会计主体：中银中证 800 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 14,104,987.63 | - | -2,882,868.46 | 11,222,119.17 |
| 二、本期期初净资产 | 14,104,987.63 | - | -2,882,868.46 | 11,222,119.17 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -61,334.86 | - | -76,771.97 | -138,106.83 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -76,870.52 | -76,870.52 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -61,334.86 | - | 98.55 | -61,236.31 |
| 其中：1.基金申购款 | 32,674,487.38 | - | -6,585,654.16 | 26,088,833.22 |
| 2.基金赎回款 | -32,735,822.24 | - | 6,585,752.71 | -26,150,069.53 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 14,043,652.77 | - | -2,959,640.43 | 11,084,012.34 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 10,645,657.17 | - | -1,382,123.84 | 9,263,533.33 |
| 二、本期期初净资产 | 10,645,657.17 | - | -1,382,123.84 | 9,263,533.33 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 653,556.68 | - | 587.00 | 654,143.68 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 52,152.53 | 52,152.53 |
| （二）、本期基金 | 653,556.68 | - | -51,565.53 | 601,991.15 |

| | | | | |
|------------------------------------------|---------------|---|---------------|--------------|
| 份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 1,287,193.65 | - | -115,007.47 | 1,172,186.18 |
| 2.基金赎回款 | -633,636.97 | - | 63,441.94 | -570,195.03 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 11,299,213.85 | - | -1,381,536.84 | 9,917,677.01 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银中证 800 指数型发起式证券投资基金是根据原中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金以下简称“中银中证 800 ETF 联接基金”)《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定，由原中银中证 800 ETF 联接基金转型而来。中银中证 800 ETF 联接基金主要投资于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF 基金”)，目标 ETF 基金于 2022 年 7 月 21 日触发基金合同终止条款，根据《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定，目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止，中银中证 800 ETF 联接基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。本基金的基金管理人中银基金管理有限公司经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，自 2022 年 10 月 10 日将中银中证 800 ETF 联接基金转型为“中银中证 800 指数型发起式证券投资基金”(以下简称“本基金”)，《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金可少量投资于其他股票(包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，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)。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。本基金的投资组合比例为：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%；投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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：标的指数收益率 X 95%+银行人民币活期存款利率(税后) X 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相

关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

(3) 债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日

计提；

(4) 处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(7) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(8) 公允价值变动收益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；

(9) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 470,543.74 |
| 等于：本金 | 470,513.93 |
| 加：应计利息 | 29.81 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 470,543.74 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | | 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|--------|-----------------|----------|---------------|-------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 10,924,314.61 | - | 10,070,004.30 | -854,310.31 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 601,192.00 | 7,934.77 | 609,164.77 | 38.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 601,192.00 | 7,934.77 | 609,164.77 | 38.00 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 11,525,506.61 | 7,934.77 | 10,679,169.07 | -854,272.31 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 4,294.25 |
| 其中：交易所市场 | 4,294.25 |
| 银行间市场 | - |

| | |
|-------|-----------|
| 应付利息 | - |
| 应付审计费 | 9,944.48 |
| 合计 | 14,238.73 |

6.4.7.7 实收基金

中银中证 800 指数型发起式 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 10,842,742.74 | 10,842,742.74 |
| 本期申购 | 180,184.32 | 180,184.32 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -149,463.61 | -149,463.61 |
| 本期末 | 10,873,463.45 | 10,873,463.45 |

中银中证 800 指数型发起式 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,262,244.89 | 3,262,244.89 |
| 本期申购 | 32,494,303.06 | 32,494,303.06 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -32,586,358.63 | -32,586,358.63 |
| 本期末 | 3,170,189.32 | 3,170,189.32 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

中银中证 800 指数型发起式 A

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 | -1,470,833.40 | -728,912.13 | -2,199,745.53 |
| 本期期初 | -1,470,833.40 | -728,912.13 | -2,199,745.53 |
| 本期利润 | -55.03 | -62,047.66 | -62,102.69 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,330.42 | -5,577.55 | -9,907.97 |
| 其中：基金申购款 | -24,737.98 | -15,275.81 | -40,013.79 |
| 基金赎回款 | 20,407.56 | 9,698.26 | 30,105.82 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,475,218.85 | -796,537.34 | -2,271,756.19 |

中银中证 800 指数型发起式 C

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 | -464,715.47 | -218,407.46 | -683,122.93 |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初 | -464,715.47 | -218,407.46 | -683,122.93 |
| 本期利润 | -2,802.95 | -11,964.88 | -14,767.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 10,772.83 | -766.31 | 10,006.52 |
| 其中：基金申购款 | -4,691,171.34 | -1,854,469.03 | -6,545,640.37 |
| 基金赎回款 | 4,701,944.17 | 1,853,702.72 | 6,555,646.89 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -456,745.59 | -231,138.65 | -687,884.24 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 658.01 |
| 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 | 44.80 |
| 其他 | 8.37 |
| 合计 | 711.18 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 3,759,521.98 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,844,440.86 |
| 减：交易费用 | 8,378.04 |
| 买卖股票差价收入 | -93,296.92 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 6,835.03 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,296.23 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 5,538.80 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 613,532.80 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 601,519.00 |
| 减：应计利息总额 | 13,310.02 |
| 减：交易费用 | 0.01 |
| 买卖债券差价收入 | -1,296.23 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 128,622.23 |
| 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 | 128,622.23 |

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -74,012.54 |
| ——股票投资 | -74,999.54 |
| ——债券投资 | 987.00 |
| ——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 | -74,012.54 |

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 185.77 |
| 基金转换费收入 | 15.17 |
| 合计 | 200.94 |

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 9,944.48 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 613.50 |
| 其他 | 1.48 |
| 合计 | 10,559.46 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 中银基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中信银行股份有限公司（“中信银行”） | 基金托管人 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月 30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 25,693.72 | 22,241.15 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,968.64 | 652.81 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 22,725.08 | 21,588.34 |

注：支付基金管理人中银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.45% 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 × 0.45% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月 30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,854.88 | 2,471.26 |

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
|----------------|---------------------------------|-----------------------|--------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中银中证 800 指数型 发起式 A | 中银中证 800 指数型发起 式 C | 合计 |
| 中银基金管理有限公司 | - | 822.01 | 822.01 |
| 合计 | - | 822.01 | 822.01 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中银中证800指数型 发起式A | 中银中证800指数型发起 式C | 合计 |
| 中银基金管理有限公司 | - | 81.71 | 81.71 |

| | | | |
|----|---|-------|-------|
| 合计 | - | 81.71 | 81.71 |
|----|---|-------|-------|

注：A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金管理有限公司，再由中银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|-----------------------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
| | 中银中证800指数型 发起式A | 中银中证800指数型 发起式C | 中银中证800指数型 发起式A | 中银中证800指数型 发起式C |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - | 10,000,000.00 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - | 10,000,000.00 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 91.97% | - | 92.90% | - |

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

(2) 本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最
新公告规定的费率结构。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|------------|----------------------|--------|----------------------|--------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信银行股份有限公司 | 470,543.74 | 658.01 | 403,765.56 | 728.92 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有 9,100 股基金管理人控股股东中国银行股份有限公司的 A 股普通股
(2023 年 6 月 30 日:7,300 股), 市值占本基金资产净值的比例为 0.38%(2023 年 6 月 30 日:0.29%);
本基金持有 700 股受基金管理人控股股东中国银行股份有限公司重大影响的中银国际证券股份有限
公司的 A 股普通股(2023 年 6 月 30 日: 600 股), 市值占本基金资产净值的比例为 0.06%(2023
年 6 月 30 日: 0.06%); 本基金持有 1,300 股基金托管人中信银行股份有限公司的 A 股普通股(2023
年 6 月 30 日: 1,100 股), 市值占本基金资产净值的比例为 0.08%(2023 年 6 月 30 日: 0.07%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2024 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的

债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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。同时，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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|-------|-------|-------|-----|----|
|-----|-------|-------|-------|-----|----|

| 2024 年 6 月 30 日 | | | | | |
|-----------------------------|--------------|-------|--------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 470,543.74 | - | - | - | 470,543.74 |
| 结算备付金 | 8,384.51 | - | - | - | 8,384.51 |
| 存出保证金 | 1,471.33 | - | - | - | 1,471.33 |
| 交易性金融资产 | 609,164.77 | - | - | 10,070,004.30 | 10,679,169.07 |
| 应收申购款 | 199.98 | - | - | 212,253.64 | 212,453.62 |
| 资产总计 | 1,089,764.33 | - | - | 10,282,257.94 | 11,372,022.27 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 129,686.31 | 129,686.31 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 138,471.89 | 138,471.89 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,244.49 | 4,244.49 |
| 应付托管费 | - | - | - | 471.62 | 471.62 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 896.89 | 896.89 |
| 其他负债 | - | - | - | 14,238.73 | 14,238.73 |
| 负债总计 | - | - | - | 288,009.93 | 288,009.93 |
| 利率敏感度缺口 | 1,089,764.33 | - | - | 9,994,248.01 | 11,084,012.34 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 492,462.61 | - | - | - | 492,462.61 |
| 结算备付金 | 6,247.19 | - | - | - | 6,247.19 |
| 存出保证金 | 532.28 | - | - | - | 532.28 |
| 交易性金融资产 | 610,683.72 | - | 200.01 | 10,137,525.71 | 10,748,409.44 |
| 应收申购款 | - | - | - | 137,549.79 | 137,549.79 |
| 资产总计 | 1,109,925.80 | - | 200.01 | 10,275,075.50 | 11,385,201.31 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 0.01 | 0.01 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 125,826.29 | 125,826.29 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,092.12 | 4,092.12 |
| 应付托管费 | - | - | - | 454.69 | 454.69 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 717.98 | 717.98 |
| 其他负债 | - | - | - | 31,991.05 | 31,991.05 |
| 负债总计 | - | - | - | 163,082.14 | 163,082.14 |
| 利率敏感度缺口 | 1,109,925.80 | - | 200.01 | 10,111,993.36 | 11,222,119.17 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 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 | 10,070,004.30 | 90.85 | 10,137,525.71 | 90.34 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 10,070,004.30 | 90.85 | 10,137,525.71 | 90.34 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------------|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 增加约 53 | 增加约 54 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | 减少约 53 | 减少约 54 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 10,070,004.30 | 10,137,525.71 |
| 第二层次 | 609,164.77 | 610,883.73 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 10,679,169.07 | 10,748,409.44 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 10,070,004.30 | 88.55 |
| | 其中：股票 | 10,070,004.30 | 88.55 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 609,164.77 | 5.36 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：债券 | 609,164.77 | 5.36 |
| | 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 | 478,928.25 | 4.21 |
| 8 | 其他各项资产 | 213,924.95 | 1.88 |
| 9 | 合计 | 11,372,022.27 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 111,012.00 | 1.00 |
| B | 采矿业 | 575,305.50 | 5.19 |
| C | 制造业 | 5,536,365.60 | 49.95 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 472,134.00 | 4.26 |
| E | 建筑业 | 200,232.20 | 1.81 |
| F | 批发和零售业 | 77,296.04 | 0.70 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 340,790.00 | 3.07 |
| H | 住宿和餐饮业 | 8,301.00 | 0.07 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 463,980.76 | 4.19 |
| J | 金融业 | 1,935,538.80 | 17.46 |
| K | 房地产业 | 99,624.00 | 0.90 |
| L | 租赁和商务服务业 | 79,295.00 | 0.72 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 74,320.80 | 0.67 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 9,979.00 | 0.09 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|---------------|-------|
| P | 教育 | 3,060.00 | 0.03 |
| Q | 卫生和社会工作 | 36,953.60 | 0.33 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 40,888.00 | 0.37 |
| S | 综合 | 4,928.00 | 0.04 |
| | 合计 | 10,070,004.30 | 90.85 |

