

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	71
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	71
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12 投资组合报告附注 .....	72
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>73</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	73
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>74</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4 基金投资策略的改变 .....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>78</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银中证 800ETF
场内简称	工银 800、工银中证 800ETF
基金主代码	515830
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 1 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,153,108.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 7 月 17 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	工银瑞信基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbcs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95561
传真	010-66583158	021-62159217
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	福建省福州市湖东路 154 号

办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	100033	200120
法定代表人	赵桂才（代任）	高建平

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 1 日。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

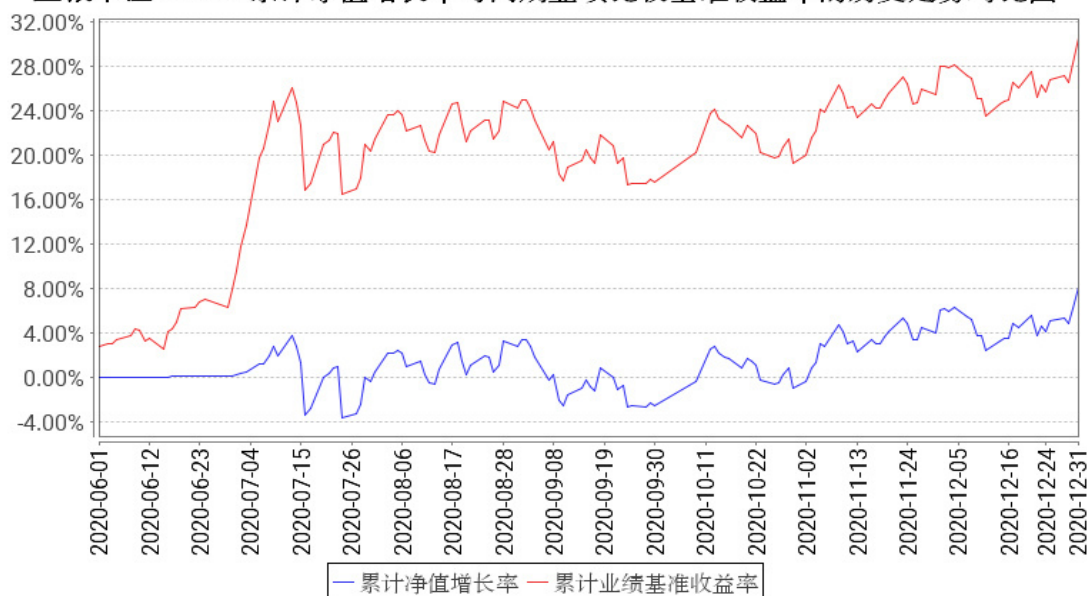
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.84%	0.99%	11.00%	1.01%	-0.16%	-0.02%
过去六个月	7.90%	1.19%	21.02%	1.35%	-13.12%	-0.16%
自基金合同生效起至今	8.13%	1.11%	30.55%	1.30%	-22.42%	-0.19%

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

工银中证800ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

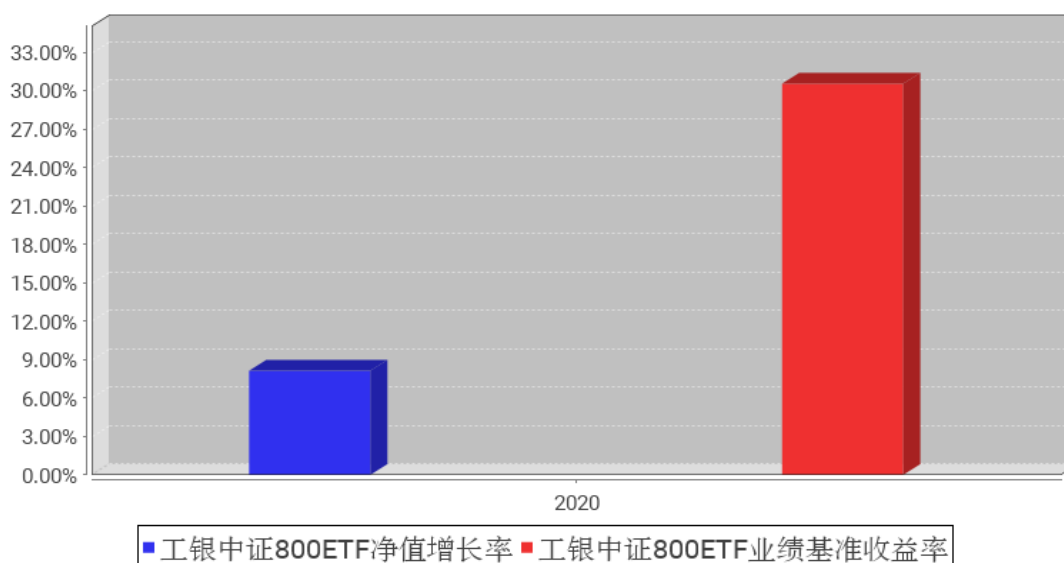


注：1、本基金基金合同于 2020 年 6 月 1 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

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

工银中证800ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。



截至 2020 年 12 月 31 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 6 个月定期开放混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金等逾 160 只公募基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	本基金的基金经理	2020 年 6 月 1 日	-	10 年	中国人民大学金融工程博士；2010 年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心产品及营销支持部研究负责人兼指数基金基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银深证 100 指数分级基金（自 2018 年 4 月 17 日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF））基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银沪深 300 指数基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银中证 500 指数分级基金（自 2020 年 2 月 18 日起变更为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金（自 2020 年 11 月 26 日期变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF））基金经理；2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日，担任工银中证高铁产业指数分级

				<p>基金基金经理；2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理；2018 年 6 月 15 日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金（LOF）基金经理；2019 年 5 月 20 日至今，担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 8 月 21 日至今，担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 1 日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至今，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>	
赵栩	指数投资中心投资部副总监，本基金的基金经理	2020 年 6 月 1 日	-	13 年	<p>2008 年加入工银瑞信，曾任风险管理部金融工程分析师，现任指数投资中心投资部副总监，2011 年 10 月 18 日至今担任工银上证央企 ETF 基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今担任工银深证红利 ETF 基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今担任工银深证红利 ETF 连接基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 27 日，担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理；2017 年 12 月 25 日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 21 日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2018 年 12 月 7 日至今担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 25 日至今担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 19 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易</p>

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

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

在交易执行环节，交易人员根据公司内部权限管理规定获得权限，并遵循价格优先、时间优

先、综合平衡、比例实施等执行原则，保证交易在不同投资组合间的利益公平。

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成份股票的停牌；3) 指数成份股调整的影响；4) 建仓期仓位变化影响等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为8.13%，业绩比较基准收益率为30.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，市场主要宽基指数中，沪深 300 指数、中证 500 指数、上证 50 指数、创业板指涨跌幅分别为 27.21%、20.87%、18.85%及 64.96%。本基金标的指数 2020 年涨跌幅为 25.79%，表现略跑输沪深 300 指数。从市场风格来看，报告期内沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数涨幅分别为 0.19%和 43.96%，成长风格表现相对较强。从估值水平来看，截至报告期末，沪深 300 指数、中证 500 指数、上证 50 指数、创业板指的市盈率分别为 16.12、28.22、14.22 及 64.39 倍，历史估值分位数分别为 93.24%、30.60%、95.73%及 83.39%，除中证 500 指数外，主要指数估值历史分位数处于较高水平。

在报告期内，A 股市场上半年受到疫情的阶段性影响，各主要指数均出现了一定的波动，二季度由于国内防疫迅速有效，市场也出现了较为明显的风险偏好的提升，走势较为强劲。进入到下半年，自 7 月中旬开始市场出现了一定程度的回调，此后市场多个板块和行业也进入到一定程度的震荡阶段，但由于疫情在海外的持续扩散，国内复工复产节奏形成了有效的相对优势，经济得到逐步的恢复和改善。伴随疫情在国内的有效控制，国内流动性出现了阶段性的收紧迹象，未来基本面的改善幅度和流动性的变化仍然值得关注。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

培训、对投研人员和销售人员的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

监察稽核方面，一是定期对基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理个人行为的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60802052_A89 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基

	<p>金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认</p>



	<p>为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2021 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	600,537.58

结算备付金		118,192.02
存出保证金		207,264.13
交易性金融资产	7.4.7.2	43,167,081.82
其中：股票投资		43,167,081.82
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		202,526.50
应收利息	7.4.7.5	234.79
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		44,295,836.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		19,176.53
应付托管费		2,983.01
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	25,283.71
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	135,065.47
负债合计		182,508.72
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	40,798,364.28
未分配利润	7.4.7.10	3,314,963.84
所有者权益合计		44,113,328.12
负债和所有者权益总计		44,295,836.84

注：1、本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

2、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 5.4106 元，基金份额总额为 8,153,108.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 6 月 1 日（基金合同生 效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		8,733,741.71
1. 利息收入		542,563.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	542,563.83
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,765,043.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,146,363.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,618,680.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,008,708.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	417,425.08
减：二、费用		1,319,006.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	437,968.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	68,128.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	606,639.86
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	206,269.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,414,734.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,414,734.94

