

# 工银瑞信沪深 300 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>52</b>
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64

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 .....	65
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 .....	65
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 .....	65
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 .....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
7.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
10.4 基金投资策略的改变 .....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8 其他重大事件 .....	72
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
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 .....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银沪深 300ETF
场内简称	工银 300、工银沪深 300ETF
基金主代码	510350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 20 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	634,614,701.00 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	2019 年 8 月 16 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	沪深 300 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbcs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95599
传真	010-66583158	010-68121816
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	赵桂才	谷澍

## 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	180,988,250.24
本期利润	37,649,337.78
加权平均基金份额本期利润	0.0584
本期加权平均净值利润率	1.11%
本期基金份额净值增长率	1.10%
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	626,971,172.69
期末可供分配基金份额利润	0.9880
期末基金资产净值	3,359,201,716.00
期末基金份额净值	5.2933
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	38.83%

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 2019 年 5 月 20 日。

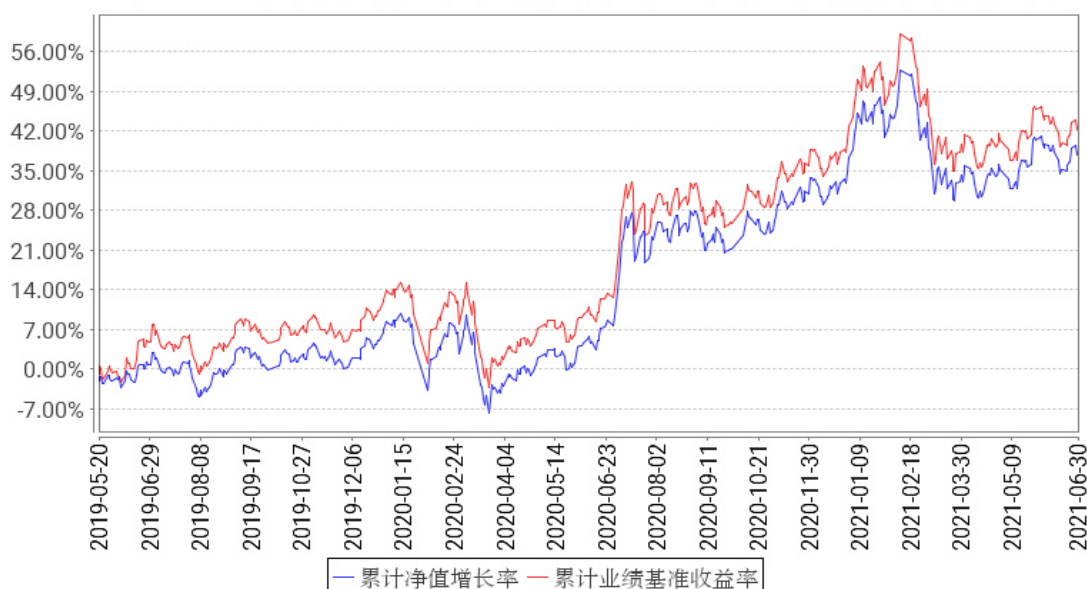
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-1.41%	0.80%	-2.02%	0.80%	0.61%	0.00%
过去三个月	4.33%	0.97%	3.48%	0.98%	0.85%	-0.01%
过去六个月	1.10%	1.30%	0.24%	1.31%	0.86%	-0.01%
过去一年	27.00%	1.32%	25.46%	1.33%	1.54%	-0.01%
自基金合同生效起至今	38.83%	1.24%	43.17%	1.27%	-4.34%	-0.03%

#### 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

工银沪深300ETF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 2019 年 5 月 20 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：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%。

### 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		
刘伟琳	本基金的基金经理	2019年5月20日	-	11年	中国人民大学金融工程博士；2010年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心产品及营销支持部研究负责人兼指数基金基金经理。2014年10月17日至今，担任工银深证100指数分级基金（自2018年4月17日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF））基金经理；2014年10月17日至今，担任工银沪深300指数基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银中证500指数分级基金（自2020年2月18日起变更为工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2015年5月21日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金（自2020年11月26日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF））基金经理；2015年7月23日至2020年11月3日，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理；2017年9月15日至2018年5月4日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理；2018年6月15日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金（LOF）基金经理；2019年5月20日至今，担任工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年8月21日至今，担任工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019年10月17日至今，担任工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年11月1日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年12月25日至今，担任工银瑞信粤

					<p>粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至今，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 21 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 22 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 6 月 11 日至今，担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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 1.10%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

## 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%。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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信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本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信沪深 300 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	32,081,143.73	29,652,508.96
结算备付金		604,903.95	2,066,510.63
存出保证金		265,326.98	461,325.40
交易性金融资产	6.4.7.2	3,316,753,879.45	3,345,342,922.99
其中：股票投资		3,316,753,879.45	3,345,342,922.99
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		11,925,601.29	8,006,009.11
应收利息	6.4.7.5	87,850.20	15,967.16
应收股利		517,594.61	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		3,362,236,300.21	3,385,545,244.25
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
<b>负 债:</b>			
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		-	1,165,324.77
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,243,358.06	1,184,469.22
应付托管费		276,301.81	263,215.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	462,145.91	746,795.44
应交税费		2,440.97	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,050,337.46	7,718,898.97
负债合计		3,034,584.21	11,078,703.78
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,419,733,336.23	2,457,481,216.91
未分配利润	6.4.7.10	939,468,379.77	916,985,323.56
所有者权益合计		3,359,201,716.00	3,374,466,540.47
负债和所有者权益总计		3,362,236,300.21	3,385,545,244.25

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 5.2933 元，基金份额总额为 634,614,701.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信沪深 300 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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		49,044,561.58	93,649,333.53
1. 利息收入		370,835.72	353,407.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	298,203.88	353,407.00
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		72,631.84	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		190,920,385.42	101,461,639.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	165,710,044.28	65,939,723.09
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
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	25,210,341.14	35,521,916.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-143,338,912.46	-7,947,626.24
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	1,092,252.90	-218,086.58
减：二、费用		11,395,223.80	12,720,410.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,614,397.17	8,068,877.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,692,088.28	1,793,083.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,405,146.03	2,148,400.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		261.53	-
7. 其他费用	6.4.7.20	683,330.79	710,048.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,649,337.78	80,928,922.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,649,337.78	80,928,922.58

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信沪深 300 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)	2,457,481,216.91	916,985,323.56	3,374,466,540.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,649,337.78	37,649,337.78
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)	-37,747,880.68	-15,166,281.57	-52,914,162.25
其中:1.基金申购款	490,722,449.24	194,507,288.79	685,229,738.03
2.基金赎回款	-528,470,329.92	-209,673,570.36	-738,143,900.28
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)	2,419,733,336.23	939,468,379.77	3,359,201,716.00
项目	上年度可比期间 2020年1月1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)	3,686,003,152.39	256,565,360.38	3,942,568,512.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	80,928,922.58	80,928,922.58
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)	-418,658,313.39	-33,163,444.94	-451,821,758.33
其中:1.基金申购款	1,338,333,952.06	27,330,771.53	1,365,664,723.59
2.基金赎回款	-1,756,992,265.45	-60,494,216.47	-1,817,486,481.92
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）	3,267,344,839.00	304,330,838.02	3,571,675,677.02

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 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：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2018]2139 号《关于准予工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,863,688,383.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0299 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,863,688,383.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 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	32,081,143.73
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	32,081,143.73

### 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	2,794,026,390.88	3,316,753,879.45	522,727,488.57
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		2,794,026,390.88	3,316,753,879.45	522,727,488.57

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	12,647.42
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	272.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	74,811.28
其他	119.30
合计	87,850.20

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

## 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	462,145.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	462,145.91

## 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	54,547.97
指数使用费	507,626.44
预提信息披露费	59,507.37
IOPV 服务费	49,588.57
应退替代款	372,806.31
可退替代款	6,260.80
合计	1,050,337.46

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	644,514,701.00	2,457,481,216.91
本期申购	128,700,000.00	490,722,449.24
本期赎回（以“-”号填列）	-138,600,000.00	-528,470,329.92
- 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	634,614,701.00	2,419,733,336.23

