

中银中证 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：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：二〇二一年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 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。

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

本报告期自 2020 年 7 月 16 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	14
6.3 其他信息.....	14
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	15
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末上市基金前十名持有人	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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的情况	65
§10 开放式基金份额变动	65
§11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银 800
场内简称	中银中证 800ETF
基金主代码	515610
交易代码	515610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 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	62,857,400.00 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 8 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
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，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	欧阳向军	姜敏
	联系电话	021-38834999	4006800000
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	jiangmin@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	李庆萍
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,476,609.45
本期利润	11,967,570.22
加权平均基金份额本期利润	0.0608
本期加权平均净值利润率	6.05%
本期基金份额净值增长率	7.06%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	3,082,897.96
期末可供分配基金份额利润	0.0490
期末基金资产净值	67,295,332.02
期末基金份额净值	1.0706
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	7.06%

注：1、本基金基金合同于 2020 年 7 月 16 日生效，无过往年度数据。

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

3、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。期末可供分配收益，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

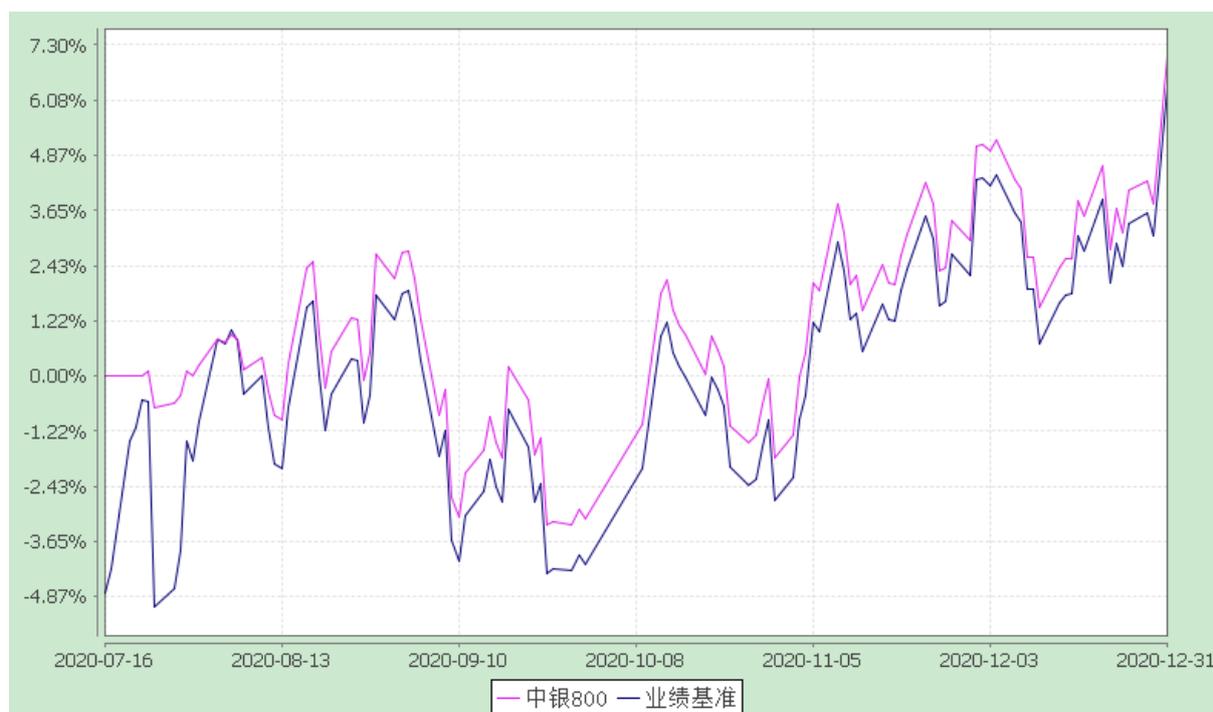
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.54%	0.99%	11.00%	1.01%	-0.46%	-0.02%
自基金合同生效日起	7.06%	0.96%	6.38%	1.24%	0.68%	-0.28%

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日)

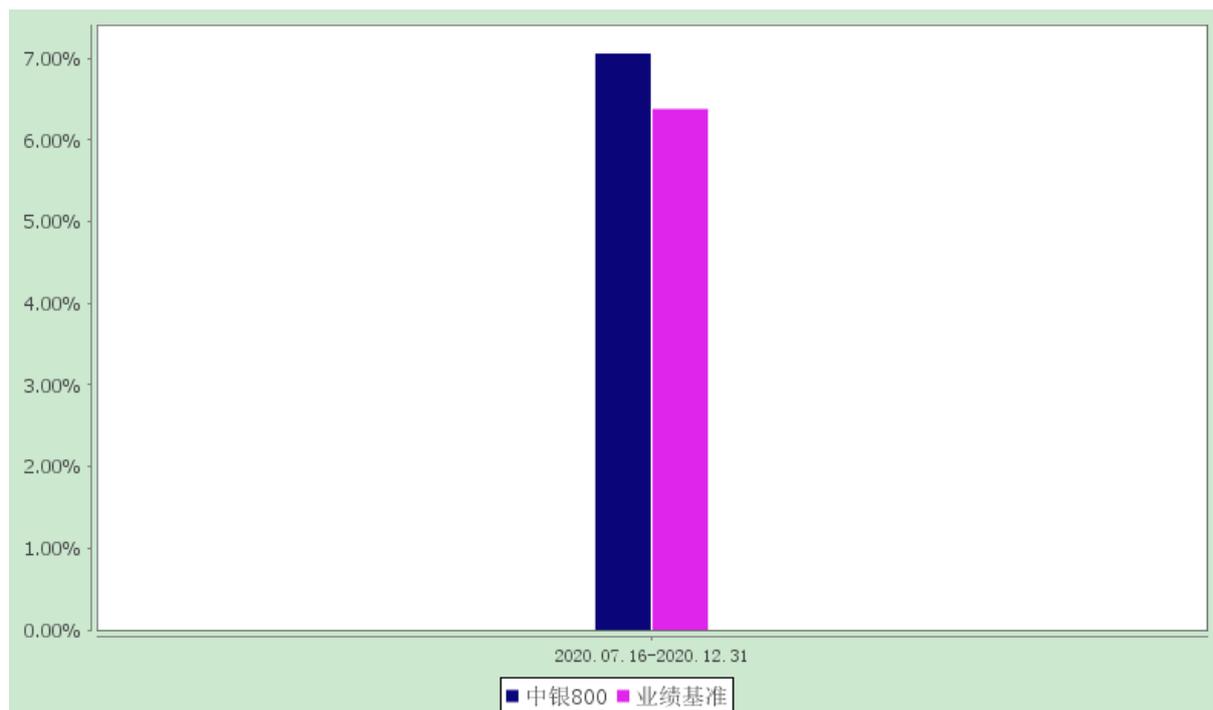


注：截至报告期末，本基金成立未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同于 2020 年 07 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2020 年 7 月 16 日）至本报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2020 年 12 月 31 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 134 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	2020-07-16	-	14	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 基金经理，2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金经理，2015 年 6 月至今任中银 300E 基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银宏利基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银丰利基金经理，2020 年 4 月至今任中银 100 基金经理，2020 年 7 月至今任中银 800 基金经理，2020 年 8 月至今任中银黄金基金经理，2020 年 9 月至今任中银上海金 ETF 联接基金经理，2020 年 11 月至今任中银中证 100ETF 联接基金经理。具有 14 年证券从业年限。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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证

各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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，2020 年全球经济先受到疫情的巨大冲击又开始缓慢复苏。具体而言，美国经济二季度受疫情影响环比下降 32.9%，三季度又环比上行 33.4%，四季度环比上行 4.0%，全年实际 GDP 下降 3.5%；消费表现好于生产，消费中表现较好的是耐用品消费，服务消费则大幅萎缩；PCE 通胀疫情期间显著下滑后回升，4 月同比增速一度降至 0.5%，但年末回升至 1.1%；失业率一度从 2020 年初的 3.6% 上升至 4 月的 14.8%，此后开始下降，年末已降至 6.7%。美联储将政策利率降至 0，并重启无限量 QE，推出各种信贷工具，支持信用市场流动性。欧元区经济复苏总体慢于美国，实际 GDP 二季度环比下降 11.8% 后，于三季度环比反弹至 12.7%，欧元区 PMI 数据弱于美国，主要是受服务业消费大幅下降的拖累，通胀同比转负，12 月 HICP 通胀率仅为 -0.3%，失业率疫情后维持高位，11 月上升至 8.6%。欧央行将主要再融资利率降至 0%，存款利率降至 -0.50%，紧急抗疫购债计划 (PEPP) 将至少持续至 2022 年 3 月底。日本经济整体维持疲弱，2020 年全年实际 GDP 增速为负，12 月 CPI 通胀同比增速降至 -0.9%，失业率疫情后小幅上升至 2.9%，日本央行亦启动无限量 QE。

国内经济方面，新冠疫情对经济造成巨大冲击，但国内疫情控制情况较好，使得中国成为全球唯一实现经济正增长的主要经济体。2020 年 GDP 实际同比增长 2.3%，较 2019 年下降 3.8 个百分点。通胀水平逐步走低，CPI 同比增长由 2019 年末的 5.4% 回落至 0.2%，PPI 探底回升，从 2019 年末的 -0.5% 略升至 -0.4%。从经济增长动力来看，出口表现亮眼逆势上行，2020 年美元计价出口累计增速

较 2019 年末回升 3.1 个百分点至 3.6% 左右；内需在疫情冲击后持续改善，修复速度各有不同，2020 年 12 月消费同比增速较 2019 年末回落 3.4 个百分点至 4.6%，全年固定资产投资累计增速较 2019 年末回落 2.5 个百分点至 2.9% 的水平。政策方面，货币政策着眼跨周期调节，应对疫情时大幅宽松，5 月后打击资金空转回归常态，整体保持流动性合理充裕，全年下调 MLF 和公开市场操作利率 30bp，M2 同比增速回升 1.4 个百分点至 10.1%，社会融资规模同比增速上升 2.6 个百分点至 13.3%，新增人民币贷款 20 万亿元。

