

工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银 MSCI 中国 ETF
场内简称	工银 MSCI、工银 MSCI 中国 ETF
基金主代码	512320
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 29 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,040,765.00 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 7 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。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	MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。
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	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	朱志明
	联系电话	400-811-9999	4008-888-108
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	95587
传真		010-66583158	010-85130975
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	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

	5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	
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	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码	100033	100010
法定代表人	赵桂才	王常青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,320,174.47
本期利润	6,361,689.94
加权平均基金份额本期利润	0.0663
本期加权平均净值利润率	5.93%
本期基金份额净值增长率	4.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,109,979.65
期末可供分配基金份额利润	0.1291
期末基金资产净值	98,661,880.24
期末基金份额净值	1.1467
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.67%

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 29 日。

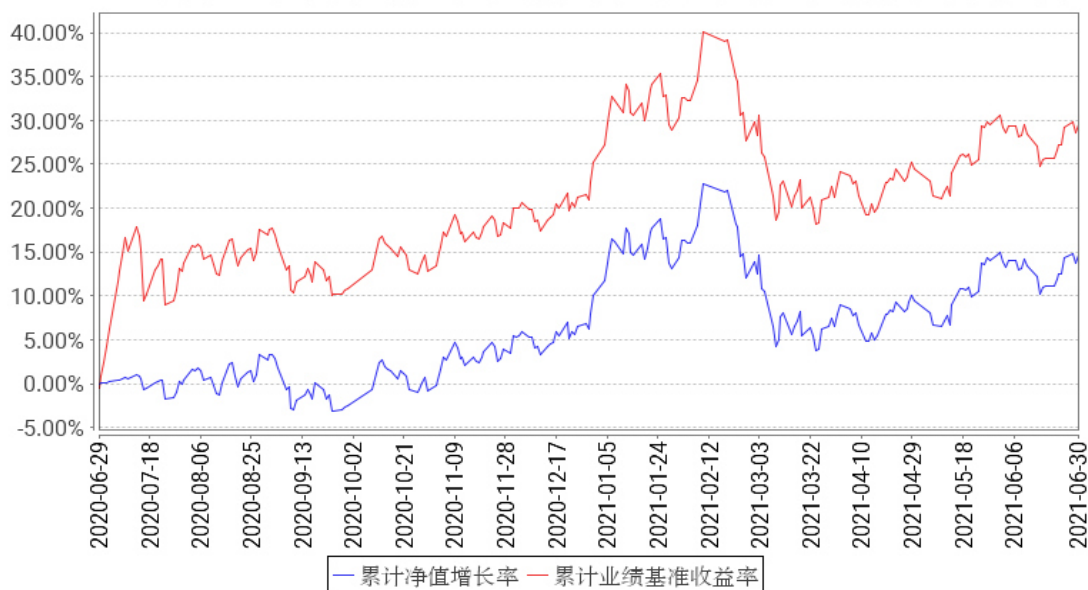
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.01%	0.83%	-0.55%	0.84%	0.56%	-0.01%
过去三个月	7.71%	0.96%	6.84%	0.98%	0.87%	-0.02%
过去六个月	4.23%	1.31%	3.38%	1.32%	0.85%	-0.01%
过去一年	14.64%	1.15%	28.40%	1.33%	-13.76%	-0.18%
自基金合同生效起至今	14.67%	1.14%	29.51%	1.33%	-14.84%	-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MSCI中国ETF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 29 日生效。

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

3.3 其他指标

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 2021 年 6 月 30 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、工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金、工银瑞信战略远见混合型证券投资基金、工银瑞信中证科技龙头 ETF 基金、工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金等逾 180 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		
邓皓友	本基金的基金经理	2020年6月29日	-	7年	曾在瀚华金控股份有限公司担任数据分析师；2014年加入工银瑞信，现任指数投资中心衍生品投资研究员、基金经理。2019年10月29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；2020年6月29日至今，担任工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021年2月9日至今，担任工银瑞信中证消费服务领先交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021年2月9日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021年3月24日至今，担任工银瑞信大和日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；2021年6月18日至今，担任工银瑞信中证 180ESG 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。

4.3.2 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 6 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 4.23%，业绩比较基准收益率为 3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，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 0.24%、6.93%、-3.90% 及 17.22%。本基金标的指数在本报告期内涨跌幅为 3.38%，表现优于沪深 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 0.28% 和 4.78%，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 14.77、22.01、12.49 及 63.11 倍，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 股市场经历了较大的市场波动，年初出现较快上涨的行情，春节之后，各主要板块及市场指数均出现了较大的波动，进入到 2 季度市场整体有所企稳，同时也出现了一些分化的行情，市场的风险偏好有一定的提升，整体上结构性行情的特征十分明显。部分具有较好景气度的行业在结构化行情中较为突出，基本面的改善和持续提供了良好的行情支撑。市场对于流动性收紧的担忧有所缓解，未来对于基本面的改善是否持续以及持续多久将成为市场关注的焦点，这同样也是结构性行情下投资者需要加以关注的。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本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

在本报告期内，本基金托管人在托管工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金过程中，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和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,087,501.51	1,723,177.61
结算备付金		65,880.01	322,022.35
存出保证金		49,453.99	579,045.21
交易性金融资产	6.4.7.2	96,611,551.04	145,725,158.16
其中：股票投资		96,611,551.04	145,725,158.16
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,556.43	144,787.47
应收利息	6.4.7.5	453.17	820.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		98,913,012.39	148,495,010.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	270,151.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		40,693.88	66,908.70
应付托管费		8,138.76	13,381.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	15,665.02	76,908.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	186,634.49	601,994.00
负债合计		251,132.15	1,029,344.35
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	86,040,765.00	134,040,765.00
未分配利润	6.4.7.10	12,621,115.24	13,424,901.50
所有者权益合计		98,661,880.24	147,465,666.50
负债和所有者权益总计		98,913,012.39	148,495,010.85