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------|------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 300 | 440,217.00 | 3.97 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 1,100 | 198,033.00 | 1.79 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 4,600 | 190,256.00 | 1.72 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 5,400 | 184,626.00 | 1.67 |
| 5 | 600900 | 长江电力 | 5,300 | 153,276.00 | 1.38 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 2,100 | 135,450.00 | 1.22 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 6,800 | 119,476.00 | 1.08 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 6,200 | 109,244.00 | 0.99 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 800 | 102,432.00 | 0.92 |
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 400 | 100,100.00 | 0.90 |
| 11 | 601328 | 交通银行 | 11,700 | 87,399.00 | 0.79 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 300 | 87,273.00 | 0.79 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 2,200 | 86,482.00 | 0.78 |
| 14 | 601398 | 工商银行 | 14,600 | 83,220.00 | 0.75 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 1,900 | 74,518.00 | 0.67 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 4,000 | 72,920.00 | 0.66 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 2,700 | 69,768.00 | 0.63 |
| 18 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,800 | 69,228.00 | 0.62 |
| 19 | 600309 | 万华化学 | 800 | 64,688.00 | 0.58 |
| 20 | 000725 | 京东方 A | 15,700 | 64,213.00 | 0.58 |
| 21 | 601288 | 农业银行 | 13,300 | 57,988.00 | 0.52 |
| 22 | 300308 | 中际旭创 | 420 | 57,909.60 | 0.52 |
| 23 | 601088 | 中国神华 | 1,300 | 57,681.00 | 0.52 |
| 24 | 601816 | 京沪高铁 | 10,600 | 56,922.00 | 0.51 |
| 25 | 300059 | 东方财富 | 5,240 | 55,334.40 | 0.50 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 26 | 601857 | 中国石油 | 4,900 | 50,568.00 | 0.46 |
| 27 | 002415 | 海康威视 | 1,600 | 49,456.00 | 0.45 |
| 28 | 600690 | 海尔智家 | 1,700 | 48,246.00 | 0.44 |
| 29 | 002714 | 牧原股份 | 1,100 | 47,960.00 | 0.43 |
| 30 | 601668 | 中国建筑 | 9,000 | 47,790.00 | 0.43 |
| 31 | 300498 | 温氏股份 | 2,400 | 47,568.00 | 0.43 |
| 32 | 600919 | 江苏银行 | 6,300 | 46,809.00 | 0.42 |
| 33 | 601138 | 工业富联 | 1,700 | 46,580.00 | 0.42 |
| 34 | 601985 | 中国核电 | 4,200 | 44,772.00 | 0.40 |
| 35 | 601225 | 陕西煤业 | 1,700 | 43,809.00 | 0.40 |
| 36 | 000568 | 泸州老窖 | 300 | 43,047.00 | 0.39 |
| 37 | 600941 | 中国移动 | 400 | 43,000.00 | 0.39 |
| 38 | 600031 | 三一重工 | 2,600 | 42,900.00 | 0.39 |
| 39 | 000001 | 平安银行 | 4,200 | 42,630.00 | 0.38 |
| 40 | 601728 | 中国电信 | 6,900 | 42,435.00 | 0.38 |
| 41 | 600809 | 山西汾酒 | 200 | 42,176.00 | 0.38 |
| 42 | 601988 | 中国银行 | 9,100 | 42,042.00 | 0.38 |
| 43 | 601919 | 中远海控 | 2,700 | 41,823.00 | 0.38 |
| 44 | 601601 | 中国太保 | 1,500 | 41,790.00 | 0.38 |
| 45 | 600000 | 浦发银行 | 5,000 | 41,150.00 | 0.37 |
| 46 | 300124 | 汇川技术 | 800 | 41,040.00 | 0.37 |
| 47 | 600406 | 国电南瑞 | 1,640 | 40,934.40 | 0.37 |
| 48 | 600150 | 中国船舶 | 1,000 | 40,710.00 | 0.37 |
| 49 | 000792 | 盐湖股份 | 2,300 | 40,135.00 | 0.36 |
| 50 | 600028 | 中国石化 | 6,300 | 39,816.00 | 0.36 |
| 51 | 603501 | 韦尔股份 | 400 | 39,748.00 | 0.36 |
| 52 | 002352 | 顺丰控股 | 1,100 | 39,259.00 | 0.35 |
| 53 | 603259 | 药明康德 | 1,000 | 39,190.00 | 0.35 |
| 54 | 000063 | 中兴通讯 | 1,400 | 39,158.00 | 0.35 |
| 55 | 601766 | 中国中车 | 5,200 | 39,052.00 | 0.35 |
| 56 | 601169 | 北京银行 | 6,600 | 38,544.00 | 0.35 |
| 57 | 600050 | 中国联通 | 8,200 | 38,540.00 | 0.35 |
| 58 | 000338 | 潍柴动力 | 2,300 | 37,352.00 | 0.34 |
| 59 | 300274 | 阳光电源 | 600 | 37,218.00 | 0.34 |
| 60 | 688981 | 中芯国际 | 800 | 36,880.00 | 0.33 |
| 61 | 601012 | 隆基绿能 | 2,600 | 36,452.00 | 0.33 |
| 62 | 600837 | 海通证券 | 4,200 | 35,952.00 | 0.32 |
| 63 | 000100 | TCL 科技 | 8,300 | 35,856.00 | 0.32 |
| 64 | 600016 | 民生银行 | 9,200 | 34,868.00 | 0.31 |
| 65 | 002230 | 科大讯飞 | 800 | 34,360.00 | 0.31 |
| 66 | 600660 | 福耀玻璃 | 700 | 33,530.00 | 0.30 |
| 67 | 002371 | 北方华创 | 100 | 31,989.00 | 0.29 |
| 68 | 300502 | 新易盛 | 300 | 31,665.00 | 0.29 |
| 69 | 601229 | 上海银行 | 4,300 | 31,218.00 | 0.28 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 70 | 002142 | 宁波银行 | 1,400 | 30,884.00 | 0.28 |
| 71 | 600089 | 特变电工 | 2,220 | 30,791.40 | 0.28 |
| 72 | 600938 | 中国海油 | 900 | 29,700.00 | 0.27 |
| 73 | 600104 | 上汽集团 | 2,100 | 29,106.00 | 0.26 |
| 74 | 601390 | 中国中铁 | 4,400 | 28,688.00 | 0.26 |
| 75 | 603986 | 兆易创新 | 300 | 28,686.00 | 0.26 |
| 76 | 688012 | 中微公司 | 200 | 28,252.00 | 0.25 |
| 77 | 000625 | 长安汽车 | 2,100 | 28,203.00 | 0.25 |
| 78 | 688041 | 海光信息 | 400 | 28,128.00 | 0.25 |
| 79 | 601600 | 中国铝业 | 3,600 | 27,468.00 | 0.25 |
| 80 | 601688 | 华泰证券 | 2,200 | 27,258.00 | 0.25 |
| 81 | 601006 | 大秦铁路 | 3,800 | 27,208.00 | 0.25 |
| 82 | 600048 | 保利发展 | 3,100 | 27,156.00 | 0.25 |
| 83 | 600905 | 三峡能源 | 6,200 | 27,032.00 | 0.24 |
| 84 | 002027 | 分众传媒 | 4,300 | 26,058.00 | 0.24 |
| 85 | 601211 | 国泰君安 | 1,900 | 25,745.00 | 0.23 |
| 86 | 600886 | 国投电力 | 1,400 | 25,536.00 | 0.23 |
| 87 | 603993 | 洛阳钼业 | 3,000 | 25,500.00 | 0.23 |
| 88 | 601818 | 光大银行 | 8,000 | 25,360.00 | 0.23 |
| 89 | 600019 | 宝钢股份 | 3,800 | 25,270.00 | 0.23 |
| 90 | 601989 | 中国重工 | 5,100 | 25,143.00 | 0.23 |
| 91 | 601888 | 中国中免 | 400 | 24,996.00 | 0.23 |
| 92 | 603019 | 中科曙光 | 600 | 24,900.00 | 0.22 |
| 93 | 601658 | 邮储银行 | 4,900 | 24,843.00 | 0.22 |
| 94 | 002304 | 洋河股份 | 300 | 24,222.00 | 0.22 |
| 95 | 603288 | 海天味业 | 700 | 24,129.00 | 0.22 |
| 96 | 600585 | 海螺水泥 | 1,000 | 23,590.00 | 0.21 |
| 97 | 600795 | 国电电力 | 3,900 | 23,361.00 | 0.21 |
| 98 | 600438 | 通威股份 | 1,200 | 22,932.00 | 0.21 |
| 99 | 688008 | 澜起科技 | 400 | 22,864.00 | 0.21 |
| 100 | 601009 | 南京银行 | 2,200 | 22,858.00 | 0.21 |
| 101 | 000938 | 紫光股份 | 1,000 | 22,350.00 | 0.20 |
| 102 | 600999 | 招商证券 | 1,600 | 22,256.00 | 0.20 |
| 103 | 601939 | 建设银行 | 3,000 | 22,200.00 | 0.20 |
| 104 | 600893 | 航发动力 | 600 | 21,930.00 | 0.20 |
| 105 | 601628 | 中国人寿 | 700 | 21,735.00 | 0.20 |
| 106 | 605499 | 东鹏饮料 | 100 | 21,575.00 | 0.19 |
| 107 | 000002 | 万科 A | 3,100 | 21,483.00 | 0.19 |
| 108 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,080 | 21,465.60 | 0.19 |
| 109 | 000425 | 徐工机械 | 3,000 | 21,450.00 | 0.19 |
| 110 | 600011 | 华能国际 | 2,200 | 21,164.00 | 0.19 |
| 111 | 000596 | 古井贡酒 | 100 | 21,107.00 | 0.19 |
| 112 | 600436 | 片仔癀 | 100 | 20,717.00 | 0.19 |
| 113 | 601669 | 中国电建 | 3,700 | 20,683.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 114 | 000538 | 云南白药 | 400 | 20,460.00 | 0.18 |
| 115 | 002028 | 思源电气 | 300 | 20,070.00 | 0.18 |
| 116 | 300014 | 亿纬锂能 | 500 | 19,960.00 | 0.18 |
| 117 | 600015 | 华夏银行 | 3,100 | 19,840.00 | 0.18 |
| 118 | 600926 | 杭州银行 | 1,500 | 19,575.00 | 0.18 |
| 119 | 002241 | 歌尔股份 | 1,000 | 19,510.00 | 0.18 |
| 120 | 600489 | 中金黄金 | 1,300 | 19,240.00 | 0.17 |
| 121 | 600547 | 山东黄金 | 700 | 19,166.00 | 0.17 |
| 122 | 002050 | 三花智控 | 1,000 | 19,080.00 | 0.17 |
| 123 | 600584 | 长电科技 | 600 | 19,026.00 | 0.17 |
| 124 | 003816 | 中国广核 | 4,100 | 18,983.00 | 0.17 |
| 125 | 600111 | 北方稀土 | 1,100 | 18,920.00 | 0.17 |
| 126 | 002179 | 中航光电 | 490 | 18,644.50 | 0.17 |
| 127 | 000157 | 中联重科 | 2,400 | 18,432.00 | 0.17 |
| 128 | 601916 | 浙商银行 | 6,500 | 17,940.00 | 0.16 |
| 129 | 600958 | 东方证券 | 2,300 | 17,480.00 | 0.16 |
| 130 | 000166 | 申万宏源 | 4,000 | 17,240.00 | 0.16 |
| 131 | 002252 | 上海莱士 | 2,200 | 17,204.00 | 0.16 |
| 132 | 601186 | 中国铁建 | 2,000 | 17,140.00 | 0.15 |
| 133 | 600760 | 中航沈飞 | 420 | 16,842.00 | 0.15 |
| 134 | 001979 | 招商蛇口 | 1,900 | 16,701.00 | 0.15 |
| 135 | 600029 | 南方航空 | 2,800 | 16,492.00 | 0.15 |
| 136 | 300433 | 蓝思科技 | 900 | 16,425.00 | 0.15 |
| 137 | 601901 | 方正证券 | 2,100 | 16,233.00 | 0.15 |
| 138 | 600009 | 上海机场 | 500 | 16,125.00 | 0.15 |
| 139 | 601800 | 中国交建 | 1,800 | 16,092.00 | 0.15 |
| 140 | 600426 | 华鲁恒升 | 600 | 15,984.00 | 0.14 |
| 141 | 600010 | 包钢股份 | 11,400 | 15,960.00 | 0.14 |
| 142 | 002938 | 鹏鼎控股 | 400 | 15,904.00 | 0.14 |
| 143 | 000776 | 广发证券 | 1,300 | 15,821.00 | 0.14 |
| 144 | 002049 | 紫光国微 | 300 | 15,780.00 | 0.14 |
| 145 | 601377 | 兴业证券 | 3,100 | 15,686.00 | 0.14 |
| 146 | 600989 | 宝丰能源 | 900 | 15,597.00 | 0.14 |
| 147 | 300782 | 卓胜微 | 200 | 15,548.00 | 0.14 |
| 148 | 600066 | 宇通客车 | 600 | 15,480.00 | 0.14 |
| 149 | 002648 | 卫星化学 | 860 | 15,462.80 | 0.14 |
| 150 | 002493 | 荣盛石化 | 1,600 | 15,456.00 | 0.14 |
| 151 | 300122 | 智飞生物 | 550 | 15,416.50 | 0.14 |
| 152 | 601058 | 赛轮轮胎 | 1,100 | 15,400.00 | 0.14 |
| 153 | 002001 | 新和成 | 800 | 15,360.00 | 0.14 |
| 154 | 600346 | 恒力石化 | 1,100 | 15,345.00 | 0.14 |
| 155 | 600674 | 川投能源 | 800 | 15,000.00 | 0.14 |
| 156 | 000786 | 北新建材 | 500 | 14,830.00 | 0.13 |
| 157 | 600188 | 兖矿能源 | 650 | 14,774.50 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 158 | 300408 | 三环集团 | 500 | 14,595.00 | 0.13 |
| 159 | 600600 | 青岛啤酒 | 200 | 14,554.00 | 0.13 |
| 160 | 000977 | 浪潮信息 | 400 | 14,548.00 | 0.13 |
| 161 | 000768 | 中航西飞 | 600 | 14,418.00 | 0.13 |
| 162 | 601868 | 中国能建 | 6,800 | 14,416.00 | 0.13 |
| 163 | 601872 | 招商轮船 | 1,700 | 14,365.00 | 0.13 |
| 164 | 002460 | 赣锋锂业 | 500 | 14,325.00 | 0.13 |
| 165 | 002311 | 海大集团 | 300 | 14,115.00 | 0.13 |
| 166 | 600233 | 圆通速递 | 900 | 14,085.00 | 0.13 |
| 167 | 000630 | 铜陵有色 | 3,900 | 14,079.00 | 0.13 |
| 168 | 600115 | 中国东航 | 3,500 | 14,035.00 | 0.13 |
| 169 | 601111 | 中国国航 | 1,900 | 14,022.00 | 0.13 |
| 170 | 002236 | 大华股份 | 900 | 13,914.00 | 0.13 |
| 171 | 603369 | 今世缘 | 300 | 13,860.00 | 0.13 |
| 172 | 601360 | 三六零 | 1,800 | 13,824.00 | 0.12 |
| 173 | 300896 | 爱美客 | 80 | 13,768.00 | 0.12 |
| 174 | 600157 | 永泰能源 | 11,600 | 13,688.00 | 0.12 |
| 175 | 601077 | 渝农商行 | 2,700 | 13,554.00 | 0.12 |
| 176 | 002340 | 格林美 | 2,100 | 13,377.00 | 0.12 |
