

中银中证 800 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：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 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
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
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
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.....	10
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.....	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
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.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
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.....	32
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.....	51
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.....	52
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的情况.....	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.....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
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	备查文件目录	58
11.1	备查文件目录.....	58
11.2	存放地点.....	58
11.3	查阅方式.....	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银 800
场内简称	中银中证 800ETF
基金主代码	515610
交易代码	515610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,857,400.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 8 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金还可参与融资和转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	罗丹丹
	联系电话	021-38834999	4006800000
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	luodandan@citicbank.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95558
传真		021-68873488	010-85230024

注册地址	上海市银城中路200号中银大厦45层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	章砚	李庆萍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中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日至2021年6月30日）
本期已实现收益	4,934,393.50
本期利润	2,237,383.13
加权平均基金份额本期利润	0.0537
本期加权平均净值利润率	4.99%
本期基金份额净值增长率	1.60%
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	2,882,884.21
期末可供分配基金份额利润	0.0877
期末基金资产净值	35,740,284.21
期末基金份额净值	1.0877
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	8.77%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.72%	0.76%	-1.30%	0.77%	0.58%	-0.01%
过去三个月	4.93%	0.86%	4.68%	0.88%	0.25%	-0.02%
过去六个月	1.60%	1.18%	1.72%	1.21%	-0.12%	-0.03%
自基金合同生效日起	8.77%	1.07%	8.22%	1.22%	0.55%	-0.15%

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2020 年 7 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：截至报告期末，本基金成立未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 142 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵建忠	基金经理	2020-07-16	-	15	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中银中证 100 基金基金经理，2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金基金经理，2015 年 6 月至今任中银 300E 基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银宏利基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银丰利基金基金经理，2020 年 4 月至今任中银 100 基金基金经理，2020 年 7 月至今任中银 800 基金基金经理，2020 年 8 月至今任中银黄金基金基金经理，2020 年 9 月至今任中银上海金 ETF 联接基金基金经理，2020 年 11 月至今任中银中证 100ETF 联接基金基金经理。具备基金、期货从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资

组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家疫情总体好转，二季度印度疫情爆发带动东南亚和英国疫情反复，截止 6 月末，美、英、中、印度和巴西全部完成疫苗接种占比分别为 45%、47%、16%、4%、12%。美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种总体恢复，6 月失业率较 2020 年 12 月下降 0.8 个百分点至 5.9%，6 月制造业 PMI 较 2020 年 12 月上行 0.1 个百分点至 60.6，6 月服务业 PMI 较 2020 年 12 月上升 2.4 个百分点至 60.1。美联储维持利率水平和资产购买规模不变，上调 IOER 和 ONRRP 利率，下半年就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。欧元区继续复苏，6 月失业率较 2020 年末回落 0.4 个百分点至 7.7%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上升 8.2 个百分点至 63.4，6 月服务业 PMI 较 2020 年末上升 11.9 个百分点至 58.3，欧央行 6 月议息会议上提出加快 PEPP 购买步伐。日本央行维持基准利率不变，经济恢复速度放缓，通缩问题有所好转，6 月 CPI 同比较 2020 年末回升 1.4 个百分点至 0.2%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上行 2.4 个百分点至 52.4。综合来看，全球经济下半年复苏进度边际放缓，主要经济体央行货币政策有边际收紧压力，但货币政策退出宽松力度预计总体较为温和。

国内经济方面，生产数据快速修复后有所转弱，经济结构性分化持续，出口维持高位，地产投资高位回落，而制造业和消费继续缓慢恢复，经济下行压力逐步体现，通胀预期回落。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 持续位于荣枯线上方窄幅震荡，6 月值较 2020 年末走低 1 个百分点至 50.9，同步指标工业增加值 1-6 月累计同比增长 15.9%，较 2020 年末上升 13.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口总体偏强，消费投资继续改善：1-6 月美元计价累计出口增速较 2020 年末回升 35 个百分点至 38.6% 左右，6 月社会消费品零售总额增速较 2020 年末回升 7.5 个百分点至 12.1%，制造业、房地产、基建投资均缓慢改善，1-6 月固定资产投资增速较 2020 年末回升 9.7 个百分点至 12.6% 的水平。通胀方面，CPI 震荡上行，6 月同比增速从 2020 年末的 0.2% 上升 0.9 个百分点至 1.1%，

PPI 快速上行后高位震荡，6 月同比增速从 2020 年末的-0.4%上升 9.2 个百分点至 8.8%。

2、行情回顾

今年开年之后股市延续去年底的涨势直到春节。春节之后，前期涨幅较大的“成长性核心资产”大幅调整，期间“价值”股和小盘股有所表现；四五月份，核心资产返身向上收复大部分失地；进入六月份，以科技股为代表的成长股行情再次启动，半导体、新能源等行业主题股票短期大幅上涨。从各行业来看，电气设备（23.83%）、钢铁（23.62%）、化工（21.46%）等行业涨幅居前，家用电器（-15.59%）、非银金融（-14.71%）、国防军工（-11.50%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为 0.75%；中证 100 涨跌幅-2.85%；中证 800 涨跌幅 1.72%；上证国企指数涨跌幅 1.40%。

3. 运行分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 1.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，欧美央行暂时维持宽松货币政策不变，海外经济稳定恢复。国内经济环境相对平稳，货币政策继续保持定力，A 股市场仍以“结构性”行情为主，当前时点下行风险可控，调整亦是蓄力。流动性环境仍然相对宽松，央行稳健的货币政策大幅收紧的可能性较低。随着市场抛压释放，市场情绪将逐步趋于缓和，在政策预期明朗以及资金面稳定因素带动下；叠加成长制造板块持仓拥挤，板块内部分歧也在加大，预计市场有望逐步开启风格平衡过程，建议成长制造和价值消费保持均衡配置，关注大盘蓝筹股的修复机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当

时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本报告期末可供分配利润为 2,882,884.21 元。本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 4 月 9 日、2021 年 5 月 7 日至本报告期末两次出现连续超过 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中银基金管理有限公司在中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露

管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银中证 800 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	964,931.07	796,000.63
结算备付金		46,414.95	291,687.90
存出保证金		26,751.17	225,916.34
交易性金融资产	6.4.7.2	34,754,328.43	66,727,446.46
其中：股票投资		34,740,328.43	66,684,046.46
基金投资		-	-
债券投资		14,000.00	43,400.00
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		-	1,256,216.00
应收利息	6.4.7.5	196.78	393.08
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		35,868,238.64	69,297,660.41
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		-	1,430,396.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,869.02	29,233.21
应付托管费		1,541.00	3,248.14

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,313.77	88,950.04
应交税费		-	0.19
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,230.64	450,500.74
负债合计		127,954.43	2,002,328.39
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	32,857,400.00	62,857,400.00
未分配利润	6.4.7.10	2,882,884.21	4,437,932.02
所有者权益合计		35,740,284.21	67,295,332.02
负债和所有者权益总计		35,868,238.64	69,297,660.41

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0877 元，基金份额总额 32,857,400.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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
一、收入		2,594,612.93
1.利息收入		5,697.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,685.34
债券利息收入		12.08
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）		5,243,692.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,939,835.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	9,740.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	294,117.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,697,010.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	42,232.90
减：二、费用		357,229.80