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 29 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.1467 元，基金份额总额为 86,040,765.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 29 日(基金合 同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		7,033,418.75	216,073.48
1. 利息收入		8,535.07	39,207.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,535.07	39,207.17
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）		9,790,531.27	6,673.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,122,295.22	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	668,236.05	6,673.06
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,958,484.53	-68,525.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	192,836.94	238,718.25
减：二、费用		671,728.81	13,828.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	267,193.71	9,003.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	53,438.79	1,800.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	98,703.15	-
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	6.4.7.20	252,393.16	3,024.01
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		6,361,689.94	202,245.26
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,361,689.94	202,245.26
-------------------	--	--------------	------------

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 29 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	134,040,765.00	13,424,901.50	147,465,666.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,361,689.94	6,361,689.94
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）	-48,000,000.00	-7,165,476.20	-55,165,476.20
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-48,000,000.00	-7,165,476.20	-55,165,476.20
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）	86,040,765.00	12,621,115.24	98,661,880.24
项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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）	659,040,765.00	-	659,040,765.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	202,245.26	202,245.26

利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	659,040,765.00	202,245.26	659,243,010.26

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 29 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信 MSCI 中国 A 股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[2020]743 号《关于准予工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于 2020 年 6 月 1 日至 2020 年 6 月 19 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）验证并出具安永华明（2020）验字第 60802052_A13 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 29 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 659,032,925.00 元（含募集股票），折合 659,032,925.00 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 246,558.25 元，其中人民币 7,840.00 元折合 7,840.00 份基金份额，剩余人民币 238,718.25 元不折合基金份额，归入基金财产；以上收到的实收基金共计人民币 659,040,765.00 元，折合 659,040,765.00 份基金份额。本基金为交易型

开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

(2) 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生

的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

（3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,087,501.51
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	2,087,501.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,510,468.39	96,611,551.04	10,101,082.65
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	86,510,468.39	96,611,551.04	10,101,082.65

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	401.27
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	29.70
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	22.20
合计	453.17

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	15,665.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	15,665.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	69,835.79
指数使用费	32,495.44
预提信息披露费	59,507.37
IOPV 服务费	24,795.19
可退替代款	0.70
合计	186,634.49

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。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	134,040,765.00	134,040,765.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-48,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	86,040,765.00	86,040,765.00

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

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,452,781.58	7,972,119.92	13,424,901.50
本期利润	9,320,174.47	-2,958,484.53	6,361,689.94
本期基金份额交易产生的变动数	-3,662,976.40	-3,502,499.80	-7,165,476.20
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-3,662,976.40	-3,502,499.80	-7,165,476.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,109,979.65	1,511,135.59	12,621,115.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	5,942.45
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	690.04	
其他	1,902.58	
合计	8,535.07	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,358,548.84
股票投资收益——赎回差价收入	3,763,746.38
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	9,122,295.22

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	45,537,581.51
减：卖出股票成本总额	40,179,032.67
买卖股票差价收入	5,358,548.84

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	55,165,476.20
减：现金支付赎回款总额	23,877,594.20
减：赎回股票成本总额	27,524,135.62
赎回差价收入	3,763,746.38

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	668,236.05
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	668,236.05

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,958,484.53
股票投资	-2,958,484.53
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,958,484.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	192,836.94

合计	192,836.94
----	------------

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	98,703.15
银行间市场交易费用	-
合计	98,703.15

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	24,795.19
注册登记费	74,383.76
指数使用费	73,871.05
合计	252,393.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
中信建投证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月29日（基金合同生效日） 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有 限公司	66,451,955.84	100.00	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券股 份有限公司	47,267.94	100.00	15,665.02	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年6月29日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券股 份有限公司	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	267,193.71	9,003.51
其中：支付销售机构的客户维护费	6,106.99	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	53,438.79	1,800.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月29日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	2,087,501.51	5,942.45	257,010,872.35	18,082.17

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 137,200.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 706,944.41 元，估值总额为人民币 709,324.00 元，占基金资产净值的比例为 0.72%。

于本报告期末，本基金持有 9,400.00 股中信建投的 A 股普通股，成本总额为人民币 411,936.57 元，估值总额为人民币 295,442.00 元，占基金资产净值的比例为 0.30%。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

6.4.12.2 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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	2,900	61,804.33	163,415.00	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	22,800	230,550.01	127,452.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30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	2,087,501.51	-	-	-	-	-	2,087,501.51
结算备付金	65,880.01	-	-	-	-	-	65,880.01
存出保证金	49,453.99	-	-	-	-	-	49,453.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	96,611,551.04	96,611,551.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,556.43	22,556.43
应收利息	-	-	-	-	-	453.17	453.17
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	2,202,835.51	-	-	-	-	96,710,176.88	98,913,012.39
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,693.88	40,693.88
应付托管费	-	-	-	-	-	8,138.76	8,138.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,665.02	15,665.02
其他负债	-	-	-	-	-	186,634.49	186,634.49
负债总计	-	-	-	-	-	251,132.15	251,132.15
利率敏感度缺口	2,202,835.51	-	-	-	-	96,459,044.73	98,661,880.24
上年度末 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	1,723,177.61	-	-	-	-	1,723,177.61
结算备付金	322,022.35	-	-	-	-	322,022.35
存出保证金	579,045.21	-	-	-	-	579,045.21
交易性金融资产	-	-	-	-	145,725,158.16	145,725,158.16
应收证券清算款	-	-	-	-	144,787.47	144,787.47
应收利息	-	-	-	-	820.05	820.05
资产总计	2,624,245.17	-	-	-	145,870,765.68	148,495,010.85
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	270,151.03	270,151.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	66,908.70	66,908.70
应付托管费	-	-	-	-	13,381.75	13,381.75
应付交易费用	-	-	-	-	76,908.87	76,908.87
其他负债	-	-	-	-	601,994.00	601,994.00
负债总计	-	-	-	-	1,029,344.35	1,029,344.35
利率敏感度缺口	2,624,245.17	-	-	-	144,841,421.33	147,465,666.50