| 177 | 603799 | 华友钴业 | 600 | 13,278.00 | 0.12 |
| 178 | 601117 | 中国化学 | 1,600 | 13,184.00 | 0.12 |
| 179 | 600741 | 华域汽车 | 800 | 13,104.00 | 0.12 |
| 180 | 002601 | 龙佰集团 | 700 | 12,999.00 | 0.12 |
| 181 | 300418 | 昆仑万维 | 400 | 12,896.00 | 0.12 |
| 182 | 601633 | 长城汽车 | 500 | 12,650.00 | 0.11 |
| 183 | 601168 | 西部矿业 | 700 | 12,565.00 | 0.11 |
| 184 | 000423 | 东阿阿胶 | 200 | 12,520.00 | 0.11 |
| 185 | 002384 | 东山精密 | 600 | 12,420.00 | 0.11 |
| 186 | 300394 | 天孚通信 | 140 | 12,378.80 | 0.11 |
| 187 | 000983 | 山西焦煤 | 1,200 | 12,372.00 | 0.11 |
| 188 | 600570 | 恒生电子 | 700 | 12,362.00 | 0.11 |
| 189 | 002129 | TCL 中环 | 1,425 | 12,326.25 | 0.11 |
| 190 | 000807 | 云铝股份 | 900 | 12,159.00 | 0.11 |
| 191 | 601838 | 成都银行 | 800 | 12,152.00 | 0.11 |
| 192 | 000933 | 神火股份 | 600 | 12,138.00 | 0.11 |
| 193 | 688223 | 晶科能源 | 1,700 | 12,070.00 | 0.11 |
| 194 | 601336 | 新华保险 | 400 | 12,012.00 | 0.11 |
| 195 | 000988 | 华工科技 | 400 | 11,972.00 | 0.11 |
| 196 | 600372 | 中航机载 | 1,000 | 11,970.00 | 0.11 |
| 197 | 002466 | 天齐锂业 | 400 | 11,964.00 | 0.11 |
| 198 | 300751 | 迈为股份 | 100 | 11,948.00 | 0.11 |
| 199 | 601995 | 中金公司 | 400 | 11,844.00 | 0.11 |
| 200 | 600161 | 天坛生物 | 480 | 11,712.00 | 0.11 |
| 201 | 601788 | 光大证券 | 800 | 11,696.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 202 | 601066 | 中信建投 | 600 | 11,544.00 | 0.10 |
| 203 | 600085 | 同仁堂 | 300 | 11,463.00 | 0.10 |
| 204 | 600988 | 赤峰黄金 | 700 | 11,438.00 | 0.10 |
| 205 | 600219 | 南山铝业 | 3,000 | 11,430.00 | 0.10 |
| 206 | 600023 | 浙能电力 | 1,600 | 11,376.00 | 0.10 |
| 207 | 688777 | 中控技术 | 300 | 11,310.00 | 0.10 |
| 208 | 600745 | 闻泰科技 | 400 | 11,300.00 | 0.10 |
| 209 | 002223 | 鱼跃医疗 | 300 | 11,280.00 | 0.10 |
| 210 | 601021 | 春秋航空 | 200 | 11,266.00 | 0.10 |
| 211 | 601799 | 星宇股份 | 100 | 11,204.00 | 0.10 |
| 212 | 002156 | 通富微电 | 500 | 11,195.00 | 0.10 |
| 213 | 601233 | 桐昆股份 | 700 | 11,172.00 | 0.10 |
| 214 | 000963 | 华东医药 | 400 | 11,124.00 | 0.10 |
| 215 | 002271 | 东方雨虹 | 900 | 11,106.00 | 0.10 |
| 216 | 600418 | 江淮汽车 | 700 | 11,088.00 | 0.10 |
| 217 | 600398 | 海澜之家 | 1,200 | 11,088.00 | 0.10 |
| 218 | 600885 | 宏发股份 | 400 | 11,072.00 | 0.10 |
| 219 | 000999 | 华润三九 | 260 | 11,070.80 | 0.10 |
| 220 | 600196 | 复星医药 | 500 | 11,070.00 | 0.10 |
| 221 | 600176 | 中国巨石 | 1,000 | 11,050.00 | 0.10 |
| 222 | 600588 | 用友网络 | 1,100 | 11,000.00 | 0.10 |
| 223 | 601699 | 潞安环能 | 600 | 10,878.00 | 0.10 |
| 224 | 300661 | 圣邦股份 | 130 | 10,761.40 | 0.10 |
| 225 | 601689 | 拓普集团 | 200 | 10,722.00 | 0.10 |
| 226 | 001965 | 招商公路 | 900 | 10,674.00 | 0.10 |
| 227 | 601577 | 长沙银行 | 1,300 | 10,634.00 | 0.10 |
| 228 | 600845 | 宝信软件 | 332 | 10,600.76 | 0.10 |
| 229 | 002916 | 深南电路 | 100 | 10,577.00 | 0.10 |
| 230 | 002180 | 纳思达 | 400 | 10,568.00 | 0.10 |
| 231 | 002128 | 电投能源 | 500 | 10,550.00 | 0.10 |
| 232 | 600183 | 生益科技 | 500 | 10,530.00 | 0.10 |
| 233 | 002353 | 杰瑞股份 | 300 | 10,524.00 | 0.09 |
| 234 | 601567 | 三星医疗 | 300 | 10,500.00 | 0.09 |
| 235 | 002736 | 国信证券 | 1,200 | 10,428.00 | 0.09 |
| 236 | 002625 | 光启技术 | 600 | 10,410.00 | 0.09 |
| 237 | 600027 | 华电国际 | 1,500 | 10,410.00 | 0.09 |
| 238 | 605117 | 德业股份 | 140 | 10,407.60 | 0.09 |
| 239 | 300033 | 同花顺 | 100 | 10,370.00 | 0.09 |
| 240 | 000400 | 许继电气 | 300 | 10,323.00 | 0.09 |
| 241 | 002273 | 水晶光电 | 600 | 10,188.00 | 0.09 |
| 242 | 600985 | 淮北矿业 | 600 | 10,044.00 | 0.09 |
| 243 | 601555 | 东吴证券 | 1,700 | 10,030.00 | 0.09 |
| 244 | 601898 | 中煤能源 | 800 | 9,984.00 | 0.09 |
| 245 | 601128 | 常熟银行 | 1,300 | 9,841.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 246 | 601881 | 中国银河 | 900 | 9,774.00 | 0.09 |
| 247 | 002078 | 太阳纸业 | 700 | 9,765.00 | 0.09 |
| 248 | 603606 | 东方电缆 | 200 | 9,762.00 | 0.09 |
| 249 | 002966 | 苏州银行 | 1,300 | 9,750.00 | 0.09 |
| 250 | 300347 | 泰格医药 | 200 | 9,720.00 | 0.09 |
| 251 | 600096 | 云天化 | 500 | 9,710.00 | 0.09 |
| 252 | 688126 | 沪硅产业 | 700 | 9,667.00 | 0.09 |
| 253 | 601618 | 中国中冶 | 3,100 | 9,610.00 | 0.09 |
| 254 | 002074 | 国轩高科 | 500 | 9,575.00 | 0.09 |
| 255 | 601607 | 上海医药 | 500 | 9,555.00 | 0.09 |
| 256 | 002517 | 恺英网络 | 1,000 | 9,550.00 | 0.09 |
| 257 | 601877 | 正泰电器 | 500 | 9,530.00 | 0.09 |
| 258 | 000895 | 双汇发展 | 400 | 9,508.00 | 0.09 |
| 259 | 600362 | 江西铜业 | 400 | 9,472.00 | 0.09 |
| 260 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,100 | 9,449.00 | 0.09 |
| 261 | 600026 | 中远海能 | 600 | 9,366.00 | 0.08 |
| 262 | 601100 | 恒立液压 | 200 | 9,316.00 | 0.08 |
| 263 | 300866 | 安克创新 | 130 | 9,257.30 | 0.08 |
| 264 | 601108 | 财通证券 | 1,400 | 9,254.00 | 0.08 |
| 265 | 600875 | 东方电气 | 500 | 9,225.00 | 0.08 |
| 266 | 603392 | 万泰生物 | 140 | 9,223.20 | 0.08 |
| 267 | 002459 | 晶澳科技 | 820 | 9,184.00 | 0.08 |
| 268 | 000661 | 长春高新 | 100 | 9,177.00 | 0.08 |
| 269 | 000876 | 新希望 | 1,000 | 9,140.00 | 0.08 |
| 270 | 002555 | 三七互娱 | 700 | 9,135.00 | 0.08 |
| 271 | 300496 | 中科创达 | 200 | 9,118.00 | 0.08 |
| 272 | 002738 | 中矿资源 | 340 | 9,112.00 | 0.08 |
| 273 | 300207 | 欣旺达 | 600 | 9,102.00 | 0.08 |
| 274 | 600873 | 梅花生物 | 900 | 9,018.00 | 0.08 |
| 275 | 002185 | 华天科技 | 1,100 | 8,965.00 | 0.08 |
| 276 | 300699 | 光威复材 | 360 | 8,938.80 | 0.08 |
| 277 | 002532 | 天山铝业 | 1,100 | 8,921.00 | 0.08 |
| 278 | 600415 | 小商品城 | 1,200 | 8,904.00 | 0.08 |
| 279 | 300003 | 乐普医疗 | 600 | 8,904.00 | 0.08 |
| 280 | 601717 | 郑煤机 | 600 | 8,880.00 | 0.08 |
| 281 | 300628 | 亿联网络 | 240 | 8,824.80 | 0.08 |
| 282 | 600332 | 白云山 | 300 | 8,799.00 | 0.08 |
| 283 | 600515 | 海南机场 | 2,800 | 8,792.00 | 0.08 |
| 284 | 002709 | 天赐材料 | 500 | 8,780.00 | 0.08 |
| 285 | 000301 | 东方盛虹 | 1,100 | 8,767.00 | 0.08 |
| 286 | 601998 | 中信银行 | 1,300 | 8,710.00 | 0.08 |
| 287 | 002920 | 德赛西威 | 100 | 8,709.00 | 0.08 |
| 288 | 300017 | 网宿科技 | 1,100 | 8,690.00 | 0.08 |
| 289 | 600025 | 华能水电 | 800 | 8,624.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 290 | 300316 | 晶盛机电 | 300 | 8,619.00 | 0.08 |
| 291 | 603290 | 斯达半导 | 100 | 8,611.00 | 0.08 |
| 292 | 600079 | 人福医药 | 500 | 8,585.00 | 0.08 |
| 293 | 601878 | 浙商证券 | 800 | 8,576.00 | 0.08 |
| 294 | 600879 | 航天电子 | 1,100 | 8,547.00 | 0.08 |
| 295 | 600177 | 雅戈尔 | 1,200 | 8,544.00 | 0.08 |
| 296 | 002739 | 万达电影 | 700 | 8,463.00 | 0.08 |
| 297 | 600298 | 安琪酵母 | 300 | 8,379.00 | 0.08 |
| 298 | 002008 | 大族激光 | 400 | 8,320.00 | 0.08 |
| 299 | 600803 | 新奥股份 | 400 | 8,320.00 | 0.08 |
| 300 | 300450 | 先导智能 | 500 | 8,315.00 | 0.08 |
| 301 | 000733 | 振华科技 | 200 | 8,306.00 | 0.07 |
| 302 | 600109 | 国金证券 | 1,100 | 8,305.00 | 0.07 |
| 303 | 002138 | 顺络电子 | 300 | 8,238.00 | 0.07 |
| 304 | 600038 | 中直股份 | 200 | 8,222.00 | 0.07 |
| 305 | 300999 | 金龙鱼 | 300 | 8,205.00 | 0.07 |
| 306 | 600765 | 中航重机 | 400 | 8,160.00 | 0.07 |
| 307 | 002432 | 九安医疗 | 200 | 8,108.00 | 0.07 |
| 308 | 002202 | 金风科技 | 1,200 | 8,064.00 | 0.07 |
| 309 | 600497 | 驰宏锌锗 | 1,500 | 8,010.00 | 0.07 |
| 310 | 000932 | 华菱钢铁 | 1,800 | 7,974.00 | 0.07 |
| 311 | 600348 | 华阳股份 | 800 | 7,968.00 | 0.07 |
| 312 | 300142 | 沃森生物 | 700 | 7,966.00 | 0.07 |
| 313 | 600642 | 申能股份 | 900 | 7,947.00 | 0.07 |
| 314 | 002007 | 华兰生物 | 500 | 7,895.00 | 0.07 |
| 315 | 300136 | 信维通信 | 400 | 7,832.00 | 0.07 |
| 316 | 000009 | 中国宝安 | 900 | 7,740.00 | 0.07 |
| 317 | 601238 | 广汽集团 | 1,000 | 7,740.00 | 0.07 |
| 318 | 600039 | 四川路桥 | 980 | 7,732.20 | 0.07 |
| 319 | 301269 | 华大九天 | 100 | 7,705.00 | 0.07 |
| 320 | 601990 | 南京证券 | 1,000 | 7,680.00 | 0.07 |
| 321 | 688122 | 西部超导 | 200 | 7,664.00 | 0.07 |
| 322 | 002850 | 科达利 | 100 | 7,638.00 | 0.07 |
| 323 | 002595 | 豪迈科技 | 200 | 7,634.00 | 0.07 |
| 324 | 600563 | 法拉电子 | 100 | 7,618.00 | 0.07 |
| 325 | 000831 | 中国稀土 | 300 | 7,605.00 | 0.07 |
| 326 | 600529 | 山东药玻 | 300 | 7,602.00 | 0.07 |
| 327 | 000683 | 远兴能源 | 1,100 | 7,601.00 | 0.07 |
| 328 | 601615 | 明阳智能 | 800 | 7,552.00 | 0.07 |
| 329 | 600862 | 中航高科 | 400 | 7,512.00 | 0.07 |
| 330 | 688396 | 华润微 | 200 | 7,488.00 | 0.07 |
| 331 | 000878 | 云南铜业 | 600 | 7,476.00 | 0.07 |
| 332 | 002281 | 光迅科技 | 200 | 7,474.00 | 0.07 |
| 333 | 000513 | 丽珠集团 | 200 | 7,442.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 334 | 300759 | 康龙化成 | 400 | 7,432.00 | 0.07 |
| 335 | 603345 | 安井食品 | 100 | 7,431.00 | 0.07 |
| 336 | 002673 | 西部证券 | 1,200 | 7,428.00 | 0.07 |
| 337 | 600060 | 海信视像 | 300 | 7,422.00 | 0.07 |
| 338 | 002444 | 巨星科技 | 300 | 7,410.00 | 0.07 |
| 339 | 000039 | 中集集团 | 800 | 7,408.00 | 0.07 |
| 340 | 689009 | 九号公司 | 200 | 7,362.00 | 0.07 |
| 341 | 600486 | 扬农化工 | 130 | 7,338.50 | 0.07 |
| 342 | 002465 | 海格通信 | 700 | 7,252.00 | 0.07 |
| 343 | 002155 | 湖南黄金 | 400 | 7,240.00 | 0.07 |
| 344 | 601179 | 中国西电 | 900 | 7,236.00 | 0.07 |
| 345 | 300144 | 宋城演艺 | 900 | 7,227.00 | 0.07 |
| 346 | 002984 | 森麒麟 | 300 | 7,227.00 | 0.07 |
| 347 | 002436 | 兴森科技 | 700 | 7,224.00 | 0.07 |
| 348 | 000408 | 藏格矿业 | 300 | 7,221.00 | 0.07 |
| 349 | 601319 | 中国人保 | 1,400 | 7,210.00 | 0.07 |
| 350 | 600839 | 四川长虹 | 1,600 | 7,184.00 | 0.06 |
| 351 | 002797 | 第一创业 | 1,400 | 7,126.00 | 0.06 |
| 352 | 002262 | 恩华药业 | 300 | 7,122.00 | 0.06 |
| 353 | 603939 | 益丰药房 | 288 | 7,070.40 | 0.06 |
| 354 | 301236 | 软通动力 | 200 | 7,042.00 | 0.06 |
| 355 | 300012 | 华测检测 | 700 | 7,042.00 | 0.06 |
| 356 | 600460 | 士兰微 | 400 | 7,004.00 | 0.06 |
| 357 | 000066 | 中国长城 | 800 | 7,000.00 | 0.06 |
| 358 | 600018 | 上港集团 | 1,200 | 6,936.00 | 0.06 |
| 359 | 600549 | 厦门钨业 | 400 | 6,900.00 | 0.06 |
| 360 | 600536 | 中国软件 | 230 | 6,881.60 | 0.06 |
| 361 | 603160 | 汇顶科技 | 100 | 6,875.00 | 0.06 |
| 362 | 300073 | 当升科技 | 200 | 6,862.00 | 0.06 |
| 363 | 601997 | 贵阳银行 | 1,300 | 6,851.00 | 0.06 |
| 364 | 600521 | 华海药业 | 400 | 6,820.00 | 0.06 |
| 365 | 600872 | 中炬高新 | 300 | 6,807.00 | 0.06 |
| 366 | 300054 | 鼎龙股份 | 300 | 6,804.00 | 0.06 |
| 367 | 600918 | 中泰证券 | 1,200 | 6,804.00 | 0.06 |