1. 管理人报酬	6.4.10.2	100,567.46
2. 托管费	6.4.10.2	11,174.19
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	79,747.87
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		0.02
7. 其他费用	6.4.7.19	165,740.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,237,383.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,237,383.13

注：本基金合同于 2020 年 7 月 16 日生效，无上年度可比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	62,857,400.00	4,437,932.02	67,295,332.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,237,383.13	2,237,383.13
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）	-30,000,000.00	-3,792,430.94	-33,792,430.94
其中：1.基金申购款	18,000,000.00	974,041.52	18,974,041.52
2.基金赎回款	-48,000,000.00	-4,766,472.46	-52,766,472.46
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）	32,857,400.00	2,882,884.21	35,740,284.21

注：本基金合同于 2020 年 7 月 16 日生效，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李道滨，主管会计工作负责人：张家文，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2049 号文《关于准予中银中证 800 交易型开放式

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

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金还可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率。

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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

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	964,931.07
定期存款	-
其他存款	-
合计	964,931.07

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	32,946,378.03	34,740,328.43	1,793,950.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	14,000.00	14,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	14,000.00	14,000.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	32,960,378.03	34,754,328.43	1,793,950.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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	166.19
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	18.81
应收债券利息	0.98
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	10.80
合计	196.78

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	21,313.77

银行间市场应付交易费用	-
合计	21,313.77

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	-
IOPV 计算发布费	24,795.19
应付信息披露费	39,671.58
应付审计费	19,835.79
应付指数使用费	6,704.48
可退替代款	223.60
合计	91,230.64

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	62,857,400.00	62,857,400.00
本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-48,000,000.00
本期末	32,857,400.00	32,857,400.00

注：注：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	3,082,897.96	1,355,034.06	4,437,932.02
本期利润	4,934,393.50	-2,697,010.37	2,237,383.13
本期基金份额交易产生的变动数	-2,766,934.86	-1,025,496.08	-3,792,430.94
其中：基金申购款	2,249,589.21	-1,275,547.69	974,041.52
基金赎回款	-5,016,524.07	250,051.61	-4,766,472.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,250,356.60	-2,367,472.39	2,882,884.21

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	4,243.66
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	610.14
其他	831.54
合计	5,685.34

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	2,796,097.76
股票投资收益——赎回差价收入	2,143,738.16
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	4,939,835.92

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	31,613,370.01
减：卖出股票成本总额	28,817,272.25
买卖股票差价收入	2,796,097.76

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	52,766,472.46
减：现金支付赎回款总额	23,523,012.46
减：赎回股票成本总额	27,099,721.84
赎回差价收入	2,143,738.16

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	107,954.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	98,200.00
减：应收利息总额	14.53
买卖债券差价收入	9,740.06

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	294,117.00
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	294,117.00

6.4.7.16 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	-2,697,010.37
——股票投资	-2,697,010.37
——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	-2,697,010.37

6.4.7.17 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	42,232.90
合计	42,232.90

6.4.7.18 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	79,747.87
银行间市场交易费用	-
合计	79,747.87

6.4.7.19 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	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	349.46
指数使用费	6,704.48
ETF 注册登记费	74,383.76
其他	24,795.19
合计	165,740.26

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	100,567.46
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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
当期发生的基金应支付的托管费	11,174.19

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
期初持有的基金份额	-	
期间申购/买入总份额	4,895,200.00	
期间因拆分变动份额	-	
减：期间赎回/卖出总份额	-	
期末持有的基金份额	4,895,200.00	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	14.90%	

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	964,931.07	4,243.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	配债未上市	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.00	-

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	5,100	46,674.40	28,509.00	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	1,000	22,244.23	56,350.00	-
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项停牌	3.05	2021-07-14	3.36	3,700	16,501.90	11,285.00	-

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

截至本报告期末,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中

风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资占基金资产净值的比例为 0.04%(2020 年 12 月 31 日：0.06%)。

本基金固定收益投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	14,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	14,000.00	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场

场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	964,931.07	-	-	-	964,931.07
结算备付金	46,414.95	-	-	-	46,414.95
存出保证金	26,751.17	-	-	-	26,751.17
交易性金融资产	14,000.00	-	-	34,740,328.43	34,754,328.43
应收利息	-	-	-	196.78	196.78
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
-	-	-	-	-	0.00
资产总计	1,052,097.19	-	-	34,816,141.45	35,868,238.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	223.60	223.60
应付管理人报酬	-	-	-	13,869.02	13,869.02
应付托管费	-	-	-	1,541.00	1,541.00
应付交易费用	-	-	-	21,313.77	21,313.77
其他负债	-	-	-	91,007.04	91,007.04
负债总计	-	-	-	127,954.43	127,954.43
利率敏感度缺口	1,052,097.19	-	-	34,688,187.02	35,740,284.21
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	796,000.63	-	-	-	796,000.63
结算备付金	291,687.90	-	-	-	291,687.90
存出保证金	225,916.34	-	-	-	225,916.34
交易性金融资产	-	-	43,400.00	66,684,046.46	66,727,446.46
应收证券清算款	-	-	-	1,256,216.00	1,256,216.00
应收利息	-	-	-	393.08	393.08
资产总计	1,313,604.87	-	43,400.00	67,940,655.54	69,297,660.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,705,896.81	1,705,896.81
应付管理人报酬	-	-	-	29,233.21	29,233.21
应付托管费	-	-	-	3,248.14	3,248.14
应付交易费用	-	-	-	88,950.04	88,950.04
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
负债总计	-	-	-	2,002,328.39	2,002,328.39
利率敏感度缺口	1,313,604.87	-	43,400.00	65,938,327.15	67,295,332.02

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2020 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	34,740,328.43	97.20	66,684,046.46	99.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	34,740,328.43	97.20	66,684,046.46	99.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 155	-
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 155	-

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	34,740,328.43	96.86
	其中：股票	34,740,328.43	96.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,000.00	0.04
	其中：债券	14,000.00	0.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,011,346.02	2.82
8	其他各项资产	102,564.19	0.29
9	合计	35,868,238.64	100.00

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务，本基金报告期末未投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	356,866.20	1.00
B	采矿业	840,609.60	2.35
C	制造业	19,804,896.41	55.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	659,801.10	1.85
E	建筑业	467,523.00	1.31
F	批发和零售业	466,095.80	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	945,041.60	2.64
H	住宿和餐饮业	42,791.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,574,709.40	4.41
J	金融业	6,797,036.38	19.02
K	房地产业	809,176.00	2.26
L	租赁和商务服务业	584,555.00	1.64
M	科学研究和技术服务业	410,520.76	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	65,568.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	55,267.20	0.15
Q	卫生和社会工作	604,254.98	1.69
R	文化、体育和娱乐业	190,448.00	0.53
S	综合	65,168.00	0.18
	合计	34,740,328.43	97.20

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

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	803	1,651,530.10	4.62
2	601318	中国平安	13,800	887,064.00	2.48
3	600036	招商银行	15,700	850,783.00	2.38
4	000858	五粮液	2,400	714,936.00	2.00