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	455,473,001.75	461,512,321.81	916,985,323.56
本期利润	180,988,250.24	-143,338,912.46	37,649,337.78
本期基金份额交易产生的变动数	-9,490,079.30	-5,676,202.27	-15,166,281.57
其中：基金申购款	104,973,694.82	89,533,593.97	194,507,288.79
基金赎回款	-114,463,774.12	-95,209,796.24	-209,673,570.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	626,971,172.69	312,497,207.08	939,468,379.77

## 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	283,523.16
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	11,636.07
其他	3,044.65
合计	298,203.88

## 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	97,129,207.72
股票投资收益——赎回差价收入	68,580,836.56
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	165,710,044.28

## 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	564,556,003.63
减：卖出股票成本总额	467,426,795.91
买卖股票差价收入	97,129,207.72

## 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	738,143,900.28
减：现金支付赎回款总额	290,369,925.28
减：赎回股票成本总额	379,193,138.44
赎回差价收入	68,580,836.56

## 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	25,210,341.14
其中：证券出借权益补偿收入	517,594.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,210,341.14

**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	-143,338,912.46



股票投资	-143,338,912.46
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	-143,338,912.46

#### 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	1,092,252.90
合计	1,092,252.90

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	1,405,146.03
银行间市场交易费用	-
合计	1,405,146.03

#### 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	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	49,588.57
银行费用	12,060.44
指数使用费	507,626.44
合计	683,330.79

## 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	基金管理人管理的其他基金

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

无。

#### 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

无。

#### 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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,614,397.17	8,068,877.66
其中：支付销售机构的客户维护费	7,445.54	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.45% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% / \text{当年天数}$$

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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,692,088.28	1,793,083.91

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

$$\text{托管费的计算方法如下：} H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	32,282,900.00	5.09	38,920,200.00	6.04

## 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1月1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
中国农业银行股份有限公司	32,081,143.73	283,523.16	53,358,033.09	335,814.83

**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 5,434,200.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 28,846,284.73 元，估值总额为人民币 28,094,814.00 元，占基金资产净值的比例为 0.84%。

于本报告期末，本基金持有 4,452,100.00 股农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 15,275,775.93 元，估值总额为人民币 13,489,863.00 元，占基金资产净值的比例为 0.40%。

**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
688083	中望软件	2021年3月4日	2021年9月13日	新股锁定	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688613	奥精医疗	2021年5月13日	2021年11月22日	新股锁定	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	新股锁定	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688639	华恒生物	2021年4月14日	2021年10月22日	新股锁定	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股锁定	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

		日	日								
300979	华利集团	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股锁 定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
688662	富信科技	2021年 3月25 日	2021年 10月8 日	新股锁 定	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56		-
688117	圣诺生物	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股锁 定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84		-
688328	深科达	2021年 3月1 日	2021年 9月9 日	新股锁 定	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21		-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70		-
300973	立高食品	2021年 4月8 日	2021年 10月 15日	新股锁 定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
688659	元琛科技	2021年 3月24 日	2021年 10月8 日	新股锁 定	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14		-
300941	创识科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股锁 定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06		-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月 30日	新股锁 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
300932	三友联众	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	新股锁 定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32		-
300982	苏文电能	2021年 4月19 日	2021年 10月 27日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股锁 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300940	南极	2021年	2021年	新股锁	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66		-

	光	1月27日	8月3日	定							
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02		-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24		-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40		-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28		-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
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		-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20		-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-

300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-



		日	日							
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月 26日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月 16日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年 5月17 日	2021年 11月 25日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月 20日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

#### 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
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	582,200	5,533,830.11	3,254,498.00	-

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000001	平安银行	2021年7月6日	22.62	58,100	1,314,222.00
2	000002	万科A	2021年7月6日	23.81	52,400	1,247,644.00
3	000063	中兴通讯	2021年7月6日	33.23	26,900	893,887.00
4	000066	中国长城	2021年7月6日	14.60	13,800	201,480.00
5	000069	华侨城A	2021年7月6日	7.44	33,600	249,984.00
6	000100	TCL科技	2021年7月6日	7.65	156,800	1,199,520.00
7	000157	中联重科	2021年7月6日	9.24	18,100	167,244.00
8	000166	申万宏源	2021年7月6日	4.68	53,600	250,848.00
9	000333	美的集团	2021年7月6日	71.37	44,500	3,175,965.00
10	000338	潍柴动力	2021年7月6日	17.87	28,100	502,147.00
11	000425	徐工机械	2021年7月6日	6.37	32,500	207,025.00
12	000538	云南白药	2021年7月6日	115.72	10,000	1,157,200.00
13	000568	泸州老窖	2021年7月6日	235.94	10,000	2,359,400.00
14	000625	长安汽车	2021年7月6日	26.28	15,200	399,456.00
15	000651	格力电器	2021年7月6日	52.10	49,300	2,568,530.00
16	000656	金科股份	2021年7月6日	5.79	25,000	144,750.00
17	000703	恒逸石化	2021年7月6日	11.95	12,300	146,985.00
18	000708	中信特钢	2021年7月6日	20.84	10,000	208,400.00
19	000725	京东方A	2021年7月6日	6.24	296,600	1,850,784.00
20	000728	国元证	2021年7月6日	7.97	24,800	197,656.00

		券				0
21	000768	中航西飞	2021 年 7 月 6 日	26.28	10,000	262,800.00
22	000776	广发证券	2021 年 7 月 6 日	15.14	14,700	222,558.00
23	000783	长江证券	2021 年 7 月 6 日	7.32	74,700	546,804.00
24	000786	北新建材	2021 年 7 月 6 日	39.25	10,000	392,500.00
25	000800	一汽解放	2021 年 7 月 6 日	10.82	10,000	108,200.00
26	000858	五粮液	2021 年 7 月 6 日	297.89	11,800	3,515,102.00
27	000860	顺鑫农业	2021 年 7 月 6 日	42.18	10,000	421,800.00
28	000876	新希望	2021 年 7 月 6 日	14.67	58,400	856,728.00
29	000895	双汇发展	2021 年 7 月 6 日	31.80	10,000	318,000.00
30	000938	紫光股份	2021 年 7 月 6 日	21.88	10,000	218,800.00
31	000963	华东医药	2021 年 7 月 6 日	46.01	10,000	460,100.00
32	000977	浪潮信息	2021 年 7 月 6 日	28.13	10,000	281,300.00
33	001979	招商蛇口	2021 年 7 月 6 日	10.95	15,700	171,915.00
34	002001	新和成	2021 年 7 月 6 日	28.68	12,200	349,896.00
35	002007	华兰生物	2021 年 7 月 6 日	36.68	10,000	366,800.00
36	002008	大族激光	2021 年 7 月 6 日	40.39	10,000	403,900.00
37	002027	分众传媒	2021 年 7 月 6 日	9.41	94,200	886,422.00
38	002044	美年健康	2021 年 7 月 6 日	9.11	25,100	228,661.00
39	002049	紫光国微	2021 年 7 月 6 日	154.19	10,000	1,541,900.00
40	002050	三花智控	2021 年 7 月 6 日	23.98	11,600	278,168.00
41	002120	韵达股份	2021 年 7 月 6 日	13.53	10,000	135,300.00
42	002129	中环股	2021 年 7 月 6 日	38.60	19,300	744,980.00

		份				0
43	002142	宁波银行	2021 年 7 月 6 日	38.97	25,100	978,147.00
44	002153	石基信息	2021 年 7 月 6 日	23.51	10,000	235,100.00
45	002157	正邦科技	2021 年 7 月 6 日	11.95	10,000	119,500.00
46	002179	中航光电	2021 年 7 月 6 日	79.02	14,400	1,137,888.00
47	002202	金风科技	2021 年 7 月 6 日	12.16	19,700	239,552.00
48	002230	科大讯飞	2021 年 7 月 6 日	67.58	18,100	1,223,198.00
49	002236	大华股份	2021 年 7 月 6 日	21.10	13,800	291,180.00
50	002241	歌尔股份	2021 年 7 月 6 日	42.74	21,300	910,362.00
51	002252	上海莱士	2021 年 7 月 6 日	7.49	19,000	142,310.00
52	002271	东方雨虹	2021 年 7 月 6 日	55.32	15,100	835,332.00
53	002304	洋河股份	2021 年 7 月 6 日	207.20	10,000	2,072,000.00
54	002311	海大集团	2021 年 7 月 6 日	81.60	10,000	816,000.00
55	002352	顺丰控股	2021 年 7 月 6 日	67.70	10,000	677,000.00
56	002384	东山精密	2021 年 7 月 6 日	20.84	13,200	275,088.00
57	002410	广联达	2021 年 7 月 6 日	68.20	10,200	695,640.00
58	002414	高德红外	2021 年 7 月 6 日	27.58	10,000	275,800.00
59	002415	海康威视	2021 年 7 月 6 日	64.50	19,700	1,270,650.00
60	002456	欧菲光	2021 年 7 月 6 日	8.88	17,800	158,064.00
61	002460	赣锋锂业	2021 年 7 月 6 日	121.09	10,000	1,210,900.00
62	002463	沪电股份	2021 年 7 月 6 日	15.47	10,700	165,529.00
63	002475	立讯精密	2021 年 7 月 6 日	46.00	40,600	1,867,600.00
64	002493	荣盛石	2021 年 7 月 6 日	17.27	12,200	210,694.00