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度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。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	96,611,551.04	97.92	145,725,158.16	98.82
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	96,611,551.04	97.92	145,725,158.16	98.82

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（含存托凭证）、其他股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、股指期货、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单，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。

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	4,863,116.21	4,449,031.55
	业绩比较基准减少 5%	-4,863,116.21	-4,449,031.55

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	96,611,551.04	97.67
	其中：股票	96,611,551.04	97.67
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	2,153,381.52	2.18
8	其他各项资产	148,079.83	0.15
9	合计	98,913,012.39	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,069,725.40	1.08
B	采矿业	2,431,503.88	2.46
C	制造业	57,180,490.10	57.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,759,602.92	1.78
E	建筑业	1,163,399.00	1.18
F	批发和零售业	1,274,046.60	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	2,799,827.80	2.84
H	住宿和餐饮业	113,900.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,833,009.20	2.87
J	金融业	18,574,145.04	18.83
K	房地产业	2,053,030.62	2.08
L	租赁和商务服务业	1,761,620.00	1.79
M	科学研究和技术服务业	1,369,909.60	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	108,822.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	102,361.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,507,810.62	1.53
R	文化、体育和娱乐业	466,882.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	96,570,085.78	97.88

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。

7.2.2 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	13,558.42	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
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	12,230.40	0.01
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	41,465.26	0.04

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

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,700	5,553,090.00	5.63
2	300750	宁德时代	5,100	2,727,480.00	2.76
3	000858	五粮液	8,500	2,532,065.00	2.57
4	600036	招商银行	45,000	2,438,550.00	2.47
5	601318	中国平安	23,600	1,517,008.00	1.54
6	300760	迈瑞医疗	2,700	1,296,135.00	1.31
7	601888	中国中免	4,300	1,290,430.00	1.31

8	601012	隆基股份	11,560	1,026,990.40	1.04
9	600900	长江电力	49,600	1,023,744.00	1.04
10	002594	比亚迪	4,000	1,004,000.00	1.02
11	603288	海天味业	7,690	991,625.50	1.01
12	000001	平安银行	42,300	956,826.00	0.97
13	600276	恒瑞医药	13,960	948,861.20	0.96
14	601166	兴业银行	45,300	930,915.00	0.94
15	603259	药明康德	5,540	867,508.60	0.88
16	600809	山西汾酒	1,900	851,200.00	0.86
17	300015	爱尔眼科	11,669	828,265.62	0.84
18	000568	泸州老窖	3,200	755,008.00	0.77
19	600309	万华化学	6,811	741,173.02	0.75
20	300059	东方财富	22,500	737,775.00	0.75
21	601398	工商银行	137,200	709,324.00	0.72
22	002475	立讯精密	15,307	704,122.00	0.71
23	002714	牧原股份	11,520	700,646.40	0.71
24	002304	洋河股份	3,300	683,760.00	0.69
25	002352	顺丰控股	9,900	670,230.00	0.68
26	300122	智飞生物	3,500	653,555.00	0.66
27	601919	中远海控	21,100	644,394.00	0.65
28	600000	浦发银行	64,000	640,000.00	0.65
29	603501	韦尔股份	1,900	611,800.00	0.62
30	600436	片仔癀	1,300	582,790.00	0.59
31	600030	中信证券	23,200	578,608.00	0.59
32	000333	美的集团	7,700	549,549.00	0.56
33	600031	三一重工	18,476	537,097.32	0.54
34	002142	宁波银行	13,100	510,507.00	0.52
35	000002	万科A	21,200	504,772.00	0.51
36	601288	农业银行	162,400	492,072.00	0.50
37	600887	伊利股份	13,300	489,839.00	0.50
38	601816	京沪高铁	89,200	471,868.00	0.48
39	000725	京东方A	73,800	460,512.00	0.47
40	002812	恩捷股份	1,900	444,790.00	0.45
41	601601	中国太保	14,900	431,653.00	0.44
42	300014	亿纬锂能	4,100	426,113.00	0.43
43	601668	中国建筑	91,500	425,475.00	0.43
44	600438	通威股份	9,800	424,046.00	0.43
45	601328	交通银行	85,600	419,440.00	0.43
46	601899	紫金矿业	43,000	416,670.00	0.42
47	300124	汇川技术	5,600	415,856.00	0.42
48	300782	卓胜微	727	390,762.50	0.40
49	002493	荣盛石化	22,100	381,667.00	0.39