5	601012	隆基股份	5,544	492,528.96	1.38
6	000333	美的集团	6,200	442,494.00	1.24
7	002415	海康威视	6,000	387,000.00	1.08
8	600276	恒瑞医药	5,660	384,710.20	1.08
9	601166	兴业银行	18,300	376,065.00	1.05
10	601888	中国中免	1,200	360,120.00	1.01
11	603259	药明康德	2,264	354,519.76	0.99
12	300059	东方财富	10,180	333,802.20	0.93
13	000651	格力电器	6,200	323,020.00	0.90
14	002594	比亚迪	1,200	301,200.00	0.84
15	600900	长江电力	14,300	295,152.00	0.83
16	600887	伊利股份	7,700	283,591.00	0.79
17	002475	立讯精密	6,100	280,600.00	0.79
18	000001	平安银行	12,400	280,488.00	0.78
19	000725	京东方 A	42,700	266,448.00	0.75
20	600030	中信证券	10,600	264,364.00	0.74
21	300015	爱尔眼科	3,501	248,500.98	0.70
22	601398	工商银行	43,900	226,963.00	0.64
23	603501	韦尔股份	700	225,400.00	0.63
24	600031	三一重工	7,500	218,025.00	0.61
25	600309	万华化学	2,000	217,640.00	0.61
26	000568	泸州老窖	900	212,346.00	0.59
27	000002	万科 A	8,600	204,766.00	0.57
28	002714	牧原股份	3,360	204,355.20	0.57
29	603288	海天味业	1,580	203,741.00	0.57
30	601919	中远海控	6,200	189,348.00	0.53
31	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.52
32	600436	片仔癀	400	179,320.00	0.50
33	002142	宁波银行	4,600	179,262.00	0.50
34	600809	山西汾酒	400	179,200.00	0.50
35	601899	紫金矿业	17,500	169,575.00	0.47
36	601328	交通银行	34,500	169,050.00	0.47
37	002304	洋河股份	800	165,760.00	0.46
38	002812	恩捷股份	700	163,870.00	0.46
39	002352	顺丰控股	2,300	155,710.00	0.44
40	000661	长春高新	400	154,800.00	0.43
41	300274	阳光电源	1,300	149,578.00	0.42
42	002230	科大讯飞	2,200	148,676.00	0.42
43	600000	浦发银行	14,773	147,730.00	0.41
44	600438	通威股份	3,400	147,118.00	0.41
45	300014	亿纬锂能	1,400	145,502.00	0.41
46	300124	汇川技术	1,900	141,094.00	0.39
47	600837	海通证券	12,100	139,150.00	0.39
48	300347	泰格医药	700	135,310.00	0.38

49	000100	TCL 科技	17,400	133,110.00	0.37
50	601816	京沪高铁	24,800	131,192.00	0.37
51	002241	歌尔股份	3,000	128,220.00	0.36
52	600585	海螺水泥	3,100	127,255.00	0.36
53	000063	中兴通讯	3,800	126,274.00	0.35
54	603799	华友钴业	1,100	125,620.00	0.35
55	601601	中国太保	4,300	124,571.00	0.35
56	600690	海尔智家	4,800	124,368.00	0.35
57	600763	通策医疗	300	123,300.00	0.34
58	002027	分众传媒	13,100	123,271.00	0.34
59	601668	中国建筑	26,300	122,295.00	0.34
60	002271	东方雨虹	2,200	121,704.00	0.34
61	002460	赣锋锂业	1,000	121,090.00	0.34
62	603986	兆易创新	640	120,256.00	0.34
63	688111	金山办公	300	118,440.00	0.33
64	600016	民生银行	26,700	117,747.00	0.33
65	300142	沃森生物	1,900	117,230.00	0.33
66	600048	保利地产	9,100	109,564.00	0.31
67	600703	三安光电	3,400	108,970.00	0.30
68	601288	农业银行	35,900	108,777.00	0.30
69	600196	复星医药	1,500	108,195.00	0.30
70	000338	潍柴动力	6,000	107,220.00	0.30
71	600919	江苏银行	14,990	106,429.00	0.30
72	601229	上海银行	12,500	102,500.00	0.29
73	601688	华泰证券	6,400	101,120.00	0.28
74	600050	中国联通	23,400	101,088.00	0.28
75	600660	福耀玻璃	1,800	100,530.00	0.28
76	600104	上汽集团	4,400	96,668.00	0.27
77	601211	国泰君安	5,600	95,984.00	0.27
78	600570	恒生电子	1,000	93,250.00	0.26
79	002129	中环股份	2,400	92,640.00	0.26
80	601766	中国中车	15,100	91,808.00	0.26
81	601169	北京银行	18,500	90,095.00	0.25
82	600999	招商证券	4,600	87,492.00	0.24
83	600019	宝钢股份	10,900	83,276.00	0.23
84	002371	北方华创	300	83,214.00	0.23
85	601088	中国神华	4,200	81,984.00	0.23
86	002410	广联达	1,200	81,840.00	0.23
87	002311	海大集团	1,000	81,600.00	0.23
88	601988	中国银行	26,400	81,312.00	0.23
89	600406	国电南瑞	3,480	80,875.20	0.23
90	002709	天赐材料	750	79,935.00	0.22
91	300498	温氏股份	5,500	79,035.00	0.22
92	601818	光大银行	20,800	78,624.00	0.22

93	300450	先导智能	1,300	78,182.00	0.22
94	600745	闻泰科技	800	77,520.00	0.22
95	002049	紫光国微	500	77,095.00	0.22
96	000799	酒鬼酒	300	76,680.00	0.21
97	000625	长安汽车	2,900	76,212.00	0.21
98	002821	凯莱英	200	74,520.00	0.21
99	300601	康泰生物	500	74,500.00	0.21
100	600028	中国石化	16,900	73,684.00	0.21
101	600009	上海机场	1,500	72,195.00	0.20
102	601628	中国人寿	2,100	71,169.00	0.20
103	600588	用友网络	2,100	69,846.00	0.20
104	000538	云南白药	600	69,432.00	0.19
105	601658	邮储银行	13,800	69,276.00	0.19
106	600893	航发动力	1,300	69,147.00	0.19
107	603486	科沃斯	300	68,424.00	0.19
108	600346	恒力石化	2,600	68,224.00	0.19
109	601390	中国中铁	12,800	67,072.00	0.19
110	002493	荣盛石化	3,850	66,489.50	0.19
111	601009	南京银行	6,300	66,276.00	0.19
112	300595	欧普康视	640	66,272.00	0.19
113	601633	长城汽车	1,500	65,385.00	0.18
114	601377	兴业证券	6,700	64,722.00	0.18
115	601857	中国石油	12,100	64,009.00	0.18
116	688036	传音控股	300	62,850.00	0.18
117	688029	南微医学	200	62,338.00	0.17
118	300413	芒果超媒	900	61,740.00	0.17
119	601225	陕西煤业	5,100	60,435.00	0.17
120	600584	长电科技	1,600	60,288.00	0.17
121	601100	恒立液压	700	60,144.00	0.17
122	300408	三环集团	1,400	59,388.00	0.17
123	600132	重庆啤酒	300	59,385.00	0.17
124	600089	特变电工	4,600	59,110.00	0.17
125	002601	龙佰集团	1,700	58,786.00	0.16
126	600426	华鲁恒升	1,870	57,876.50	0.16
127	600600	青岛啤酒	500	57,825.00	0.16
128	000895	双汇发展	1,800	57,240.00	0.16
129	002001	新 和 成	1,980	56,786.40	0.16
130	000009	中国宝安	3,100	56,637.00	0.16
131	002074	国轩高科	1,300	56,628.00	0.16
132	600460	士兰微	1,000	56,350.00	0.16
133	600926	杭州银行	3,800	56,050.00	0.16
134	000776	广发证券	3,700	56,018.00	0.16
135	600111	北方稀土	2,700	55,890.00	0.16
136	300433	蓝思科技	1,900	55,879.00	0.16