		化				0
65	002508	老板电 器	2021 年 7 月 6 日	46.50	12,300	571,950.0 0
66	002555	三七互 娱	2021 年 7 月 6 日	24.02	10,000	240,200.0 0
67	002558	巨人网 络	2021 年 7 月 6 日	13.30	10,000	133,000.0 0
68	002594	比亚迪	2021 年 7 月 6 日	251.00	10,000	2,510,000 .00
69	002600	领益智 造	2021 年 7 月 6 日	9.19	12,100	111,199.0 0
70	002601	龙麟佰 利	2021 年 7 月 6 日	34.58	10,000	345,800.0 0
71	002602	世纪华 通	2021 年 7 月 6 日	6.42	30,800	197,736.0 0
72	002607	中公教 育	2021 年 7 月 6 日	20.89	10,000	208,900.0 0
73	002624	完美世 界	2021 年 7 月 6 日	23.91	10,000	239,100.0 0
74	002673	西部证 券	2021 年 7 月 6 日	8.25	10,000	82,500.00
75	002714	牧原股 份	2021 年 7 月 6 日	60.82	21,700	1,319,794 .00
76	002736	国信证 券	2021 年 7 月 6 日	10.75	11,100	119,325.0 0
77	002739	万达电 影	2021 年 7 月 6 日	15.79	10,000	157,900.0 0
78	002773	康弘药 业	2021 年 7 月 6 日	23.13	10,000	231,300.0 0
79	002841	视源股 份	2021 年 7 月 6 日	124.29	10,000	1,242,900 .00
80	002939	长城证 券	2021 年 7 月 6 日	11.13	10,000	111,300.0 0
81	300003	乐普医 疗	2021 年 7 月 6 日	32.12	10,300	330,836.0 0
82	300014	亿纬锂 能	2021 年 7 月 6 日	103.93	11,200	1,164,016 .00
83	300015	爱尔眼 科	2021 年 7 月 6 日	70.98	14,781	1,049,155 .38
84	300033	同花顺	2021 年 7 月 6 日	112.78	1,100	124,058.0 0
85	300059	东方财 富	2021 年 7 月 6 日	32.79	82,500	2,705,175 .00
86	300122	智飞生	2021 年 7 月 6 日	186.73	4,500	840,285.0

		物				0
87	300124	汇川技术	2021 年 7 月 6 日	74.26	16,400	1,217,864.00
88	300136	信维通信	2021 年 7 月 6 日	30.88	8,300	256,304.00
89	300142	沃森生物	2021 年 7 月 6 日	61.70	19,300	1,190,810.00
90	300144	宋城演艺	2021 年 7 月 6 日	16.80	10,800	181,440.00
91	300274	阳光电源	2021 年 7 月 6 日	115.06	8,800	1,012,528.00
92	300347	泰格医药	2021 年 7 月 6 日	193.30	4,100	792,530.00
93	300408	三环集团	2021 年 7 月 6 日	42.42	10,300	436,926.00
94	300413	芒果超媒	2021 年 7 月 6 日	68.60	3,400	233,240.00
95	300433	蓝思科技	2021 年 7 月 6 日	29.41	5,200	152,932.00
96	300450	先导智能	2021 年 7 月 6 日	60.14	8,800	529,232.00
97	300498	温氏股份	2021 年 7 月 6 日	14.37	49,700	714,189.00
98	300529	健帆生物	2021 年 7 月 6 日	86.36	3,400	293,624.00
99	300558	贝达药业	2021 年 7 月 6 日	108.24	1,900	205,656.00
100	300595	欧普康视	2021 年 7 月 6 日	103.55	3,500	362,425.00
101	300601	康泰生物	2021 年 7 月 6 日	149.00	1,000	149,000.00
102	300628	亿联网络	2021 年 7 月 6 日	83.80	1,500	125,700.00
103	300676	华大基因	2021 年 7 月 6 日	118.60	1,700	201,620.00
104	300677	英科医疗	2021 年 7 月 6 日	124.80	1,500	187,200.00
105	600000	浦发银行	2021 年 7 月 6 日	10.00	124,300	1,243,000.00
106	600010	包钢股份	2021 年 7 月 6 日	1.55	138,400	214,520.00
107	600011	华能国际	2021 年 7 月 6 日	4.22	17,700	74,694.00
108	600015	华夏银	2021 年 7 月 6 日	6.19	27,500	170,225.00

		行				0
109	600016	民生银行	2021 年 7 月 6 日	4.41	369,200	1,628,172.00
110	600018	上港集团	2021 年 7 月 6 日	4.77	10,000	47,700.00
111	600019	宝钢股份	2021 年 7 月 6 日	7.64	45,500	347,620.00
112	600025	华能水电	2021 年 7 月 6 日	5.79	10,000	57,900.00
113	600028	中国石化	2021 年 7 月 6 日	4.36	34,700	151,292.00
114	600029	南方航空	2021 年 7 月 6 日	6.02	16,500	99,330.00
115	600030	中信证券	2021 年 7 月 6 日	24.94	73,900	1,843,066.00
116	600031	三一重工	2021 年 7 月 6 日	29.07	54,500	1,584,315.00
117	600036	招商银行	2021 年 7 月 6 日	54.19	83,800	4,541,122.00
118	600048	保利地产	2021 年 7 月 6 日	12.04	57,700	694,708.00
119	600050	中国联通	2021 年 7 月 6 日	4.32	128,400	554,688.00
120	600061	国投资本	2021 年 7 月 6 日	8.49	12,700	107,823.00
121	600079	人福医药	2021 年 7 月 6 日	28.27	10,000	282,700.00
122	600085	同仁堂	2021 年 7 月 6 日	40.85	10,000	408,500.00
123	600104	上汽集团	2021 年 7 月 6 日	21.97	13,600	298,792.00
124	600109	国金证券	2021 年 7 月 6 日	12.69	24,100	305,829.00
125	600111	北方稀土	2021 年 7 月 6 日	20.70	21,900	453,330.00
126	600115	中国东航	2021 年 7 月 6 日	5.08	17,300	87,884.00
127	600118	中国卫星	2021 年 7 月 6 日	29.26	10,000	292,600.00
128	600143	金发科技	2021 年 7 月 6 日	20.86	19,500	406,770.00
129	600150	中国船舶	2021 年 7 月 6 日	16.51	10,000	165,100.00
130	600161	天坛生	2021 年 7 月 6 日	34.25	10,000	342,500.00

		物				0
131	600176	中国巨石	2021 年 7 月 6 日	15.51	18,600	288,486.00
132	600183	生益科技	2021 年 7 月 6 日	23.41	10,000	234,100.00
133	600196	复星医药	2021 年 7 月 6 日	72.13	10,000	721,300.00
134	600233	圆通速递	2021 年 7 月 6 日	10.01	10,000	100,100.00
135	600276	恒瑞医药	2021 年 7 月 6 日	67.97	36,600	2,487,702.00
136	600299	安迪苏	2021 年 7 月 6 日	11.96	10,000	119,600.00
137	600309	万华化学	2021 年 7 月 6 日	108.82	10,000	1,088,200.00
138	600332	白云山	2021 年 7 月 6 日	33.85	10,000	338,500.00
139	600340	华夏幸福	2021 年 7 月 6 日	5.24	32,400	169,776.00
140	600346	恒力石化	2021 年 7 月 6 日	26.24	10,000	262,400.00
141	600352	浙江龙盛	2021 年 7 月 6 日	13.74	27,200	373,728.00
142	600362	江西铜业	2021 年 7 月 6 日	22.38	10,000	223,800.00
143	600383	金地集团	2021 年 7 月 6 日	10.24	56,200	575,488.00
144	600406	国电南瑞	2021 年 7 月 6 日	23.24	15,720	365,332.80
145	600426	华鲁恒升	2021 年 7 月 6 日	30.95	13,500	417,825.00
146	600438	通威股份	2021 年 7 月 6 日	43.27	28,100	1,215,887.00
147	600489	中金黄金	2021 年 7 月 6 日	8.62	21,300	183,606.00
148	600519	贵州茅台	2021 年 7 月 6 日	2,056.70	10,000	20,567,000.00
149	600521	华海药业	2021 年 7 月 6 日	20.88	10,000	208,800.00
150	600522	中天科技	2021 年 7 月 6 日	10.00	24,800	248,000.00
151	600547	山东黄金	2021 年 7 月 6 日	19.22	10,000	192,200.00
152	600570	恒生电	2021 年 7 月 6 日	93.25	10,000	932,500.00