2、行情回顾

回顾 2020 年，新冠疫情蔓延并引发了全球流动性危机，资本市场波动剧烈。一季度，国内全力抗击疫情，经济下行压力加大，工业企业生产经营遭受冲击，制造业新旧动能转换有所放缓，固定资产投资同比下降，线下消费增速回落。同时，逐渐蔓延开的海外疫情对国际自由贸易体系也产生了不利影响，欧美股市创出 2008 年金融危机以来最大单季度跌幅，世界范围内经济面临挑战。二季度，随着国内复工复产的有序推进，宏观基本面稳健回升，A 股股市企稳回升，国际市场也反弹强劲。三季度初市场出现由券商、银行和地产等低估值板块引领的量价齐升行情，此后市场风格初现高估值往低估值阶段性转换的迹象，表现整体比较平淡，市场观望情绪较浓。年底在北上资金和公募基金大举流入下，A 股震荡向上创出年内新高。截至 2020 年 12 月 31 日，从各行业来看，休闲服务（99.38%）、电气设备（94.71%）、食品饮料（84.97%）等行业涨幅居前，房地产（-10.85%）、通信（-8.33%）、建筑装饰（-7.92%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为+22.66%；中证 100 涨跌幅+24.09%；上证国企指数涨跌幅+12.59%，中证 800 指数涨跌+25.79%。

3. 运行分析

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，本基金份额净值增长率为 7.06%，同期业绩比较基准收益率为 6.38%。

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 2021 年，各国将进入疫后的修复期，经济恢复的强度和政策退出节奏之间的博弈将成为主导资产价格波动的主要线索。整体而言，在美联储采取“适应性”政策导向的情况下，全球流动性扩张的最快阶段虽已过去，但整体仍保持宽松态势，“资产荒”的背景下仍应积极寻找结构性投资机会，同时密切跟踪政策的退坡节奏。A 股市场或将从 2020 年的靠估值驱动转变为靠盈利驱动。中国经济的韧性足，结构升级空间大，发展质量会不断提高，竞争格局好、商业模式不可复制、盈利能力强的行业龙头或将具备穿越经济周期的能力，并在大浪淘沙的过程中建立更强大的竞争优势。从增量

资金性质看，外资、保险、银行理财将是 A 股最重要的增量资金来源。这些资金更加注重稳定性、偏向于中长期配置。未来，A 股市场将逐步形成由长长期配置型资金占据主导的格局：机构将取代散户、居民间接持股将取代直接持股。国际化、机构化将共同推动 A 股的价值化进程。未来以龙头公司、优质公司为代表的核心资产将成为这些长期资金共同配置的方向。

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，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，本基金管理人坚持一切从防范风险、保护基金份额持有人利益出发，致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司内控部门与审计部按照制度，通过基金运作监控和内部审计等方法，独立地开展工作，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

(1) 深入开展审计检查，确保基金运作合规性

主要措施有：对基金运作涉及的投资、研究、交易、风险管理、信息资讯等业务环节开展独立检查，及时发现业务流程中存在的风险并督促整改，确保相关业务运作符合法律法规及公司制度的规定。

(2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，定期更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

通过以上工作的开展，在本报告期内，本基金运作过程中未发生违规关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规与审计工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的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，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规

性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。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。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就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等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入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。

4.7.2 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。

4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的规定，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。截至本报告期末，本基金无相关收益分配事项。

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

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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 交易型开放式指数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中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金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 审计报告

安永华明（2021）审字第 61062100_B91 号

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 7 月 16 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。

我们认为，后附的中银中证 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，公允反映了中银中证 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 7 月 16 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。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中银中证 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。

6.3 其他信息

中银中证 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。

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。

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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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。

在编制财务报表时，管理层负责评估中银中证 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。

治理层负责监督中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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：

（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。

（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。

（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。

（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，就可能导致对中银中证 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中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

（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。

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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

陈露 徐雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2021 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中银中证 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
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	796,000.63
结算备付金		291,687.90
存出保证金		225,916.34
交易性金融资产	7.4.7.2	66,727,446.46
其中：股票投资		66,684,046.46
基金投资		-
债券投资		43,400.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,256,216.00
应收利息	7.4.7.5	393.08
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		69,297,660.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-
短期借款		-

交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款	7.4.12.3	-
应付证券清算款		1,430,396.07
应付赎回款		-
应付管理人报酬		29,233.21
应付托管费		3,248.14
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	88,950.04
应交税费		0.19
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	450,500.74
负债合计		2,002,328.39
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	62,857,400.00
未分配利润	7.4.7.10	4,437,932.02
所有者权益合计		67,295,332.02
负债和所有者权益总计		69,297,660.41

注：（1）报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0706 元，基金份额总 62,857,400.00 份。

（2）本基金合同于 2020 年 7 月 16 日生效。

7.2 利润表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 7 月 16 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 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		13,483,085.12
1.利息收入		427,633.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	235,949.06
债券利息收入		37.03
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		191,647.15
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,340,693.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,781,000.28

基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	53,616.97
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	506,076.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,490,960.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	223,797.66
减：二、费用		1,515,514.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2	406,512.23
2. 托管费	7.4.10.2	45,168.05
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	765,561.88
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.03
7. 其他费用	7.4.7.19	298,272.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,967,570.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,967,570.22

注：本基金于 2020 年 7 月 16 日成立，无上年度可比期间数据，本财务报表的实际编制期间为 2020 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 7 月 16 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 7 月 16 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）	377,857,400.00	-	377,857,400.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,967,570.22	11,967,570.22
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）	-315,000,000.00	-7,529,638.20	-322,529,638.20

其中：1.基金申购款	18,000,000.00	-168,682.77	17,831,317.23
2.基金赎回款	-333,000,000.00	-7,360,955.43	-340,360,955.43
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）	62,857,400.00	4,437,932.02	67,295,332.02

注：本基金于 2020 年 7 月 16 日成立，无上年度可比期间数据，本财务报表的实际编制期间为 2020 年 7 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李道滨，主管会计工作负责人：张家文，会计机构负责人：乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银中证 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]2049 号文《关于准予中银中证 800 交易型开放式

指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 7 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 377,857,400.00 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中银基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)[2020]252 号文审核同意，本基金于 2020 年 8 月 18 日在上交所挂牌交易。

本基金主要投资于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、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)。本基金还可参与融资和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和备选成份股的资产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%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《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 7 月 16 日（基金合同生效日）起至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 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。

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和债券投资等；

(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，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) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 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；

(6) 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。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按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。

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) 资产支持证券投资收益/(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；

(8) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（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；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

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、每一基金份额享有同等分配权；

5、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；

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

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通

知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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	796,000.63
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	796,000.63

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	62,193,085.69	66,684,046.46	4,490,960.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	43,400.00	43,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	43,400.00	43,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	62,236,485.69	66,727,446.46	4,490,960.77

7.4.7.3 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。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

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	156.93
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	131.30
应收债券利息	3.25
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	101.60
合计	393.08

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	88,950.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	88,950.04

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	-
可退替代款	193.80
应退退补款	275,306.94
应付信息披露费	100,000.00
应付审计费	40,000.00
应付指数使用费	35,000.00
合计	450,500.74

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 16 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	377,857,400.00	377,857,400.00
本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-333,000,000.00	-333,000,000.00

本期末	62,857,400.00	62,857,400.00
-----	---------------	---------------

注：1.本基金合同于 2020 年 7 月 16 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 377,855,000.0000 元，有效认购资金在初始募集期内产生利息人民币 2,400.00 元，未发生股票认购，以上实收基金（本息）合计为人民币 377,857,400.00 元，折合 377,857,400.00 份基金份额。

2.投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	7,476,609.45	4,490,960.77	11,967,570.22
本期基金份额交易产生的变动数	-4,393,711.49	-3,135,926.71	-7,529,638.20
其中：基金申购款	249,165.27	-417,848.04	-168,682.77
基金赎回款	-4,642,876.76	-2,718,078.67	-7,360,955.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,082,897.96	1,355,034.06	4,437,932.02

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	226,072.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,748.05
其他	1,128.62
合计	235,949.06

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 7 月 16 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	3,337,751.18
股票投资收益——赎回差价收入	4,443,249.10
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	7,781,000.28

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7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	174,872,603.18
减：卖出股票成本总额	171,534,852.00
买卖股票差价收入	3,337,751.18

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7月16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	340,360,955.43
减：现金支付赎回款总额	148,819,710.43
减：赎回股票成本总额	187,097,995.90
赎回差价收入	4,443,249.10

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2020年7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	309,651.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	256,000.00
减：应收利息总额	34.17
买卖债券差价收入	53,616.97

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年7月16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	506,076.20
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	506,076.20

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	4,490,960.77
——股票投资	4,490,960.77
——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	4,490,960.77

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年7月16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	223,797.66
合计	223,797.66

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	765,561.88
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	765,561.88

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年7月16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	100,000.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	-
指数使用费	64,293.48
ETF 注册登记费	75,000.00
其他	18,979.23
合计	298,272.71

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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

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
中银基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人的控股股东
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	受中国银行重大影响
贝莱德投资管理（英国）有限公司	基金管理人的股东
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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7月16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	406,512.23
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年7月16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	45,168.05	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期内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。

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

本基金本报告期内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。

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

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7月16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
中信银行	796,000.63	226,072.39