| 368 | 688599 | 天合光能 | 400 | 6,768.00 | 0.06 |
| 369 | 300832 | 新产业 | 100 | 6,744.00 | 0.06 |
| 370 | 601666 | 平煤股份 | 600 | 6,720.00 | 0.06 |
| 371 | 600118 | 中国卫星 | 300 | 6,669.00 | 0.06 |
| 372 | 000728 | 国元证券 | 1,100 | 6,666.00 | 0.06 |
| 373 | 688297 | 中无人机 | 200 | 6,606.00 | 0.06 |
| 374 | 002472 | 双环传动 | 300 | 6,606.00 | 0.06 |
| 375 | 688009 | 中国通号 | 1,100 | 6,600.00 | 0.06 |
| 376 | 002821 | 凯莱英 | 100 | 6,580.00 | 0.06 |
| 377 | 601162 | 天风证券 | 3,000 | 6,540.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 378 | 600863 | 内蒙华电 | 1,400 | 6,496.00 | 0.06 |
| 379 | 300002 | 神州泰岳 | 800 | 6,496.00 | 0.06 |
| 380 | 603816 | 顾家家居 | 200 | 6,458.00 | 0.06 |
| 381 | 002064 | 华峰化学 | 900 | 6,453.00 | 0.06 |
| 382 | 000921 | 海信家电 | 200 | 6,448.00 | 0.06 |
| 383 | 601198 | 东兴证券 | 800 | 6,368.00 | 0.06 |
| 384 | 002407 | 多氟多 | 520 | 6,359.60 | 0.06 |
| 385 | 601696 | 中银证券 | 700 | 6,356.00 | 0.06 |
| 386 | 600566 | 济川药业 | 200 | 6,342.00 | 0.06 |
| 387 | 002812 | 恩捷股份 | 200 | 6,330.00 | 0.06 |
| 388 | 300474 | 景嘉微 | 100 | 6,323.00 | 0.06 |
| 389 | 301358 | 湖南裕能 | 200 | 6,292.00 | 0.06 |
| 390 | 002409 | 雅克科技 | 100 | 6,291.00 | 0.06 |
| 391 | 000783 | 长江证券 | 1,300 | 6,279.00 | 0.06 |
| 392 | 688385 | 复旦微电 | 200 | 6,276.00 | 0.06 |
| 393 | 002195 | 岩山科技 | 2,500 | 6,275.00 | 0.06 |
| 394 | 300413 | 芒果超媒 | 300 | 6,270.00 | 0.06 |
| 395 | 300487 | 蓝晓科技 | 150 | 6,264.00 | 0.06 |
| 396 | 603899 | 晨光股份 | 200 | 6,256.00 | 0.06 |
| 397 | 688778 | 厦钨新能 | 200 | 6,248.00 | 0.06 |
| 398 | 300601 | 康泰生物 | 400 | 6,244.00 | 0.06 |
| 399 | 600061 | 国投资本 | 1,100 | 6,215.00 | 0.06 |
| 400 | 000960 | 锡业股份 | 400 | 6,196.00 | 0.06 |
| 401 | 600511 | 国药股份 | 200 | 6,158.00 | 0.06 |
| 402 | 300395 | 菲利华 | 200 | 6,150.00 | 0.06 |
| 403 | 603659 | 璞泰来 | 435 | 6,146.55 | 0.06 |
| 404 | 002603 | 以岭药业 | 400 | 6,132.00 | 0.06 |
| 405 | 688036 | 传音控股 | 80 | 6,123.20 | 0.06 |
| 406 | 601000 | 唐山港 | 1,300 | 6,110.00 | 0.06 |
| 407 | 601156 | 东航物流 | 300 | 6,105.00 | 0.06 |
| 408 | 600369 | 西南证券 | 1,700 | 6,086.00 | 0.05 |
| 409 | 300979 | 华利集团 | 100 | 6,085.00 | 0.05 |
| 410 | 000617 | 中油资本 | 1,100 | 6,072.00 | 0.05 |
| 411 | 600132 | 重庆啤酒 | 100 | 6,070.00 | 0.05 |
| 412 | 000021 | 深科技 | 400 | 6,048.00 | 0.05 |
| 413 | 603338 | 浙江鼎力 | 100 | 6,042.00 | 0.05 |
| 414 | 300001 | 特锐德 | 300 | 6,036.00 | 0.05 |
| 415 | 601865 | 福莱特 | 300 | 6,030.00 | 0.05 |
| 416 | 600970 | 中材国际 | 500 | 6,030.00 | 0.05 |
| 417 | 000738 | 航发控制 | 300 | 6,021.00 | 0.05 |
| 418 | 300058 | 蓝色光标 | 1,100 | 5,984.00 | 0.05 |
| 419 | 002410 | 广联达 | 620 | 5,939.60 | 0.05 |
| 420 | 600021 | 上海电力 | 600 | 5,934.00 | 0.05 |
| 421 | 600699 | 均胜电子 | 400 | 5,928.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 422 | 603893 | 瑞芯微 | 100 | 5,917.00 | 0.05 |
| 423 | 002841 | 视源股份 | 200 | 5,906.00 | 0.05 |
| 424 | 000519 | 中兵红箭 | 400 | 5,868.00 | 0.05 |
| 425 | 600546 | 山煤国际 | 400 | 5,848.00 | 0.05 |
| 426 | 600612 | 老凤祥 | 100 | 5,819.00 | 0.05 |
| 427 | 688180 | 君实生物 | 200 | 5,810.00 | 0.05 |
| 428 | 000830 | 鲁西化工 | 500 | 5,795.00 | 0.05 |
| 429 | 600129 | 太极集团 | 200 | 5,784.00 | 0.05 |
| 430 | 603806 | 福斯特 | 392 | 5,762.40 | 0.05 |
| 431 | 600141 | 兴发集团 | 300 | 5,724.00 | 0.05 |
| 432 | 300037 | 新宙邦 | 200 | 5,712.00 | 0.05 |
| 433 | 601059 | 信达证券 | 400 | 5,684.00 | 0.05 |
| 434 | 000703 | 恒逸石化 | 800 | 5,672.00 | 0.05 |
| 435 | 002558 | 巨人网络 | 600 | 5,664.00 | 0.05 |
| 436 | 000591 | 太阳能 | 1,200 | 5,652.00 | 0.05 |
| 437 | 300567 | 精测电子 | 100 | 5,651.00 | 0.05 |
| 438 | 600704 | 物产中大 | 1,300 | 5,642.00 | 0.05 |
| 439 | 688002 | 睿创微纳 | 200 | 5,594.00 | 0.05 |
| 440 | 600380 | 健康元 | 500 | 5,585.00 | 0.05 |
| 441 | 300919 | 中伟股份 | 180 | 5,578.20 | 0.05 |
| 442 | 000997 | 新大陆 | 400 | 5,564.00 | 0.05 |
| 443 | 600895 | 张江高科 | 300 | 5,544.00 | 0.05 |
| 444 | 300223 | 北京君正 | 100 | 5,544.00 | 0.05 |
| 445 | 601216 | 君正集团 | 1,500 | 5,535.00 | 0.05 |
| 446 | 601966 | 玲珑轮胎 | 300 | 5,511.00 | 0.05 |
| 447 | 600282 | 南钢股份 | 1,100 | 5,478.00 | 0.05 |
| 448 | 600637 | 东方明珠 | 900 | 5,472.00 | 0.05 |
| 449 | 603596 | 伯特利 | 140 | 5,446.00 | 0.05 |
| 450 | 300529 | 健帆生物 | 200 | 5,442.00 | 0.05 |
| 451 | 300604 | 长川科技 | 200 | 5,434.00 | 0.05 |
| 452 | 000708 | 中信特钢 | 400 | 5,428.00 | 0.05 |
| 453 | 300146 | 汤臣倍健 | 400 | 5,420.00 | 0.05 |
| 454 | 600998 | 九州通 | 1,108 | 5,407.04 | 0.05 |
| 455 | 600763 | 通策医疗 | 100 | 5,405.00 | 0.05 |
| 456 | 300724 | 捷佳伟创 | 100 | 5,401.00 | 0.05 |
| 457 | 002385 | 大北农 | 1,400 | 5,390.00 | 0.05 |
| 458 | 300677 | 英科医疗 | 200 | 5,362.00 | 0.05 |
| 459 | 000623 | 吉林敖东 | 400 | 5,360.00 | 0.05 |
| 460 | 600153 | 建发股份 | 600 | 5,358.00 | 0.05 |
| 461 | 603833 | 欧派家居 | 100 | 5,356.00 | 0.05 |
| 462 | 300285 | 国瓷材料 | 300 | 5,355.00 | 0.05 |
| 463 | 688521 | 芯原股份 | 200 | 5,350.00 | 0.05 |
| 464 | 002294 | 信立泰 | 200 | 5,326.00 | 0.05 |
| 465 | 600583 | 海油工程 | 900 | 5,319.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 466 | 600155 | 华创云信 | 900 | 5,319.00 | 0.05 |
| 467 | 000729 | 燕京啤酒 | 600 | 5,298.00 | 0.05 |
| 468 | 002044 | 美年健康 | 1,400 | 5,292.00 | 0.05 |
| 469 | 600143 | 金发科技 | 800 | 5,288.00 | 0.05 |
| 470 | 000723 | 美锦能源 | 1,100 | 5,236.00 | 0.05 |
| 471 | 002152 | 广电运通 | 500 | 5,230.00 | 0.05 |
| 472 | 600820 | 隧道股份 | 800 | 5,224.00 | 0.05 |
| 473 | 000636 | 风华高科 | 400 | 5,224.00 | 0.05 |
| 474 | 002439 | 启明星辰 | 300 | 5,178.00 | 0.05 |
| 475 | 600516 | 方大炭素 | 1,200 | 5,172.00 | 0.05 |
| 476 | 600392 | 盛和资源 | 600 | 5,172.00 | 0.05 |
| 477 | 300088 | 长信科技 | 1,100 | 5,170.00 | 0.05 |
| 478 | 601808 | 中海油服 | 300 | 5,160.00 | 0.05 |
| 479 | 002831 | 裕同科技 | 200 | 5,118.00 | 0.05 |
| 480 | 002958 | 青农商行 | 1,900 | 5,092.00 | 0.05 |
| 481 | 600008 | 首创环保 | 1,900 | 5,092.00 | 0.05 |
| 482 | 601016 | 节能风电 | 1,700 | 5,083.00 | 0.05 |
| 483 | 300383 | 光环新网 | 600 | 5,070.00 | 0.05 |
| 484 | 600131 | 国网信通 | 300 | 5,061.00 | 0.05 |
| 485 | 600499 | 科达制造 | 600 | 5,058.00 | 0.05 |
| 486 | 603979 | 金诚信 | 100 | 5,053.00 | 0.05 |
| 487 | 300454 | 深信服 | 100 | 5,053.00 | 0.05 |
| 488 | 600909 | 华安证券 | 1,200 | 5,052.00 | 0.05 |
| 489 | 300765 | 新诺威 | 200 | 5,046.00 | 0.05 |
| 490 | 300251 | 光线传媒 | 600 | 5,046.00 | 0.05 |
| 491 | 600535 | 天士力 | 400 | 5,032.00 | 0.05 |
| 492 | 600867 | 通化东宝 | 600 | 5,022.00 | 0.05 |
| 493 | 000629 | 钒钛股份 | 2,000 | 5,000.00 | 0.05 |
| 494 | 601933 | 永辉超市 | 2,000 | 4,960.00 | 0.04 |
| 495 | 000750 | 国海证券 | 1,700 | 4,947.00 | 0.04 |
| 496 | 600673 | 东阳光 | 700 | 4,928.00 | 0.04 |
| 497 | 300568 | 星源材质 | 600 | 4,920.00 | 0.04 |
| 498 | 000998 | 隆平高科 | 500 | 4,915.00 | 0.04 |
| 499 | 601665 | 齐鲁银行 | 1,000 | 4,910.00 | 0.04 |
| 500 | 300024 | 机器人 | 500 | 4,870.00 | 0.04 |
| 501 | 600580 | 卧龙电驱 | 400 | 4,860.00 | 0.04 |
| 502 | 000893 | 亚钾国际 | 300 | 4,848.00 | 0.04 |
| 503 | 300118 | 东方日升 | 400 | 4,840.00 | 0.04 |
| 504 | 300957 | 贝泰妮 | 100 | 4,832.00 | 0.04 |
| 505 | 601456 | 国联证券 | 500 | 4,820.00 | 0.04 |
| 506 | 601991 | 大唐发电 | 1,600 | 4,816.00 | 0.04 |
| 507 | 601231 | 环旭电子 | 300 | 4,815.00 | 0.04 |
| 508 | 002429 | 兆驰股份 | 1,000 | 4,810.00 | 0.04 |
| 509 | 000883 | 湖北能源 | 800 | 4,808.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 510 | 600737 | 中粮糖业 | 500 | 4,795.00 | 0.04 |
| 511 | 300442 | 润泽科技 | 200 | 4,790.00 | 0.04 |
| 512 | 603883 | 老百姓 | 260 | 4,773.60 | 0.04 |
| 513 | 688819 | 天能股份 | 200 | 4,772.00 | 0.04 |
| 514 | 600498 | 烽火通信 | 300 | 4,770.00 | 0.04 |
| 515 | 600004 | 白云机场 | 500 | 4,740.00 | 0.04 |
| 516 | 600170 | 上海建工 | 2,200 | 4,730.00 | 0.04 |
| 517 | 600166 | 福田汽车 | 2,100 | 4,725.00 | 0.04 |
| 518 | 688561 | 奇安信 | 200 | 4,724.00 | 0.04 |
| 519 | 603486 | 科沃斯 | 100 | 4,718.00 | 0.04 |
| 520 | 600732 | 爱旭股份 | 520 | 4,706.00 | 0.04 |
| 521 | 603225 | 新凤鸣 | 300 | 4,677.00 | 0.04 |
| 522 | 603260 | 合盛硅业 | 100 | 4,671.00 | 0.04 |
| 523 | 000060 | 中金岭南 | 1,100 | 4,664.00 | 0.04 |
| 524 | 688005 | 容百科技 | 200 | 4,656.00 | 0.04 |
| 525 | 002756 | 永兴材料 | 130 | 4,651.40 | 0.04 |
| 526 | 002025 | 航天电器 | 100 | 4,638.00 | 0.04 |
| 527 | 603087 | 甘李药业 | 100 | 4,632.00 | 0.04 |
| 528 | 605358 | 立昂微 | 200 | 4,628.00 | 0.04 |
| 529 | 002372 | 伟星新材 | 300 | 4,626.00 | 0.04 |
| 530 | 003031 | 中瓷电子 | 100 | 4,624.00 | 0.04 |
| 531 | 002926 | 华西证券 | 700 | 4,613.00 | 0.04 |
| 532 | 603658 | 安图生物 | 100 | 4,607.00 | 0.04 |
| 533 | 600816 | 建元信托 | 1,700 | 4,607.00 | 0.04 |
| 534 | 600754 | 锦江酒店 | 200 | 4,596.00 | 0.04 |
| 535 | 300776 | 帝尔激光 | 100 | 4,596.00 | 0.04 |
| 536 | 002487 | 大金重工 | 200 | 4,576.00 | 0.04 |
| 537 | 002624 | 完美世界 | 600 | 4,560.00 | 0.04 |
| 538 | 300114 | 中航电测 | 100 | 4,525.00 | 0.04 |
| 539 | 002065 | 东华软件 | 1,000 | 4,520.00 | 0.04 |
| 540 | 000598 | 兴蓉环境 | 600 | 4,512.00 | 0.04 |
| 541 | 002368 | 太极股份 | 200 | 4,510.00 | 0.04 |
| 542 | 002497 | 雅化集团 | 500 | 4,460.00 | 0.04 |
| 543 | 603077 | 和邦生物 | 2,700 | 4,455.00 | 0.04 |
| 544 | 600373 | 中文传媒 | 300 | 4,452.00 | 0.04 |
| 545 | 002430 | 杭氧股份 | 200 | 4,450.00 | 0.04 |
| 546 | 603688 | 石英股份 | 150 | 4,441.50 | 0.04 |
| 547 | 002261 | 拓维信息 | 400 | 4,428.00 | 0.04 |
| 548 | 002508 | 老板电器 | 200 | 4,420.00 | 0.04 |
| 549 | 000818 | 航锦科技 | 200 | 4,416.00 | 0.04 |
| 550 | 002507 | 涪陵榨菜 | 360 | 4,410.00 | 0.04 |
| 551 | 603885 | 吉祥航空 | 400 | 4,396.00 | 0.04 |
| 552 | 603927 | 中科软 | 240 | 4,341.60 | 0.04 |
| 553 | 600435 | 北方导航 | 500 | 4,310.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 554 | 600755 | 厦门国贸 | 600 | 4,302.00 | 0.04 |
| 555 | 300009 | 安科生物 | 500 | 4,270.00 | 0.04 |
| 556 | 002268 | 电科网安 | 300 | 4,269.00 | 0.04 |
| 557 | 603156 | 养元饮品 | 200 | 4,254.00 | 0.04 |
| 558 | 601698 | 中国卫通 | 300 | 4,227.00 | 0.04 |
| 559 | 600739 | 辽宁成大 | 500 | 4,185.00 | 0.04 |
| 560 | 300763 | 锦浪科技 | 100 | 4,164.00 | 0.04 |