注：本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	391,080,183.00	-	391,080,183.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,414,734.94	7,414,734.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-350,281,818.72	-4,099,771.10	-354,381,589.82
其中：1. 基金申购款	5,004,025.98	-139,253.31	4,864,772.67
2. 基金赎回款	-355,285,844.70	-3,960,517.79	-359,246,362.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	40,798,364.28	3,314,963.84	44,113,328.12

注：本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵桂才

郝炜

关亚君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1959 号《关于准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的批准，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于 2020 年 3 月 27 日至 2020 年 5 月 22 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2020）验字第 60802052\_A08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 6 月 1 日正式生效，设立时募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币 391,080,183.00 元（含募集股票），折合 391,080,183.00 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 98,807.59 元，归入基金财产；以上收到的实收基金共计人民币 391,080,183.00 元，折合 391,080,183.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转债（含分离交易可转债）、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）。本基金可以参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 06 月 01 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

###### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

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

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

##### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。



与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配采用现金分红方式；

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

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

(5) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能

能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；

(6) 基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	活期存款	600,537.58
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	600,537.58	

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,158,372.87	43,167,081.82	3,008,708.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		40,158,372.87	43,167,081.82	3,008,708.95

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	75.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	57.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	102.52
合计	234.79

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	25,283.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,283.71

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

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

注：1、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额；

2、应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	391,080,183.00	391,080,183.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2020 年 07 月 09 日 基金拆分/ 份额折算前	391,080,183.00	391,080,183.00
基金拆分/份额折算调整	-312,927,075.00	-
本期申购	1,000,000.00	5,004,025.98
本期赎回（以“-”号填列）	-71,000,000.00	-355,285,844.70
本期末	8,153,108.00	40,798,364.28

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

(2) 本基金于自 2020 年 3 月 27 日至 2020 年 5 月 22 日向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 6 月 1 日正式生效。本基金设立时，基金份额总额 391,080,183.00 份。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,406,025.99	3,008,708.95	7,414,734.94
本期基金份额交易产生的变动数	-2,470,485.29	-1,629,285.81	-4,099,771.10
其中：基金申购款	15,093.24	-154,346.55	-139,253.31
基金赎回款	-2,485,578.53	-1,474,939.26	-3,960,517.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,935,540.70	1,379,423.14	3,314,963.84

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	63,364.83
定期存款利息收入	421,073.62
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	56,799.19
其他	1,326.19
合计	542,563.83

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,274,677.52
股票投资收益——赎回差价收入	-128,314.07
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,146,363.45

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	169,645,128.99
减：卖出股票成本总额	166,370,451.47



买卖股票差价收入	3,274,677.52
----------	--------------

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	359,246,362.49
减：现金支付赎回款总额	161,408,429.49
减：赎回股票成本总额	197,966,247.07
赎回差价收入	-128,314.07

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,618,680.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,618,680.40

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日

1. 交易性金融资产	3,008,708.95
股票投资	3,008,708.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,008,708.95

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	318,617.39
其他	98,807.69
合计	417,425.08

注：替代损益指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	606,639.86
银行间市场交易费用	-
合计	606,639.86

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年 12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	22,950.82
开户费	400.00
银行费用	1,765.00

指数使用费	81,153.85
合计	206,269.67

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	437,968.79
其中：支付销售机构的客户维护费	5,163.85

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	68,128.45

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	600,537.58	152,323.17

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2020年12月31日，本基金持有57,700.00股工商银行的A股普通股，成本总额为人民币304,905.83元，估值总额为人民币287,923.00元，占基金资产净值的比例为0.65%。

于2020年12月31日，本基金持有24,853.00股兴业银行的A股普通股，成本总额为人民币443,024.45元，估值总额为人民币518,682.11元，占基金资产净值的比例为1.18%。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300862	蓝盾光电	2020年8月7日	2021年3月4日	新股锁定	33.95	38.54	556	18,876.20	21,428.24	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	329	5,576.55	5,576.55	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	348	5,282.64	5,282.64	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	325	4,962.75	4,962.75	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股锁定	43.76	51.10	60	2,625.60	3,066.00	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股流通受限	4.59	5.46	6,270	28,779.30	34,234.20	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项	3.23	2021年1月7日	3.40	3,600	16,801.95	11,628.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

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

(2) 风险管理部、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查等，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行



独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的债券投资。

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

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	600,537.58	-	-	-	-	-	600,537.58
结算备付金	118,192.02	-	-	-	-	-	118,192.02
存出保证金	207,264.13	-	-	-	-	-	207,264.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	43,167,081.82	43,167,081.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-202,526.50	202,526.50
应收利息	-	-	-	-	-	234.79	234.79
资产总计	925,993.73	-	-	-	-	43,369,843.11	44,295,836.84
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,176.53	19,176.53
应付托管费	-	-	-	-	-	2,983.01	2,983.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,283.71	25,283.71
其他负债	-	-	-	-	-	135,065.47	135,065.47
负债总计	-	-	-	-	-	182,508.72	182,508.72
利率敏感度	925,993.73	-	-	-	-	-43,187,334.11	44,113,328.14

缺口	3				.39	2
----	---	--	--	--	-----	---

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	43,167,081.82	97.85
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	43,167,081.82	97.85

注：1、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券

(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%,投资于标的指数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%。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

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

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

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

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 43,080,903.44 元,属于第二层次的余额为人民币 27,449.94 元,属于第三层次的余额为人民币

58,728.44 元。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

无。

#### 7.4.14.3 其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	43,167,081.82	97.45
	其中：股票	43,167,081.82	97.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	718,729.60	1.62
8	其他各项资产	410,025.42	0.93
9	合计	44,295,836.84	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	491,753.00	1.11
B	采矿业	1,027,897.00	2.33
C	制造业	23,937,226.99	54.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	769,418.50	1.74
E	建筑业	642,741.00	1.46
F	批发和零售业	607,687.42	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	1,077,467.60	2.44
H	住宿和餐饮业	44,863.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,739,052.60	3.94
J	金融业	9,366,251.13	21.23
K	房地产业	1,235,329.20	2.80
L	租赁和商务服务业	733,015.30	1.66
M	科学研究和技术服务业	420,777.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	88,398.90	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	51,477.00	0.12
Q	卫生和社会工作	614,407.00	1.39
R	文化、体育和娱乐业	233,546.00	0.53
S	综合	45,457.00	0.10
	合计	43,126,765.64	97.76

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	40,316.18	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,316.18	0.09

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

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	900	1,798,200.00	4.08
2	601318	中国平安	17,900	1,556,942.00	3.53
3	000858	五粮液	3,400	992,290.00	2.25
4	600036	招商银行	21,100	927,345.00	2.10
5	000333	美的集团	8,300	817,052.00	1.85
6	600276	恒瑞医药	6,400	713,344.00	1.62
7	601166	兴业银行	24,853	518,682.11	1.18
8	000651	格力电器	8,300	514,102.00	1.17
9	601888	中国中免	1,656	467,737.20	1.06
10	600887	伊利股份	10,400	461,448.00	1.05
11	600030	中信证券	14,100	414,540.00	0.94
12	601012	隆基股份	4,400	405,680.00	0.92



13	002475	立讯精密	7,200	404,064.00	0.92
14	300059	东方财富	11,700	362,700.00	0.82
15	600031	三一重工	10,100	353,298.00	0.80
16	603288	海天味业	1,700	340,918.00	0.77
17	000002	万科A	11,100	318,570.00	0.72
18	002415	海康威视	6,400	310,464.00	0.70
19	000001	平安银行	15,900	307,506.00	0.70
20	002594	比亚迪	1,500	291,450.00	0.66
21	601398	工商银行	57,700	287,923.00	0.65
22	600900	长江电力	15,000	287,400.00	0.65
23	603259	药明康德	2,100	282,912.00	0.64
24	002352	顺丰控股	3,100	273,513.00	0.62
25	000568	泸州老窖	1,200	271,392.00	0.62
26	000725	京东方A	44,600	267,600.00	0.61
27	002304	洋河股份	1,100	259,589.00	0.59
28	600309	万华化学	2,800	254,912.00	0.58
29	002714	牧原股份	3,200	246,720.00	0.56
30	601601	中国太保	5,900	226,560.00	0.51
31	600585	海螺水泥	4,100	211,642.00	0.48
32	601899	紫金矿业	22,700	210,883.00	0.48
33	601328	交通银行	45,200	202,496.00	0.46
34	300015	爱尔眼科	2,700	202,203.00	0.46
35	600690	海尔智家	6,500	189,865.00	0.43
36	600048	保利地产	11,900	188,258.00	0.43
37	600809	山西汾酒	500	187,645.00	0.43
38	600000	浦发银行	19,300	186,824.00	0.42
39	002142	宁波银行	5,246	185,393.64	0.42
40	600016	民生银行	34,900	181,480.00	0.41
41	601688	华泰证券	10,018	180,424.18	0.41
42	000661	长春高新	400	179,564.00	0.41
43	300122	智飞生物	1,200	177,492.00	0.40
44	600438	通威股份	4,600	176,824.00	0.40
45	601668	中国建筑	34,500	171,465.00	0.39
46	600837	海通证券	13,100	168,466.00	0.38
47	300124	汇川技术	1,800	167,940.00	0.38
48	002027	分众传媒	16,900	166,803.00	0.38
49	000100	TCL 科技	23,100	163,548.00	0.37
50	300014	亿纬锂能	2,000	163,000.00	0.37
51	603501	韦尔股份	700	161,770.00	0.37
52	000063	中兴通讯	4,600	154,790.00	0.35
53	600999	招商证券	6,440	150,309.60	0.34
54	601288	农业银行	47,200	148,208.00	0.34