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2020年7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日获得的利息收入为人民币 8,748.05 元，2020 年末结算备付金余额为人民币 291,687.90 元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中银国际	600919	江苏银行	配股	9,060	41,585.40
中银国际	000728	国元证券	配股	4,650	25,296.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的控股股东中国银行发行的股票中国银行、基金托管人中信银行发行的股票中信银行和受中国银行重大影响的中银国际证券股份有限公司发行的股票中银证券。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有中国银行 55,700 股，中信银行 7,900 股，中银证券 900 股。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600919	江苏银行	2020-1-17	2020-01-14	配股未上市	4.59	5.46	9,060	41,585.40	49,467.60	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020-1-15	2021-01-15	配债未上市	100.00	100.00	400	40,000.00	40,000.00	-
113616	韦尔转债	2020-1-29	2021-01-22	配债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-
128142	新乳转债	2020-1-18	2021-01-19	配债未上市	100.00	100.00	4	400.00	400.00	-

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	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌开	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	-----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	盘单价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
300182	捷成股份	2020-12-30	重大事项停牌	3.23	2021-01-07	3.40	5,800	30,127.76	18,734.00	-

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

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止, 本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资占基金资产净值的比例为 0.06%。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(所有者权益)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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	796,000.63	-	-	-	796,000.63
结算备付金	291,687.90	-	-	-	291,687.90
存出保证金	225,916.34	-	-	-	225,916.34
交易性金融资产	-	-	43,400.00	66,684,046.46	66,727,446.46
应收证券清算款	-	-	-	1,256,216.00	1,256,216.00
应收利息	-	-	-	393.08	393.08
资产总计	1,313,604.87	-	43,400.00	67,940,655.54	69,297,660.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,705,896.81	1,705,896.81
应付管理人报酬	-	-	-	29,233.21	29,233.21
应付托管费	-	-	-	3,248.14	3,248.14
应付交易费用	-	-	-	88,950.04	88,950.04
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
负债总计	-	-	-	2,002,328.39	2,002,328.39
利率敏感度缺口	1,313,604.87	-	43,400.00	65,938,327.15	67,295,332.02

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%，银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影

响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。于上年度末，本基金尚未成立。

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。

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	66,684,046.46	99.09
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	66,684,046.46	99.09

注：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金成立未满半年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 66,615,844.86 元,属于第二层次的余额为人民币 111,601.60 元,无划分为第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等,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等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,确定相关证券等公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	66,684,046.46	96.23
	其中:股票	66,684,046.46	96.23

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,400.00	0.06
	其中：债券	43,400.00	0.06
	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	1,087,688.53	1.57
8	其他各项资产	1,482,525.42	2.14
9	合计	69,297,660.41	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	773,378.00	1.15
B	采矿业	1,614,680.60	2.40
C	制造业	36,640,411.12	54.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,210,111.30	1.80
E	建筑业	1,003,931.00	1.49
F	批发和零售业	948,664.80	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,670,848.00	2.48
H	住宿和餐饮业	71,841.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,819,379.00	4.19
J	金融业	14,580,568.24	21.67
K	房地产业	1,944,597.00	2.89
L	租赁和商务服务业	1,118,218.00	1.66
M	科学研究和技术服务业	664,444.40	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	141,727.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	76,786.00	0.11
Q	卫生和社会工作	960,618.00	1.43
R	文化、体育和娱乐业	372,269.00	0.55
S	综合	71,574.00	0.11
	合计	66,684,046.46	99.09

注：股票投资合计如与报告期末资产组合情况中期末股票公允价值存在差异是因为本表不考虑可退替代款估值增值。

8.2.2 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。

8.2.3 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。

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	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	28,200	2,452,836.00	3.64
2	600519	贵州茅台	1,203	2,403,594.00	3.57
3	000858	五粮液	5,200	1,517,620.00	2.26
4	600036	招商银行	32,400	1,423,980.00	2.12
5	000333	美的集团	12,500	1,230,500.00	1.83
6	600276	恒瑞医药	9,700	1,081,162.00	1.61
7	601166	兴业银行	38,500	803,495.00	1.19
8	000651	格力电器	12,700	786,638.00	1.17
9	601888	中国中免	2,500	706,125.00	1.05
10	600887	伊利股份	15,600	692,172.00	1.03
11	600030	中信证券	22,500	661,500.00	0.98
12	601012	隆基股份	6,760	623,272.00	0.93
13	002475	立讯精密	10,800	606,096.00	0.90
14	300059	东方财富	18,100	561,100.00	0.83
15	600031	三一重工	15,300	535,194.00	0.80
16	603288	海天味业	2,600	521,404.00	0.77
17	000002	万科A	18,100	519,470.00	0.77
18	000001	平安银行	25,600	495,104.00	0.74
19	002415	海康威视	9,800	475,398.00	0.71
20	002594	比亚迪	2,400	466,320.00	0.69
21	601398	工商银行	92,600	462,074.00	0.69
22	600900	长江电力	24,100	461,756.00	0.69
23	603259	药明康德	3,320	447,270.40	0.66
24	002352	顺丰控股	4,900	432,327.00	0.64
25	000568	泸州老窖	1,900	429,704.00	0.64
26	000725	京东方A	69,400	416,400.00	0.62
27	002714	牧原股份	5,100	393,210.00	0.58
28	600809	山西汾酒	1,000	375,290.00	0.56
29	600309	万华化学	4,100	373,264.00	0.55

30	000661	长春高新	800	359,128.00	0.53
31	002304	洋河股份	1,500	353,985.00	0.53
32	601601	中国太保	9,200	353,280.00	0.52
33	601899	紫金矿业	36,800	341,872.00	0.51
34	600585	海螺水泥	6,400	330,368.00	0.49
35	300015	爱尔眼科	4,400	329,516.00	0.49
36	601328	交通银行	72,800	326,144.00	0.48
37	600048	保利地产	19,200	303,744.00	0.45
38	600000	浦发银行	31,073	300,786.64	0.45
39	600016	民生银行	56,300	292,760.00	0.44
40	601688	华泰证券	15,600	280,956.00	0.42
41	600690	海尔智家	9,600	280,416.00	0.42
42	002142	宁波银行	7,800	275,652.00	0.41
43	601668	中国建筑	55,400	275,338.00	0.41
44	002027	分众传媒	27,000	266,490.00	0.40
45	600837	海通证券	20,400	262,344.00	0.39
46	000100	TCL 科技	36,600	259,128.00	0.39
47	600438	通威股份	6,700	257,548.00	0.38
48	300124	汇川技术	2,700	251,910.00	0.37
49	300122	智飞生物	1,700	251,447.00	0.37
50	000063	中兴通讯	7,300	245,645.00	0.37
51	300014	亿纬锂能	3,000	244,500.00	0.36
52	600436	片仔癀	900	240,759.00	0.36
53	601288	农业银行	76,200	239,268.00	0.36
54	603501	韦尔股份	1,000	231,100.00	0.34
55	600570	恒生电子	2,200	230,780.00	0.34
56	600104	上汽集团	9,300	227,292.00	0.34
57	600999	招商证券	9,700	226,398.00	0.34
58	002241	歌尔股份	6,000	223,920.00	0.33
59	300498	温氏股份	11,800	215,114.00	0.32
60	300347	泰格医药	1,300	210,093.00	0.31
61	601211	国泰君安	11,900	208,607.00	0.31
62	000338	潍柴动力	13,100	206,849.00	0.31
63	601229	上海银行	26,200	205,408.00	0.31
64	002410	广联达	2,600	204,724.00	0.30
65	002460	赣锋锂业	2,000	202,400.00	0.30
66	603986	兆易创新	1,000	197,500.00	0.29
67	600009	上海机场	2,600	196,716.00	0.29
68	002230	科大讯飞	4,800	196,176.00	0.29
69	600763	通策医疗	700	193,564.00	0.29
70	600588	用友网络	4,400	193,028.00	0.29
71	601169	北京银行	39,200	189,728.00	0.28
72	300274	阳光电源	2,500	180,700.00	0.27
73	601988	中国银行	55,700	177,126.00	0.26

74	300601	康泰生物	1,000	174,500.00	0.26
75	600919	江苏银行	31,860	173,955.60	0.26
76	600196	复星医药	3,200	172,768.00	0.26
77	601766	中国中车	32,000	169,920.00	0.25
78	601628	中国人寿	4,400	168,916.00	0.25
79	600660	福耀玻璃	3,500	168,175.00	0.25
80	002271	东方雨虹	4,300	166,840.00	0.25
81	600893	航发动力	2,800	166,180.00	0.25
82	601818	光大银行	41,400	165,186.00	0.25
83	600703	三安光电	6,000	162,060.00	0.24
84	300142	沃森生物	4,200	161,952.00	0.24
85	600406	国电南瑞	5,900	156,763.00	0.23
86	601088	中国神华	8,700	156,687.00	0.23
87	600346	恒力石化	5,600	156,632.00	0.23
88	002812	恩捷股份	1,100	155,958.00	0.23
89	601919	中远海控	12,600	153,846.00	0.23
90	002493	荣盛石化	5,400	149,094.00	0.22
91	000538	云南白药	1,300	147,680.00	0.22
92	600028	中国石化	35,100	141,453.00	0.21
93	600019	宝钢股份	23,700	141,015.00	0.21
94	601390	中国中铁	26,600	140,182.00	0.21
95	300413	芒果超媒	1,900	137,750.00	0.20
96	002311	海大集团	2,100	137,550.00	0.20
97	603799	华友钴业	1,700	134,810.00	0.20
98	000876	新希望	6,000	134,400.00	0.20
99	002049	紫光国微	1,000	133,810.00	0.20
100	000895	双汇发展	2,800	131,432.00	0.20
101	002007	华兰生物	3,100	130,944.00	0.19
102	600745	闻泰科技	1,300	128,700.00	0.19
103	000768	中航西飞	3,500	128,380.00	0.19
104	600958	东方证券	11,000	127,930.00	0.19
105	600584	长电科技	3,000	127,710.00	0.19
106	601336	新华保险	2,200	127,534.00	0.19
107	000776	广发证券	7,800	126,984.00	0.19
108	000625	长安汽车	5,800	126,904.00	0.19
109	002371	北方华创	700	126,518.00	0.19
110	601009	南京银行	15,600	126,048.00	0.19
111	000166	申万宏源	23,600	124,608.00	0.19
112	601100	恒立液压	1,100	124,300.00	0.18
113	601377	兴业证券	14,000	121,520.00	0.18
114	000157	中联重科	12,200	120,780.00	0.18
115	300012	华测检测	4,400	120,428.00	0.18
116	002821	凯莱英	400	119,656.00	0.18
117	002050	三花智控	4,800	118,320.00	0.18