| 561 | 601958 | 金铂股份 | 400 | 4,164.00 | 0.04 |
| 562 | 600582 | 天地科技 | 600 | 4,134.00 | 0.04 |
| 563 | 600801 | 华新水泥 | 300 | 4,125.00 | 0.04 |
| 564 | 603568 | 伟明环保 | 200 | 4,116.00 | 0.04 |
| 565 | 002299 | 圣农发展 | 300 | 4,092.00 | 0.04 |
| 566 | 688303 | 大全能源 | 200 | 4,078.00 | 0.04 |
| 567 | 000739 | 普洛药业 | 300 | 4,071.00 | 0.04 |
| 568 | 600884 | 杉杉股份 | 500 | 4,060.00 | 0.04 |
| 569 | 603826 | 坤彩科技 | 140 | 4,055.80 | 0.04 |
| 570 | 600390 | 五矿资本 | 1,000 | 4,050.00 | 0.04 |
| 571 | 300296 | 利亚德 | 900 | 4,050.00 | 0.04 |
| 572 | 601611 | 中国核建 | 500 | 4,045.00 | 0.04 |
| 573 | 002683 | 广东宏大 | 200 | 4,026.00 | 0.04 |
| 574 | 002240 | 盛新锂能 | 300 | 4,026.00 | 0.04 |
| 575 | 603728 | 鸣志电器 | 100 | 4,023.00 | 0.04 |
| 576 | 002939 | 长城证券 | 600 | 4,020.00 | 0.04 |
| 577 | 603000 | 人民网 | 200 | 3,998.00 | 0.04 |
| 578 | 002203 | 海亮股份 | 500 | 3,990.00 | 0.04 |
| 579 | 600416 | 湘电股份 | 400 | 3,976.00 | 0.04 |
| 580 | 300390 | 天华新能 | 230 | 3,951.40 | 0.04 |
| 581 | 603298 | 杭叉集团 | 200 | 3,928.00 | 0.04 |
| 582 | 603179 | 新泉股份 | 100 | 3,924.00 | 0.04 |
| 583 | 603589 | 口子窖 | 100 | 3,919.00 | 0.04 |
| 584 | 600062 | 华润双鹤 | 200 | 3,916.00 | 0.04 |
| 585 | 603379 | 三美股份 | 100 | 3,914.00 | 0.04 |
| 586 | 600325 | 华发股份 | 600 | 3,900.00 | 0.04 |
| 587 | 300373 | 扬杰科技 | 100 | 3,890.00 | 0.04 |
| 588 | 002506 | 协鑫集成 | 2,000 | 3,880.00 | 0.04 |
| 589 | 002120 | 韵达股份 | 500 | 3,870.00 | 0.03 |
| 590 | 601636 | 旗滨集团 | 600 | 3,870.00 | 0.03 |
| 591 | 002080 | 中材科技 | 300 | 3,870.00 | 0.03 |
| 592 | 600995 | 南网储能 | 400 | 3,864.00 | 0.03 |
| 593 | 601236 | 红塔证券 | 600 | 3,852.00 | 0.03 |
| 594 | 688567 | 孚能科技 | 400 | 3,840.00 | 0.03 |
| 595 | 600901 | 江苏金租 | 760 | 3,838.00 | 0.03 |
| 596 | 002865 | 钧达股份 | 100 | 3,838.00 | 0.03 |
| 597 | 002414 | 高德红外 | 650 | 3,828.50 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 598 | 002500 | 山西证券 | 800 | 3,760.00 | 0.03 |
| 599 | 600598 | 北大荒 | 300 | 3,747.00 | 0.03 |
| 600 | 002056 | 横店东磁 | 300 | 3,741.00 | 0.03 |
| 601 | 601098 | 中南传媒 | 300 | 3,726.00 | 0.03 |
| 602 | 600968 | 海油发展 | 900 | 3,708.00 | 0.03 |
| 603 | 002019 | 亿帆医药 | 300 | 3,708.00 | 0.03 |
| 604 | 600258 | 首旅酒店 | 300 | 3,705.00 | 0.03 |
| 605 | 000887 | 中鼎股份 | 300 | 3,672.00 | 0.03 |
| 606 | 300438 | 鹏辉能源 | 200 | 3,668.00 | 0.03 |
| 607 | 600528 | 中铁工业 | 500 | 3,660.00 | 0.03 |
| 608 | 000027 | 深圳能源 | 500 | 3,650.00 | 0.03 |
| 609 | 600848 | 上海临港 | 400 | 3,644.00 | 0.03 |
| 610 | 300803 | 指南针 | 100 | 3,641.00 | 0.03 |
| 611 | 603712 | 七一二 | 200 | 3,638.00 | 0.03 |
| 612 | 002373 | 千方科技 | 400 | 3,628.00 | 0.03 |
| 613 | 601212 | 白银有色 | 1,300 | 3,614.00 | 0.03 |
| 614 | 601866 | 中远海发 | 1,400 | 3,612.00 | 0.03 |
| 615 | 600655 | 豫园股份 | 700 | 3,605.00 | 0.03 |
| 616 | 002531 | 天顺风能 | 400 | 3,576.00 | 0.03 |
| 617 | 000563 | 陕国投 A | 1,300 | 3,575.00 | 0.03 |
| 618 | 601155 | 新城控股 | 400 | 3,548.00 | 0.03 |
| 619 | 601019 | 山东出版 | 300 | 3,546.00 | 0.03 |
| 620 | 300253 | 卫宁健康 | 600 | 3,540.00 | 0.03 |
| 621 | 600859 | 王府井 | 300 | 3,522.00 | 0.03 |
| 622 | 300676 | 华大基因 | 100 | 3,501.00 | 0.03 |
| 623 | 600483 | 福能股份 | 300 | 3,498.00 | 0.03 |
| 624 | 000709 | 河钢股份 | 1,800 | 3,492.00 | 0.03 |
| 625 | 603195 | 公牛集团 | 45 | 3,470.40 | 0.03 |
| 626 | 001286 | 陕西能源 | 300 | 3,459.00 | 0.03 |
| 627 | 603233 | 大参林 | 240 | 3,432.00 | 0.03 |
| 628 | 600959 | 江苏有线 | 1,300 | 3,432.00 | 0.03 |
| 629 | 002936 | 郑州银行 | 1,980 | 3,425.40 | 0.03 |
| 630 | 600707 | 彩虹股份 | 500 | 3,405.00 | 0.03 |
| 631 | 002670 | 国盛金控 | 400 | 3,388.00 | 0.03 |
| 632 | 601965 | 中国汽研 | 200 | 3,378.00 | 0.03 |
| 633 | 601598 | 中国外运 | 600 | 3,378.00 | 0.03 |
| 634 | 600399 | 抚顺特钢 | 600 | 3,378.00 | 0.03 |
| 635 | 300748 | 金力永磁 | 260 | 3,369.60 | 0.03 |
| 636 | 002568 | 百润股份 | 200 | 3,366.00 | 0.03 |
| 637 | 300212 | 易华录 | 200 | 3,366.00 | 0.03 |
| 638 | 002408 | 齐翔腾达 | 600 | 3,360.00 | 0.03 |
| 639 | 601399 | 国机重装 | 1,300 | 3,354.00 | 0.03 |
| 640 | 300070 | 碧水源 | 800 | 3,352.00 | 0.03 |
| 641 | 600316 | 洪都航空 | 200 | 3,326.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 642 | 002690 | 美亚光电 | 200 | 3,300.00 | 0.03 |
| 643 | 601928 | 凤凰传媒 | 300 | 3,288.00 | 0.03 |
| 644 | 300558 | 贝达药业 | 100 | 3,255.00 | 0.03 |
| 645 | 600329 | 达仁堂 | 100 | 3,239.00 | 0.03 |
| 646 | 000155 | 川能动力 | 300 | 3,231.00 | 0.03 |
| 647 | 600977 | 中国电影 | 300 | 3,228.00 | 0.03 |
| 648 | 600098 | 广州发展 | 500 | 3,200.00 | 0.03 |
| 649 | 601880 | 辽港股份 | 2,600 | 3,198.00 | 0.03 |
| 650 | 603228 | 景旺电子 | 100 | 3,180.00 | 0.03 |
| 651 | 300595 | 欧普康视 | 200 | 3,136.00 | 0.03 |
| 652 | 000800 | 一汽解放 | 400 | 3,132.00 | 0.03 |
| 653 | 603517 | 绝味食品 | 200 | 3,080.00 | 0.03 |
| 654 | 002653 | 海思科 | 100 | 3,070.00 | 0.03 |
| 655 | 002572 | 索菲亚 | 200 | 3,066.00 | 0.03 |
| 656 | 002607 | 中公教育 | 2,000 | 3,060.00 | 0.03 |
| 657 | 600056 | 中国医药 | 300 | 3,036.00 | 0.03 |
| 658 | 603858 | 步长制药 | 200 | 3,030.00 | 0.03 |
| 659 | 600925 | 苏能股份 | 600 | 3,030.00 | 0.03 |
| 660 | 000032 | 深桑达 A | 200 | 2,996.00 | 0.03 |
| 661 | 688772 | 珠海冠宇 | 200 | 2,980.00 | 0.03 |
| 662 | 688538 | 和辉光电 | 1,500 | 2,970.00 | 0.03 |
| 663 | 603650 | 彤程新材 | 100 | 2,955.00 | 0.03 |
| 664 | 600271 | 航天信息 | 400 | 2,944.00 | 0.03 |
| 665 | 600578 | 京能电力 | 900 | 2,916.00 | 0.03 |
| 666 | 000050 | 深天马 A | 400 | 2,912.00 | 0.03 |
| 667 | 002244 | 滨江集团 | 400 | 2,904.00 | 0.03 |
| 668 | 600378 | 昊华科技 | 100 | 2,890.00 | 0.03 |
| 669 | 601298 | 青岛港 | 300 | 2,868.00 | 0.03 |
| 670 | 600906 | 财达证券 | 500 | 2,865.00 | 0.03 |
| 671 | 000537 | 中绿电 | 300 | 2,859.00 | 0.03 |
| 672 | 002557 | 洽洽食品 | 100 | 2,819.00 | 0.03 |
| 673 | 600500 | 中化国际 | 800 | 2,792.00 | 0.03 |
| 674 | 000778 | 新兴铸管 | 800 | 2,784.00 | 0.03 |
| 675 | 603456 | 九洲药业 | 200 | 2,744.00 | 0.02 |
| 676 | 003022 | 联泓新科 | 200 | 2,742.00 | 0.02 |
| 677 | 603529 | 爱玛科技 | 100 | 2,733.00 | 0.02 |
| 678 | 601118 | 海南橡胶 | 600 | 2,730.00 | 0.02 |
| 679 | 603882 | 金城医学 | 100 | 2,719.00 | 0.02 |
| 680 | 000825 | 太钢不锈 | 800 | 2,704.00 | 0.02 |
| 681 | 000937 | 冀中能源 | 400 | 2,680.00 | 0.02 |
| 682 | 000785 | 居然之家 | 1,100 | 2,673.00 | 0.02 |
| 683 | 600350 | 山东高速 | 300 | 2,655.00 | 0.02 |
| 684 | 600663 | 陆家嘴 | 300 | 2,646.00 | 0.02 |
| 685 | 002867 | 周大生 | 200 | 2,612.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 686 | 600517 | 国网英大 | 600 | 2,598.00 | 0.02 |
| 687 | 601568 | 北元集团 | 700 | 2,597.00 | 0.02 |
| 688 | 002791 | 坚朗五金 | 100 | 2,587.00 | 0.02 |
| 689 | 688425 | 铁建重工 | 700 | 2,576.00 | 0.02 |
| 690 | 300682 | 朗新集团 | 300 | 2,553.00 | 0.02 |
| 691 | 300888 | 稳健医疗 | 100 | 2,530.00 | 0.02 |
| 692 | 600377 | 宁沪高速 | 200 | 2,520.00 | 0.02 |
| 693 | 002266 | 浙富控股 | 900 | 2,511.00 | 0.02 |
| 694 | 000987 | 越秀资本 | 500 | 2,480.00 | 0.02 |
| 695 | 600871 | 石化油服 | 1,400 | 2,436.00 | 0.02 |
| 696 | 600361 | 创新新材 | 600 | 2,418.00 | 0.02 |
| 697 | 603185 | 弘元绿能 | 140 | 2,392.60 | 0.02 |
| 698 | 001227 | 兰州银行 | 1,000 | 2,380.00 | 0.02 |
| 699 | 603707 | 健友股份 | 200 | 2,376.00 | 0.02 |
| 700 | 600208 | 新湖中宝 | 1,500 | 2,370.00 | 0.02 |
| 701 | 002608 | 江苏国信 | 300 | 2,325.00 | 0.02 |
| 702 | 601106 | 中国一重 | 1,000 | 2,310.00 | 0.02 |
| 703 | 601608 | 中信重工 | 600 | 2,286.00 | 0.02 |
| 704 | 002423 | 中粮资本 | 300 | 2,247.00 | 0.02 |
| 705 | 000559 | 万向钱潮 | 500 | 2,230.00 | 0.02 |
| 706 | 600827 | 百联股份 | 300 | 2,214.00 | 0.02 |
| 707 | 003035 | 南网能源 | 500 | 2,200.00 | 0.02 |
| 708 | 600022 | 山东钢铁 | 1,800 | 2,196.00 | 0.02 |
| 709 | 000958 | 电投产融 | 600 | 2,196.00 | 0.02 |
| 710 | 600032 | 浙江新能 | 300 | 2,184.00 | 0.02 |
| 711 | 600967 | 内蒙一机 | 300 | 2,160.00 | 0.02 |
| 712 | 603305 | 旭升集团 | 200 | 2,112.00 | 0.02 |
| 713 | 301267 | 华夏眼科 | 100 | 2,072.00 | 0.02 |
| 714 | 600126 | 杭钢股份 | 500 | 2,055.00 | 0.02 |
| 715 | 601992 | 金隅集团 | 1,500 | 2,055.00 | 0.02 |
| 716 | 603218 | 日月股份 | 200 | 2,054.00 | 0.02 |
| 717 | 000539 | 粤电力 A | 400 | 2,032.00 | 0.02 |
| 718 | 300357 | 我武生物 | 100 | 2,022.00 | 0.02 |
| 719 | 301029 | 怡合达 | 100 | 1,966.00 | 0.02 |
| 720 | 600764 | 中国海防 | 100 | 1,963.00 | 0.02 |
| 721 | 600299 | 安迪苏 | 200 | 1,940.00 | 0.02 |
| 722 | 300861 | 美畅股份 | 100 | 1,935.00 | 0.02 |
| 723 | 001872 | 招商港口 | 100 | 1,925.00 | 0.02 |
| 724 | 001203 | 大中矿业 | 200 | 1,922.00 | 0.02 |
| 725 | 601858 | 中国科传 | 100 | 1,912.00 | 0.02 |
| 726 | 000156 | 华数传媒 | 300 | 1,884.00 | 0.02 |
| 727 | 600339 | 中油工程 | 600 | 1,872.00 | 0.02 |
| 728 | 600481 | 双良节能 | 400 | 1,868.00 | 0.02 |
| 729 | 603127 | 昭衍新药 | 140 | 1,857.80 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 730 | 600095 | 湘财股份 | 300 | 1,788.00 | 0.02 |
| 731 | 600315 | 上海家化 | 100 | 1,778.00 | 0.02 |
| 732 | 002518 | 科士达 | 100 | 1,770.00 | 0.02 |
| 733 | 002563 | 森马服饰 | 300 | 1,743.00 | 0.02 |
| 734 | 001289 | 龙源电力 | 100 | 1,725.00 | 0.02 |
| 735 | 000898 | 鞍钢股份 | 800 | 1,696.00 | 0.02 |
| 736 | 000967 | 盈峰环境 | 400 | 1,692.00 | 0.02 |
| 737 | 600928 | 西安银行 | 500 | 1,635.00 | 0.01 |
| 738 | 000401 | 冀东水泥 | 400 | 1,624.00 | 0.01 |
| 739 | 600808 | 马钢股份 | 800 | 1,616.00 | 0.01 |
| 740 | 603317 | 天味食品 | 140 | 1,597.40 | 0.01 |
| 741 | 601228 | 广州港 | 500 | 1,525.00 | 0.01 |
| 742 | 688387 | 信科移动 | 300 | 1,512.00 | 0.01 |
| 743 | 002153 | 石基信息 | 260 | 1,489.80 | 0.01 |
| 744 | 603737 | 三棵树 | 40 | 1,450.80 | 0.01 |
| 745 | 688779 | 五矿新能 | 300 | 1,389.00 | 0.01 |
| 746 | 000959 | 首钢股份 | 500 | 1,360.00 | 0.01 |
| 747 | 601139 | 深圳燃气 | 200 | 1,336.00 | 0.01 |
| 748 | 603056 | 德邦股份 | 100 | 1,310.00 | 0.01 |
| 749 | 600927 | 永安期货 | 100 | 1,115.00 | 0.01 |
| 750 | 601828 | 美凯龙 | 400 | 1,020.00 | 0.01 |
| 751 | 002945 | 华林证券 | 100 | 998.00 | 0.01 |
| 752 | 601158 | 重庆水务 | 200 | 960.00 | 0.01 |
| 753 | 000031 | 大悦城 | 400 | 936.00 | 0.01 |
| 754 | 600956 | 新天绿能 | 100 | 817.00 | 0.01 |