137	601939	建设银行	8,400	55,860.00	0.16
138	002179	中航光电	700	55,314.00	0.15
139	002340	格林美	5,900	55,165.00	0.15
140	002050	三花智控	2,300	55,154.00	0.15
141	603444	吉比特	100	53,000.00	0.15
142	000166	申万宏源	11,300	52,884.00	0.15
143	603806	福斯特	500	52,565.00	0.15
144	600741	华域汽车	2,000	52,540.00	0.15
145	600958	东方证券	5,200	51,948.00	0.15
146	300003	乐普医疗	1,600	51,392.00	0.14
147	002007	华兰生物	1,400	51,352.00	0.14
148	000786	北新建材	1,300	51,025.00	0.14
149	000963	华东医药	1,100	50,611.00	0.14
150	601336	新华保险	1,100	50,501.00	0.14
151	002607	中公教育	2,400	50,136.00	0.14
152	601155	新城控股	1,200	49,920.00	0.14
153	688012	中微公司	300	49,776.00	0.14
154	002841	视源股份	400	49,716.00	0.14
155	601901	方正证券	5,300	49,608.00	0.14
156	601006	大秦铁路	7,500	49,350.00	0.14
157	000157	中联重科	5,300	48,972.00	0.14
158	300285	国瓷材料	1,000	48,750.00	0.14
159	002236	大华股份	2,300	48,530.00	0.14
160	601233	桐昆股份	2,000	48,180.00	0.13
161	600143	金发科技	2,300	47,978.00	0.13
162	603882	金城医学	300	47,931.00	0.13
163	600015	华夏银行	7,700	47,663.00	0.13
164	600176	中国巨石	3,058	47,429.58	0.13
165	601138	工业富联	3,800	47,158.00	0.13
166	601989	中国重工	11,400	46,968.00	0.13
167	603993	洛阳钼业	9,000	46,440.00	0.13
168	600352	浙江龙盛	3,300	45,342.00	0.13
169	601799	星宇股份	200	45,144.00	0.13
170	688099	晶晨股份	400	44,880.00	0.13
171	000768	中航西飞	1,700	44,676.00	0.13
172	002008	大族激光	1,100	44,429.00	0.12
173	600547	山东黄金	2,300	44,206.00	0.12
174	601600	中国铝业	8,300	43,990.00	0.12
175	600885	宏发股份	700	43,890.00	0.12
176	001979	招商蛇口	4,000	43,800.00	0.12
177	600010	包钢股份	28,100	43,555.00	0.12
178	601877	正泰电器	1,300	43,394.00	0.12
179	603369	今世缘	800	43,328.00	0.12
180	300529	健帆生物	500	43,180.00	0.12

181	601186	中国铁建	5,800	43,094.00	0.12
182	002185	华天科技	2,800	43,092.00	0.12
183	601788	光大证券	2,400	42,936.00	0.12
184	300207	欣旺达	1,300	42,328.00	0.12
185	603899	晨光文具	500	42,280.00	0.12
186	600760	中航沈飞	700	42,210.00	0.12
187	002202	金风科技	3,400	41,344.00	0.12
188	601916	浙商银行	10,400	41,288.00	0.12
189	000876	新希望	2,800	41,076.00	0.11
190	603659	璞泰来	300	40,980.00	0.11
191	002555	三七互娱	1,700	40,834.00	0.11
192	300316	晶盛机电	800	40,400.00	0.11
193	300037	新宙邦	400	40,040.00	0.11
194	000938	紫光股份	1,820	39,821.60	0.11
195	003816	中国广核	14,700	39,249.00	0.11
196	603160	汇顶科技	300	38,889.00	0.11
197	002736	国信证券	3,600	38,700.00	0.11
198	000069	华侨城 A	5,200	38,688.00	0.11
199	600989	宝丰能源	2,800	38,304.00	0.11
200	600109	国金证券	3,000	38,070.00	0.11
201	600150	中国船舶	2,300	37,973.00	0.11
202	601066	中信建投	1,200	37,716.00	0.11
203	000425	徐工机械	5,900	37,583.00	0.11
204	300677	英科医疗	300	37,440.00	0.10
205	688008	澜起科技	600	37,428.00	0.10
206	601669	中国电建	9,600	37,152.00	0.10
207	601636	旗滨集团	2,000	37,120.00	0.10
208	300136	信维通信	1,200	37,056.00	0.10
209	000977	浪潮信息	1,300	36,569.00	0.10
210	688396	华润微	400	36,408.00	0.10
211	600733	北汽蓝谷	2,700	36,396.00	0.10
212	601238	广汽集团	2,800	36,260.00	0.10
213	300146	汤臣倍健	1,100	36,190.00	0.10
214	600795	国电电力	14,800	35,964.00	0.10
215	603019	中科曙光	1,300	35,893.00	0.10
216	300253	卫宁健康	2,200	35,794.00	0.10
217	300676	华大基因	300	35,580.00	0.10
218	002384	东山精密	1,700	35,428.00	0.10
219	000783	长江证券	4,800	35,136.00	0.10
220	002223	鱼跃医疗	900	34,317.00	0.10
221	601838	成都银行	2,700	34,128.00	0.10
222	600079	人福医药	1,200	33,924.00	0.09
223	300033	同花顺	300	33,834.00	0.09
224	603517	绝味食品	400	33,716.00	0.09