		子				0
153	600584	长电科技	2021 年 7 月 6 日	37.68	10,100	380,568.00
154	600585	海螺水泥	2021 年 7 月 6 日	41.05	11,200	459,760.00
155	600588	用友网络	2021 年 7 月 6 日	33.26	11,000	365,860.00
156	600600	青岛啤酒	2021 年 7 月 6 日	115.65	10,000	1,156,500.00
157	600655	豫园股份	2021 年 7 月 6 日	11.59	10,000	115,900.00
158	600660	福耀玻璃	2021 年 7 月 6 日	55.85	11,000	614,350.00
159	600690	海尔智家	2021 年 7 月 6 日	25.91	20,200	523,382.00
160	600703	三安光电	2021 年 7 月 6 日	32.05	18,200	583,310.00
161	600705	中航资本	2021 年 7 月 6 日	3.87	38,000	147,060.00
162	600741	华域汽车	2021 年 7 月 6 日	26.27	10,000	262,700.00
163	600745	闻泰科技	2021 年 7 月 6 日	96.90	10,000	969,000.00
164	600760	中航沈飞	2021 年 7 月 6 日	60.30	14,000	844,200.00
165	600795	国电电力	2021 年 7 月 6 日	2.43	86,000	208,980.00
166	600809	山西汾酒	2021 年 7 月 6 日	448.00	10,000	4,480,000.00
167	600837	海通证券	2021 年 7 月 6 日	11.50	77,100	886,650.00
168	600845	宝信软件	2021 年 7 月 6 日	50.90	10,000	509,000.00
169	600848	上海临港	2021 年 7 月 6 日	17.90	10,000	179,000.00
170	600872	中炬高新	2021 年 7 月 6 日	42.02	10,000	420,200.00
171	600886	国投电力	2021 年 7 月 6 日	9.61	14,000	134,540.00
172	600887	伊利股份	2021 年 7 月 6 日	36.83	72,800	2,681,224.00
173	600893	航发动力	2021 年 7 月 6 日	53.19	10,000	531,900.00
174	600900	长江电	2021 年 7 月 6 日	20.64	62,000	1,279,680

		力				.00
175	600918	中泰证 券	2021 年 7 月 6 日	10.82	12,000	129,840.0 0
176	600919	江苏银 行	2021 年 7 月 6 日	7.10	120,200	853,420.0 0
177	600926	杭州银 行	2021 年 7 月 6 日	14.75	19,000	280,250.0 0
178	600958	东方证 券	2021 年 7 月 6 日	9.99	39,700	396,603.0 0
179	600999	招商证 券	2021 年 7 月 6 日	19.02	16,300	310,026.0 0
180	601006	大秦铁 路	2021 年 7 月 6 日	6.58	29,900	196,742.0 0
181	601009	南京银 行	2021 年 7 月 6 日	10.52	33,700	354,524.0 0
182	601012	隆基股 份	2021 年 7 月 6 日	88.84	46,060	4,091,970 .40
183	601021	春秋航 空	2021 年 7 月 6 日	56.90	10,000	569,000.0 0
184	601088	中国神 华	2021 年 7 月 6 日	19.52	10,000	195,200.0 0
185	601100	恒立液 压	2021 年 7 月 6 日	85.92	10,000	859,200.0 0
186	601108	财通证 券	2021 年 7 月 6 日	10.49	23,000	241,270.0 0
187	601111	中国国 航	2021 年 7 月 6 日	7.78	10,000	77,800.00
188	601138	工业富 联	2021 年 7 月 6 日	12.41	10,000	124,100.0 0
189	601155	新城控 股	2021 年 7 月 6 日	41.60	10,000	416,000.0 0
190	601162	天风证 券	2021 年 7 月 6 日	4.86	23,800	115,668.0 0
191	601166	兴业银 行	2021 年 7 月 6 日	20.55	163,000	3,349,650 .00
192	601169	北京银 行	2021 年 7 月 6 日	4.87	139,400	678,878.0 0
193	601186	中国铁 建	2021 年 7 月 6 日	7.43	24,600	182,778.0 0
194	601211	国泰君 安	2021 年 7 月 6 日	17.14	28,700	491,918.0 0
195	601216	君正集 团	2021 年 7 月 6 日	5.09	17,100	87,039.00
196	601225	陕西煤	2021 年 7 月 6 日	11.85	19,900	235,815.0

		业				0
197	601229	上海银行	2021 年 7 月 6 日	8.20	82,100	673,220.00
198	601231	环旭电子	2021 年 7 月 6 日	16.81	10,000	168,100.00
199	601236	红塔证券	2021 年 7 月 6 日	13.56	10,000	135,600.00
200	601288	农业银行	2021 年 7 月 6 日	3.03	136,100	412,383.00
201	601318	中国平安	2021 年 7 月 6 日	64.28	79,900	5,135,972.00
202	601319	中国人保	2021 年 7 月 6 日	5.93	10,000	59,300.00
203	601328	交通银行	2021 年 7 月 6 日	4.90	140,800	689,920.00
204	601336	新华保险	2021 年 7 月 6 日	45.91	10,000	459,100.00
205	601360	三六零	2021 年 7 月 6 日	12.21	10,000	122,100.00
206	601377	兴业证券	2021 年 7 月 6 日	9.66	51,400	496,524.00
207	601390	中国中铁	2021 年 7 月 6 日	5.24	48,200	252,568.00
208	601398	工商银行	2021 年 7 月 6 日	5.17	45,800	236,786.00
209	601555	东吴证券	2021 年 7 月 6 日	8.34	30,300	252,702.00
210	601600	中国铝业	2021 年 7 月 6 日	5.30	52,600	278,780.00
211	601601	中国太保	2021 年 7 月 6 日	28.97	20,100	582,297.00
212	601607	上海医药	2021 年 7 月 6 日	21.13	10,000	211,300.00
213	601618	中国中冶	2021 年 7 月 6 日	2.98	34,700	103,406.00
214	601628	中国人寿	2021 年 7 月 6 日	33.89	10,000	338,900.00
215	601633	长城汽车	2021 年 7 月 6 日	43.59	10,000	435,900.00
216	601658	邮储银行	2021 年 7 月 6 日	5.02	28,000	140,560.00
217	601668	中国建筑	2021 年 7 月 6 日	4.65	114,800	533,820.00
218	601669	中国电	2021 年 7 月 6 日	3.87	43,000	166,410.00