55	600570	恒生电子	1,400	146,860.00	0.33
56	002241	歌尔股份	3,900	145,548.00	0.33
57	300347	泰格医药	900	145,449.00	0.33
58	600104	上汽集团	5,900	144,196.00	0.33
59	600763	通策医疗	500	138,260.00	0.31
60	300498	温氏股份	7,500	136,725.00	0.31
61	600919	江苏银行	24,570	134,152.20	0.30
62	601211	国泰君安	7,600	133,228.00	0.30
63	300274	阳光电源	1,800	130,104.00	0.29
64	000338	潍柴动力	8,200	129,478.00	0.29
65	600009	上海机场	1,700	128,622.00	0.29
66	601229	上海银行	16,400	128,576.00	0.29
67	002410	广联达	1,600	125,984.00	0.29
68	002230	科大讯飞	3,000	122,610.00	0.28
69	002460	赣锋锂业	1,200	121,440.00	0.28
70	600588	用友网络	2,700	118,449.00	0.27
71	601169	北京银行	24,300	117,612.00	0.27
72	600660	福耀玻璃	2,400	115,320.00	0.26
73	600893	航发动力	1,900	112,765.00	0.26
74	601988	中国银行	34,700	110,346.00	0.25
75	600196	复星医药	2,000	107,980.00	0.24
76	601628	中国人寿	2,800	107,492.00	0.24
77	600436	片仔癀	400	107,004.00	0.24
78	601766	中国中车	20,000	106,200.00	0.24
79	002271	东方雨虹	2,700	104,760.00	0.24
80	601818	光大银行	26,200	104,538.00	0.24
81	300142	沃森生物	2,700	104,112.00	0.24
82	600406	国电南瑞	3,900	103,623.00	0.23
83	603799	华友钴业	1,300	103,090.00	0.23
84	601088	中国神华	5,700	102,657.00	0.23
85	600703	三安光电	3,800	102,638.00	0.23
86	000538	云南白药	900	102,240.00	0.23
87	601919	中远海控	8,300	101,343.00	0.23
88	002812	恩捷股份	700	99,246.00	0.22
89	603986	兆易创新	500	98,750.00	0.22
90	600346	恒力石化	3,500	97,895.00	0.22
91	002493	荣盛石化	3,500	96,635.00	0.22
92	002049	紫光国微	700	93,667.00	0.21
93	601390	中国中铁	17,400	91,698.00	0.21
94	002821	凯莱英	300	89,742.00	0.20
95	600745	闻泰科技	900	89,100.00	0.20
96	600028	中国石化	21,900	88,257.00	0.20

97	000768	中航西飞	2,400	88,032.00	0.20
98	600019	宝钢股份	14,700	87,465.00	0.20
99	300601	康泰生物	500	87,250.00	0.20
100	002311	海大集团	1,300	85,150.00	0.19
101	600584	长电科技	2,000	85,140.00	0.19
102	000876	新希望	3,800	85,120.00	0.19
103	000895	双汇发展	1,800	84,492.00	0.19
104	000625	长安汽车	3,800	83,144.00	0.19
105	000776	广发证券	5,100	83,028.00	0.19
106	600958	东方证券	7,100	82,573.00	0.19
107	601009	南京银行	10,200	82,416.00	0.19
108	601336	新华保险	1,400	81,158.00	0.18
109	600741	华域汽车	2,800	80,696.00	0.18
110	002007	华兰生物	1,900	80,256.00	0.18
111	601377	兴业证券	9,200	79,856.00	0.18
112	300413	芒果超媒	1,100	79,750.00	0.18
113	002129	中环股份	3,100	79,050.00	0.18
114	688012	中微公司	500	78,795.00	0.18
115	000166	申万宏源	14,900	78,672.00	0.18
116	002179	中航光电	1,000	78,290.00	0.18
117	603160	汇顶科技	500	77,775.00	0.18
118	000157	中联重科	7,800	77,220.00	0.18
119	300012	华测检测	2,800	76,636.00	0.17
120	600926	杭州银行	5,100	76,092.00	0.17
121	601633	长城汽车	2,000	75,620.00	0.17
122	600426	华鲁恒升	2,000	74,600.00	0.17
123	601877	正泰电器	1,900	74,404.00	0.17
124	002001	新和成	2,200	74,096.00	0.17
125	002050	三花智控	3,000	73,950.00	0.17
126	600176	中国巨石	3,700	73,852.00	0.17
127	600547	山东黄金	3,120	73,694.40	0.17
128	601939	建设银行	11,600	72,848.00	0.17
129	601901	方正证券	7,000	72,590.00	0.16
130	603993	洛阳钼业	11,600	72,500.00	0.16
131	000786	北新建材	1,800	72,090.00	0.16
132	001979	招商蛇口	5,400	71,766.00	0.16
133	300408	三环集团	1,900	70,775.00	0.16
134	002074	国轩高科	1,800	70,416.00	0.16
135	600109	国金证券	4,200	68,334.00	0.15
136	600050	中国联通	15,300	68,238.00	0.15
137	002736	国信证券	5,000	68,200.00	0.15
138	601100	恒立液压	596	67,348.00	0.15

139	300433	蓝思科技	2,200	67,342.00	0.15
140	601066	中信建投	1,600	67,200.00	0.15
141	002202	金风科技	4,700	66,975.00	0.15
142	600872	中炬高新	1,000	66,650.00	0.15
143	688008	澜起科技	800	66,304.00	0.15
144	600015	华夏银行	10,600	66,250.00	0.15
145	601857	中国石油	15,900	65,985.00	0.15
146	002555	三七互娱	2,100	65,583.00	0.15
147	000860	顺鑫农业	900	65,286.00	0.15
148	601006	大秦铁路	10,100	65,246.00	0.15
149	002938	鹏鼎控股	1,300	64,571.00	0.15
150	600079	人福医药	1,900	64,372.00	0.15
151	600089	特变电工	6,300	63,945.00	0.14
152	601225	陕西煤业	6,800	63,512.00	0.14
153	603369	今世缘	1,100	63,118.00	0.14
154	601788	光大证券	3,400	62,968.00	0.14
155	601989	中国重工	15,000	62,850.00	0.14
156	300033	同花顺	500	61,990.00	0.14
157	601186	中国铁建	7,800	61,620.00	0.14
158	603019	中科曙光	1,800	61,614.00	0.14
159	002601	龙蟠佰利	2,000	61,540.00	0.14
160	300207	欣旺达	2,000	61,420.00	0.14
161	601799	星宇股份	300	60,150.00	0.14
162	600352	浙江龙盛	4,400	59,928.00	0.14
163	002008	大族激光	1,400	59,850.00	0.14
164	002236	大华股份	3,000	59,670.00	0.14
165	600600	青岛啤酒	600	59,640.00	0.14
166	603345	安井食品	300	57,861.00	0.13
167	000547	航天发展	2,100	57,750.00	0.13
168	002600	领益智造	4,800	57,552.00	0.13
169	002624	完美世界	1,950	57,525.00	0.13
170	002841	视源股份	500	57,515.00	0.13
171	300003	乐普医疗	2,100	57,078.00	0.13
172	000066	中国长城	3,000	56,970.00	0.13
173	003816	中国广核	20,200	56,964.00	0.13
174	600183	生益科技	2,000	56,320.00	0.13
175	000783	长江证券	6,700	56,280.00	0.13
176	601108	财通证券	4,400	55,660.00	0.13
177	688002	睿创微纳	500	55,500.00	0.13
178	601360	三六零	3,500	54,985.00	0.12
179	600760	中航沈飞	700	54,726.00	0.12
180	000596	古井贡酒	200	54,400.00	0.12

181	002371	北方华创	300	54,222.00	0.12
182	300285	国瓷材料	1,200	54,132.00	0.12
183	601233	桐昆股份	2,600	53,534.00	0.12
184	002044	美年健康	4,700	53,251.00	0.12
185	603899	晨光文具	600	53,136.00	0.12
186	600143	金发科技	3,100	53,134.00	0.12
187	600486	扬农化工	400	52,800.00	0.12
188	601985	中国核电	10,700	52,644.00	0.12
189	601155	新城控股	1,500	52,245.00	0.12
190	002384	东山精密	2,000	52,000.00	0.12
191	002709	天赐材料	500	51,900.00	0.12
192	300676	华大基因	400	51,424.00	0.12
193	600383	金地集团	3,800	51,300.00	0.12
194	601555	东吴证券	5,200	51,272.00	0.12
195	603882	金域医学	400	51,248.00	0.12
196	603833	欧派家居	380	51,110.00	0.12
197	002797	第一创业	5,100	50,745.00	0.12
198	002185	华天科技	3,700	50,394.00	0.11
199	000938	紫光股份	2,460	50,307.00	0.11
200	002414	高德红外	1,200	50,100.00	0.11
201	000069	华侨城 A	7,000	49,630.00	0.11
202	300144	宋城演艺	2,800	49,616.00	0.11
203	002024	苏宁易购	6,400	49,344.00	0.11
204	601669	中国电建	12,700	49,276.00	0.11
205	002385	大北农	5,100	49,266.00	0.11
206	600885	宏发股份	900	48,798.00	0.11
207	600739	辽宁成大	2,000	48,640.00	0.11
208	600111	北方稀土	3,700	48,433.00	0.11
209	000977	浪潮信息	1,800	48,384.00	0.11
210	300529	健帆生物	700	47,474.00	0.11
211	002456	欧菲光	3,600	47,448.00	0.11
212	601878	浙商证券	3,100	47,430.00	0.11
213	300496	中科创达	400	46,800.00	0.11
214	601933	永辉超市	6,500	46,670.00	0.11
215	601138	工业富联	3,400	46,546.00	0.11
216	002340	格林美	6,600	46,134.00	0.10
217	600029	南方航空	7,700	45,892.00	0.10
218	600161	天坛生物	1,100	45,870.00	0.10
219	002607	中公教育	1,300	45,669.00	0.10
220	688036	传音控股	300	45,642.00	0.10
221	600522	中天科技	4,200	45,528.00	0.10
222	601099	太平洋	11,100	45,288.00	0.10