118	600741	华域汽车	4,100	118,162.00	0.18
119	002129	中环股份	4,600	117,300.00	0.17
120	688008	澜起科技	1,400	116,032.00	0.17
121	600547	山东黄金	4,900	115,738.00	0.17
122	600426	华鲁恒升	3,100	115,630.00	0.17
123	002841	视源股份	1,000	115,030.00	0.17
124	603993	洛阳钼业	18,400	115,000.00	0.17
125	600926	杭州银行	7,700	114,884.00	0.17
126	002001	新 和 成	3,400	114,512.00	0.17
127	601901	方正证券	10,800	111,996.00	0.17
128	600176	中国巨石	5,600	111,776.00	0.17
129	688012	中微公司	700	110,313.00	0.16
130	001979	招商蛇口	8,300	110,307.00	0.16
131	601633	长城汽车	2,900	109,649.00	0.16
132	601877	正泰电器	2,800	109,648.00	0.16
133	002179	中航光电	1,400	109,606.00	0.16
134	601939	建设银行	17,400	109,272.00	0.16
135	601066	中信建投	2,600	109,200.00	0.16
136	603160	汇顶科技	700	108,885.00	0.16
137	000786	北新建材	2,700	108,135.00	0.16
138	300408	三环集团	2,900	108,025.00	0.16
139	600050	中国联通	24,200	107,932.00	0.16
140	601857	中国石油	25,700	106,655.00	0.16
141	002555	三七互娱	3,400	106,182.00	0.16
142	002074	国轩高科	2,700	105,624.00	0.16
143	300496	中科创达	900	105,300.00	0.16
144	600109	国金证券	6,400	104,128.00	0.15
145	300433	蓝思科技	3,400	104,074.00	0.15
146	002709	天赐材料	1,000	103,800.00	0.15
147	603882	金域医学	800	102,496.00	0.15
148	600079	人福医药	3,000	101,640.00	0.15
149	002601	龙蟠佰利	3,300	101,541.00	0.15
150	002236	大华股份	5,100	101,439.00	0.15
151	601006	大秦铁路	15,700	101,422.00	0.15
152	002736	国信证券	7,400	100,936.00	0.15
153	601989	中国重工	23,900	100,141.00	0.15
154	600015	华夏银行	16,000	100,000.00	0.15
155	601225	陕西煤业	10,700	99,938.00	0.15
156	600600	青岛啤酒	1,000	99,400.00	0.15
157	600089	特变电工	9,700	98,455.00	0.15
158	002202	金风科技	6,900	98,325.00	0.15
158	002008	大族激光	2,300	98,325.00	0.15
160	601788	光大证券	5,300	98,156.00	0.15
161	603899	晨光文具	1,100	97,416.00	0.14

162	002624	完美世界	3,300	97,350.00	0.14
163	600352	浙江龙盛	7,100	96,702.00	0.14
164	603019	中科曙光	2,800	95,844.00	0.14
165	601186	中国铁建	12,000	94,800.00	0.14
166	000860	顺鑫农业	1,300	94,302.00	0.14
167	600872	中炬高新	1,400	93,310.00	0.14
168	300003	乐普医疗	3,400	92,412.00	0.14
169	300207	欣旺达	3,000	92,130.00	0.14
170	603369	今世缘	1,600	91,808.00	0.14
171	000547	航天发展	3,300	90,750.00	0.13
172	300285	国瓷材料	2,000	90,220.00	0.13
173	600183	生益科技	3,200	90,112.00	0.13
174	002938	鹏鼎控股	1,800	89,406.00	0.13
175	000066	中国长城	4,700	89,253.00	0.13
176	002044	美年健康	7,700	87,241.00	0.13
177	003816	中国广核	30,900	87,138.00	0.13
178	300033	同花顺	700	86,786.00	0.13
179	002600	领益智造	7,223	86,603.77	0.13
180	000783	长江证券	10,100	84,840.00	0.13
181	601233	桐昆股份	4,100	84,419.00	0.13
182	601155	新城控股	2,400	83,592.00	0.12
183	601108	财通证券	6,600	83,490.00	0.12
184	002568	百润股份	800	83,432.00	0.12
185	600132	重庆啤酒	700	83,293.00	0.12
186	601360	三六零	5,300	83,263.00	0.12
187	600143	金发科技	4,800	82,272.00	0.12
188	000596	古井贡酒	300	81,600.00	0.12
189	601799	星宇股份	400	80,200.00	0.12
190	601985	中国核电	16,300	80,196.00	0.12
191	601555	东吴证券	8,100	79,866.00	0.12
192	600383	金地集团	5,900	79,650.00	0.12
193	002185	华天科技	5,800	78,996.00	0.12
194	600760	中航沈飞	1,000	78,180.00	0.12
195	000938	紫光股份	3,820	78,119.00	0.12
196	002384	东山精密	3,000	78,000.00	0.12
197	688002	睿创微纳	700	77,700.00	0.12
198	601669	中国电建	19,900	77,212.00	0.11
199	300676	华大基因	600	77,136.00	0.11
200	603806	福斯特	900	76,860.00	0.11
201	688036	传音控股	500	76,070.00	0.11
202	000069	华侨城 A	10,700	75,863.00	0.11
203	002797	第一创业	7,600	75,620.00	0.11
204	600739	辽宁成大	3,100	75,392.00	0.11
205	000977	浪潮信息	2,800	75,264.00	0.11

206	002024	苏宁易购	9,600	74,016.00	0.11
207	002456	欧菲光	5,600	73,808.00	0.11
208	300595	欧普康视	900	73,728.00	0.11
209	601878	浙商证券	4,800	73,440.00	0.11
210	002385	大北农	7,600	73,416.00	0.11
211	600111	北方稀土	5,600	73,304.00	0.11
212	300144	宋城演艺	4,100	72,652.00	0.11
213	601933	永辉超市	10,100	72,518.00	0.11
214	601099	太平洋	17,600	71,808.00	0.11
215	300136	信维通信	2,000	71,760.00	0.11
216	300699	光威复材	800	71,240.00	0.11
217	601138	工业富联	5,200	71,188.00	0.11
218	002602	世纪华通	10,000	71,100.00	0.11
219	600161	天坛生物	1,700	70,890.00	0.11
220	600885	宏发股份	1,300	70,486.00	0.10
221	600522	中天科技	6,500	70,460.00	0.10
222	600795	国电电力	31,200	70,200.00	0.10
223	600010	包钢股份	59,800	69,966.00	0.10
224	600029	南方航空	11,700	69,732.00	0.10
225	002340	格林美	9,900	69,201.00	0.10
226	300357	我武生物	900	69,030.00	0.10
227	603589	口子窖	1,000	68,900.00	0.10
228	300529	健帆生物	1,000	67,820.00	0.10
229	601800	中国交建	9,300	67,518.00	0.10
230	603833	欧派家居	500	67,250.00	0.10
231	601168	西部矿业	5,400	66,852.00	0.10
232	600201	生物股份	3,200	66,848.00	0.10
233	002414	高德红外	1,600	66,800.00	0.10
234	002625	光启技术	3,000	66,750.00	0.10
235	000425	徐工机械	12,300	66,051.00	0.10
236	600486	扬农化工	500	66,000.00	0.10
237	002916	深南电路	600	64,836.00	0.10
238	601966	玲珑轮胎	1,828	64,290.76	0.10
239	603816	顾家家居	909	64,093.59	0.10
240	000636	风华高科	1,900	64,030.00	0.10
241	000703	恒逸石化	5,000	64,000.00	0.10
242	000963	华东医药	2,400	63,744.00	0.09
243	002607	中公教育	1,800	63,234.00	0.09
244	601600	中国铝业	17,300	62,799.00	0.09
245	600316	洪都航空	1,100	62,557.00	0.09
246	000728	国元证券	6,950	62,272.00	0.09
247	600061	国投资本	4,500	62,235.00	0.09
248	603486	科沃斯	700	61,943.00	0.09
249	601607	上海医药	3,200	61,440.00	0.09