		建				0
219	601688	华泰证 券	2021 年 7 月 6 日	15.80	41,400	654,120.0 0
220	601696	中银证 券	2021 年 7 月 6 日	20.59	10,000	205,900.0 0
221	601698	中国卫 通	2021 年 7 月 6 日	16.19	10,000	161,900.0 0
222	601727	上海电 气	2021 年 7 月 6 日	4.24	17,800	75,472.00
223	601766	中国中 车	2021 年 7 月 6 日	6.08	52,800	321,024.0 0
224	601788	光大证 券	2021 年 7 月 6 日	17.89	10,000	178,900.0 0
225	601800	中国交 建	2021 年 7 月 6 日	6.48	10,000	64,800.00
226	601808	中海油 服	2021 年 7 月 6 日	14.36	10,000	143,600.0 0
227	601816	京沪高 铁	2021 年 7 月 6 日	5.29	163,800	866,502.0 0
228	601818	光大银 行	2021 年 7 月 6 日	3.78	429,600	1,623,888 .00
229	601838	成都银 行	2021 年 7 月 6 日	12.64	16,300	206,032.0 0
230	601857	中国石 油	2021 年 7 月 6 日	5.29	18,300	96,807.00
231	601872	招商轮 船	2021 年 7 月 6 日	4.62	13,800	63,756.00
232	601877	正泰电 器	2021 年 7 月 6 日	33.38	10,000	333,800.0 0
233	601878	浙商证 券	2021 年 7 月 6 日	13.08	10,000	130,800.0 0
234	601881	中国银 河	2021 年 7 月 6 日	10.78	10,000	107,800.0 0
235	601888	中国中 免	2021 年 7 月 6 日	300.10	10,000	3,001,000 .00
236	601899	紫金矿 业	2021 年 7 月 6 日	9.69	110,500	1,070,745 .00
237	601901	方正证 券	2021 年 7 月 6 日	9.36	27,500	257,400.0 0
238	601919	中远海 控	2021 年 7 月 6 日	30.54	22,100	674,934.0 0
239	601933	永辉超 市	2021 年 7 月 6 日	4.73	26,800	126,764.0 0
240	601939	建设银	2021 年 7 月 6 日	6.65	10,000	66,500.00

		行				
241	601985	中国核电	2021 年 7 月 6 日	5.06	19,200	97,152.00
242	601988	中国银行	2021 年 7 月 6 日	3.08	19,400	59,752.00
243	601989	中国重工	2021 年 7 月 6 日	4.12	44,900	184,988.00
244	601990	南京证券	2021 年 7 月 6 日	10.52	43,200	454,464.00
245	601998	中信银行	2021 年 7 月 6 日	5.10	13,800	70,380.00
246	603019	中科曙光	2021 年 7 月 6 日	27.61	12,200	336,842.00
247	603259	药明康德	2021 年 7 月 6 日	156.59	23,500	3,679,865.00
248	603288	海天味业	2021 年 7 月 6 日	128.95	10,000	1,289,500.00
249	603369	今世缘	2021 年 7 月 6 日	54.16	10,000	541,600.00
250	603501	韦尔股份	2021 年 7 月 6 日	322.00	10,000	3,220,000.00
251	603799	华友钴业	2021 年 7 月 6 日	114.20	10,000	1,142,000.00
252	603806	福斯特	2021 年 7 月 6 日	105.13	10,000	1,051,300.00
253	603899	晨光文具	2021 年 7 月 6 日	84.56	10,000	845,600.00
254	603939	益丰药房	2021 年 7 月 6 日	56.09	10,000	560,900.00
255	603986	兆易创新	2021 年 7 月 6 日	187.90	10,000	1,879,000.00
256	603993	洛阳钼业	2021 年 7 月 6 日	5.16	37,800	195,048.00
257	688008	澜起科技	2021 年 7 月 6 日	62.38	2,300	143,474.00
258	688009	中国通号	2021 年 7 月 6 日	5.69	5,300	30,157.00
259	688012	中微公司	2021 年 7 月 6 日	165.92	1,700	282,064.00
260	688036	传音控股	2021 年 7 月 6 日	209.50	1,000	209,500.00
261	688111	金山办公	2021 年 7 月 6 日	394.80	1,000	394,800.00
262	688126	沪硅产	2021 年 7 月 6 日	29.18	2,400	70,032.00

		业				
263	688363	华熙生物	2021 年 7 月 6 日	277.86	1,000	277,860.00
264	688396	华润微	2021 年 7 月 6 日	91.02	1,000	91,020.00
合计	-	-	-	-	7,687,961	188,358,300.58

#### 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	32,081,143.73	-	-	-	-	-	32,081,143.73
结算备付金	604,903.95	-	-	-	-	-	604,903.95
存出保证金	265,326.98	-	-	-	-	-	265,326.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,316,753,879.45	3,316,753,879.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,925,601.29	11,925,601.29
应收利息	-	-	-	-	-	87,850.20	87,850.20
应收股利	-	-	-	-	-	517,594.61	517,594.61
资产总计	32,951,374.66	-	-	-	-	3,329,284,925.55	3,362,236,300.21
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,243,358.06	1,243,358.06
应付托管费	-	-	-	-	-	276,301.81	276,301.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	462,145.91	462,145.91
应付税费	-	-	-	-	-	2,440.97	2,440.97
其他负债	-	-	-	-	-	1,050,337	1,050,337

						.46	46
负债总计	-	-	-	-	-	3,034,584.21	3,034,584.21
利率敏感度缺口	32,951,374.66	-	-	-	-	3,326,250,341.34	3,359,201,716.00
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	29,652,508.96	-	-	-	-	-	29,652,508.96
结算备付金	2,066,510.63	-	-	-	-	-	2,066,510.63
存出保证金	461,325.40	-	-	-	-	-	461,325.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,345,342,922.99	3,345,342,922.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,006,009.11	8,006,009.11
应收利息	-	-	-	-	-	15,967.16	15,967.16
资产总计	32,180,344.99	-	-	-	-	3,353,364,899.26	3,385,545,244.25
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,165,324.77	1,165,324.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,184,469.22	1,184,469.22
应付托管费	-	-	-	-	-	263,215.38	263,215.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	746,795.44	746,795.44
其他负债	-	-	-	-	-	7,718,898.97	7,718,898.97
负债总计	-	-	-	-	-	11,078,703.78	11,078,703.78
利率敏感度缺口	32,180,344.99	-	-	-	-	3,342,286,195.48	3,374,466,540.47

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	3,316,753,879.45	98.74	3,345,342,922.99	99.14
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	3,316,753,879.45	98.74	3,345,342,922.99	99.14

注：1、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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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%	166,522,229.63	166,979,667.18
	业绩比较基准减少 5%	-166,522,229.63	-166,979,667.18

#### 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	3,316,753,879.45	98.65
	其中：股票	3,316,753,879.45	98.65
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	32,686,047.68	0.97
8	其他各项资产	12,796,373.08	0.38
9	合计	3,362,236,300.21	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。

3、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 188,358,300.58 元，占期末资产净值比例为 5.61%。

## 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	34,748,241.26	1.03
B	采矿业	70,070,434.40	2.09
C	制造业	1,833,808,707.69	54.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,525,966.53	1.74
E	建筑业	40,106,898.94	1.19
F	批发和零售业	23,799,846.14	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	95,722,142.08	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,408,444.96	3.23
J	金融业	782,028,813.84	23.28
K	房地产业	68,232,059.30	2.03
L	租赁和商务服务业	60,438,118.40	1.80
M	科学研究和技术服务业	47,300,014.18	1.41
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	5,980,430.98	0.18
Q	卫生和社会工作	70,400,906.50	2.10
R	文化、体育和娱乐业	13,817,358.70	0.41
S	综合	-	-
	合计	3,313,388,383.90	98.64

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,953,951.78	0.06

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.01
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	1,002,961.23	0.03
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	30,146.60	0.00
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	3,365,495.55	0.10

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	97,560	200,651,652.00	5.97
2	601318	中国平安	1,679,588	107,963,916.64	3.21
3	600036	招商银行	1,918,988	103,989,959.72	3.10
4	000858	五粮液	301,128	89,703,019.92	2.67
5	601012	隆基股份	670,884	59,601,334.56	1.77
6	000333	美的集团	764,483	54,561,151.71	1.62
7	600276	恒瑞医药	694,486	47,204,213.42	1.41
8	002415	海康威视	724,485	46,729,282.50	1.39
9	601166	兴业银行	2,255,350	46,347,442.50	1.38