225	600029	南方航空	5,600	33,712.00	0.09
226	600886	国投电力	3,500	33,635.00	0.09
227	300144	宋城演艺	2,000	33,600.00	0.09
228	002624	完美世界	1,400	33,474.00	0.09
229	000703	恒逸石化	2,800	33,460.00	0.09
230	601985	中国核电	6,600	33,396.00	0.09
231	002916	深南电路	300	33,339.00	0.09
232	601127	小康股份	500	33,335.00	0.09
233	601360	三六零	2,700	32,967.00	0.09
234	002648	卫星石化	840	32,919.60	0.09
235	600183	生益科技	1,400	32,774.00	0.09
236	600219	南山铝业	9,100	32,760.00	0.09
237	600085	同仁堂	800	32,680.00	0.09
238	600884	杉杉股份	1,400	32,648.00	0.09
239	601108	财通证券	3,100	32,519.00	0.09
240	300558	贝达药业	300	32,472.00	0.09
241	002600	领益智造	3,523	32,376.37	0.09
242	002938	鹏鼎控股	900	32,292.00	0.09
243	000066	中国长城	2,200	32,120.00	0.09
244	603290	斯达半导	100	32,000.00	0.09
245	601607	上海医药	1,500	31,695.00	0.09
246	601555	XD 东吴证	3,800	31,692.00	0.09
247	603737	三棵树	180	31,680.00	0.09
248	600563	法拉电子	200	31,672.00	0.09
249	002252	上海莱士	4,200	31,458.00	0.09
250	002414	高德红外	1,140	31,441.20	0.09
251	002353	杰瑞股份	700	31,290.00	0.09
252	002625	光启技术	1,500	31,215.00	0.09
253	002138	顺络电子	800	31,016.00	0.09
254	600522	中天科技	3,100	31,000.00	0.09
255	600161	天坛生物	900	30,825.00	0.09
256	601077	渝农商行	7,700	30,723.00	0.09
257	000728	国元证券	3,850	30,684.50	0.09
258	002444	巨星科技	900	30,672.00	0.09
259	600332	白云山	900	30,465.00	0.09
260	300699	光威复材	400	30,380.00	0.09
261	000547	航天发展	1,600	30,192.00	0.08
262	002044	美年健康	3,300	30,063.00	0.08
263	002797	第一创业	4,200	29,988.00	0.08
264	688002	睿创微纳	300	29,949.00	0.08
265	600383	金地集团	2,900	29,696.00	0.08
266	002212	天融信	1,500	29,655.00	0.08
267	601111	中国国航	3,800	29,564.00	0.08
268	002602	世纪华通	4,600	29,532.00	0.08

269	000860	顺鑫农业	700	29,526.00	0.08
270	600872	中炬高新	700	29,414.00	0.08
271	600362	江西铜业	1,300	29,094.00	0.08
272	601099	太平洋	8,500	28,815.00	0.08
273	601168	西部矿业	2,400	28,632.00	0.08
274	000807	云铝股份	2,400	28,560.00	0.08
275	601800	中国交建	4,400	28,512.00	0.08
276	002024	苏宁易购	5,100	28,509.00	0.08
277	600754	锦江酒店	500	28,475.00	0.08
278	601021	春秋航空	500	28,450.00	0.08
279	600115	中国东航	5,600	28,448.00	0.08
280	603833	欧派家居	200	28,392.00	0.08
281	600704	物产中大	3,600	28,332.00	0.08
282	000988	华工科技	1,200	28,224.00	0.08
283	603939	益丰药房	500	28,045.00	0.08
284	601117	中国化学	3,200	28,032.00	0.08
285	600845	宝信软件	550	27,995.00	0.08
286	600061	国投资本	3,292	27,949.08	0.08
287	002422	科伦药业	1,400	27,930.00	0.08
288	002508	老板电器	600	27,900.00	0.08
289	603893	瑞芯微	200	27,892.00	0.08
290	002385	大北农	4,100	27,880.00	0.08
291	600392	盛和资源	1,600	27,776.00	0.08
292	600862	中航高科	900	27,702.00	0.08
293	000636	风华高科	900	27,198.00	0.08
294	601727	上海电气	6,400	27,136.00	0.08
295	603589	口子窖	400	27,076.00	0.08
296	600739	辽宁成大	1,300	27,053.00	0.08
297	300308	中际旭创	700	26,964.00	0.08
298	601618	中国中冶	9,000	26,820.00	0.08
299	002078	太阳纸业	2,000	26,700.00	0.07
300	002507	涪陵榨菜	700	26,362.00	0.07
301	002030	达安基因	1,240	26,337.60	0.07
302	601162	天风证券	5,400	26,244.00	0.07
303	000830	鲁西化工	1,400	26,222.00	0.07
304	600068	葛洲坝	3,500	26,215.00	0.07
305	002439	启明星辰	900	26,109.00	0.07
306	600705	中航产融	6,700	25,929.00	0.07
307	002180	纳思达	800	25,760.00	0.07
308	300088	长信科技	3,100	25,606.00	0.07
309	600699	均胜电子	1,000	25,520.00	0.07
310	000039	中集集团	1,400	25,452.00	0.07
311	600779	水井坊	200	25,270.00	0.07
312	300628	亿联网络	300	25,140.00	0.07

313	002250	联化科技	900	25,110.00	0.07
314	600606	绿地控股	4,600	25,070.00	0.07
315	000630	铜陵有色	9,200	25,024.00	0.07
316	000513	丽珠集团	500	25,010.00	0.07
317	000708	中信特钢	1,200	25,008.00	0.07
318	601878	浙商证券	1,900	24,852.00	0.07
319	002028	思源电气	800	24,632.00	0.07
320	600201	生物股份	1,400	24,430.00	0.07
321	601990	南京证券	2,300	24,196.00	0.07
322	002013	中航机电	2,400	24,168.00	0.07
323	600315	上海家化	400	24,056.00	0.07
324	002075	沙钢股份	2,200	24,002.00	0.07
325	002456	欧菲光	2,700	23,976.00	0.07
326	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.07
327	002157	正邦科技	2,000	23,900.00	0.07
328	300618	寒锐钴业	300	23,652.00	0.07
329	002273	水晶光电	1,600	23,504.00	0.07
330	002127	南极电商	2,400	23,448.00	0.07
331	600011	华能国际	5,500	23,210.00	0.06
332	002463	沪电股份	1,500	23,205.00	0.06
333	600655	豫园股份	2,000	23,180.00	0.06
334	000656	金科股份	4,000	23,160.00	0.06
335	600177	雅戈尔	3,500	23,065.00	0.06
336	600521	华海药业	1,100	22,968.00	0.06
336	000021	深科技	1,200	22,968.00	0.06
338	600549	厦门钨业	1,100	22,913.00	0.06
339	601997	贵阳银行	3,200	22,912.00	0.06
340	600536	中国软件	400	22,772.00	0.06
341	601933	永辉超市	4,800	22,704.00	0.06
342	002092	中泰化学	2,200	22,594.00	0.06
343	600988	赤峰黄金	1,500	22,485.00	0.06
344	601689	拓普集团	600	22,458.00	0.06
345	000983	山西焦煤	2,700	22,437.00	0.06
346	600486	扬农化工	200	22,354.00	0.06
347	002511	中顺洁柔	800	22,040.00	0.06
348	300168	万达信息	1,500	21,900.00	0.06
349	002465	海格通信	2,300	21,758.00	0.06
350	002156	通富微电	900	21,636.00	0.06
351	600516	方大炭素	2,900	21,576.00	0.06
352	002299	圣农发展	900	21,492.00	0.06
352	600867	通化东宝	1,800	21,492.00	0.06
354	600848	上海临港	1,200	21,480.00	0.06
355	601216	君正集团	4,200	21,378.00	0.06
356	600171	上海贝岭	700	21,301.00	0.06