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 123,645.00 | 1.10 |
| 2 | 300896 | 爱美客 | 116,614.00 | 1.04 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 106,182.00 | 0.95 |
| 4 | 688111 | 金山办公 | 102,335.54 | 0.91 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 91,462.00 | 0.82 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 89,023.00 | 0.79 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 77,653.00 | 0.69 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 76,009.00 | 0.68 |

| | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|
| 9 | 600436 | 片仔癀 | 69,692.00 | 0.62 |
| 10 | 688036 | 传音控股 | 58,274.00 | 0.52 |
| 11 | 688256 | 寒武纪 | 55,409.06 | 0.49 |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 50,546.00 | 0.45 |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 50,508.00 | 0.45 |
| 14 | 000786 | 北新建材 | 49,420.00 | 0.44 |
| 15 | 000002 | 万科A | 49,390.00 | 0.44 |
| 16 | 603501 | 韦尔股份 | 47,955.00 | 0.43 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 46,863.00 | 0.42 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 44,243.00 | 0.39 |
| 19 | 605499 | 东鹏饮料 | 43,713.00 | 0.39 |
| 20 | 002594 | 比亚迪 | 43,553.00 | 0.39 |

注：“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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 688111 | 金山办公 | 163,152.00 | 1.45 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 123,380.00 | 1.10 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 115,223.00 | 1.03 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 113,299.00 | 1.01 |
| 5 | 300896 | 爱美客 | 105,245.00 | 0.94 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 102,630.00 | 0.91 |
| 7 | 688256 | 寒武纪 | 93,398.00 | 0.83 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 83,753.00 | 0.75 |
| 9 | 688036 | 传音控股 | 73,760.00 | 0.66 |
| 10 | 600436 | 片仔癀 | 69,024.00 | 0.62 |
| 11 | 600309 | 万华化学 | 52,854.00 | 0.47 |
| 12 | 000975 | 山金国际 | 51,779.00 | 0.46 |
| 13 | 603233 | 大参林 | 50,067.00 | 0.45 |
| 14 | 600900 | 长江电力 | 49,605.00 | 0.44 |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 49,086.00 | 0.44 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 48,185.00 | 0.43 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 48,065.00 | 0.43 |
| 18 | 300274 | 阳光电源 | 47,697.00 | 0.43 |
| 19 | 601899 | 紫金矿业 | 47,292.00 | 0.42 |
| 20 | 600795 | 国电电力 | 46,970.00 | 0.42 |