10	601888	中国中免	151,424	45,442,342.40	1.35
11	603259	药明康德	277,902	43,516,674.18	1.30
12	300059	东方财富	1,281,886	42,033,041.94	1.25
13	000651	格力电器	746,097	38,871,653.70	1.16
14	600900	长江电力	1,764,013	36,409,228.32	1.08
15	002594	比亚迪	140,581	35,285,831.00	1.05
16	002475	立讯精密	757,966	34,866,436.00	1.04
17	600887	伊利股份	943,018	34,731,352.94	1.03
18	000001	平安银行	1,504,400	34,029,528.00	1.01
19	600030	中信证券	1,320,914	32,943,595.16	0.98
20	000725	京东方 A	5,247,800	32,746,272.00	0.97
21	300015	爱尔眼科	418,775	29,724,649.50	0.88
22	601398	工商银行	5,434,200	28,094,814.00	0.84
23	600031	三一重工	920,972	26,772,656.04	0.80
24	000568	泸州老窖	113,353	26,744,506.82	0.80
25	600309	万华化学	243,721	26,521,719.22	0.79
26	603501	韦尔股份	80,700	25,985,400.00	0.77
27	603288	海天味业	195,840	25,253,568.00	0.75
28	000002	万科 A	1,055,001	25,119,573.81	0.75
29	002714	牧原股份	407,807	24,802,821.74	0.74
30	600809	山西汾酒	53,913	24,153,024.00	0.72
31	300122	智飞生物	123,900	23,135,847.00	0.69
32	601919	中远海控	750,300	22,914,162.00	0.68
33	002142	宁波银行	559,167	21,790,737.99	0.65
34	600436	片仔癀	46,600	20,890,780.00	0.62
35	601328	交通银行	4,258,300	20,865,670.00	0.62
36	601899	紫金矿业	2,141,977	20,755,757.13	0.62
37	002304	洋河股份	93,695	19,413,604.00	0.58
38	002812	恩捷股份	82,800	19,383,480.00	0.58
39	002352	顺丰控股	282,793	19,145,086.10	0.57
40	002230	科大讯飞	275,629	18,627,007.82	0.55
41	300014	亿纬锂能	175,515	18,241,273.95	0.54
42	600000	浦发银行	1,821,767	18,217,670.00	0.54
43	300274	阳光电源	158,300	18,213,998.00	0.54
44	600438	通威股份	418,693	18,116,846.11	0.54
45	300124	汇川技术	240,482	17,858,193.32	0.53
46	600837	海通证券	1,496,091	17,205,046.50	0.51
47	000661	长春高新	43,654	16,894,098.00	0.50
48	000100	TCL 科技	2,174,900	16,637,985.00	0.50
49	601816	京沪高铁	3,045,000	16,108,050.00	0.48
50	000063	中兴通讯	479,049	15,918,798.27	0.47
51	002241	歌尔股份	370,900	15,852,266.00	0.47

52	300347	泰格医药	81,500	15,753,950.00	0.47
53	603986	兆易创新	82,252	15,455,150.80	0.46
54	601601	中国太保	530,844	15,378,550.68	0.46
55	600585	海螺水泥	372,401	15,287,061.05	0.46
56	600690	海尔智家	587,197	15,214,274.27	0.45
57	002271	东方雨虹	273,660	15,138,871.20	0.45
58	601668	中国建筑	3,253,300	15,127,845.00	0.45
59	002460	赣锋锂业	124,500	15,075,705.00	0.45
60	603799	华友钴业	131,744	15,045,164.80	0.45
61	002027	分众传媒	1,593,600	14,995,776.00	0.45
62	300142	沃森生物	242,950	14,990,015.00	0.45
63	600016	民生银行	3,300,200	14,553,882.00	0.43
64	600763	通策医疗	34,600	14,220,600.00	0.42
65	601288	农业银行	4,452,100	13,489,863.00	0.40
66	600196	复星医药	186,792	13,473,306.96	0.40
67	600048	保利地产	1,113,200	13,402,928.00	0.40
68	600703	三安光电	416,460	13,347,543.00	0.40
69	000338	潍柴动力	735,793	13,148,620.91	0.39
70	600919	江苏银行	1,832,331	13,009,550.10	0.39
71	002129	中环股份	328,600	12,683,960.00	0.38
72	601229	上海银行	1,542,733	12,650,410.60	0.38
73	601688	华泰证券	798,398	12,614,688.40	0.38
74	600050	中国联通	2,884,600	12,461,472.00	0.37
75	600660	福耀玻璃	217,294	12,135,869.90	0.36
76	600570	恒生电子	129,387	12,065,337.75	0.36
77	601211	国泰君安	698,315	11,969,119.10	0.36
78	600104	上汽集团	542,545	11,919,713.65	0.35
79	601766	中国中车	1,888,556	11,482,420.48	0.34
80	601169	北京银行	2,291,774	11,160,939.38	0.33
81	688111	金山办公	27,895	11,012,946.00	0.33
82	600999	招商证券	575,210	10,940,494.20	0.33
83	002371	北方华创	38,131	10,576,776.78	0.31
84	600019	宝钢股份	1,380,061	10,543,666.04	0.31
85	002311	海大集团	128,700	10,501,920.00	0.31
86	002049	紫光国微	65,800	10,145,702.00	0.30
87	601988	中国银行	3,271,100	10,074,988.00	0.30
88	002410	广联达	147,168	10,036,857.60	0.30
89	600406	国电南瑞	430,667	10,008,701.08	0.30
90	601088	中国神华	512,300	10,000,096.00	0.30
91	300498	温氏股份	692,096	9,945,419.52	0.30
92	601818	光大银行	2,561,200	9,681,336.00	0.29
93	300601	康泰生物	63,900	9,521,100.00	0.28



94	300450	先导智能	158,100	9,508,134.00	0.28
95	600745	闻泰科技	96,600	9,360,540.00	0.28
96	000625	长安汽车	351,500	9,237,420.00	0.27
97	000538	云南白药	79,200	9,165,024.00	0.27
98	600028	中国石化	2,076,600	9,053,976.00	0.27
99	600893	航发动力	165,580	8,807,200.20	0.26
100	601628	中国人寿	258,609	8,764,259.01	0.26
101	600346	恒力石化	326,680	8,572,083.20	0.26
102	601658	邮储银行	1,685,400	8,460,708.00	0.25
103	600588	用友网络	252,861	8,410,156.86	0.25
104	002821	凯莱英	22,200	8,271,720.00	0.25
105	601390	中国中铁	1,575,800	8,257,192.00	0.25
106	601633	长城汽车	189,104	8,243,043.36	0.25
107	300595	欧普康视	79,200	8,201,160.00	0.24
108	601009	南京银行	777,400	8,178,248.00	0.24
109	002493	荣盛石化	470,855	8,131,665.85	0.24
110	601377	兴业证券	831,112	8,028,541.92	0.24
111	601857	中国石油	1,506,769	7,970,808.01	0.24
112	600009	上海机场	160,526	7,726,116.38	0.23
113	688036	传音控股	36,692	7,686,974.00	0.23
114	300413	芒果超媒	110,330	7,568,638.00	0.23
115	600132	重庆啤酒	37,200	7,363,740.00	0.22
116	601225	陕西煤业	619,700	7,343,445.00	0.22
117	600584	长电科技	192,700	7,260,936.00	0.22
118	002601	龙鳞佰利	208,100	7,196,098.00	0.21
119	300408	三环集团	169,508	7,190,529.36	0.21
120	600426	华鲁恒升	229,300	7,096,835.00	0.21
121	600111	北方稀土	338,500	7,006,950.00	0.21
122	000776	广发证券	459,300	6,953,802.00	0.21
123	601100	恒立液压	80,756	6,938,555.52	0.21
124	601939	建设银行	1,039,300	6,911,345.00	0.21
125	002001	新和成	240,419	6,895,216.92	0.21
126	603882	金域医学	42,800	6,838,156.00	0.20
127	000895	双汇发展	214,900	6,833,820.00	0.20
128	300433	蓝思科技	231,799	6,817,208.59	0.20
129	688012	中微公司	40,985	6,800,231.20	0.20
130	600926	杭州银行	459,553	6,778,406.75	0.20
131	002179	中航光电	85,380	6,746,727.60	0.20
132	002050	三花智控	278,249	6,672,411.02	0.20
133	000166	申万宏源	1,397,000	6,537,960.00	0.19
134	600958	东方证券	648,400	6,477,516.00	0.19
135	600741	华域汽车	245,140	6,439,827.80	0.19