250	600886	国投电力	7,100	61,344.00	0.09
251	000708	中信特钢	2,800	61,012.00	0.09
252	601021	春秋航空	1,100	60,973.00	0.09
253	600705	中航资本	13,900	60,882.00	0.09
254	603338	浙江鼎力	600	60,714.00	0.09
255	000656	金科股份	8,500	60,265.00	0.09
256	600529	山东药玻	1,200	60,180.00	0.09
257	002463	沪电股份	3,200	60,128.00	0.09
258	601111	中国国航	8,000	59,920.00	0.09
259	601838	成都银行	5,600	59,752.00	0.09
260	002013	中航机电	5,200	59,540.00	0.09
261	002507	涪陵榨菜	1,400	59,220.00	0.09
262	002078	太阳纸业	4,100	59,163.00	0.09
263	600219	南山铝业	18,700	59,092.00	0.09
264	300628	亿联网络	800	58,496.00	0.09
265	002030	达安基因	1,700	58,310.00	0.09
266	603658	安图生物	400	58,072.00	0.09
267	000750	国海证券	9,900	58,014.00	0.09
268	603345	安井食品	300	57,861.00	0.09
269	600362	江西铜业	2,900	57,855.00	0.09
270	600884	杉杉股份	3,200	57,696.00	0.09
271	002791	坚朗五金	400	57,600.00	0.09
272	600862	中航高科	1,900	57,190.00	0.08
273	300088	长信科技	6,400	56,896.00	0.08
274	300463	迈克生物	1,200	55,920.00	0.08
275	600066	宇通客车	3,300	55,836.00	0.08
276	600699	均胜电子	2,200	55,792.00	0.08
277	600606	绿地控股	9,500	55,385.00	0.08
278	600845	宝信软件	800	55,184.00	0.08
279	300223	北京君正	600	54,894.00	0.08
280	601997	贵阳银行	6,900	54,855.00	0.08
281	002252	上海莱士	7,400	54,760.00	0.08
282	002212	天融信	2,600	54,626.00	0.08
283	600511	国药股份	1,100	54,241.00	0.08
284	002465	海格通信	5,000	54,150.00	0.08
285	600115	东方航空	11,500	53,820.00	0.08
286	601162	天风证券	8,800	53,680.00	0.08
287	300482	万孚生物	600	53,526.00	0.08
288	002131	利欧股份	17,600	53,328.00	0.08
289	601128	常熟银行	7,200	53,136.00	0.08
290	600340	华夏幸福	4,100	53,013.00	0.08
291	002773	康弘药业	1,100	52,965.00	0.08
292	002157	正邦科技	3,100	52,824.00	0.08
293	002353	杰瑞股份	1,500	52,500.00	0.08

294	002422	科伦药业	2,700	52,488.00	0.08
295	000009	中国宝安	6,900	51,957.00	0.08
296	600487	亨通光电	3,700	51,763.00	0.08
297	002075	沙钢股份	4,700	51,559.00	0.08
298	601816	京沪高铁	9,100	51,506.00	0.08
299	600011	华能国际	11,400	51,072.00	0.08
300	601618	中国中冶	18,700	51,051.00	0.08
301	600177	雅戈尔	7,100	51,049.00	0.08
302	000988	华工科技	2,200	51,018.00	0.08
303	600867	通化东宝	3,800	50,844.00	0.08
304	601727	上海电气	9,400	50,760.00	0.08
305	300146	汤臣倍健	2,100	50,715.00	0.08
306	000630	铜陵有色	19,600	50,372.00	0.07
307	002120	韵达股份	3,200	50,240.00	0.07
308	600038	中直股份	800	50,168.00	0.07
309	600460	士兰微	2,000	50,000.00	0.07
310	600779	水井坊	600	49,812.00	0.07
311	000998	隆平高科	2,500	49,525.00	0.07
312	002500	山西证券	5,500	49,225.00	0.07
313	002508	老板电器	1,200	48,936.00	0.07
314	002673	西部证券	4,800	48,672.00	0.07
315	002557	洽洽食品	900	48,465.00	0.07
316	600118	中国卫星	1,500	48,270.00	0.07
317	300316	晶盛机电	1,600	48,128.00	0.07
318	002250	联化科技	2,000	47,980.00	0.07
319	300168	万达信息	2,200	47,718.00	0.07
320	600068	葛洲坝	7,200	47,376.00	0.07
321	600369	西南证券	8,800	47,344.00	0.07
322	603866	桃李面包	800	47,280.00	0.07
323	688099	晶晨股份	600	47,238.00	0.07
324	600733	北汽蓝谷	5,400	46,818.00	0.07
325	002683	宏大爆破	1,300	46,735.00	0.07
326	600489	中金黄金	5,300	46,693.00	0.07
327	601990	南京证券	3,800	46,626.00	0.07
328	601198	东兴证券	3,500	46,620.00	0.07
329	600637	东方明珠	5,200	46,488.00	0.07
330	600754	锦江酒店	900	46,377.00	0.07
331	600380	健康元	3,300	45,903.00	0.07
332	000021	深科技	2,400	45,624.00	0.07
333	603737	三棵树	300	45,450.00	0.07
334	002739	万达电影	2,500	45,200.00	0.07
335	002223	鱼跃医疗	1,600	45,136.00	0.07
336	000961	中南建设	5,100	45,033.00	0.07
337	000039	中集集团	3,000	44,970.00	0.07

338	600909	华安证券	5,600	44,800.00	0.07
339	601216	君正集团	9,000	44,550.00	0.07
339	000513	丽珠集团	1,100	44,550.00	0.07
341	300001	特锐德	1,500	44,040.00	0.07
342	002670	国盛金控	3,200	44,000.00	0.07
343	300418	昆仑万维	2,200	43,890.00	0.07
344	600332	白云山	1,500	43,875.00	0.07
345	300070	碧水源	5,700	43,605.00	0.06
346	600498	烽火通信	1,800	43,344.00	0.06
347	600563	法拉电子	400	43,020.00	0.06
348	002156	通富微电	1,700	42,908.00	0.06
349	603444	吉比特	100	42,600.00	0.06
350	601658	邮储银行	8,900	42,542.00	0.06
351	002299	圣农发展	1,600	42,464.00	0.06
352	600516	方大炭素	6,000	42,420.00	0.06
353	002705	新宝股份	1,000	42,250.00	0.06
354	002920	德赛西威	500	42,070.00	0.06
355	600018	上港集团	9,200	42,044.00	0.06
356	688088	虹软科技	600	41,952.00	0.06
357	600879	航天电子	5,600	41,888.00	0.06
358	002572	索菲亚	1,600	41,440.00	0.06
359	002926	华西证券	3,300	41,184.00	0.06
360	000623	吉林敖东	2,500	41,175.00	0.06
361	002080	中材科技	1,700	41,106.00	0.06
362	603195	公牛集团	200	41,058.00	0.06
363	600004	白云机场	2,900	40,977.00	0.06
364	002603	以岭药业	1,600	40,800.00	0.06
365	300024	机器人	3,300	40,590.00	0.06
366	300271	华宇软件	1,700	40,579.00	0.06
367	000878	云南铜业	2,800	40,516.00	0.06
368	600390	五矿资本	5,800	40,484.00	0.06
369	002444	巨星科技	1,300	40,443.00	0.06
370	688009	中国通号	6,900	40,434.00	0.06
371	601998	中信银行	7,900	40,369.00	0.06
372	600418	江淮汽车	3,300	40,359.00	0.06
373	600415	小商品城	7,300	40,223.00	0.06
374	002373	千方科技	2,100	40,152.00	0.06
375	601881	中国银河	3,200	40,032.00	0.06
376	000050	深天马 A	2,700	39,798.00	0.06
377	600155	华创阳安	3,000	39,570.00	0.06
378	002081	金螳螂	4,200	39,438.00	0.06
379	600372	中航电子	2,000	39,300.00	0.06
380	002138	顺络电子	1,600	39,232.00	0.06
381	600271	航天信息	3,100	39,060.00	0.06

382	002032	苏泊尔	500	38,995.00	0.06
383	601689	拓普集团	1,000	38,430.00	0.06
384	300315	掌趣科技	7,500	38,325.00	0.06
385	300009	安科生物	2,600	38,168.00	0.06
386	601117	中国化学	6,500	38,155.00	0.06
387	300618	寒锐钴业	400	37,964.00	0.06
388	601615	明阳智能	2,000	37,960.00	0.06
389	600233	圆通速递	3,300	37,950.00	0.06
390	002019	亿帆医药	2,000	37,860.00	0.06
391	600153	建发股份	4,600	37,766.00	0.06
392	300244	迪安诊断	1,100	37,708.00	0.06
393	000975	银泰黄金	4,360	37,539.60	0.06
394	600166	福田汽车	11,800	37,170.00	0.06
395	600801	华新水泥	1,800	37,134.00	0.06
396	002273	水晶光电	3,200	37,088.00	0.06
397	600549	厦门钨业	2,200	37,070.00	0.06
398	000830	鲁西化工	2,900	37,062.00	0.06
399	600918	中泰证券	2,000	37,000.00	0.05
400	300115	长盈精密	1,500	36,975.00	0.05
400	600535	天士力	2,500	36,975.00	0.05
402	688029	南微医学	200	36,802.00	0.05
403	002558	巨人网络	2,100	36,603.00	0.05
404	002124	天邦股份	2,500	36,500.00	0.05
405	600655	豫园股份	4,100	36,449.00	0.05
406	600998	九州通	2,000	36,320.00	0.05
407	601916	浙商银行	8,900	36,312.00	0.05
408	600667	太极实业	3,800	35,910.00	0.05
409	600859	王府井	1,100	35,838.00	0.05
410	300017	网宿科技	5,200	35,828.00	0.05
411	002958	青农商行	7,000	35,630.00	0.05
412	603605	珀莱雅	200	35,600.00	0.05
413	002511	中顺洁柔	1,700	35,479.00	0.05
414	601319	中国人保	5,400	35,478.00	0.05
415	002690	美亚光电	800	35,424.00	0.05
416	000401	冀东水泥	2,500	35,375.00	0.05
417	000686	东北证券	3,600	35,352.00	0.05
418	600208	新湖中宝	11,400	35,340.00	0.05
419	601236	红塔证券	1,900	35,321.00	0.05
420	002064	华峰化学	3,500	35,315.00	0.05
421	000540	中天金融	11,200	35,280.00	0.05
422	603883	老百姓	560	35,184.80	0.05
423	600765	中航重机	1,400	35,000.00	0.05
424	000739	普洛药业	1,500	34,920.00	0.05
425	600170	上海建工	11,600	34,916.00	0.05