注：“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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|--------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 3,851,918.99 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 3,759,521.98 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 609,164.77 | 5.50 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 609,164.77 | 5.50 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1 | 019727 | 23 国债 24 | 3,000 | 305,457.12 | 2.76 |
| 2 | 019733 | 24 国债 02 | 2,000 | 202,146.14 | 1.82 |
| 3 | 019709 | 23 国债 16 | 1,000 | 101,561.51 | 0.92 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交

易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告编制日前一年内，招商银行、兴业银行受到国家金融监督管理总局公开处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,471.33 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 212,453.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 213,924.95 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.1 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 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 |
| 中银中证 800 指数型发起式 A | 236 | 46,074.00 | 10,000,000.00 | 91.9670% | 873,463.45 | 8.0330% |
| 中银中证 800 指数型发起式 C | 537 | 5,903.52 | - | - | 3,170,189.32 | 100.0000% |
| 合计 | 773 | 18,167.73 | 10,000,000.00 | 71.2065% | 4,043,652.77 | 28.7935% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中银中证 800 指数型发起式 A | - | - |
| | 中银中证 800 指数型发起式 C | 509,862.39 | 16.0830% |
| | 合计 | 509,862.39 | 3.6306% |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 中银中证 800 指数型发起式 A | 0 |
| | 中银中证 800 指数型发起式 C | 50~100 |
| | 合计 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开 | 中银中证 800 指数型发 | 0 |