50	600104	上汽集团	17,000	373,490.00	0.38
51	600019	宝钢股份	48,600	371,304.00	0.38
52	300274	阳光电源	3,200	368,192.00	0.37
53	600690	海尔智家	13,800	357,558.00	0.36
54	600585	海螺水泥	8,700	357,135.00	0.36
55	000661	长春高新	900	348,300.00	0.35
56	601818	光大银行	90,200	340,956.00	0.35
57	600016	民生银行	77,300	340,893.00	0.35
58	600346	恒力石化	12,800	335,872.00	0.34
59	002230	科大讯飞	4,900	331,142.00	0.34
60	000538	云南白药	2,800	324,016.00	0.33
61	002241	歌尔股份	7,500	320,550.00	0.32
62	300433	蓝思科技	10,800	317,628.00	0.32
63	600196	复星医药	4,400	317,372.00	0.32
64	600048	保利地产	26,100	314,244.00	0.32
65	600703	三安光电	9,800	314,090.00	0.32
66	600893	航发动力	5,800	308,502.00	0.31
67	600999	招商证券	16,200	308,124.00	0.31
68	002371	北方华创	1,100	305,118.00	0.31
69	300759	康龙化成	1,400	303,786.00	0.31
70	600028	中国石化	69,500	303,020.00	0.31
71	002027	分众传媒	32,000	301,120.00	0.31
72	603799	华友钴业	2,600	296,920.00	0.30
73	601066	中信建投	9,400	295,442.00	0.30
74	002311	海大集团	3,600	293,760.00	0.30
75	601658	邮储银行	58,000	291,160.00	0.30
76	002460	赣锋锂业	2,400	290,616.00	0.29
77	600763	通策医疗	700	287,700.00	0.29
78	600406	国电南瑞	12,100	281,204.00	0.29
79	601211	国泰君安	16,400	281,096.00	0.28
80	601088	中国神华	14,400	281,088.00	0.28
81	000063	中兴通讯	8,400	279,132.00	0.28
82	603986	兆易创新	1,480	278,092.00	0.28
83	300413	芒果超媒	3,900	267,540.00	0.27
84	000338	潍柴动力	14,800	264,476.00	0.27
85	600745	闻泰科技	2,700	261,630.00	0.27
86	601225	陕西煤业	21,800	258,330.00	0.26
87	000625	长安汽车	9,700	254,916.00	0.26
88	002129	中环股份	6,600	254,760.00	0.26
89	601229	上海银行	31,000	254,200.00	0.26
90	601688	华泰证券	16,000	252,800.00	0.26
91	601857	中国石油	47,100	249,159.00	0.25

92	600660	福耀玻璃	4,400	245,740.00	0.25
93	600837	海通证券	21,100	242,650.00	0.25
94	601100	恒立液压	2,800	240,576.00	0.24
95	300999	金龙鱼	2,800	237,888.00	0.24
96	600588	用友网络	7,100	236,146.00	0.24
97	601988	中国银行	76,600	235,928.00	0.24
98	000100	TCL 科技	30,600	234,090.00	0.24
99	300454	深信服	900	233,532.00	0.24
100	601390	中国中铁	44,400	232,656.00	0.24
101	000166	申万宏源	49,100	229,788.00	0.23
102	601009	南京银行	21,800	229,336.00	0.23
103	600919	江苏银行	32,212	228,705.20	0.23
104	603486	科沃斯	1,000	228,080.00	0.23
105	601169	北京银行	46,100	224,507.00	0.23
106	300601	康泰生物	1,500	223,500.00	0.23
107	600132	重庆啤酒	1,100	217,745.00	0.22
108	600760	中航沈飞	3,600	217,080.00	0.22
109	600570	恒生电子	2,300	214,475.00	0.22
110	002709	天赐材料	2,010	214,225.80	0.22
111	601633	长城汽车	4,900	213,591.00	0.22
112	300142	沃森生物	3,400	209,780.00	0.21
113	603806	福斯特	1,980	208,157.40	0.21
114	601628	中国人寿	6,100	206,729.00	0.21
115	601336	新华保险	4,500	206,595.00	0.21
116	601989	中国重工	49,700	204,764.00	0.21
117	601155	新城控股	4,900	203,840.00	0.21
118	603659	璞泰来	1,480	202,168.00	0.20
119	002049	紫光国微	1,300	200,447.00	0.20
120	000895	双汇发展	6,300	200,340.00	0.20
121	300498	温氏股份	13,900	199,743.00	0.20
122	603993	洛阳钼业	38,500	198,660.00	0.20
123	601138	工业富联	15,900	197,319.00	0.20
124	000776	广发证券	12,900	195,306.00	0.20
125	000596	古井贡酒	800	191,600.00	0.19
126	300595	欧普康视	1,840	190,532.00	0.19
127	600926	杭州银行	12,900	190,275.00	0.19
128	002179	中航光电	2,400	189,648.00	0.19
129	001979	招商蛇口	17,300	189,435.00	0.19
130	002050	三花智控	7,800	187,044.00	0.19
131	002841	视源股份	1,500	186,435.00	0.19
132	002821	凯莱英	500	186,300.00	0.19
133	600989	宝丰能源	13,300	181,944.00	0.18

134	600741	华域汽车	6,900	181,263.00	0.18
135	000799	酒鬼酒	700	178,920.00	0.18
136	000963	华东医药	3,800	174,838.00	0.18
137	600600	青岛啤酒	1,500	173,475.00	0.18
138	600015	华夏银行	28,000	173,320.00	0.18
139	300408	三环集团	4,000	169,680.00	0.17
140	002601	龙蟠佰利	4,900	169,442.00	0.17
141	603899	晨光文具	2,000	169,120.00	0.17
142	601901	方正证券	18,000	168,480.00	0.17
143	300628	亿联网络	2,000	167,600.00	0.17
144	600111	北方稀土	7,900	163,530.00	0.17
145	600460	士兰微	2,900	163,415.00	0.17
146	600150	中国船舶	9,800	161,798.00	0.16
147	002001	新和成	5,600	160,608.00	0.16
148	601985	中国核电	31,700	160,402.00	0.16
149	603882	金域医学	1,000	159,770.00	0.16
150	002568	百润股份	1,680	159,247.20	0.16
151	000768	中航西飞	6,000	157,680.00	0.16
152	601877	正泰电器	4,700	156,886.00	0.16
153	688185	康希诺	200	155,554.00	0.16
154	300347	泰格医药	800	154,640.00	0.16
155	600010	宝钢股份	99,400	154,070.00	0.16
156	600547	山东黄金	7,920	152,222.40	0.15
157	601788	光大证券	8,500	152,065.00	0.15
158	601600	中国铝业	28,500	151,050.00	0.15
159	002736	国信证券	14,000	150,500.00	0.15
160	603833	欧派家居	1,059	150,335.64	0.15
161	002648	卫星石化	3,780	148,138.20	0.15
162	603737	三棵树	840	147,840.00	0.15
163	600584	长电科技	3,900	146,952.00	0.15
164	300529	健帆生物	1,700	146,812.00	0.15
165	002007	华兰生物	4,000	146,720.00	0.15
166	000301	东方盛虹	7,000	146,300.00	0.15
167	603369	今世缘	2,700	146,232.00	0.15
168	600886	国投电力	15,200	146,072.00	0.15
169	000786	北新建材	3,700	145,225.00	0.15
170	601799	星宇股份	642	144,912.24	0.15
171	601916	浙商银行	36,500	144,905.00	0.15
172	000876	新希望	9,800	143,766.00	0.15
173	600426	华鲁恒升	4,640	143,608.00	0.15
174	002064	华峰化学	10,100	143,420.00	0.15
175	000157	中联重科	15,400	142,296.00	0.14