426	000723	美锦能源	5,200	34,736.00	0.05
427	600315	上海家化	1,000	34,730.00	0.05
428	600598	北大荒	1,800	34,650.00	0.05
429	603858	步长制药	1,500	34,605.00	0.05
430	002966	苏州银行	4,500	34,560.00	0.05
431	603638	艾迪精密	500	34,470.00	0.05
432	000738	航发控制	1,500	34,395.00	0.05
433	000690	宝新能源	4,700	34,310.00	0.05
434	002152	广电运通	3,200	34,176.00	0.05
435	002195	二三四五	15,100	34,126.00	0.05
436	600895	张江高科	2,000	34,080.00	0.05
437	600642	申能股份	6,500	33,930.00	0.05
438	002382	蓝帆医疗	1,600	33,744.00	0.05
439	002831	裕同科技	1,100	33,682.00	0.05
440	603156	养元饮品	1,300	33,592.00	0.05
441	002506	协鑫集成	7,900	33,575.00	0.05
442	300630	普利制药	800	33,512.00	0.05
443	600085	同仁堂	1,400	33,460.00	0.05
444	002056	横店东磁	2,200	33,418.00	0.05
445	601238	广汽集团	2,500	33,225.00	0.05
446	603317	天味食品	400	32,896.00	0.05
447	601231	环旭电子	1,700	32,878.00	0.05
448	601717	郑煤机	3,000	32,790.00	0.05
449	601992	金隅集团	11,000	32,670.00	0.05
450	600497	驰宏锌锗	6,800	32,640.00	0.05
451	300212	易华录	1,060	32,489.00	0.05
452	002221	东华能源	3,200	32,448.00	0.05
453	600008	首创股份	11,410	32,290.30	0.05
454	002939	长城证券	2,500	32,175.00	0.05
455	002028	思源电气	1,600	32,096.00	0.05
456	000060	中金岭南	6,600	31,812.00	0.05
457	600409	三友化工	3,100	31,775.00	0.05
458	000729	燕京啤酒	3,700	31,524.00	0.05
459	000960	锡业股份	2,800	31,360.00	0.05
460	002648	卫星石化	1,200	31,344.00	0.05
461	600580	卧龙电驱	2,000	31,200.00	0.05
462	600392	盛和资源	3,500	31,115.00	0.05
463	600875	东方电气	3,100	30,907.00	0.05
464	601866	中远海发	10,400	30,888.00	0.05
465	000807	云铝股份	4,100	30,873.00	0.05
466	600827	百联股份	2,100	30,660.00	0.05
467	600297	广汇汽车	10,700	30,602.00	0.05
468	300058	蓝色光标	5,100	30,600.00	0.05
469	300296	利亚德	4,800	30,528.00	0.05

470	600256	广汇能源	10,700	30,281.00	0.04
471	000581	威孚高科	1,300	30,147.00	0.04
472	600150	中国船舶	1,700	30,073.00	0.04
473	002146	荣盛发展	4,600	30,038.00	0.04
474	600848	上海临港	1,500	30,030.00	0.04
475	002372	伟星新材	1,600	29,920.00	0.04
476	601456	国联证券	1,400	29,862.00	0.04
477	002429	兆驰股份	4,800	29,760.00	0.04
478	600528	中铁工业	3,400	29,716.00	0.04
479	002595	豪迈科技	1,000	29,650.00	0.04
480	600027	华电国际	8,700	29,580.00	0.04
481	600260	凯乐科技	2,700	29,430.00	0.04
482	000983	山西焦煤	5,200	29,328.00	0.04
483	600704	物产中大	6,700	29,279.00	0.04
484	002745	木林森	2,000	29,180.00	0.04
485	603712	七一二	700	29,155.00	0.04
486	002281	光迅科技	1,000	29,040.00	0.04
487	000997	新大陆	1,900	29,032.00	0.04
488	002242	九阳股份	900	28,836.00	0.04
489	601872	招商轮船	5,100	28,815.00	0.04
490	600839	四川长虹	9,900	28,710.00	0.04
491	000671	阳光城	4,400	28,688.00	0.04
492	600482	中国动力	1,600	28,672.00	0.04
493	600167	联美控股	2,500	28,375.00	0.04
494	002294	信立泰	1,000	28,330.00	0.04
495	600811	东方集团	7,700	28,105.00	0.04
496	600728	佳都科技	3,700	28,083.00	0.04
497	600737	中粮糖业	2,900	28,072.00	0.04
498	603927	中科软	700	28,063.00	0.04
499	002153	石基信息	900	27,981.00	0.04
500	300474	景嘉微	400	27,964.00	0.04
501	600325	华发股份	4,500	27,945.00	0.04
502	600515	海航基础	4,100	27,675.00	0.04
502	002092	中泰化学	4,500	27,675.00	0.04
504	002396	星网锐捷	1,200	27,672.00	0.04
505	600820	隧道股份	5,100	27,591.00	0.04
506	600160	巨化股份	3,400	27,574.00	0.04
507	002390	信邦制药	3,200	27,136.00	0.04
508	600967	内蒙一机	2,200	26,752.00	0.04
509	600881	亚泰集团	8,600	26,660.00	0.04
510	601577	长沙银行	2,800	26,656.00	0.04
511	600410	华胜天成	3,000	26,580.00	0.04
512	603087	甘李药业	200	26,444.00	0.04
513	002085	万丰奥威	4,000	26,240.00	0.04

514	002368	太极股份	1,000	26,110.00	0.04
515	000930	中粮科技	3,100	26,102.00	0.04
516	000012	南玻A	3,500	25,830.00	0.04
517	002925	盈趣科技	400	25,732.00	0.04
518	300002	神州泰岳	5,000	25,550.00	0.04
519	600258	首旅酒店	1,200	25,464.00	0.04
520	600567	山鹰国际	8,400	25,368.00	0.04
521	000709	河钢股份	11,300	25,312.00	0.04
522	600435	北方导航	2,800	25,200.00	0.04
523	300166	东方国信	2,300	25,185.00	0.04
524	002387	维信诺	2,200	25,080.00	0.04
525	002174	游族网络	1,900	25,004.00	0.04
526	600718	东软集团	2,400	24,984.00	0.04
527	600282	南钢股份	8,000	24,960.00	0.04
528	600273	嘉化能源	2,700	24,948.00	0.04
529	000999	华润三九	1,000	24,940.00	0.04
530	601696	中银证券	900	24,912.00	0.04
531	600804	鹏博士	3,700	24,864.00	0.04
532	000629	攀钢钒钛	11,400	24,738.00	0.04
533	000301	东方盛虹	2,600	24,648.00	0.04
534	601179	中国西电	5,300	24,433.00	0.04
535	603198	迎驾贡酒	700	24,430.00	0.04
536	600597	光明乳业	1,500	24,390.00	0.04
537	000627	天茂集团	5,000	24,350.00	0.04
538	600446	金证股份	1,500	24,315.00	0.04
539	600188	兖州煤业	2,400	24,168.00	0.04
540	000877	天山股份	1,600	24,160.00	0.04
541	603290	斯达半导	100	24,090.00	0.04
542	002867	周大生	900	23,985.00	0.04
543	601005	重庆钢铁	16,100	23,828.00	0.04
544	600064	南京高科	2,300	23,621.00	0.04
545	600572	康恩贝	5,000	23,550.00	0.03
546	600039	四川路桥	5,200	23,452.00	0.03
547	000932	华菱钢铁	4,900	23,422.00	0.03
548	002268	卫士通	1,400	23,380.00	0.03
548	600026	中远海能	3,500	23,380.00	0.03
550	002004	华邦健康	4,200	23,268.00	0.03
551	000778	新兴铸管	6,300	23,184.00	0.03
552	600216	浙江医药	1,700	23,120.00	0.03
553	002807	江阴银行	5,400	23,112.00	0.03
554	600908	无锡银行	3,800	23,104.00	0.03
555	601975	招商南油	9,200	23,092.00	0.03
556	000598	兴蓉环境	4,800	23,040.00	0.03
557	600060	海信视像	2,000	22,960.00	0.03

558	002233	塔牌集团	1,800	22,932.00	0.03
559	000089	深圳机场	2,800	22,876.00	0.03
560	603568	伟明环保	1,200	22,716.00	0.03
561	000027	深圳能源	3,700	22,533.00	0.03
562	000887	中鼎股份	1,900	22,249.00	0.03
563	600989	宝丰能源	1,900	22,230.00	0.03
564	688321	微芯生物	600	22,206.00	0.03
565	002563	森马服饰	2,200	22,044.00	0.03
565	600755	厦门国贸	3,300	22,044.00	0.03
567	300026	红日药业	4,800	21,984.00	0.03
568	000967	盈峰环境	2,700	21,978.00	0.03
569	603000	人民网	1,300	21,970.00	0.03
570	002128	露天煤业	2,000	21,880.00	0.03
571	601106	中国一重	7,300	21,827.00	0.03
572	000970	中科三环	2,300	21,735.00	0.03
573	000400	许继电气	1,500	21,690.00	0.03
573	601118	海南橡胶	4,500	21,690.00	0.03
575	001914	招商积余	1,000	21,530.00	0.03
576	600025	华能水电	4,800	21,408.00	0.03
577	000825	太钢不锈	5,900	21,299.00	0.03
578	002701	奥瑞金	4,300	21,242.00	0.03
579	002191	劲嘉股份	2,300	21,229.00	0.03
580	600398	海澜之家	3,300	21,186.00	0.03
581	600037	歌华有线	2,300	21,160.00	0.03
582	601077	渝农商行	4,700	21,150.00	0.03
583	603228	景旺电子	700	21,105.00	0.03
584	300072	三聚环保	3,700	21,016.00	0.03
585	601333	广深铁路	9,400	20,868.00	0.03
586	600158	中体产业	1,700	20,842.00	0.03
587	300376	易事特	2,600	20,696.00	0.03
588	002399	海普瑞	1,200	20,664.00	0.03
589	600021	上海电力	2,900	20,648.00	0.03
590	601860	紫金银行	4,900	20,629.00	0.03
591	000528	柳工	2,800	20,608.00	0.03
592	002936	郑州银行	4,600	20,516.00	0.03
593	002217	合力泰	5,000	20,500.00	0.03
594	600022	山东钢铁	14,300	20,449.00	0.03
595	600120	浙江东方	3,400	20,298.00	0.03
596	002110	三钢闽光	3,000	20,190.00	0.03
597	603392	万泰生物	100	20,153.00	0.03
598	600507	方大特钢	2,900	20,126.00	0.03
599	600970	中材国际	2,900	19,952.00	0.03
600	601865	福莱特	500	19,950.00	0.03
601	000685	中山公用	2,400	19,920.00	0.03