| | | |
|-------|-------------------|---|
| 开放式基金 | 起式 A | |
| | 中银中证 800 指数型发起式 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 71.21% | 10,000,000.00 | 71.21% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 71.21% | 10,000,000.00 | 71.21% | - |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中银中证 800 指数型发起式 A | 中银中证 800 指数型发起式 C |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2022 年 10 月 10 日)基金份额总额 | 10,492,397.72 | 137,941.93 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,842,742.74 | 3,262,244.89 |
| 本报告期基金总申购份额 | 180,184.32 | 32,494,303.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 149,463.61 | 32,586,358.63 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 10,873,463.45 | 3,170,189.32 |

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经 2024 年第一次股东会决议同意王志强先生、袁淳先生担任基金管理人独立董事，赵欣舸先生、杜惠芬女士不再担任基金管理人独立董事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | 4,775,338.33 | 62.74% | 3,776.08 | 62.83% | - |
| 兴业证券 | 3 | 2,836,102.64 | 37.26% | 2,233.44 | 37.17% | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字<1998>29号）及《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）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后

根据评分高低进行选择基金专用交易单元，并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：退租国投证券上海交易单元一个，退租国泰君安证券上海、深圳交易单元各一个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 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 |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 601,192.00 | 99.96% | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 222.80 | 0.04% | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------------------------------------|-----------|------------|
| 1 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-01-19 |
| 2 | 中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-02 |
| 3 | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-19 |
| 4 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2023 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 5 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-19 |
| 6 | 中银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-05-10 |
| 7 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金(中银中证 800 指数型发起式 C)产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-26 |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------|-----------|------------|
| 8 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金(中银中证 800 指数型发起式 A)产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-26 |
| 9 | 中银中证 800 指数型发起式证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 1 号) | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-26 |
| 10 | 中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-28 |

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|---------------|------|------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20240101-20240630 | 10,000,000.00 | - | - | 10,000,000.00 | 71.2065% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,存在以下特有风险:(1)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险;(2)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险;(3)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险;(4)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。 | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集注册的文件;
- 2、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3、《中银中证 800 指数型发起式证券投资基金托管协议》;
- 4、关于申请募集注册中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金之法律意见书;
- 5、关于修改《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》之法律意见书;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二四年八月三十一日