223	002602	世纪华通	6,340	45,077.40	0.10
224	603486	科沃斯	500	44,245.00	0.10
225	600010	包钢股份	37,500	43,875.00	0.10
226	600795	国电电力	19,400	43,650.00	0.10
227	603658	安图生物	300	43,554.00	0.10
228	000425	徐工机械	8,100	43,497.00	0.10
229	002916	深南电路	400	43,224.00	0.10
230	002791	坚朗五金	300	43,200.00	0.10
231	300136	信维通信	1,200	43,056.00	0.10
232	601966	玲珑轮胎	1,220	42,907.40	0.10
233	601800	中国交建	5,900	42,834.00	0.10
234	603806	福斯特	500	42,700.00	0.10
235	603338	浙江鼎力	420	42,499.80	0.10
236	002507	涪陵榨菜	1,000	42,300.00	0.10
237	002625	光启技术	1,900	42,275.00	0.10
238	600201	生物股份	2,000	41,780.00	0.09
239	002568	百润股份	400	41,716.00	0.09
240	600886	国投电力	4,800	41,472.00	0.09
241	603589	口子窖	600	41,340.00	0.09
242	601168	西部矿业	3,300	40,854.00	0.09
243	601600	中国铝业	11,200	40,656.00	0.09
244	601607	上海医药	2,100	40,320.00	0.09
245	600529	山东药玻	800	40,120.00	0.09
246	600705	中航资本	9,100	39,858.00	0.09
247	000963	华东医药	1,500	39,840.00	0.09
248	600316	洪都航空	700	39,809.00	0.09
249	000728	国元证券	4,430	39,692.80	0.09
250	000703	恒逸石化	3,100	39,680.00	0.09
251	000708	中信特钢	1,800	39,222.00	0.09
252	000656	金科股份	5,500	38,995.00	0.09
253	002078	太阳纸业	2,700	38,961.00	0.09
254	601111	中国国航	5,200	38,948.00	0.09
255	002013	中航机电	3,400	38,930.00	0.09
256	600061	国投资本	2,800	38,724.00	0.09
257	000750	国海证券	6,600	38,676.00	0.09
258	601838	成都银行	3,600	38,412.00	0.09
259	300357	我武生物	500	38,350.00	0.09
260	002030	达安基因	1,110	38,073.00	0.09
261	600219	南山铝业	11,900	37,604.00	0.09
262	002463	沪电股份	2,000	37,580.00	0.09
263	300088	长信科技	4,200	37,338.00	0.08
264	600066	宇通客车	2,200	37,224.00	0.08

265	000636	风华高科	1,100	37,070.00	0.08
266	688029	南微医学	200	36,802.00	0.08
267	300223	北京君正	400	36,596.00	0.08
268	600606	绿地控股	6,200	36,146.00	0.08
269	600862	中航高科	1,200	36,120.00	0.08
270	300316	晶盛机电	1,200	36,096.00	0.08
271	600362	江西铜业	1,800	35,910.00	0.08
272	600884	杉杉股份	1,990	35,879.70	0.08
273	002157	正邦科技	2,100	35,784.00	0.08
274	600132	重庆啤酒	300	35,697.00	0.08
275	300482	万孚生物	400	35,684.00	0.08
276	300699	光威复材	400	35,620.00	0.08
277	600115	东方航空	7,600	35,568.00	0.08
278	600699	均胜电子	1,400	35,504.00	0.08
279	600118	中国卫星	1,100	35,398.00	0.08
280	603816	顾家家居	500	35,255.00	0.08
281	002131	利欧股份	11,600	35,148.00	0.08
282	002353	杰瑞股份	1,000	35,000.00	0.08
283	002422	科伦药业	1,800	34,992.00	0.08
284	600340	华夏幸福	2,700	34,911.00	0.08
285	601162	天风证券	5,700	34,770.00	0.08
286	601128	常熟银行	4,700	34,686.00	0.08
287	601997	贵阳银行	4,300	34,185.00	0.08
288	603444	吉比特	80	34,080.00	0.08
289	600011	华能国际	7,600	34,048.00	0.08
290	002252	上海莱士	4,600	34,040.00	0.08
291	601816	京沪高铁	6,000	33,960.00	0.08
292	600177	雅戈尔	4,700	33,793.00	0.08
293	002920	德赛西威	400	33,656.00	0.08
294	002212	天融信	1,600	33,616.00	0.08
295	002465	海格通信	3,100	33,573.00	0.08
296	601727	上海电气	6,200	33,480.00	0.08
297	601021	春秋航空	600	33,258.00	0.08
298	600779	水井坊	400	33,208.00	0.08
299	002120	韵达股份	2,100	32,970.00	0.07
300	002075	沙钢股份	3,000	32,910.00	0.07
301	300595	欧普康视	400	32,768.00	0.07
302	002508	老板电器	800	32,624.00	0.07
303	600460	士兰微	1,300	32,500.00	0.07
304	000009	中国宝安	4,300	32,379.00	0.07
305	002683	宏大爆破	900	32,355.00	0.07
306	300001	特锐德	1,100	32,296.00	0.07

307	600563	法拉电子	300	32,265.00	0.07
308	002500	山西证券	3,600	32,220.00	0.07
309	601618	中国中冶	11,800	32,214.00	0.07
310	600637	东方明珠	3,600	32,184.00	0.07
311	600487	亨通光电	2,300	32,177.00	0.07
312	600867	通化东宝	2,400	32,112.00	0.07
313	601990	南京证券	2,600	31,902.00	0.07
314	000998	隆平高科	1,600	31,696.00	0.07
315	688099	晶晨股份	400	31,492.00	0.07
316	300146	汤臣倍健	1,300	31,395.00	0.07
317	600733	北汽蓝谷	3,600	31,212.00	0.07
318	002032	苏泊尔	400	31,196.00	0.07
319	000630	铜陵有色	12,100	31,097.00	0.07
320	002572	索菲亚	1,200	31,080.00	0.07
321	002223	鱼跃医疗	1,100	31,031.00	0.07
322	600068	葛洲坝	4,700	30,926.00	0.07
323	600369	西南证券	5,700	30,666.00	0.07
324	601198	东兴证券	2,300	30,636.00	0.07
325	300168	万达信息	1,400	30,366.00	0.07
326	603737	三棵树	200	30,300.00	0.07
327	002156	通富微电	1,200	30,288.00	0.07
328	000988	华工科技	1,300	30,147.00	0.07
329	603883	老百姓	474	29,781.42	0.07
330	600511	国药股份	600	29,586.00	0.07
331	002138	顺络电子	1,200	29,424.00	0.07
332	002673	西部证券	2,900	29,406.00	0.07
333	600332	白云山	1,000	29,250.00	0.07
334	300628	亿联网络	400	29,248.00	0.07
335	002299	圣农发展	1,100	29,194.00	0.07
336	600489	中金黄金	3,300	29,073.00	0.07
337	002773	康弘药业	600	28,890.00	0.07
338	002670	国盛金控	2,100	28,875.00	0.07
339	600909	华安证券	3,600	28,800.00	0.07
340	002250	联化科技	1,200	28,788.00	0.07
341	601216	君正集团	5,800	28,710.00	0.07
342	300271	华宇软件	1,200	28,644.00	0.06
343	000021	深科技	1,500	28,515.00	0.06
344	000039	中集集团	1,900	28,481.00	0.06
345	300618	寒锐钴业	300	28,473.00	0.06
346	300070	碧水源	3,700	28,305.00	0.06
347	000961	中南建设	3,200	28,256.00	0.06
348	002603	以岭药业	1,100	28,050.00	0.06