602	000488	晨鸣纸业	3,100	19,902.00	0.03
603	600006	东风汽车	2,100	19,824.00	0.03
604	000883	湖北能源	5,100	19,788.00	0.03
605	300133	华策影视	3,200	19,776.00	0.03
606	000898	鞍钢股份	6,500	19,760.00	0.03
607	600171	上海贝岭	1,400	19,628.00	0.03
608	600673	东阳光	3,900	19,617.00	0.03
609	600645	中源协和	1,000	19,610.00	0.03
610	000563	陕国投 A	5,200	19,604.00	0.03
611	000090	天健集团	3,300	19,602.00	0.03
612	002839	张家港行	3,200	19,520.00	0.03
613	601699	潞安环能	3,000	19,500.00	0.03
614	603077	和邦生物	13,700	19,454.00	0.03
615	002266	浙富控股	4,300	19,350.00	0.03
616	002985	北摩高科	100	19,330.00	0.03
617	600782	新钢股份	4,200	19,278.00	0.03
618	600195	中牧股份	1,500	19,215.00	0.03
619	002203	海亮股份	2,600	19,214.00	0.03
620	601808	中海油服	1,500	19,155.00	0.03
621	000990	诚志股份	1,600	18,976.00	0.03
622	600928	西安银行	3,400	18,904.00	0.03
623	601000	唐山港	7,600	18,848.00	0.03
624	600376	首开股份	3,200	18,784.00	0.03
625	300182	捷成股份	5,800	18,734.00	0.03
626	002155	湖南黄金	2,200	18,722.00	0.03
627	000402	金融街	2,900	18,705.00	0.03
628	002048	宁波华翔	1,200	18,684.00	0.03
629	600056	中国医药	1,300	18,629.00	0.03
630	601200	上海环境	1,700	18,530.00	0.03
631	600073	上海梅林	1,800	18,522.00	0.03
632	601598	中国外运	4,200	18,480.00	0.03
633	002544	杰赛科技	1,100	18,458.00	0.03
634	600500	中化国际	3,500	18,445.00	0.03
635	002244	滨江集团	4,000	18,360.00	0.03
636	300180	华峰超纤	3,100	18,321.00	0.03
637	000028	国药一致	400	18,320.00	0.03
638	601608	中信重工	4,600	18,216.00	0.03
639	603885	吉祥航空	1,600	18,192.00	0.03
640	601698	中国卫通	1,000	18,140.00	0.03
641	600466	蓝光发展	3,900	18,057.00	0.03
642	000519	中兵红箭	1,800	18,036.00	0.03
643	600126	杭钢股份	3,400	17,986.00	0.03
644	600649	城投控股	3,300	17,919.00	0.03
645	600546	山煤国际	2,100	17,871.00	0.03

646	601016	节能风电	5,200	17,836.00	0.03
647	000758	中色股份	3,500	17,780.00	0.03
648	000559	万向钱潮	3,300	17,655.00	0.03
649	000078	海王生物	4,400	17,644.00	0.03
650	002317	众生药业	1,600	17,632.00	0.03
651	300010	豆神教育	1,800	17,568.00	0.03
652	002249	大洋电机	3,900	17,550.00	0.03
653	600835	上海机电	900	17,514.00	0.03
654	002505	鹏都农牧	6,900	17,457.00	0.03
655	000869	张裕 A	400	17,440.00	0.03
656	600729	重庆百货	600	17,340.00	0.03
657	600094	大名城	4,300	17,286.00	0.03
658	600266	城建发展	3,400	17,272.00	0.03
659	002635	安洁科技	1,000	17,230.00	0.03
660	601098	中南传媒	1,800	17,154.00	0.03
661	600373	中文传媒	1,700	17,153.00	0.03
662	600901	江苏租赁	3,100	17,081.00	0.03
663	601718	际华集团	5,600	16,968.00	0.03
664	600959	江苏有线	5,100	16,881.00	0.03
665	600388	龙净环保	1,900	16,872.00	0.03
666	600348	阳泉煤业	3,000	16,830.00	0.03
667	002440	闰土股份	1,800	16,776.00	0.02
668	600648	外高桥	1,200	16,764.00	0.02
669	600808	马钢股份	6,300	16,758.00	0.02
670	000158	常山北明	2,700	16,740.00	0.02
671	002458	益生股份	1,500	16,725.00	0.02
672	000564	供销大集	6,400	16,576.00	0.02
673	002183	怡亚通	3,800	16,568.00	0.02
674	600675	中华企业	4,900	16,464.00	0.02
675	002640	跨境通	3,200	16,448.00	0.02
676	600633	浙数文化	2,000	16,280.00	0.02
677	600566	济川药业	800	16,184.00	0.02
678	601958	金钼股份	2,600	16,146.00	0.02
679	000959	首钢股份	4,200	16,086.00	0.02
680	601778	晶科科技	2,200	15,972.00	0.02
681	002815	崇达技术	1,100	15,884.00	0.02
682	600643	爱建集团	2,100	15,792.00	0.02
683	600329	中新药业	900	15,768.00	0.02
684	600863	内蒙华电	6,100	15,677.00	0.02
685	600131	国网信通	1,100	15,653.00	0.02
686	000415	渤海租赁	6,500	15,600.00	0.02
687	000826	启迪环境	2,300	15,548.00	0.02
688	603650	彤程新材	500	15,500.00	0.02
689	600141	兴发集团	1,400	15,442.00	0.02

690	601880	大连港	8,000	15,440.00	0.02
691	300113	顺网科技	900	15,435.00	0.02
692	002583	海能达	2,500	15,350.00	0.02
693	300459	金科文化	4,800	15,312.00	0.02
694	600717	天津港	3,200	15,296.00	0.02
695	601611	中国核建	2,100	15,288.00	0.02
696	002589	瑞康医药	2,900	15,167.00	0.02
697	002434	万里扬	1,700	15,164.00	0.02
698	002038	双鹭药业	1,500	15,150.00	0.02
699	002468	申通快递	1,500	15,120.00	0.02
700	600259	广晟有色	500	15,085.00	0.02
701	002010	传化智联	3,200	15,072.00	0.02
702	002408	齐翔腾达	1,800	15,048.00	0.02
703	300257	开山股份	1,100	15,015.00	0.02
704	600312	平高电气	2,100	14,994.00	0.02
705	603708	家家悦	700	14,910.00	0.02
706	002424	贵州百灵	1,900	14,877.00	0.02
707	600823	世茂股份	3,200	14,752.00	0.02
708	600582	天地科技	4,700	14,476.00	0.02
709	600062	华润双鹤	1,200	14,388.00	0.02
710	002002	鸿达兴业	4,700	14,100.00	0.02
711	000031	大悦城	3,200	14,080.00	0.02
712	000008	神州高铁	5,500	13,970.00	0.02
713	600556	天下秀	1,100	13,915.00	0.02
714	600339	中油工程	4,500	13,860.00	0.02
715	000046	泛海控股	4,200	13,776.00	0.02
716	000718	苏宁环球	4,000	13,720.00	0.02
717	601127	小康股份	800	13,664.00	0.02
718	600639	浦东金桥	1,100	13,640.00	0.02
719	603377	东方时尚	700	13,552.00	0.02
720	002375	亚厦股份	1,800	13,392.00	0.02
721	603260	合盛硅业	400	13,376.00	0.02
722	600307	酒钢宏兴	8,100	13,365.00	0.02
723	002948	青岛银行	2,200	13,046.00	0.02
724	600776	东方通信	1,100	13,035.00	0.02
725	000543	皖能电力	3,100	12,958.00	0.02
726	000156	华数传媒	1,500	12,840.00	0.02
727	000501	鄂武商 A	1,100	12,815.00	0.02
728	000717	韶钢松山	3,000	12,810.00	0.02
729	601928	凤凰传媒	2,000	12,660.00	0.02
730	603225	新凤鸣	900	12,510.00	0.02
731	600664	哈药股份	3,900	12,441.00	0.02
732	000062	深圳华强	1,000	12,440.00	0.02
733	300134	大富科技	1,200	12,396.00	0.02