357	600637	东方明珠	2,600	21,294.00	0.06
358	000050	深天马 A	1,500	21,270.00	0.06
359	600066	宇通客车	1,700	21,233.00	0.06
360	300009	安科生物	1,420	21,158.00	0.06
361	600418	江淮汽车	1,700	21,131.00	0.06
362	600038	中直股份	400	21,096.00	0.06
363	601005	重庆钢铁	7,900	21,093.00	0.06
364	601128	常熟银行	3,400	21,080.00	0.06
365	300001	特锐德	700	21,077.00	0.06
366	300463	迈克生物	500	21,045.00	0.06
367	600018	上港集团	4,400	20,988.00	0.06
368	002080	中材科技	800	20,936.00	0.06
369	000998	隆平高科	1,300	20,852.00	0.06
370	000960	锡业股份	1,300	20,839.00	0.06
371	300482	万孚生物	320	20,700.80	0.06
372	600489	中金黄金	2,400	20,688.00	0.06
373	601696	中银证券	1,000	20,590.00	0.06
374	000739	普洛药业	700	20,580.00	0.06
375	600487	亨通光电	1,800	20,520.00	0.06
376	600118	XD 中国卫	700	20,482.00	0.06
377	300070	碧水源	2,800	20,468.00	0.06
378	688126	沪硅产业	700	20,426.00	0.06
379	002603	以岭药业	700	20,412.00	0.06
379	000723	美锦能源	2,700	20,412.00	0.06
381	600529	山东药玻	600	20,370.00	0.06
382	002120	韵达股份	1,500	20,295.00	0.06
383	000825	太钢不锈	2,700	20,223.00	0.06
384	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.06
385	300223	北京君正	200	20,184.00	0.06
386	600827	百联股份	1,000	20,150.00	0.06
387	300383	光环新网	1,400	20,146.00	0.06
388	002373	千方科技	1,200	20,040.00	0.06
389	600166	福田汽车	5,800	20,010.00	0.06
390	600369	西南证券	4,100	19,967.00	0.06
391	002558	巨人网络	1,500	19,950.00	0.06
392	000750	国海证券	4,700	19,928.00	0.06
393	601998	中信银行	3,900	19,890.00	0.06
394	000932	华菱钢铁	3,000	19,800.00	0.06
395	603638	艾迪精密	460	19,720.20	0.06
396	603658	安图生物	260	19,700.20	0.06
397	603605	珀莱雅	100	19,671.00	0.06
398	002131	利欧股份	8,400	19,656.00	0.05
399	600909	华安证券	3,520	19,606.40	0.05
400	000975	银泰黄金	2,060	19,590.60	0.05

401	300474	景嘉微	200	19,584.00	0.05
402	600879	航天电子	2,600	19,552.00	0.05
403	300296	利亚德	2,500	19,550.00	0.05
404	002152	广电运通	1,500	19,545.00	0.05
405	601615	明阳智能	1,200	19,428.00	0.05
406	002572	索菲亚	800	19,360.00	0.05
407	002926	华西证券	2,000	19,260.00	0.05
408	300271	华宇软件	1,000	19,250.00	0.05
409	600316	洪都航空	500	19,240.00	0.05
410	300357	我武生物	300	19,236.00	0.05
411	600380	健康元	1,400	19,222.00	0.05
412	300244	迪安诊断	500	19,150.00	0.05
413	600642	申能股份	3,100	19,034.00	0.05
414	601872	招商轮船	4,080	18,849.60	0.05
415	601866	中远海发	5,000	18,750.00	0.05
416	000623	吉林敖东	1,200	18,588.00	0.05
417	601198	东兴证券	1,700	18,581.00	0.05
418	688321	微芯生物	400	18,476.00	0.05
419	601995	中金公司	300	18,450.00	0.05
420	600998	九州通	1,200	18,444.00	0.05
421	000012	南 玻 A	1,800	18,432.00	0.05
422	601319	中国人保	3,100	18,383.00	0.05
423	600895	张江高科	1,000	18,270.00	0.05
424	600271	航天信息	1,400	18,242.00	0.05
425	002065	东华软件	2,300	18,239.00	0.05
426	688009	中国通号	3,200	18,208.00	0.05
427	002673	西部证券	2,200	18,150.00	0.05
428	002500	山西证券	2,700	18,117.00	0.05
429	600415	小商品城	3,500	18,025.00	0.05
430	600153	建发股份	2,200	17,820.00	0.05
431	300115	长盈精密	860	17,716.00	0.05
432	601699	潞安环能	1,500	17,715.00	0.05
433	603338	浙江鼎力	300	17,607.00	0.05
434	688208	道通科技	200	17,398.00	0.05
435	002739	万达电影	1,100	17,369.00	0.05
436	600667	太极实业	1,900	17,290.00	0.05
437	601881	中国银河	1,600	17,248.00	0.05
438	002557	洽洽食品	400	17,240.00	0.05
439	603156	养元饮品	600	17,148.00	0.05
440	300024	机器人	1,600	17,072.00	0.05
441	600256	广汇能源	5,100	16,983.00	0.05
442	600707	彩虹股份	1,800	16,938.00	0.05
443	600188	XD 兖州煤	1,100	16,896.00	0.05
444	600390	五矿资本	2,800	16,744.00	0.05

445	002690	美亚光电	300	16,728.00	0.05
446	603707	健友股份	400	16,700.00	0.05
447	002382	蓝帆医疗	800	16,680.00	0.05
448	000878	云南铜业	1,300	16,679.00	0.05
449	002683	宏大爆破	600	16,662.00	0.05
450	600008	首创环保	5,510	16,585.10	0.05
451	002372	伟星新材	800	16,536.00	0.05
452	600511	国药股份	500	16,530.00	0.05
453	000027	深圳能源	1,800	16,506.00	0.05
454	002294	信立泰	500	16,450.00	0.05
455	002221	东华能源	1,500	16,425.00	0.05
456	300418	昆仑万维	1,000	16,380.00	0.05
457	600497	驰宏锌锗	3,800	16,378.00	0.05
458	600535	天士力	1,100	16,291.00	0.05
459	300251	光线传媒	1,500	16,215.00	0.05
460	600409	三友化工	1,600	16,176.00	0.05
461	600208	新湖中宝	5,300	16,112.00	0.05
462	000401	冀东水泥	1,300	16,055.00	0.04
463	600155	华创阳安	1,500	16,050.00	0.04
464	600233	圆通速递	1,600	16,016.00	0.04
465	002670	国盛金控	1,400	15,946.00	0.04
466	600765	中航重机	700	15,855.00	0.04
467	600801	华新水泥	900	15,813.00	0.04
468	000718	苏宁环球	1,900	15,751.00	0.04
469	603858	步长制药	700	15,743.00	0.04
470	300630	普利制药	300	15,720.00	0.04
470	002390	信邦制药	1,500	15,720.00	0.04
472	603866	桃李面包	500	15,600.00	0.04
473	002019	亿帆医药	900	15,525.00	0.04
474	002174	游族网络	900	15,453.00	0.04
475	002966	苏州银行	2,100	15,435.00	0.04
476	603260	合盛硅业	200	15,382.00	0.04
477	600875	东方电气	1,400	15,358.00	0.04
478	603233	大参林	300	15,333.00	0.04
479	002506	协鑫集成	4,400	15,312.00	0.04
480	002146	荣盛发展	2,700	15,228.00	0.04
481	600060	海信视像	900	15,210.00	0.04
482	600170	上海建工	5,500	15,180.00	0.04
483	300058	蓝色光标	2,500	15,125.00	0.04
484	601717	郑煤机	1,300	15,119.00	0.04
485	600141	兴发集团	800	15,064.00	0.04
486	600160	巨化股份	1,700	15,028.00	0.04
487	002958	青农商行	3,500	14,980.00	0.04
488	000997	新大陆	900	14,931.00	0.04