176	002600	领益智造	15,400	141,526.00	0.14
177	300316	晶盛机电	2,800	141,400.00	0.14
178	300496	中科创达	900	141,354.00	0.14
179	002414	高德红外	5,120	141,209.60	0.14
180	601377	兴业证券	14,600	141,036.00	0.14
181	300661	圣邦股份	550	139,001.50	0.14
182	600779	水井坊	1,100	138,985.00	0.14
182	601939	建设银行	20,900	138,985.00	0.14
183	002236	大华股份	6,500	137,150.00	0.14
184	000938	紫光股份	6,260	136,968.80	0.14
185	600176	中国巨石	8,758	135,836.58	0.14
186	002791	坚朗五金	700	135,835.00	0.14
187	300033	同花顺	1,200	135,336.00	0.14
188	600029	南方航空	22,300	134,246.00	0.14
189	000069	华侨城 A	17,900	133,176.00	0.13
190	601966	玲珑轮胎	3,000	131,220.00	0.13
191	600958	东方证券	13,000	129,870.00	0.13
192	603160	汇顶科技	1,000	129,630.00	0.13
193	601669	中国电建	33,400	129,258.00	0.13
194	002024	苏宁易购	22,800	127,452.00	0.13
195	603345	安井食品	500	127,010.00	0.13
196	601360	三六零	10,400	126,984.00	0.13
197	600845	宝信软件	2,470	125,723.00	0.13
198	300003	乐普医疗	3,900	125,268.00	0.13
199	600115	中国东航	24,400	123,952.00	0.13
200	002916	深南电路	1,100	122,243.00	0.12
201	002938	鹏鼎控股	3,400	121,992.00	0.12
202	002074	国轩高科	2,800	121,968.00	0.12
203	300146	汤臣倍健	3,700	121,730.00	0.12
204	601233	桐昆股份	5,000	120,450.00	0.12
205	600061	国投资本	14,036	119,165.64	0.12
206	600183	生益科技	5,000	117,050.00	0.12
207	601995	中金公司	1,900	116,850.00	0.12
208	600143	金发科技	5,600	116,816.00	0.12
209	601618	中国中冶	38,900	115,922.00	0.12
210	600754	锦江酒店	2,000	113,900.00	0.12
211	601021	春秋航空	2,000	113,800.00	0.12
212	601111	中国国航	14,500	112,810.00	0.11
213	002459	晶澳科技	2,300	112,700.00	0.11
214	300207	欣旺达	3,435	111,843.60	0.11
215	601878	浙商证券	8,500	111,180.00	0.11
216	002555	三七互娱	4,600	110,492.00	0.11

217	002252	上海莱士	14,700	110,103.00	0.11
218	002920	德赛西威	1,000	110,080.00	0.11
219	603517	绝味食品	1,300	109,577.00	0.11
220	601636	旗滨集团	5,900	109,504.00	0.11
221	000425	徐工机械	17,100	108,927.00	0.11
222	603816	顾家家居	1,400	108,192.00	0.11
223	603185	上机数控	600	107,370.00	0.11
224	300285	国瓷材料	2,200	107,250.00	0.11
225	300676	华大基因	900	106,740.00	0.11
226	600332	白云山	3,100	104,935.00	0.11
227	002602	世纪华通	16,260	104,389.20	0.11
228	600089	特变电工	8,100	104,085.00	0.11
229	600161	天坛生物	3,020	103,435.00	0.10
230	002607	中公教育	4,900	102,361.00	0.10
231	600079	人福医药	3,600	101,772.00	0.10
232	601881	中国银河	9,400	101,332.00	0.10
233	600009	上海机场	2,100	101,073.00	0.10
234	300223	北京君正	1,000	100,920.00	0.10
235	600362	江西铜业	4,500	100,710.00	0.10
236	002624	完美世界	4,200	100,422.00	0.10
237	600383	金地集团	9,800	100,352.00	0.10
238	600885	宏发股份	1,600	100,320.00	0.10
239	601838	成都银行	7,900	99,856.00	0.10
240	300677	英科医疗	800	99,840.00	0.10
241	688002	睿创微纳	1,000	99,830.00	0.10
242	688008	澜起科技	1,600	99,808.00	0.10
243	603658	安图生物	1,310	99,258.70	0.10
244	601865	福莱特	2,500	98,825.00	0.10
245	600674	川投能源	8,000	98,640.00	0.10
246	601933	永辉超市	20,800	98,384.00	0.10
247	601727	上海电气	23,200	98,368.00	0.10
248	300450	先导智能	1,632	98,148.48	0.10
249	600298	安琪酵母	1,800	97,884.00	0.10
250	002625	光启技术	4,700	97,807.00	0.10
251	002508	老板电器	2,100	97,650.00	0.10
252	600352	浙江龙盛	7,100	97,554.00	0.10
253	300558	贝达药业	900	97,416.00	0.10
254	002340	格林美	10,400	97,240.00	0.10
255	002080	中材科技	3,700	96,829.00	0.10
256	600606	绿地控股	17,700	96,465.00	0.10
257	600018	上港集团	20,200	96,354.00	0.10
258	300144	宋城演艺	5,700	95,760.00	0.10