349	002444	巨星科技	900	27,999.00	0.06
350	688088	虹软科技	400	27,968.00	0.06
351	300463	迈克生物	600	27,960.00	0.06
352	300418	昆仑万维	1,400	27,930.00	0.06
353	600380	健康元	2,000	27,820.00	0.06
354	601658	邮储银行	5,800	27,724.00	0.06
355	600879	航天电子	3,700	27,676.00	0.06
356	600845	宝信软件	400	27,592.00	0.06
357	603638	艾迪精密	400	27,576.00	0.06
358	600516	方大炭素	3,900	27,573.00	0.06
359	601881	中国银河	2,200	27,522.00	0.06
360	002926	华西证券	2,200	27,456.00	0.06
361	600018	上港集团	6,000	27,420.00	0.06
362	002739	万达电影	1,500	27,120.00	0.06
363	300115	长盈精密	1,100	27,115.00	0.06
364	002557	洽洽食品	500	26,925.00	0.06
365	600418	江淮汽车	2,200	26,906.00	0.06
366	601689	拓普集团	700	26,901.00	0.06
367	600004	白云机场	1,900	26,847.00	0.06
368	600801	华新水泥	1,300	26,819.00	0.06
369	601998	中信银行	5,200	26,572.00	0.06
370	600390	五矿资本	3,800	26,524.00	0.06
371	600498	烽火通信	1,100	26,488.00	0.06
372	600155	华创阳安	2,000	26,380.00	0.06
373	000623	吉林敖东	1,600	26,352.00	0.06
374	002081	金螳螂	2,800	26,292.00	0.06
375	000878	云南铜业	1,800	26,046.00	0.06
376	300024	机器人	2,100	25,830.00	0.06
377	688009	中国通号	4,400	25,784.00	0.06
378	600754	锦江酒店	500	25,765.00	0.06
379	000739	普洛药业	1,100	25,608.00	0.06
380	600415	小商品城	4,600	25,346.00	0.06
381	601117	中国化学	4,300	25,241.00	0.06
382	600271	航天信息	2,000	25,200.00	0.06
383	600038	中直股份	400	25,084.00	0.06
384	000050	深天马 A	1,700	25,058.00	0.06
385	002511	中顺洁柔	1,200	25,044.00	0.06
386	600765	中航重机	1,000	25,000.00	0.06
387	002373	千方科技	1,300	24,856.00	0.06
388	600166	福田汽车	7,800	24,570.00	0.06
388	600667	太极实业	2,600	24,570.00	0.06
389	000513	丽珠集团	600	24,300.00	0.06

390	002064	华峰化学	2,400	24,216.00	0.05
391	002080	中材科技	1,000	24,180.00	0.05
392	600233	圆通速递	2,100	24,150.00	0.05
393	603290	斯达半导	100	24,090.00	0.05
394	000723	美锦能源	3,600	24,048.00	0.05
395	300315	掌趣科技	4,700	24,017.00	0.05
396	600655	豫园股份	2,700	24,003.00	0.05
397	300244	迪安诊断	700	23,996.00	0.05
398	000975	银泰黄金	2,780	23,935.80	0.05
399	002958	青农商行	4,700	23,923.00	0.05
400	600085	同仁堂	1,000	23,900.00	0.05
401	600153	建发股份	2,900	23,809.00	0.05
402	601319	中国人保	3,600	23,652.00	0.05
403	603866	桃李面包	400	23,640.00	0.05
404	600549	厦门钨业	1,400	23,590.00	0.05
405	600372	中航电子	1,200	23,580.00	0.05
406	000686	东北证券	2,400	23,568.00	0.05
407	300009	安科生物	1,600	23,488.00	0.05
408	300017	网宿科技	3,400	23,426.00	0.05
409	002124	天邦股份	1,600	23,360.00	0.05
410	601916	浙商银行	5,700	23,256.00	0.05
410	603156	养元饮品	900	23,256.00	0.05
411	601231	环旭电子	1,200	23,208.00	0.05
412	002273	水晶光电	2,000	23,180.00	0.05
413	603858	步长制药	1,000	23,070.00	0.05
414	000830	鲁西化工	1,800	23,004.00	0.05
415	600208	新潮中宝	7,400	22,940.00	0.05
416	000738	航发控制	1,000	22,930.00	0.05
417	601615	明阳智能	1,200	22,776.00	0.05
418	002019	亿帆医药	1,200	22,716.00	0.05
419	000540	中天金融	7,200	22,680.00	0.05
420	002558	巨人网络	1,300	22,659.00	0.05
421	000401	冀东水泥	1,600	22,640.00	0.05
422	600170	上海建工	7,500	22,575.00	0.05
423	600642	申能股份	4,300	22,446.00	0.05
424	601236	红塔证券	1,200	22,308.00	0.05
425	600918	中泰证券	1,200	22,200.00	0.05
426	600535	天士力	1,500	22,185.00	0.05
427	600895	张江高科	1,300	22,152.00	0.05
428	002195	二三四五	9,800	22,148.00	0.05
429	603605	珀莱雅	124	22,072.00	0.05
430	002028	思源电气	1,100	22,066.00	0.05

431	600848	上海临港	1,100	22,022.00	0.05
432	600998	九州通	1,200	21,792.00	0.05
433	002506	协鑫集成	5,100	21,675.00	0.05
434	600008	首创股份	7,650	21,649.50	0.05
435	002966	苏州银行	2,800	21,504.00	0.05
435	600482	中国动力	1,200	21,504.00	0.05
436	002831	裕同科技	700	21,434.00	0.05
437	002152	广电运通	2,000	21,360.00	0.05
438	600392	盛和资源	2,400	21,336.00	0.05
439	601456	国联证券	1,000	21,330.00	0.05
440	002221	东华能源	2,100	21,294.00	0.05
441	002056	横店东磁	1,400	21,266.00	0.05
442	601238	广汽集团	1,600	21,264.00	0.05
443	600150	中国船舶	1,200	21,228.00	0.05
444	600598	北大荒	1,100	21,175.00	0.05
445	000690	宝新能源	2,900	21,170.00	0.05
446	002705	新宝股份	500	21,125.00	0.05
447	002382	蓝帆医疗	1,000	21,090.00	0.05
448	601992	金隅集团	7,100	21,087.00	0.05
449	300058	蓝色光标	3,500	21,000.00	0.05
450	300474	景嘉微	300	20,973.00	0.05
451	002648	卫星石化	800	20,896.00	0.05
452	000581	威孚高科	900	20,871.00	0.05
453	002595	豪迈科技	700	20,755.00	0.05
454	000060	中金岭南	4,300	20,726.00	0.05
455	600497	驰宏锌锗	4,300	20,640.00	0.05
456	002939	长城证券	1,600	20,592.00	0.05
457	002372	伟星新材	1,100	20,570.00	0.05
458	603195	公牛集团	100	20,529.00	0.05
459	600409	三友化工	2,000	20,500.00	0.05
460	000729	燕京啤酒	2,400	20,448.00	0.05
461	000807	云铝股份	2,700	20,331.00	0.05
462	002281	光迅科技	700	20,328.00	0.05
463	600580	卧龙电驱	1,300	20,280.00	0.05
464	601866	中远海发	6,800	20,196.00	0.05
465	603392	万泰生物	100	20,153.00	0.05
466	000983	山西焦煤	3,570	20,134.80	0.05
467	600528	中铁工业	2,300	20,102.00	0.05
468	600875	东方电气	2,000	19,940.00	0.05
469	002294	信立泰	700	19,831.00	0.04
470	601872	招商轮船	3,500	19,775.00	0.04
471	600297	广汇汽车	6,900	19,734.00	0.04

472	601717	郑煤机	1,800	19,674.00	0.04
473	300212	易华录	640	19,616.00	0.04
474	600859	王府井	600	19,548.00	0.04
475	600256	广汇能源	6,900	19,527.00	0.04
476	002985	北摩高科	100	19,330.00	0.04
477	002925	盈趣科技	300	19,299.00	0.04
478	600704	物产中大	4,400	19,228.00	0.04
479	002429	兆驰股份	3,100	19,220.00	0.04
480	600258	首旅酒店	900	19,098.00	0.04
481	300296	利亚德	3,000	19,080.00	0.04
482	000960	锡业股份	1,700	19,040.00	0.04
482	600027	华电国际	5,600	19,040.00	0.04
483	600811	东方集团	5,200	18,980.00	0.04
483	600827	百联股份	1,300	18,980.00	0.04
484	002146	荣盛发展	2,900	18,937.00	0.04
485	600160	巨化股份	2,310	18,734.10	0.04
486	600260	凯乐科技	1,700	18,530.00	0.04
487	002396	星网锐捷	800	18,448.00	0.04
488	603317	天味食品	224	18,421.76	0.04
489	600737	中粮糖业	1,900	18,392.00	0.04
490	002268	卫士通	1,100	18,370.00	0.04
491	000997	新大陆	1,200	18,336.00	0.04
492	600839	四川长虹	6,300	18,270.00	0.04
493	600515	海航基础	2,700	18,225.00	0.04
494	600728	佳都科技	2,400	18,216.00	0.04
495	600167	联美控股	1,600	18,160.00	0.04
496	600597	光明乳业	1,100	17,886.00	0.04
497	002092	中泰化学	2,900	17,835.00	0.04
498	600446	金证股份	1,100	17,831.00	0.04
499	002085	万丰奥威	2,700	17,712.00	0.04
499	002690	美亚光电	400	17,712.00	0.04
500	000671	阳光城	2,700	17,604.00	0.04
501	002745	木林森	1,200	17,508.00	0.04
502	600325	华发股份	2,800	17,388.00	0.04
503	300002	神州泰岳	3,400	17,374.00	0.04
504	600315	上海家化	500	17,365.00	0.04
505	600820	隧道股份	3,200	17,312.00	0.04
506	601577	长沙银行	1,800	17,136.00	0.04
507	600881	亚泰集团	5,500	17,050.00	0.04
508	600967	内蒙一机	1,400	17,024.00	0.04
509	000012	南玻A	2,300	16,974.00	0.04
510	002390	信邦制药	2,000	16,960.00	0.04