136	002841	视源股份	51,581	6,411,002.49	0.19
137	600600	青岛啤酒	55,000	6,360,750.00	0.19
138	300003	乐普医疗	196,000	6,295,520.00	0.19
139	000963	华东医药	135,600	6,238,956.00	0.19
140	002007	华兰生物	169,620	6,221,661.60	0.19
141	000786	北新建材	157,300	6,174,025.00	0.18
142	601006	大秦铁路	923,600	6,077,288.00	0.18
143	000157	中联重科	657,623	6,076,436.52	0.18
144	603806	福斯特	57,200	6,013,436.00	0.18
145	002607	中公教育	286,282	5,980,430.98	0.18
146	601901	方正证券	635,508	5,948,354.88	0.18
147	601336	新华保险	129,340	5,937,999.40	0.18
148	600015	华夏银行	955,731	5,915,974.89	0.18
149	002236	大华股份	279,300	5,893,230.00	0.18
150	601989	中国重工	1,418,300	5,843,396.00	0.17
151	600143	金发科技	279,000	5,819,940.00	0.17
152	601155	新城控股	139,902	5,819,923.20	0.17
153	600176	中国巨石	372,766	5,781,600.66	0.17
154	601138	工业富联	461,199	5,723,479.59	0.17
155	603993	洛阳钼业	1,094,400	5,647,104.00	0.17
156	000768	中航西飞	214,071	5,625,785.88	0.17
157	601877	正泰电器	167,415	5,588,312.70	0.17
158	600352	浙江龙盛	403,161	5,539,432.14	0.16
159	600010	包钢股份	3,540,500	5,487,775.00	0.16
160	600760	中航沈飞	90,780	5,474,034.00	0.16
161	601788	光大证券	302,242	5,407,109.38	0.16
162	600547	山东黄金	280,533	5,391,844.26	0.16
163	601600	中国铝业	1,015,236	5,380,750.80	0.16
164	001979	招商蛇口	490,751	5,373,723.45	0.16
165	300529	健帆生物	62,100	5,362,956.00	0.16
166	002008	大族激光	132,511	5,352,119.29	0.16
167	601186	中国铁建	714,700	5,310,221.00	0.16
168	688169	石头科技	4,196	5,291,156.00	0.16
169	603369	今世缘	97,500	5,280,600.00	0.16
170	002202	金风科技	429,024	5,216,931.84	0.16
171	000876	新希望	350,305	5,138,974.35	0.15
172	601916	浙商银行	1,292,200	5,130,034.00	0.15
173	002555	三七互娱	205,817	4,943,724.34	0.15
174	003816	中国广核	1,833,300	4,894,911.00	0.15
175	601799	星宇股份	21,600	4,875,552.00	0.15
176	603899	晨光文具	57,516	4,863,552.96	0.14
177	000938	紫光股份	221,976	4,856,834.88	0.14

178	002736	国信证券	446,700	4,802,025.00	0.14
179	600109	国金证券	376,131	4,773,102.39	0.14
180	601066	中信建投	151,301	4,755,390.43	0.14
181	000069	华侨城 A	634,700	4,722,168.00	0.14
182	600989	宝丰能源	341,900	4,677,192.00	0.14
183	000425	徐工机械	730,900	4,655,833.00	0.14
184	300136	信维通信	150,027	4,632,833.76	0.14
185	600150	中国船舶	277,900	4,588,129.00	0.14
186	601669	中国电建	1,181,762	4,573,418.94	0.14
187	603160	汇顶科技	35,173	4,559,475.99	0.14
188	600795	国电电力	1,831,000	4,449,330.00	0.13
189	000977	浪潮信息	157,600	4,433,288.00	0.13
190	002384	东山精密	212,300	4,424,332.00	0.13
191	603659	璞泰来	32,200	4,398,520.00	0.13
192	000783	长江证券	598,617	4,381,876.44	0.13
193	688008	澜起科技	70,077	4,371,403.26	0.13
194	603019	中科曙光	157,780	4,356,305.80	0.13
195	601238	广汽集团	335,920	4,350,164.00	0.13
196	600085	同仁堂	106,300	4,342,355.00	0.13
197	000596	古井贡酒	18,028	4,317,706.00	0.13
198	002624	完美世界	179,550	4,293,040.50	0.13
199	600079	人福医药	151,800	4,291,386.00	0.13
200	601838	成都银行	336,698	4,255,862.72	0.13
201	300677	英科医疗	33,500	4,180,800.00	0.12
202	300558	贝达药业	38,300	4,145,592.00	0.12
203	600886	国投电力	431,061	4,142,496.21	0.12
204	600183	生益科技	176,647	4,135,306.27	0.12
205	600029	南方航空	686,690	4,133,873.80	0.12
206	601985	中国核电	812,100	4,109,226.00	0.12
207	601108	财通证券	389,601	4,086,914.49	0.12
208	000703	恒逸石化	341,680	4,083,076.00	0.12
209	300144	宋城演艺	242,949	4,081,543.20	0.12
210	601360	三六零	331,200	4,043,952.00	0.12
211	002600	领益智造	438,500	4,029,815.00	0.12
212	601555	东吴证券	482,630	4,025,134.20	0.12
213	002414	高德红外	145,480	4,012,338.40	0.12
214	603517	绝味食品	47,300	3,986,917.00	0.12
215	000066	中国长城	271,600	3,965,360.00	0.12
216	603833	欧派家居	27,860	3,955,005.60	0.12
217	002252	上海莱士	523,700	3,922,513.00	0.12
218	002044	美年健康	424,100	3,863,551.00	0.12
219	002938	鹏鼎控股	106,800	3,831,984.00	0.11

220	601077	渝农商行	957,700	3,821,223.00	0.11
221	600522	中天科技	380,800	3,808,000.00	0.11
222	601607	上海医药	179,056	3,783,453.28	0.11
223	300676	华大基因	31,900	3,783,340.00	0.11
224	000728	国元证券	472,050	3,762,238.50	0.11
225	300033	同花顺	33,120	3,735,273.60	0.11
226	002602	世纪华通	578,238	3,712,287.96	0.11
227	688396	华润微	40,593	3,694,774.86	0.11
228	600332	白云山	108,200	3,662,570.00	0.11
229	600872	中炬高新	86,599	3,638,889.98	0.11
230	600161	天坛生物	105,500	3,613,375.00	0.11
231	601111	中国国航	463,600	3,606,808.00	0.11
232	600362	江西铜业	160,500	3,591,990.00	0.11
233	600383	金地集团	350,500	3,589,120.00	0.11
234	601800	中国交建	545,600	3,535,488.00	0.11
235	600115	中国东航	695,762	3,534,470.96	0.11
236	600845	宝信软件	69,366	3,530,729.40	0.11
237	300628	亿联网络	41,700	3,494,460.00	0.10
238	002508	老板电器	73,400	3,413,100.00	0.10
239	000860	顺鑫农业	80,800	3,408,144.00	0.10
240	601727	上海电气	796,500	3,377,160.00	0.10
241	600061	国投资本	397,037	3,370,844.13	0.10
242	002916	深南电路	30,038	3,338,122.94	0.10
243	601618	中国中冶	1,108,300	3,302,734.00	0.10
244	000708	中信特钢	156,800	3,267,712.00	0.10
245	601162	天风证券	670,530	3,258,775.80	0.10
246	002024	苏宁易购	582,200	3,254,498.00	0.10
247	601021	春秋航空	56,868	3,235,789.20	0.10
248	600705	中航资本	826,400	3,198,168.00	0.10
249	688363	华熙生物	11,396	3,166,492.56	0.09
250	601878	浙商证券	240,550	3,146,394.00	0.09
251	603939	益丰药房	55,300	3,101,777.00	0.09
252	600606	绿地控股	568,100	3,096,145.00	0.09
253	601990	南京证券	284,200	2,989,784.00	0.09
254	002456	欧菲光	335,600	2,980,128.00	0.09
255	002157	正邦科技	244,700	2,924,165.00	0.09
256	600011	华能国际	685,056	2,890,936.32	0.09
257	002463	沪电股份	185,923	2,876,228.81	0.09
258	000656	金科股份	496,300	2,873,577.00	0.09
259	600521	华海药业	136,100	2,841,768.00	0.08
260	601933	永辉超市	591,882	2,799,601.86	0.08
261	600655	豫园股份	240,000	2,781,600.00	0.08