259	000703	恒逸石化	8,000	95,600.00	0.10
260	601117	中国化学	10,800	94,608.00	0.10
261	600219	南山铝业	26,100	93,960.00	0.10
262	002353	杰瑞股份	2,100	93,870.00	0.10
263	601216	君正集团	18,400	93,656.00	0.09
264	000066	中国长城	6,400	93,440.00	0.09
265	000825	太钢不锈	12,400	92,876.00	0.09
266	300724	捷佳伟创	800	92,808.00	0.09
267	002185	华天科技	6,000	92,340.00	0.09
267	600862	中航高科	3,000	92,340.00	0.09
268	603127	昭衍新药	500	91,875.00	0.09
269	601162	天风证券	18,900	91,854.00	0.09
270	002202	金风科技	7,500	91,200.00	0.09
271	300751	迈为股份	200	90,940.00	0.09
272	600489	中金黄金	10,544	90,889.28	0.09
273	600315	上海家化	1,500	90,210.00	0.09
274	300037	新宙邦	900	90,090.00	0.09
275	000977	浪潮信息	3,200	90,016.00	0.09
276	601689	拓普集团	2,400	89,832.00	0.09
277	688009	中国通号	15,700	89,333.00	0.09
278	601607	上海医药	4,200	88,746.00	0.09
279	000783	长江证券	12,100	88,572.00	0.09
280	000932	华菱钢铁	13,400	88,440.00	0.09
281	603589	口子窖	1,300	87,997.00	0.09
282	603456	九洲药业	1,800	87,444.00	0.09
283	603233	大参林	1,700	86,887.00	0.09
284	600704	物产中大	11,000	86,570.00	0.09
285	002013	中航机电	8,500	85,595.00	0.09
286	002120	韵达股份	6,300	85,239.00	0.09
287	002444	巨星科技	2,500	85,200.00	0.09
288	601990	南京证券	8,000	84,160.00	0.09
289	002223	鱼跃医疗	2,200	83,886.00	0.09
290	600109	国金证券	6,600	83,754.00	0.08
291	002690	美亚光电	1,500	83,640.00	0.08
292	300699	光威复材	1,100	83,545.00	0.08
293	600188	兖州煤业	5,400	82,944.00	0.08
294	601696	中银证券	4,000	82,360.00	0.08
295	600655	豫园股份	7,100	82,289.00	0.08
296	603939	益丰药房	1,460	81,891.40	0.08
297	601108	财通证券	7,800	81,822.00	0.08
298	601872	招商轮船	17,640	81,496.80	0.08
299	002157	正邦科技	6,800	81,260.00	0.08

300	002409	雅克科技	1,000	81,000.00	0.08
301	000807	云铝股份	6,800	80,920.00	0.08
302	002673	西部证券	9,700	80,025.00	0.08
303	002511	中顺洁柔	2,900	79,895.00	0.08
304	002294	信立泰	2,400	78,960.00	0.08
305	000027	深圳能源	8,600	78,862.00	0.08
306	603605	珀莱雅	400	78,684.00	0.08
307	000830	鲁西化工	4,200	78,666.00	0.08
308	600486	扬农化工	700	78,239.00	0.08
309	603638	艾迪精密	1,820	78,023.40	0.08
310	002044	美年健康	8,500	77,435.00	0.08
311	002384	东山精密	3,700	77,108.00	0.08
312	601077	渝农商行	19,300	77,007.00	0.08
313	601699	潞安环能	6,500	76,765.00	0.08
314	000050	深天马 A	5,400	76,572.00	0.08
315	600699	均胜电子	3,000	76,560.00	0.08
316	002032	苏泊尔	1,200	76,548.00	0.08
317	688006	杭可科技	900	76,500.00	0.08
318	601319	中国人保	12,900	76,497.00	0.08
319	300253	卫宁健康	4,700	76,469.00	0.08
320	000739	普洛药业	2,600	76,440.00	0.08
321	000728	国元证券	9,560	76,193.20	0.08
322	002078	太阳纸业	5,700	76,095.00	0.08
323	002603	以岭药业	2,600	75,816.00	0.08
324	600705	中航资本	19,500	75,465.00	0.08
325	002180	纳思达	2,300	74,060.00	0.08
326	000983	山西焦煤	8,900	73,959.00	0.07
327	000800	一汽解放	6,800	73,576.00	0.07
328	002405	四维图新	5,000	73,500.00	0.07
329	002430	杭氧股份	2,100	72,639.00	0.07
330	002372	伟星新材	3,500	72,345.00	0.07
331	002507	涪陵榨菜	1,900	71,554.00	0.07
332	600872	中炬高新	1,700	71,434.00	0.07
333	601555	东吴证券	8,500	70,890.00	0.07
334	600369	西南证券	14,500	70,615.00	0.07
335	603707	健友股份	1,690	70,557.50	0.07
336	300357	我武生物	1,100	70,532.00	0.07
337	600827	百联股份	3,500	70,525.00	0.07
338	000723	美锦能源	9,300	70,308.00	0.07
339	000513	丽珠集团	1,400	70,028.00	0.07
340	603613	国联股份	700	69,979.00	0.07
341	603444	吉比特	132	69,960.00	0.07