511	603000	人民网	1,000	16,900.00	0.04
512	000930	中粮科技	2,000	16,840.00	0.04
513	600410	华胜天成	1,900	16,834.00	0.04
514	600804	鹏博士	2,500	16,800.00	0.04
515	000877	天山股份	1,100	16,610.00	0.04
515	600567	山鹰国际	5,500	16,610.00	0.04
516	601179	中国西电	3,600	16,596.00	0.04
517	000627	天茂集团	3,400	16,558.00	0.04
518	000709	河钢股份	7,300	16,352.00	0.04
519	600216	浙江医药	1,200	16,320.00	0.04
520	600282	南钢股份	5,200	16,224.00	0.04
521	600435	北方导航	1,800	16,200.00	0.04
522	002368	太极股份	620	16,188.20	0.04
523	000301	东方盛虹	1,700	16,116.00	0.04
524	000629	攀钢钒钛	7,400	16,058.00	0.04
525	600026	中远海能	2,400	16,032.00	0.04
526	002242	九阳股份	500	16,020.00	0.04
527	002387	维信诺	1,400	15,960.00	0.04
527	601865	福莱特	400	15,960.00	0.04
528	000400	许继电气	1,100	15,906.00	0.04
529	600908	无锡银行	2,600	15,808.00	0.04
530	002174	游族网络	1,200	15,792.00	0.04
531	600273	嘉化能源	1,700	15,708.00	0.04
532	600037	歌华有线	1,700	15,640.00	0.04
533	600718	东软集团	1,500	15,615.00	0.04
534	002153	石基信息	500	15,545.00	0.04
535	002004	华邦健康	2,800	15,512.00	0.04
536	002807	江阴银行	3,600	15,408.00	0.03
537	600064	南京高科	1,500	15,405.00	0.03
538	300166	东方国信	1,400	15,330.00	0.03
539	000027	深圳能源	2,500	15,225.00	0.03
540	600188	兖州煤业	1,500	15,105.00	0.03
541	000778	新兴铸管	4,100	15,088.00	0.03
542	300630	普利制药	360	15,080.40	0.03
543	600572	康恩贝	3,200	15,072.00	0.03
544	001914	招商积余	700	15,071.00	0.03
545	601975	招商南油	6,000	15,060.00	0.03
546	000999	华润三九	600	14,964.00	0.03
547	600060	海信视像	1,300	14,924.00	0.03
548	600039	四川路桥	3,300	14,883.00	0.03
549	000932	华菱钢铁	3,100	14,818.00	0.03
550	688321	微芯生物	400	14,804.00	0.03

551	600158	中体产业	1,200	14,712.00	0.03
552	000089	深圳机场	1,800	14,706.00	0.03
553	600755	厦门国贸	2,200	14,696.00	0.03
554	601005	重庆钢铁	9,900	14,652.00	0.03
555	000598	兴蓉环境	3,000	14,400.00	0.03
556	300026	红日药业	3,100	14,198.00	0.03
557	600398	海澜之家	2,200	14,124.00	0.03
558	000825	太钢不锈	3,900	14,079.00	0.03
559	601106	中国一重	4,700	14,053.00	0.03
560	000887	中鼎股份	1,200	14,052.00	0.03
561	601808	中海油服	1,100	14,047.00	0.03
562	600989	宝丰能源	1,200	14,040.00	0.03
563	600171	上海贝岭	1,000	14,020.00	0.03
564	002233	塔牌集团	1,100	14,014.00	0.03
565	002048	宁波华翔	900	14,013.00	0.03
566	601118	海南橡胶	2,900	13,978.00	0.03
567	002191	劲嘉股份	1,500	13,845.00	0.03
568	601696	中银证券	500	13,840.00	0.03
569	002701	奥瑞金	2,800	13,832.00	0.03
570	600195	中牧股份	1,077	13,796.37	0.03
571	000028	国药一致	300	13,740.00	0.03
572	600120	浙江东方	2,300	13,731.00	0.03
573	300072	三聚环保	2,400	13,632.00	0.03
574	000528	柳工	1,851	13,623.36	0.03
575	601077	渝农商行	3,000	13,500.00	0.03
576	002110	三钢闽光	2,000	13,460.00	0.03
577	600025	华能水电	3,000	13,380.00	0.03
578	600022	山东钢铁	9,300	13,299.00	0.03
579	000970	中科三环	1,400	13,230.00	0.03
580	002317	众生药业	1,200	13,224.00	0.03
581	603087	甘李药业	100	13,222.00	0.03
582	000883	湖北能源	3,400	13,192.00	0.03
583	600507	方大特钢	1,900	13,186.00	0.03
584	002128	露天煤业	1,200	13,128.00	0.03
585	002217	合力泰	3,200	13,120.00	0.03
586	601333	广深铁路	5,900	13,098.00	0.03
587	000869	张裕A	300	13,080.00	0.03
587	601200	上海环境	1,200	13,080.00	0.03
588	600673	东阳光	2,600	13,078.00	0.03
589	000090	天健集团	2,200	13,068.00	0.03
590	601860	紫金银行	3,100	13,051.00	0.03
591	000990	诚志股份	1,100	13,046.00	0.03

592	002563	森马服饰	1,300	13,026.00	0.03
593	000967	盈峰环境	1,600	13,024.00	0.03
594	601699	潞安环能	2,000	13,000.00	0.03
595	002936	郑州银行	2,910	12,978.60	0.03
596	603077	和邦生物	9,100	12,922.00	0.03
597	600376	首开股份	2,200	12,914.00	0.03
598	000402	金融街	2,000	12,900.00	0.03
599	600056	中国医药	900	12,897.00	0.03
600	600782	新钢股份	2,800	12,852.00	0.03
601	000488	晨鸣纸业	2,000	12,840.00	0.03
602	000563	陕国投 A	3,400	12,818.00	0.03
603	600021	上海电力	1,800	12,816.00	0.03
604	002839	张家港行	2,100	12,810.00	0.03
605	600928	西安银行	2,300	12,788.00	0.03
606	300376	易事特	1,600	12,736.00	0.03
607	601698	中国卫通	700	12,698.00	0.03
608	300010	豆神教育	1,300	12,688.00	0.03
609	600500	中化国际	2,400	12,648.00	0.03
609	601000	唐山港	5,100	12,648.00	0.03
610	002266	浙富控股	2,800	12,600.00	0.03
611	002203	海亮股份	1,700	12,563.00	0.03
612	603885	吉祥航空	1,100	12,507.00	0.03
613	603712	七一二	300	12,495.00	0.03
614	000898	鞍钢股份	4,100	12,464.00	0.03
615	000685	中山公用	1,500	12,450.00	0.03
616	603650	彤程新材	400	12,400.00	0.03
617	002244	滨江集团	2,700	12,393.00	0.03
618	600970	中材国际	1,800	12,384.00	0.03
619	300133	华策影视	2,000	12,360.00	0.03
620	600073	上海梅林	1,200	12,348.00	0.03
621	601598	中国外运	2,800	12,320.00	0.03
622	600006	东风汽车	1,300	12,272.00	0.03
623	002458	益生股份	1,100	12,265.00	0.03
624	600126	杭钢股份	2,300	12,167.00	0.03
625	002440	闰土股份	1,300	12,116.00	0.03
626	600373	中文传媒	1,200	12,108.00	0.03
627	600259	广晟有色	400	12,068.00	0.03
628	600466	蓝光发展	2,600	12,038.00	0.03
629	603927	中科软	300	12,027.00	0.03
630	000519	中兵红箭	1,200	12,024.00	0.03
631	300113	顺网科技	700	12,005.00	0.03
631	601016	节能风电	3,500	12,005.00	0.03