734	600869	远东股份	3,100	12,369.00	0.02
735	600748	上实发展	2,500	12,275.00	0.02
736	300324	旋极信息	2,900	12,267.00	0.02
737	600640	号百控股	1,000	12,250.00	0.02
738	600968	海油发展	5,100	12,189.00	0.02
739	603515	欧普照明	400	12,084.00	0.02
740	000937	冀中能源	2,900	12,064.00	0.02
741	002945	华林证券	800	12,056.00	0.02
742	600707	彩虹股份	1,800	11,988.00	0.02
743	600787	中储股份	2,600	11,986.00	0.02
744	000061	农产品	1,700	11,985.00	0.02
745	002416	爱施德	1,600	11,936.00	0.02
746	000681	视觉中国	900	11,700.00	0.02
747	600338	西藏珠峰	1,100	11,528.00	0.02
748	603056	德邦股份	900	11,421.00	0.02
749	603888	新华网	600	11,400.00	0.02
750	600545	卓郎智能	3,200	11,200.00	0.02
751	600985	淮北矿业	1,000	11,190.00	0.02
752	601298	青岛港	1,700	10,931.00	0.02
753	601869	长飞光纤	400	10,816.00	0.02
754	002503	搜于特	4,800	10,752.00	0.02
755	000600	建投能源	1,900	10,659.00	0.02
756	000813	德展健康	2,400	10,632.00	0.02
757	002302	西部建设	1,200	10,536.00	0.02
758	600277	亿利洁能	3,500	10,465.00	0.02
759	603983	丸美股份	200	10,442.00	0.02
760	601228	广州港	3,100	10,416.00	0.02
761	600299	安迪苏	900	10,359.00	0.02
762	601139	深圳燃气	1,400	10,136.00	0.02
763	600871	石化油服	5,100	9,996.00	0.01
764	600517	国网英大	1,600	9,728.00	0.01
765	603379	三美股份	500	9,550.00	0.01
766	600657	信达地产	2,300	9,315.00	0.01
767	600575	淮河能源	4,000	9,280.00	0.01
768	600350	山东高速	1,500	9,270.00	0.01
769	002419	天虹股份	1,200	9,168.00	0.01
770	600291	西水股份	1,600	9,072.00	0.01
771	600903	贵州燃气	700	8,890.00	0.01
772	000732	泰禾集团	2,700	8,829.00	0.01
773	002946	新乳业	500	8,805.00	0.01
774	000537	广宇发展	1,400	8,778.00	0.01
775	002653	海思科	500	8,760.00	0.01
776	002093	国脉科技	1,200	8,748.00	0.01
777	603328	依顿电子	1,100	8,745.00	0.01

778	002051	中工国际	1,200	8,508.00	0.01
779	601828	美凯龙	1,000	8,490.00	0.01
780	600623	华谊集团	1,400	8,120.00	0.01
781	600053	九鼎投资	400	7,820.00	0.01
781	000553	安道麦 A	1,000	7,820.00	0.01
783	002901	大博医疗	100	7,373.00	0.01
784	603893	瑞芯微	100	7,235.00	0.01
785	601969	海南矿业	1,200	7,176.00	0.01
786	002818	富森美	500	7,065.00	0.01
787	603786	科博达	100	6,762.00	0.01
788	601801	皖新传媒	1,400	6,650.00	0.01
789	002941	新疆交建	600	6,600.00	0.01
790	601003	柳钢股份	1,200	6,228.00	0.01
791	002957	科瑞技术	300	6,135.00	0.01
792	603355	莱克电气	200	6,046.00	0.01
793	603719	良品铺子	100	5,867.00	0.01
794	002423	中粮资本	600	5,808.00	0.01
795	601512	中新集团	500	4,970.00	0.01
796	600917	重庆燃气	700	4,802.00	0.01
797	001872	招商港口	300	4,776.00	0.01
798	603868	飞科电器	100	4,678.00	0.01
799	603256	宏和科技	500	4,415.00	0.01
800	601068	中铝国际	1,000	3,560.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	19,558,099.29	29.06
2	601318	中国平安	14,639,076.14	21.75
3	000858	五粮液	8,263,587.00	12.28
4	600036	招商银行	6,766,226.00	10.05
5	000333	美的集团	6,421,749.65	9.54
6	600276	恒瑞医药	5,851,047.87	8.69
7	000651	格力电器	4,814,500.00	7.15
8	600030	中信证券	4,326,856.00	6.43
9	002475	立讯精密	4,301,548.00	6.39
10	600887	伊利股份	3,699,289.45	5.50
11	601166	兴业银行	3,520,876.00	5.23

12	601888	中国中免	3,435,761.00	5.11
13	000002	万科A	3,347,827.36	4.97
14	300059	东方财富	3,119,111.00	4.63
15	601398	工商银行	2,984,210.00	4.43
16	601012	隆基股份	2,770,337.57	4.12
17	600900	长江电力	2,759,075.96	4.10
18	002415	海康威视	2,604,416.00	3.87
19	002714	牧原股份	2,524,210.20	3.75
20	000661	长春高新	2,461,131.48	3.66
21	000001	平安银行	2,455,966.00	3.65
22	600585	海螺水泥	2,448,390.00	3.64
23	600837	海通证券	2,415,683.00	3.59
24	603288	海天味业	2,382,026.82	3.54
25	000725	京东方A	2,337,974.00	3.47
26	601328	交通银行	2,244,202.00	3.33
27	601688	华泰证券	2,179,089.00	3.24
28	600000	浦发银行	2,141,247.86	3.18
29	600031	三一重工	2,140,406.40	3.18
30	600048	保利地产	2,061,264.00	3.06
31	600016	民生银行	2,035,811.00	3.03
32	300122	智飞生物	2,017,430.23	3.00
33	000063	中兴通讯	2,002,536.75	2.98
34	300142	沃森生物	1,998,943.00	2.97
35	603259	药明康德	1,991,221.20	2.96
36	002352	顺丰控股	1,881,219.00	2.80
37	300498	温氏股份	1,873,331.57	2.78
38	601668	中国建筑	1,841,253.00	2.74
39	300015	爱尔眼科	1,819,876.00	2.70
40	600309	万华化学	1,717,896.06	2.55
41	002304	洋河股份	1,700,577.00	2.53
42	002142	宁波银行	1,695,028.00	2.52
43	601288	农业银行	1,590,896.00	2.36
44	601601	中国太保	1,590,220.00	2.36
45	002241	歌尔股份	1,576,976.00	2.34
46	000568	泸州老窖	1,547,746.00	2.30
47	000100	TCL 科技	1,529,947.00	2.27
48	600745	闻泰科技	1,503,807.46	2.23
49	600196	复星医药	1,432,629.00	2.13
50	601211	国泰君安	1,429,341.00	2.12
51	601899	紫金矿业	1,427,237.00	2.12
52	600570	恒生电子	1,423,388.00	2.12
53	601229	上海银行	1,390,491.00	2.07
54	000338	潍柴动力	1,378,902.00	2.05

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	7,963,886.00	11.83
2	000333	美的集团	6,048,811.68	8.99
3	000651	格力电器	4,228,763.00	6.28
4	002475	立讯精密	3,689,448.34	5.48
5	000002	万科A	2,934,054.00	4.36
6	300059	东方财富	2,661,290.79	3.95
7	000001	平安银行	2,423,252.64	3.60
8	002415	海康威视	2,368,970.00	3.52
9	000725	京东方A	2,202,433.00	3.27
10	300015	爱尔眼科	1,876,312.50	2.79
11	002714	牧原股份	1,874,088.00	2.78
12	000661	长春高新	1,856,581.00	2.76
13	002352	顺丰控股	1,718,806.48	2.55
14	000568	泸州老窖	1,711,029.00	2.54
15	000063	中兴通讯	1,669,404.00	2.48
16	002304	洋河股份	1,667,879.00	2.48
17	300122	智飞生物	1,647,171.00	2.45
18	002142	宁波银行	1,591,397.99	2.36
19	002594	比亚迪	1,563,644.26	2.32
20	300498	温氏股份	1,495,762.00	2.22
21	002241	歌尔股份	1,455,907.00	2.16
22	300142	沃森生物	1,392,017.00	2.07
23	000100	TCL 科技	1,375,691.00	2.04

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

买入股票的成本（成交）总额	410,821,113.86
卖出股票的收入（成交）总额	174,872,603.18

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	43,400.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,400.00	0.06

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

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	113044	大秦转债	400	40,000.00	0.06
2	113616	韦尔转债	30	3,000.00	0.00
3	128142	新乳转债	4	400.00	0.00

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

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的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。

8.12.2 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。

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	225,916.34
2	应收证券清算款	1,256,216.00
3	应收股利	-
4	应收利息	393.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,482,525.42

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

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。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,243	50,569.11	7,941,900.00	12.6348%	54,915,500.00	87.3652%

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	海南家美太阳能有限公司	5,000,000.00	7.95%
2	华泰证券股份有限公司	2,043,600.00	3.25%
3	陈潜	1,500,000.00	2.39%
4	叶星华	1,104,000.00	1.76%
5	申爱军	1,000,000.00	1.59%
6	金祖森	1,000,000.00	1.59%
7	广发证券股份有限公司	898,300.00	1.43%
8	段东东	881,700.00	1.40%
9	庞建新	600,000.00	0.95%
10	袁志勇	500,000.00	0.80%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

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的情况

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7月16日)基金份额总额	377,857,400.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	333,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,857,400.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

§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

本报告期内，陈军不再担任副执行总裁，详情请参见基金管理人 2020 年 2 月 29 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；李建担任投资总监（权益），详情请参见基金管理人 2020 年 9 月 24 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告》；奚鹏洲担任投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2020 年 9 月 24 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告》；王圣明不再担任副执行总裁，详情请参见基金管理人

2020 年 12 月 31 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，基金托管人根据工作需要，于 2020 年 10 月 9 日，任命杨璋琪先生担任基金托管人资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

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，没有涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，没有发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 40,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

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没有受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	298,005,446.94	50.89%	271,574.41	50.41%	-
东方证券	2	264,042,986.71	45.09%	245,215.41	45.52%	-
长江证券	2	23,552,599.21	4.02%	21,934.32	4.07%	-

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》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：本基金与托管于中信银行的其他公募基金共用交易单元，本报告期末新增租用证券公司交易单元。

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		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
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	309,651.14	100.00%	133,000,000.00	47.00%	-	-
长江证券	-	-	150,000,000.00	53.00%	-	-

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	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2020-07-17
2	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会规定媒介	2020-08-13
3	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定媒介	2020-08-13
4	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要 2020 年年度更新	中国证监会规定媒介	2020-08-28
5	中银基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-02
6	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-24

7	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-24
8	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-27
9	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31
10	中银基金管理有限公司西南分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31
11	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2020-12-31

§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募集注册的文件；
- 2、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、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、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、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、基金托管人处，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

二〇二一年三月三十日