489	600498	烽火通信	800	14,904.00	0.04
489	002408	齐翔腾达	1,200	14,904.00	0.04
491	600372	中航电子	900	14,895.00	0.04
492	300315	掌趣科技	3,500	14,875.00	0.04
493	002831	裕同科技	500	14,845.00	0.04
494	600325	华发股份	2,200	14,828.00	0.04
495	600663	陆家嘴	1,100	14,652.00	0.04
496	300017	网宿科技	2,500	14,625.00	0.04
497	002195	二三四五	7,200	14,616.00	0.04
498	000738	航发控制	700	14,581.00	0.04
499	000540	中天金融	5,300	14,469.00	0.04
500	000060	中金岭南	3,200	14,464.00	0.04
501	603712	七一二	400	14,440.00	0.04
501	600859	王府井	500	14,440.00	0.04
503	000686	东北证券	1,700	14,365.00	0.04
504	600258	首旅酒店	600	14,316.00	0.04
505	601016	节能风电	3,800	14,212.00	0.04
506	603225	新凤鸣	700	14,210.00	0.04
507	600567	山鹰国际	4,100	14,145.00	0.04
508	600027	XD 华电国	4,100	14,104.00	0.04
509	600737	中粮糖业	1,400	14,014.00	0.04
510	601992	金隅集团	5,200	13,988.00	0.04
511	600482	中国动力	800	13,936.00	0.04
512	600732	爱旭股份	1,000	13,920.00	0.04
513	002191	劲嘉股份	1,300	13,832.00	0.04
514	000158	常山北明	1,200	13,788.00	0.04
515	600528	中铁工业	1,700	13,770.00	0.04
516	603883	老百姓	260	13,696.80	0.04
517	600839	四川长虹	4,700	13,677.00	0.04
518	002268	卫士通	700	13,636.00	0.04
519	000961	中南建设	2,300	13,616.00	0.04
520	603077	和邦生物	6,500	13,520.00	0.04
520	000671	阳光城	2,600	13,520.00	0.04
522	002081	金螳螂	1,700	13,464.00	0.04
522	600598	北大荒	900	13,464.00	0.04
524	601231	环旭电子	800	13,448.00	0.04
525	601577	长沙银行	1,500	13,410.00	0.04
526	000999	华润三九	500	13,375.00	0.04
527	600500	中化国际	1,700	13,362.00	0.04
528	002939	长城证券	1,200	13,356.00	0.04
529	002429	兆驰股份	2,200	13,354.00	0.04
530	002595	豪迈科技	500	13,350.00	0.04
531	600728	XD 佳都科	1,800	13,338.00	0.04
532	600025	华能水电	2,300	13,317.00	0.04

533	600580	卧龙电驱	1,000	13,300.00	0.04
534	603198	迎驾贡酒	300	13,290.00	0.04
535	002925	盈趣科技	340	13,229.40	0.04
536	002124	天邦股份	1,880	13,178.80	0.04
537	600282	南钢股份	3,700	13,172.00	0.04
538	002153	石基信息	560	13,165.60	0.04
539	002010	传化智联	1,700	13,107.00	0.04
540	600340	华夏幸福	2,500	13,100.00	0.04
541	000729	燕京啤酒	1,800	13,032.00	0.04
542	002056	横店东磁	1,000	13,000.00	0.04
543	002242	九阳股份	400	12,996.00	0.04
544	000800	一汽解放	1,200	12,984.00	0.04
545	603927	中科软	300	12,885.00	0.04
546	002396	星网锐捷	600	12,810.00	0.04
547	600216	浙江医药	800	12,808.00	0.04
548	000709	河钢股份	5,200	12,792.00	0.04
549	002203	海亮股份	1,200	12,768.00	0.04
550	002032	苏泊尔	200	12,758.00	0.04
551	600820	隧道股份	2,400	12,696.00	0.04
552	000930	中粮科技	1,400	12,614.00	0.04
553	002387	维信诺	1,200	12,516.00	0.04
554	000581	威孚高科	600	12,498.00	0.03
555	300182	捷成股份	2,500	12,475.00	0.03
556	002004	华邦健康	2,000	12,420.00	0.03
557	300212	易华录	460	12,378.60	0.03
558	300166	东方国信	1,000	12,360.00	0.03
559	002281	光迅科技	500	12,300.00	0.03
560	000488	晨鸣纸业	1,500	12,210.00	0.03
561	603885	吉祥航空	800	12,208.00	0.03
562	601236	红塔证券	900	12,204.00	0.03
563	000629	攀钢钒钛	5,300	12,137.00	0.03
564	002745	木林森	900	12,060.00	0.03
565	603000	XD 人民网	700	12,033.00	0.03
566	000898	鞍钢股份	2,700	12,015.00	0.03
567	600808	马钢股份	2,800	12,012.00	0.03
568	002563	森马服饰	1,000	11,950.00	0.03
569	600970	中材国际	1,300	11,921.00	0.03
570	002867	周大生	600	11,862.00	0.03
571	002048	宁波华翔	600	11,700.00	0.03
572	300002	神州泰岳	2,400	11,640.00	0.03
573	600398	海澜之家	1,600	11,584.00	0.03
574	605358	立昂微	100	11,558.00	0.03
575	600803	新奥股份	700	11,557.00	0.03
576	600260	凯乐科技	1,300	11,544.00	0.03