342	002138	顺络电子	1,800	69,786.00	0.07
343	002156	通富微电	2,900	69,716.00	0.07
344	601615	明阳智能	4,300	69,617.00	0.07
345	600372	中航电子	4,200	69,510.00	0.07
346	300251	光线传媒	6,400	69,184.00	0.07
347	600233	圆通速递	6,900	69,069.00	0.07
348	002152	广电运通	5,300	69,059.00	0.07
349	600739	辽宁成大	3,300	68,673.00	0.07
350	600038	中直股份	1,300	68,562.00	0.07
351	600803	新奥股份	4,100	67,691.00	0.07
352	600011	华能国际	16,000	67,520.00	0.07
353	000860	顺鑫农业	1,600	67,488.00	0.07
354	000656	金科股份	11,600	67,164.00	0.07
355	600522	中天科技	6,700	67,000.00	0.07
356	601058	赛轮轮胎	6,700	66,933.00	0.07
357	600875	东方电气	6,100	66,917.00	0.07
358	600521	华海药业	3,200	66,816.00	0.07
359	600177	雅戈尔	10,100	66,559.00	0.07
360	000547	航天发展	3,500	66,045.00	0.07
361	600392	盛和资源	3,800	65,968.00	0.07
362	002030	达安基因	3,100	65,844.00	0.07
363	600642	申能股份	10,700	65,698.00	0.07
364	002797	第一创业	9,200	65,688.00	0.07
365	603866	桃李面包	2,104	65,644.80	0.07
366	601198	东兴证券	6,000	65,580.00	0.07
367	600039	四川路桥	10,400	65,208.00	0.07
368	000021	深科技	3,400	65,076.00	0.07
369	300136	信维通信	2,100	64,848.00	0.07
370	600549	厦门钨业	3,100	64,573.00	0.07
371	603338	浙江鼎力	1,100	64,559.00	0.07
372	002299	圣农发展	2,700	64,476.00	0.07
373	002541	鸿路钢构	1,100	64,185.00	0.07
374	603267	鸿远电子	500	63,960.00	0.06
375	600998	九州通	4,100	63,017.00	0.06
376	600536	中国软件	1,100	62,623.00	0.06
377	000630	铜陵有色	23,000	62,560.00	0.06
378	002939	长城证券	5,600	62,328.00	0.06
379	600848	上海临港	3,480	62,292.00	0.06
380	600895	张江高科	3,400	62,118.00	0.06
381	002385	大北农	9,100	61,880.00	0.06
382	002422	科伦药业	3,100	61,845.00	0.06
383	600415	小商品城	12,000	61,800.00	0.06

384	600516	方大炭素	8,300	61,752.00	0.06
385	300308	中际旭创	1,600	61,632.00	0.06
386	603712	七一二	1,700	61,370.00	0.06
387	300482	万孚生物	940	60,808.60	0.06
388	002429	兆驰股份	9,900	60,093.00	0.06
389	600066	宇通客车	4,800	59,952.00	0.06
390	600380	健康元	4,300	59,039.00	0.06
391	002463	沪电股份	3,800	58,786.00	0.06
392	002563	森马服饰	4,900	58,555.00	0.06
393	002266	浙富控股	11,700	58,383.00	0.06
394	600598	北大荒	3,900	58,344.00	0.06
395	600909	华安证券	10,300	57,371.00	0.06
396	000975	银泰黄金	6,020	57,250.20	0.06
397	000709	河钢股份	23,200	57,072.00	0.06
398	603218	日月股份	2,100	56,868.00	0.06
399	002373	千方科技	3,400	56,780.00	0.06
400	603858	步长制药	2,500	56,225.00	0.06
401	000999	华润三九	2,100	56,175.00	0.06
402	002925	盈趣科技	1,430	55,641.30	0.06
403	002010	传化智联	7,200	55,512.00	0.06
404	002242	九阳股份	1,700	55,233.00	0.06
405	002926	华西证券	5,700	54,891.00	0.06
406	600988	赤峰黄金	3,600	53,964.00	0.05
407	002065	东华软件	6,800	53,924.00	0.05
408	601456	国联证券	3,500	53,900.00	0.05
409	601231	环旭电子	3,200	53,792.00	0.05
410	002146	荣盛发展	9,500	53,580.00	0.05
411	600170	上海建工	19,400	53,544.00	0.05
412	600511	国药股份	1,600	52,896.00	0.05
413	002127	南极电商	5,400	52,758.00	0.05
414	600801	华新水泥	3,000	52,710.00	0.05
415	600867	通化东宝	4,400	52,536.00	0.05
416	002456	欧菲光	5,900	52,392.00	0.05
417	002075	沙钢股份	4,800	52,368.00	0.05
418	002500	山西证券	7,800	52,338.00	0.05
419	600160	巨化股份	5,900	52,156.00	0.05
420	000738	航发控制	2,500	52,075.00	0.05
421	002958	青农商行	12,100	51,788.00	0.05
422	000988	华工科技	2,200	51,744.00	0.05
423	002153	石基信息	2,200	51,722.00	0.05
424	002212	天融信	2,600	51,402.00	0.05
425	300463	迈克生物	1,218	51,265.62	0.05