262	603392	万泰生物	10,440	2,705,839.20	0.08
263	600118	中国卫星	91,714	2,683,551.64	0.08
264	601216	君正集团	522,600	2,660,034.00	0.08
265	600848	上海临港	147,480	2,639,892.00	0.08
266	601696	中银证券	127,800	2,631,402.00	0.08
267	600489	中金黄金	299,200	2,579,104.00	0.08
268	600018	上港集团	535,700	2,555,289.00	0.08
269	002558	巨人网络	188,100	2,501,730.00	0.07
270	603195	公牛集团	12,300	2,484,600.00	0.07
271	601995	中金公司	40,300	2,478,450.00	0.07
272	601998	中信银行	474,200	2,418,420.00	0.07
273	002120	韵达股份	178,488	2,414,942.64	0.07
274	601872	招商轮船	501,800	2,318,316.00	0.07
275	601319	中国人保	386,000	2,288,980.00	0.07
276	688009	中国通号	401,532	2,284,717.08	0.07
277	002673	西部证券	275,800	2,275,350.00	0.07
278	688126	沪硅产业	76,986	2,246,451.48	0.07
279	603338	浙江鼎力	37,300	2,189,137.00	0.07
280	002739	万达电影	137,250	2,167,177.50	0.06
281	601881	中国银河	198,900	2,144,142.00	0.06
282	603658	安图生物	26,890	2,037,455.30	0.06
283	600233	圆通速递	195,000	1,951,950.00	0.06
284	603233	大参林	36,000	1,839,960.00	0.05
285	600482	中国动力	100,872	1,757,190.24	0.05
286	601231	环旭电子	102,500	1,723,025.00	0.05
287	002153	石基信息	70,315	1,653,105.65	0.05
288	600025	华能水电	281,492	1,629,838.68	0.05
289	002939	长城证券	145,200	1,616,076.00	0.05
290	002032	苏泊尔	25,048	1,597,811.92	0.05
291	600340	华夏幸福	304,391	1,595,008.84	0.05
292	000800	一汽解放	145,300	1,572,146.00	0.05
293	601236	红塔证券	112,700	1,528,212.00	0.05
294	002773	康弘药业	57,492	1,329,789.96	0.04
295	601808	中海油服	92,500	1,328,300.00	0.04
296	600918	中泰证券	118,800	1,285,416.00	0.04
297	601698	中国卫通	68,400	1,107,396.00	0.03
298	603087	甘李药业	9,600	1,023,168.00	0.03
299	600299	安迪苏	62,600	748,696.00	0.02
300	002945	华林证券	40,800	563,856.00	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	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.03
2	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
3	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
4	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
5	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.00
6	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
7	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
8	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.00
9	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.00
10	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.00
11	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
12	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
13	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.00
14	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
15	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
16	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
17	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
18	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
19	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
20	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
21	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
22	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
23	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
24	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
25	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
26	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
27	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
28	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
29	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
30	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
31	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
32	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
33	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
34	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
35	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
36	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
37	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
38	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
39	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
40	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
41	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
42	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00

43	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
44	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
45	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
46	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
47	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
48	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
49	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
50	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
51	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
52	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
53	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
54	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
55	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
56	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
57	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
58	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
59	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
60	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
61	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600519	贵州茅台	30,428,900.92	0.90
2	000858	五粮液	20,681,094.00	0.61
3	300274	阳光电源	15,573,689.00	0.46
4	000333	美的集团	15,320,543.85	0.45
5	601816	京沪高铁	14,217,922.44	0.42
6	002415	海康威视	13,603,392.15	0.40
7	688111	金山办公	12,120,201.75	0.36
8	000725	京东方 A	10,378,597.00	0.31
9	300450	先导智能	9,945,969.40	0.29
10	000651	格力电器	9,384,705.00	0.28
11	002475	立讯精密	8,713,919.55	0.26
12	300595	欧普康视	8,406,876.40	0.25
13	300122	智飞生物	8,282,373.00	0.25
14	300015	爱尔眼科	8,192,730.33	0.24
15	600426	华鲁恒升	7,843,294.80	0.23
16	300059	东方财富	7,581,818.37	0.22
17	000001	平安银行	7,318,577.00	0.22
18	000568	泸州老窖	7,076,503.00	0.21
19	000002	万科 A	6,698,248.00	0.20

20	000661	长春高新	6,492,678.00	0.19
----	--------	------	--------------	------

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	000858	五粮液	30,045,104.70	0.89
2	000333	美的集团	20,834,180.84	0.62
3	000651	格力电器	13,397,929.48	0.40
4	300059	东方财富	11,496,136.20	0.34
5	000001	平安银行	10,771,682.61	0.32
6	000568	泸州老窖	10,149,710.36	0.30
7	000002	万科 A	9,327,322.63	0.28
8	002594	比亚迪	8,935,695.27	0.26
9	000661	长春高新	8,865,595.00	0.26
10	002415	海康威视	8,485,724.20	0.25
11	600036	招商银行	8,371,298.00	0.25
12	002714	牧原股份	8,177,733.62	0.24
13	601318	中国平安	8,170,702.00	0.24
14	002475	立讯精密	6,994,902.24	0.21
15	002352	顺丰控股	6,705,734.00	0.20
16	000725	京东方 A	6,546,170.84	0.19
17	002821	凯莱英	6,042,643.00	0.18
18	300014	亿纬锂能	5,964,257.76	0.18
19	000100	TCL 科技	5,821,242.62	0.17
20	300122	智飞生物	5,720,529.00	0.17

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	572,343,342.27
卖出股票收入（成交）总额	564,556,003.63

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	265,326.98
2	应收证券清算款	11,925,601.29

3	应收股利	517,594.61
4	应收利息	87,850.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,796,373.08

#### 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

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	600519	贵州茅台	20,567,000.00	0.61	转融通流通受限
2	601318	中国平安	5,135,972.00	0.15	转融通流通受限
3	600036	招商银行	4,541,122.00	0.14	转融通流通受限
4	601012	隆基股份	4,091,970.40	0.12	转融通流通受限
5	000858	五粮液	3,515,102.00	0.10	转融通流通受限
6	601166	兴业银行	3,349,650.00	0.10	转融通流通受限
7	000333	美的集团	3,175,965.00	0.09	转融通流通受限
8	601888	中国中免	3,001,000.00	0.09	转融通流通受限
9	600276	恒瑞医药	2,487,702.00	0.07	转融通流通受限
10	002415	海康威视	1,270,650.00	0.04	转融通流通受限

##### 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	688083	中望软件	962,734.96	0.03	新股锁定

2	300957	贝泰妮	214,921.88	0.01	新股锁定
3	688613	奥精医疗	166,179.50	0.00	新股锁定
4	301015	百洋医药	17,939.46	0.00	新股锁定

### 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

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,391	456,229.12	625,545,246.00	98.57	9,069,455.00	1.43

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国农业银行股份有限公司-工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	32,282,900.00	5.09

### 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	中国石油天然气集团有限公司	584,129,672.00	92.04
2	张澄	1,870,700.00	0.29
3	方正证券股份有限公司	1,619,900.00	0.26
4	中信证券股份有限公司	1,606,758.00	0.25
5	华夏基金-华夏银行-华夏基金-瑞衡多资产策略 1 号集合资产管理计划	1,395,068.00	0.22
6	华泰证券股份有限公司	1,245,100.00	0.20

7	中信建投证券股份有限公司	1,241,523.00	0.20
8	泰康资管—中国银行—泰康资产管理有限责任公司益泰 6 号资产管理产品	1,178,100.00	0.19
9	华夏基金—民生银行—华夏基金—瑞晟多资产策略 1 号集合资产管理计划	602,200.00	0.09
10	彭跃	524,534.00	0.08
11	中国农业银行股份有限公司—工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	32,282,900.00	5.09

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（2019 年 5 月 20 日）基金份额总额	6,863,688,383.00
本报告期期初基金份额总额	644,514,701.00
本报告期基金总申购份额	128,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	138,600,000.00
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	634,614,701.00

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：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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普华永道中天会计师事务所（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	2	565,785,153.45	50.12%	345,866.94	48.26%	-
银河证券	1	354,484,213.78	31.40%	223,786.84	31.23%	-
方正证券	3	194,640,462.56	17.24%	138,448.11	19.32%	-
国信证券	1	13,723,707.72	1.22%	8,389.42	1.17%	-
广发证券	3	86,522.91	0.01%	61.52	0.01%	-
光大证券	2	54,244.20	0.00%	38.60	0.01%	-
申万宏源	1	43,437.72	0.00%	30.89	0.00%	-
中金公司	2	29,028.79	0.00%	20.64	0.00%	-
华西证券	2	21,630.46	0.00%	15.38	0.00%	-
中信证券	2	16,441.70	0.00%	11.70	0.00%	-
瑞银证券	1	10,380.46	0.00%	6.34	0.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。

b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。

c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

## (2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

## 2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

本报告期内本基金新增华西证券 48946 上海交易单元，华西证券 011725 深圳交易单元。

## 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	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

## 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	584,129,672.00	-	-	584,129,672.00	92.04
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

工银瑞信沪深 300 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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信沪深 300 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