632	603568	伟明环保	630	11,925.90	0.03
633	002155	湖南黄金	1,400	11,914.00	0.03
634	600266	城建发展	2,340	11,887.20	0.03
635	300180	华峰超纤	2,000	11,820.00	0.03
636	000559	万向钱潮	2,200	11,770.00	0.03
637	000758	中色股份	2,300	11,684.00	0.03
638	300182	捷成股份	3,600	11,628.00	0.03
639	600959	江苏有线	3,500	11,585.00	0.03
640	600729	重庆百货	400	11,560.00	0.03
641	601608	中信重工	2,900	11,484.00	0.03
642	600649	城投控股	2,100	11,403.00	0.03
643	002505	鹏都农牧	4,500	11,385.00	0.03
644	002183	怡亚通	2,600	11,336.00	0.03
645	600094	大名城	2,800	11,256.00	0.03
646	600348	阳泉煤业	2,000	11,220.00	0.03
647	601718	际华集团	3,700	11,211.00	0.03
648	002038	双鹭药业	1,100	11,110.00	0.03
649	002468	申通快递	1,100	11,088.00	0.03
650	600546	山煤国际	1,300	11,063.00	0.03
651	600141	兴发集团	1,000	11,030.00	0.03
652	600901	江苏租赁	2,000	11,020.00	0.02
653	600808	马钢股份	4,100	10,906.00	0.02
654	002408	齐翔腾达	1,300	10,868.00	0.02
655	000078	海王生物	2,700	10,827.00	0.02
656	002249	大洋电机	2,400	10,800.00	0.02
657	002640	跨境通	2,100	10,794.00	0.02
658	600062	华润双鹤	900	10,791.00	0.02
659	000959	首钢股份	2,800	10,724.00	0.02
660	002434	万里扬	1,200	10,704.00	0.02
661	002867	周大生	400	10,660.00	0.02
662	600388	龙净环保	1,200	10,656.00	0.02
663	000564	供销大集	4,100	10,619.00	0.02
664	600633	浙数文化	1,300	10,582.00	0.02
665	601958	金钼股份	1,700	10,557.00	0.02
666	000158	常山北明	1,700	10,540.00	0.02
667	601098	中南传媒	1,100	10,483.00	0.02
668	603198	迎驾贡酒	300	10,470.00	0.02
669	600675	中华企业	3,100	10,416.00	0.02
670	002010	传化智联	2,200	10,362.00	0.02
671	002399	海普瑞	600	10,332.00	0.02
672	002901	大博医疗	140	10,322.20	0.02
673	000415	渤海租赁	4,300	10,320.00	0.02



674	600863	内蒙华电	4,000	10,280.00	0.02
675	601778	晶科科技	1,400	10,164.00	0.02
676	601880	大连港	5,200	10,036.00	0.02
677	603260	合盛硅业	300	10,032.00	0.02
678	002589	瑞康医药	1,900	9,937.00	0.02
679	002583	海能达	1,600	9,824.00	0.02
680	600645	中源协和	500	9,805.00	0.02
681	600643	爱建集团	1,300	9,776.00	0.02
682	600835	上海机电	500	9,730.00	0.02
683	300459	金科文化	3,000	9,570.00	0.02
684	600776	东方通信	800	9,480.00	0.02
685	000826	启迪环境	1,400	9,464.00	0.02
685	601611	中国核建	1,300	9,464.00	0.02
686	000501	鄂武商 A	800	9,320.00	0.02
687	002002	鸿达兴业	3,100	9,300.00	0.02
688	600312	平高电气	1,300	9,282.00	0.02
689	600717	天津港	1,940	9,273.20	0.02
690	000031	大悦城	2,100	9,240.00	0.02
691	600823	世茂股份	2,000	9,220.00	0.02
692	000061	农产品	1,300	9,165.00	0.02
693	000681	视觉中国	700	9,100.00	0.02
694	603515	欧普照明	300	9,063.00	0.02
695	603228	景旺电子	300	9,045.00	0.02
696	002375	亚厦股份	1,200	8,928.00	0.02
697	000718	苏宁环球	2,600	8,918.00	0.02
698	000046	泛海控股	2,700	8,856.00	0.02
699	600307	酒钢宏兴	5,300	8,745.00	0.02
700	002815	崇达技术	600	8,664.00	0.02
701	000008	神州高铁	3,400	8,636.00	0.02
702	600339	中油工程	2,800	8,624.00	0.02
703	002635	安洁科技	500	8,615.00	0.02
704	002424	贵州百灵	1,100	8,613.00	0.02
705	000156	华数传媒	1,000	8,560.00	0.02
706	000717	韶钢松山	2,000	8,540.00	0.02
707	600131	国网信通	600	8,538.00	0.02
708	300324	旋极信息	2,000	8,460.00	0.02
709	002544	杰赛科技	500	8,390.00	0.02
710	600338	西藏珠峰	800	8,384.00	0.02
711	600648	外高桥	600	8,382.00	0.02
712	600968	海油发展	3,500	8,365.00	0.02
713	000543	皖能电力	2,000	8,360.00	0.02
714	600582	天地科技	2,700	8,316.00	0.02

715	002948	青岛银行	1,400	8,302.00	0.02
716	600664	哈药股份	2,600	8,294.00	0.02
717	002416	爱施德	1,100	8,206.00	0.02
718	601869	长飞光纤	300	8,112.00	0.02
719	600566	济川药业	400	8,092.00	0.02
720	600869	远东股份	2,000	7,980.00	0.02
721	000937	冀中能源	1,900	7,904.00	0.02
722	002302	西部建设	900	7,902.00	0.02
723	600748	上实发展	1,600	7,856.00	0.02
724	600985	淮北矿业	700	7,833.00	0.02
725	601298	青岛港	1,200	7,716.00	0.02
726	603379	三美股份	400	7,640.00	0.02
727	603888	新华网	400	7,600.00	0.02
728	601928	凤凰传媒	1,200	7,596.00	0.02
729	600556	天下秀	600	7,590.00	0.02
730	600707	彩虹股份	1,100	7,326.00	0.02
731	601139	深圳燃气	1,000	7,240.00	0.02
732	603893	瑞芯微	100	7,235.00	0.02
733	002503	搜于特	3,200	7,168.00	0.02
734	002946	新乳业	400	7,044.00	0.02
735	600329	中新药业	400	7,008.00	0.02
736	600545	卓郎智能	2,000	7,000.00	0.02
737	600787	中储股份	1,500	6,915.00	0.02
738	600277	亿利洁能	2,300	6,877.00	0.02
739	300257	开山股份	500	6,825.00	0.02
740	600291	西水股份	1,200	6,804.00	0.02
741	600350	山东高速	1,100	6,798.00	0.02
742	603786	科博达	100	6,762.00	0.02
743	601228	广州港	2,000	6,720.00	0.02
744	601828	美凯龙	790	6,707.10	0.02
745	600517	国网英大	1,100	6,688.00	0.02
746	000813	德展健康	1,500	6,645.00	0.02
747	002093	国脉科技	900	6,561.00	0.01
748	600871	石化油服	3,300	6,468.00	0.01
749	603708	家家悦	300	6,390.00	0.01
750	002051	中工国际	900	6,381.00	0.01
751	000537	广宇发展	1,000	6,270.00	0.01
752	600575	淮河能源	2,700	6,264.00	0.01
753	000062	深圳华强	500	6,220.00	0.01
754	600639	浦东金桥	500	6,200.00	0.01
755	300134	大富科技	600	6,198.00	0.01
756	000600	建投能源	1,100	6,171.00	0.01

757	600640	号百控股	500	6,125.00	0.01
758	002419	天虹股份	800	6,112.00	0.01
759	603355	莱克电气	200	6,046.00	0.01
760	002945	华林证券	400	6,028.00	0.01
761	603225	新凤鸣	431	5,990.90	0.01
762	603719	良品铺子	100	5,867.00	0.01
763	600053	九鼎投资	300	5,865.00	0.01
764	603377	东方时尚	300	5,808.00	0.01
765	600623	华谊集团	1,000	5,800.00	0.01
766	600657	信达地产	1,400	5,670.00	0.01
767	603328	依顿电子	700	5,565.00	0.01
768	000732	泰禾集团	1,700	5,559.00	0.01
769	000553	安道麦 A	700	5,474.00	0.01
770	002653	海思科	300	5,256.00	0.01
771	601801	皖新传媒	1,100	5,225.00	0.01
772	603983	丸美股份	100	5,221.00	0.01
773	601127	小康股份	300	5,124.00	0.01
774	603056	德邦股份	400	5,076.00	0.01
775	603868	飞科电器	100	4,678.00	0.01
776	601003	柳钢股份	900	4,671.00	0.01
777	600299	安迪苏	400	4,604.00	0.01
778	002941	新疆交建	400	4,400.00	0.01
779	002818	富森美	300	4,239.00	0.01
780	002957	科瑞技术	200	4,090.00	0.01
781	601512	中新集团	400	3,976.00	0.01
782	002423	中粮资本	400	3,872.00	0.01
783	600903	贵州燃气	300	3,810.00	0.01
784	601969	海南矿业	600	3,588.00	0.01
785	603256	宏和科技	400	3,532.00	0.01
786	001872	招商港口	220	3,502.40	0.01
787	600917	重庆燃气	400	2,744.00	0.01
788	601068	中铝国际	500	1,780.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300862	蓝盾光电	556	21,428.24	0.05
2	605277	新亚电子	329	5,576.55	0.01
3	003030	祖名股份	348	5,282.64	0.01
4	003031	中瓷电子	325	4,962.75	0.01
5	300861	美畅股份	60	3,066.00	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	15,621,785.00	35.41
2	600519	贵州茅台	14,676,343.27	33.27
3	600036	招商银行	7,093,769.00	16.08
4	000858	五粮液	7,039,253.18	15.96
5	600276	恒瑞医药	6,358,069.39	14.41
6	000333	美的集团	5,513,961.04	12.50
7	000651	格力电器	5,071,540.00	11.50
8	600030	中信证券	4,676,241.00	10.60
9	002475	立讯精密	4,128,368.30	9.36
10	601166	兴业银行	3,900,549.06	8.84
11	600887	伊利股份	3,655,869.39	8.29
12	000002	万科A	3,536,216.00	8.02
13	601398	工商银行	3,252,521.00	7.37
14	601888	中国中免	3,148,870.08	7.14
15	600900	长江电力	2,969,355.00	6.73
16	300059	东方财富	2,955,496.00	6.70
17	000661	长春高新	2,748,086.00	6.23
18	601328	交通银行	2,596,944.00	5.89
19	000001	平安银行	2,569,418.00	5.82
20	000725	京东方A	2,453,153.00	5.56
21	600585	海螺水泥	2,421,180.00	5.49
22	002714	牧原股份	2,413,063.00	5.47
23	600000	浦发银行	2,411,960.14	5.47
24	601688	华泰证券	2,370,939.08	5.37
25	002415	海康威视	2,368,948.50	5.37
26	600837	海通证券	2,354,910.00	5.34
27	600016	民生银行	2,279,061.00	5.17
28	603288	海天味业	2,176,900.00	4.93
29	601012	隆基股份	2,163,336.00	4.90
30	600048	保利地产	2,152,816.00	4.88
31	600031	三一重工	2,148,153.00	4.87
32	000063	中兴通讯	2,135,006.00	4.84
33	601668	中国建筑	1,946,585.00	4.41
34	300498	温氏股份	1,929,518.00	4.37
35	603259	药明康德	1,834,642.98	4.16
36	600570	恒生电子	1,778,903.32	4.03
37	603986	兆易创新	1,777,786.00	4.03