426	600027	华电国际	14,818	50,973.92	0.05
427	000987	越秀金控	4,000	50,640.00	0.05
428	601099	太平洋	14,900	50,511.00	0.05
429	000750	国海证券	11,900	50,456.00	0.05
430	300070	碧水源	6,900	50,439.00	0.05
431	000423	东阿阿胶	1,400	50,274.00	0.05
432	600153	建发股份	6,200	50,220.00	0.05
433	600688	上海石化	13,300	50,008.00	0.05
434	603883	老百姓	940	49,519.20	0.05
435	002558	巨人网络	3,700	49,210.00	0.05
436	600859	王府井	1,700	49,096.00	0.05
437	601992	金隅集团	18,200	48,958.00	0.05
438	600256	广汇能源	14,700	48,951.00	0.05
439	300383	光环新网	3,400	48,926.00	0.05
440	000961	中南建设	8,200	48,544.00	0.05
441	601598	中国外运	9,600	48,480.00	0.05
442	300773	拉卡拉	1,700	47,991.00	0.05
443	002557	洽洽食品	1,100	47,410.00	0.05
444	002151	北斗星通	1,100	47,377.00	0.05
445	002465	海格通信	5,000	47,300.00	0.05
446	002705	新宝股份	1,800	47,250.00	0.05
447	600026	中远海能	7,600	46,816.00	0.05
448	000671	阳光城	9,000	46,800.00	0.05
449	603027	千禾味业	1,780	46,796.20	0.05
450	002081	金螳螂	5,900	46,728.00	0.05
451	002019	亿帆医药	2,700	46,575.00	0.05
451	600498	烽火通信	2,500	46,575.00	0.05
452	000998	隆平高科	2,900	46,516.00	0.05
453	300088	长信科技	5,400	44,604.00	0.05
454	600340	华夏幸福	8,510	44,592.40	0.05
455	002506	协鑫集成	12,800	44,544.00	0.05
456	002683	宏大爆破	1,600	44,432.00	0.05
457	600879	航天电子	5,900	44,368.00	0.04
458	000729	燕京啤酒	6,100	44,164.00	0.04
459	600529	山东药玻	1,300	44,135.00	0.04
460	000402	金融街	6,500	43,875.00	0.04
461	600583	海油工程	9,600	43,200.00	0.04
462	000686	东北证券	5,100	43,095.00	0.04
463	002727	一心堂	1,300	43,043.00	0.04
464	300296	利亚德	5,500	43,010.00	0.04
465	000629	攀钢钒钛	18,700	42,823.00	0.04
466	300418	昆仑万维	2,600	42,588.00	0.04

467	000540	中天金融	15,300	41,769.00	0.04
468	001914	招商积余	2,329	40,012.22	0.04
469	000627	天茂集团	10,800	39,096.00	0.04
470	000623	吉林敖东	2,500	38,725.00	0.04
471	300212	易华录	1,400	37,674.00	0.04
472	000581	威孚高科	1,800	37,494.00	0.04
473	601128	常熟银行	6,000	37,200.00	0.04
474	002399	海普瑞	2,300	36,639.00	0.04
475	000401	冀东水泥	2,900	35,815.00	0.04
476	002131	利欧股份	14,700	34,398.00	0.03
476	601098	中南传媒	3,900	34,398.00	0.03
477	002572	索菲亚	1,000	24,200.00	0.02

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

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	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
2	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
3	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
4	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	844,094.00	0.57
2	300760	迈瑞医疗	423,622.00	0.29
3	600519	贵州茅台	409,861.00	0.28
4	601816	京沪高铁	394,595.00	0.27
5	601888	中国中免	366,252.00	0.25
6	600809	山西汾酒	296,915.00	0.20
7	600036	招商银行	292,145.00	0.20
8	300750	宁德时代	290,055.00	0.20
9	300999	金龙鱼	287,212.00	0.19
10	300759	康龙化成	277,733.00	0.19
11	601658	邮储银行	262,429.00	0.18
12	601318	中国平安	241,712.00	0.16
13	000858	五粮液	214,850.00	0.15
14	002352	顺丰控股	209,037.00	0.14
15	600989	宝丰能源	206,268.00	0.14
16	603501	韦尔股份	198,412.00	0.13

17	600150	中国船舶	181,558.00	0.12
18	300601	康泰生物	173,574.00	0.12
19	600584	长电科技	166,681.00	0.11
20	300059	东方财富	163,363.00	0.11

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	1,805,616.00	1.22
2	000858	五粮液	1,784,431.00	1.21
3	300750	宁德时代	1,484,008.00	1.01
4	300760	迈瑞医疗	753,284.00	0.51
5	000001	平安银行	670,686.00	0.45
6	002594	比亚迪	663,810.00	0.45
7	600519	贵州茅台	637,456.00	0.43
8	002714	牧原股份	603,410.94	0.41
9	000568	泸州老窖	572,421.00	0.39
10	300059	东方财富	564,519.00	0.38
11	002475	立讯精密	558,697.00	0.38
12	002304	洋河股份	508,894.00	0.35
13	002352	顺丰控股	503,066.00	0.34
14	002271	东方雨虹	473,665.64	0.32
15	300015	爱尔眼科	461,531.00	0.31
16	000002	万科 A	459,055.00	0.31
17	300122	智飞生物	448,526.00	0.30
18	601766	中国中车	446,261.00	0.30
19	600436	片仔癀	434,493.00	0.29
20	600050	中国联通	374,014.00	0.25

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,548,045.70
卖出股票收入（成交）总额	45,537,581.51

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	49,453.99
2	应收证券清算款	22,556.43
3	应收股利	-
4	应收利息	453.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	148,079.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 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	605287	德才股份	11,014.44	0.01	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
949	90,664.66	48,565,999.00	56.45	37,474,766.00	43.55

8.2 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	中国国际金融股份有	40,000,000.00	46.49

	限公司		
2	广发证券股份有限公司	6,846,634.00	7.96
3	中信证券股份有限公司	1,719,365.00	2.00
4	孙奇峰	1,283,600.00	1.49
5	杨军玲	1,000,000.00	1.16
6	刘敏德	1,000,000.00	1.16
7	黄运丹	500,000.00	0.58
8	马建国	500,000.00	0.58
9	贾慧	500,000.00	0.58
10	陈玲	500,000.00	0.58

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。

8.3 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	0.00

8.4 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月29日） 基金份额总额	659,040,765.00
本报告期期初基金份额总额	134,040,765.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	86,040,765.00

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

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

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

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	5	66,451,955.84	100.00%	47,267.94	100.00%	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月16日
2	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021年2月6日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021年3月31日

4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 5 月 27 日
---	---------------------------------------	------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210630	40,000,000.00	-	-	40,000,000.00	46.49
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中, 存在基金规模大幅波动的风险, 以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信 MSCI 中国 A 股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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- 4、《工银瑞信 MSCI 中国 A 股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。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日