38	601288	农业银行	1,764,029.00	4.00
39	000568	泸州老窖	1,684,613.00	3.82
40	300015	爱尔眼科	1,633,477.70	3.70
41	002142	宁波银行	1,623,924.85	3.68
42	601211	国泰君安	1,623,437.00	3.68
43	000100	TCL 科技	1,598,323.00	3.62
44	601601	中国太保	1,570,406.00	3.56
45	300142	沃森生物	1,549,425.00	3.51
46	002352	顺丰控股	1,546,858.00	3.51
47	601229	上海银行	1,543,139.00	3.50
48	600309	万华化学	1,533,432.00	3.48
49	600588	用友网络	1,458,919.70	3.31
50	002304	洋河股份	1,417,696.00	3.21
51	002594	比亚迪	1,410,685.00	3.20
52	601169	北京银行	1,385,716.00	3.14
53	601988	中国银行	1,363,744.00	3.09
54	601899	紫金矿业	1,329,660.00	3.01
55	000338	潍柴动力	1,324,405.00	3.00
56	300601	康泰生物	1,297,491.00	2.94
57	002241	歌尔股份	1,277,065.00	2.89
58	600745	闻泰科技	1,255,815.00	2.85
59	600009	上海机场	1,251,650.00	2.84
60	300122	智飞生物	1,247,855.00	2.83
61	000876	新 希 望	1,245,242.00	2.82
62	600436	片仔癀	1,234,219.00	2.80
63	600690	海尔智家	1,226,067.00	2.78
64	600104	上汽集团	1,191,488.00	2.70
65	601818	光大银行	1,183,398.00	2.68
66	601766	中国中车	1,174,148.00	2.66
67	601628	中国人寿	1,174,055.00	2.66
68	002410	广联达	1,164,963.00	2.64
69	600999	招商证券	1,114,666.40	2.53
70	002555	三七互娱	1,105,224.00	2.51
71	002230	科大讯飞	1,100,350.00	2.49
72	600703	三安光电	1,091,278.00	2.47
73	002027	分众传媒	1,085,170.00	2.46
74	600919	江苏银行	1,064,720.30	2.41
75	001979	招商蛇口	1,022,307.00	2.32
76	002371	北方华创	1,015,176.00	2.30
77	300003	乐普医疗	1,007,206.00	2.28
78	000166	申万宏源	999,968.00	2.27
79	600547	山东黄金	991,143.48	2.25

80	600028	中国石化	971,136.00	2.20
81	000538	云南白药	970,975.00	2.20
82	002007	华兰生物	963,516.00	2.18
83	300347	泰格医药	961,749.25	2.18
84	600809	山西汾酒	935,304.00	2.12
85	600438	通威股份	928,344.00	2.10
86	002271	东方雨虹	921,411.00	2.09
87	601788	光大证券	918,090.00	2.08
88	002460	赣锋锂业	915,109.90	2.07
89	002129	中环股份	907,424.12	2.06
90	300413	芒果超媒	905,501.00	2.05
91	000776	广发证券	898,150.00	2.04
92	300014	亿纬锂能	890,692.00	2.02

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；  
2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	6,793,789.00	15.40
2	000333	美的集团	5,619,770.87	12.74
3	000651	格力电器	4,505,487.00	10.21
4	002475	立讯精密	3,748,483.70	8.50
5	000002	万科A	3,061,937.57	6.94
6	300059	东方财富	2,768,256.56	6.28
7	000661	长春高新	2,603,209.00	5.90
8	000001	平安银行	2,330,016.50	5.28
9	002415	海康威视	2,269,174.00	5.14
10	000725	京东方A	2,155,838.00	4.89
11	002714	牧原股份	2,155,249.60	4.89
12	000063	中兴通讯	1,695,141.00	3.84
13	300498	温氏股份	1,677,392.00	3.80
14	000568	泸州老窖	1,660,975.00	3.77
15	300015	爱尔眼科	1,634,006.50	3.70
16	300142	沃森生物	1,612,636.00	3.66
17	002142	宁波银行	1,551,802.21	3.52
18	002352	顺丰控股	1,527,777.32	3.46
19	300122	智飞生物	1,486,643.00	3.37
20	002594	比亚迪	1,452,460.00	3.29
21	000100	TCL 科技	1,447,843.00	3.28
22	002241	歌尔股份	1,360,327.00	3.08

23	600519	贵州茅台	1,342,470.00	3.04
24	002304	洋河股份	1,328,388.00	3.01
25	300601	康泰生物	1,310,845.00	2.97
26	000338	潍柴动力	1,270,074.00	2.88
27	000876	新希望	1,128,049.00	2.56
28	002027	分众传媒	1,112,462.01	2.52
29	002410	广联达	1,042,971.00	2.36
30	002007	华兰生物	977,661.11	2.22
31	002271	东方雨虹	969,172.78	2.20
32	300124	汇川技术	927,640.00	2.10
33	002230	科大讯飞	923,120.93	2.09
34	002555	三七互娱	921,584.49	2.09
35	300347	泰格医药	913,840.00	2.07
36	002371	北方华创	894,685.00	2.03
37	000538	云南白药	883,199.00	2.00

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	398,460,816.41
卖出股票收入（成交）总额	169,645,128.99

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	207,264.13
2	应收证券清算款	202,526.50
3	应收股利	-
4	应收利息	234.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	410,025.42



#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300862	蓝盾光电	21,428.24	0.05	新股锁定
2	605277	新亚电子	5,576.55	0.01	新股未上市
3	003030	祖名股份	5,282.64	0.01	新股未上市
4	003031	中瓷电子	4,962.75	0.01	新股未上市
5	300861	美畅股份	3,066.00	0.01	新股锁定

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
737	11,062.56	1,668,920.00	20.47	6,484,188.00	79.53

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信证券股份有限公司	1,298,847.00	15.93
2	广发证券股份有限公司	330,104.00	4.05
3	许金科	211,188.00	2.59
4	王云燕	199,846.00	2.45
5	王海燕	190,853.00	2.34
6	张振萍	131,898.00	1.62

7	赖国全	100,000.00	1.23
8	陶钢	99,923.00	1.23
9	罗光兴	99,923.00	1.23
10	周兰萍	99,923.00	1.23

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 6 月 1 日）基 基金份额总额	391,080,183.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	1,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	71,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-312,927,075.00
本报告期期末基金份额总额	8,153,108.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

基金管理人于 2020 年 2 月 22 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，马成先生自 2020 年 2 月 21 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

基金管理人于 2020 年 9 月 5 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于高级管理人员变更

的公告》，郭特华女士自 2020 年 9 月 3 日起不再担任工银瑞信基金管理有限公司董事长，由王海璐女士代任工银瑞信基金管理有限公司董事长。

## 2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	4	397,581,840.57	70.10%	282,802.35	73.14%	-
华泰证券	2	167,420,220.26	29.52%	102,345.12	26.47%	-
光大证券	2	2,151,817.00	0.38%	1,530.65	0.40%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

西南证券	4	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

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

(2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

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

本报告期内本基金新增开源证券 011161 深圳交易单元，开源证券 48816 上海交易单元，信达证券 010913 深圳交易单元，信达证券 47997 上海交易单元，浙商证券 009628 深圳交易单元，浙商证券 46126 上海交易单元。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金春节假期延长期间交易规则的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 29 日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 2 月 22 日
3	关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 25 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 26 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于终止中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 26 日
6	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 2 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 11 日
8	关于工银瑞信中证 800 交易型开放式	中国证监会规定的媒介	2020 年 7 月 8 日

	指数证券投资基金基金份额折算的公告		
9	关于工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 7 月 13 日
10	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 7 月 14 日
11	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定的媒介	2020 年 7 月 14 日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 7 月 17 日
13	工银瑞信基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 7 月 21 日
14	工银瑞信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 9 月 5 日
15	工银瑞信基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 10 月 27 日
16	工银瑞信基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 12 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 3 月 27 日