577	600037	歌华有线	1,200	11,532.00	0.03
578	600597	光明乳业	800	11,528.00	0.03
579	601106	中国一重	3,400	11,526.00	0.03
580	600022	山东钢铁	6,700	11,524.00	0.03
581	600755	厦门国贸	1,400	11,494.00	0.03
582	000883	湖北能源	2,500	11,475.00	0.03
582	600645	中源协和	500	11,475.00	0.03
584	000598	兴蓉环境	2,200	11,462.00	0.03
585	603568	伟明环保	500	11,415.00	0.03
586	600881	亚泰集团	4,000	11,400.00	0.03
587	002002	鸿达兴业	2,900	11,397.00	0.03
588	601880	辽港股份	6,600	11,286.00	0.03
588	600039	四川路桥	1,800	11,286.00	0.03
590	600811	东方集团	3,700	11,285.00	0.03
591	000690	宝新能源	2,200	11,242.00	0.03
592	600329	中新药业	400	11,236.00	0.03
593	600782	新钢股份	2,000	11,160.00	0.03
593	000778	新兴铸管	3,000	11,160.00	0.03
595	688088	虹软科技	200	11,150.00	0.03
596	600967	内蒙一机	1,100	11,132.00	0.03
597	600348	华阳股份	1,500	11,130.00	0.03
598	600026	中远海能	1,800	11,088.00	0.03
599	600908	无锡银行	1,900	11,020.00	0.03
600	600985	淮北矿业	900	10,989.00	0.03
601	002183	怡亚通	1,900	10,887.00	0.03
602	000887	中鼎股份	900	10,872.00	0.03
603	600410	华胜天成	1,400	10,864.00	0.03
604	600918	中泰证券	1,000	10,820.00	0.03
605	002701	奥瑞金	2,100	10,794.00	0.03
606	601456	国联证券	700	10,780.00	0.03
607	600126	杭钢股份	2,100	10,773.00	0.03
608	600718	东软集团	1,100	10,758.00	0.03
609	600167	联美控股	1,200	10,716.00	0.03
610	601118	海南橡胶	2,100	10,689.00	0.03
611	000528	柳 工	1,300	10,660.00	0.03
612	603087	甘李药业	100	10,658.00	0.03
613	002085	万丰奥威	1,900	10,640.00	0.03
614	000970	中科三环	1,100	10,505.00	0.03
615	002249	大洋电机	2,000	10,500.00	0.03
615	002705	新宝股份	400	10,500.00	0.03
617	000877	天山股份	800	10,424.00	0.03
618	002128	露天煤业	1,000	10,410.00	0.03
619	603392	万泰生物	40	10,367.20	0.03
620	601179	中国西电	2,500	10,300.00	0.03

621	600064	南京高科	1,100	10,219.00	0.03
622	600572	康恩贝	2,300	10,212.00	0.03
623	000990	诚志股份	800	10,184.00	0.03
624	300741	华宝股份	200	10,144.00	0.03
625	000400	许继电气	800	10,128.00	0.03
626	000402	金融街	1,500	10,125.00	0.03
627	002110	三钢闽光	1,500	10,110.00	0.03
628	600446	金证股份	700	10,108.00	0.03
629	000089	深圳机场	1,300	10,101.00	0.03
630	601598	中国外运	2,000	10,100.00	0.03
631	601808	中海油服	700	10,052.00	0.03
632	002368	太极股份	500	10,030.00	0.03
633	002266	浙富控股	2,000	9,980.00	0.03
634	300072	三聚环保	1,700	9,758.00	0.03
635	601698	中国卫通	600	9,714.00	0.03
636	000519	中兵红箭	900	9,648.00	0.03
636	300376	易事特	1,200	9,648.00	0.03
638	603650	彤程新材	200	9,620.00	0.03
639	601200	上海环境	800	9,576.00	0.03
640	600195	中牧股份	800	9,568.00	0.03
641	600517	国网英大	1,400	9,534.00	0.03
642	601975	招商南油	4,400	9,416.00	0.03
643	300026	红日药业	2,200	9,350.00	0.03
644	601718	际华集团	3,300	9,306.00	0.03
645	002773	康弘药业	400	9,252.00	0.03
645	002233	塔牌集团	900	9,252.00	0.03
647	600120	浙江东方	2,140	9,159.20	0.03
648	601000	唐山港	3,800	9,158.00	0.03
649	600158	中体产业	800	9,128.00	0.03
650	000959	首钢股份	1,600	8,992.00	0.03
651	000685	中山公用	1,100	8,976.00	0.03
652	600376	首开股份	1,600	8,960.00	0.03
652	002505	鹏都农牧	4,000	8,960.00	0.03
654	003035	南网能源	900	8,946.00	0.03
655	601333	广深铁路	4,200	8,904.00	0.02
656	300133	华策影视	1,500	8,880.00	0.02
657	600373	中文传媒	900	8,874.00	0.02
658	002440	闰土股份	1,000	8,850.00	0.02
659	000090	天健集团	1,600	8,848.00	0.02
660	600307	酒钢宏兴	3,800	8,816.00	0.02
661	600507	方大特钢	1,300	8,814.00	0.02
662	600435	北方导航	1,100	8,734.00	0.02
663	600804	鹏博士	1,800	8,712.00	0.02
664	002839	张家港行	1,600	8,704.00	0.02

665	001914	招商积余	500	8,590.00	0.02
666	600673	东阳光	1,900	8,531.00	0.02
667	002155	湖南黄金	1,100	8,525.00	0.02
668	600388	龙净环保	1,000	8,520.00	0.02
669	600056	中国医药	700	8,505.00	0.02
670	000559	万向钱潮	1,600	8,496.00	0.02
671	600764	中国海防	300	8,490.00	0.02
672	002038	双鹭药业	800	8,424.00	0.02
673	600643	爱建集团	1,200	8,376.00	0.02
674	601860	紫金银行	2,300	8,349.00	0.02
675	600062	华润双鹤	700	8,337.00	0.02
676	000967	盈峰环境	1,200	8,244.00	0.02
677	600729	重庆百货	300	8,235.00	0.02
678	601608	中信重工	2,200	8,228.00	0.02
679	600095	湘财股份	700	8,197.00	0.02
680	600582	XD 天地科	2,100	8,190.00	0.02
681	000758	中色股份	1,700	8,075.00	0.02
682	002936	郑州银行	2,200	8,074.00	0.02
683	600266	城建发展	1,700	8,058.00	0.02
684	000563	陕国投 A	2,500	8,050.00	0.02
685	002416	爱施德	800	8,024.00	0.02
686	002399	海普瑞	500	7,965.00	0.02
687	600131	国网信通	600	7,944.00	0.02
688	601098	中南传媒	900	7,938.00	0.02
689	601991	大唐发电	3,000	7,920.00	0.02
689	300180	华峰超纤	1,600	7,920.00	0.02
691	603228	景旺电子	300	7,860.00	0.02
692	600901	江苏租赁	1,500	7,800.00	0.02
693	601958	金钼股份	1,200	7,776.00	0.02
694	300113	顺网科技	600	7,764.00	0.02
695	000681	视觉中国	600	7,758.00	0.02
696	000415	渤海租赁	3,200	7,744.00	0.02
697	600959	江苏有线	2,500	7,625.00	0.02
698	600649	城投控股	1,600	7,616.00	0.02
699	000028	国药一致	200	7,568.00	0.02
700	603786	科博达	100	7,550.00	0.02
701	600094	大名城	2,000	7,540.00	0.02
702	600928	西安银行	1,600	7,456.00	0.02
703	600776	东方通信	600	7,440.00	0.02
704	000869	张裕 A	200	7,428.00	0.02
705	600556	天下秀	700	7,392.00	0.02
706	600648	外高桥	500	7,390.00	0.02
707	600006	东风汽车	1,000	7,300.00	0.02
708	002434	万里扬	900	7,299.00	0.02

709	002901	大博医疗	100	7,289.00	0.02
710	601611	中国核建	1,000	7,220.00	0.02
711	300257	开山股份	500	7,185.00	0.02
712	600546	XD 山煤国	1,000	7,180.00	0.02
712	600633	浙数文化	1,000	7,180.00	0.02
714	603317	天味食品	240	7,063.20	0.02
715	600717	天津港	1,800	7,056.00	0.02
716	000501	鄂武商 A	600	7,020.00	0.02
717	002458	益生股份	700	6,979.00	0.02
718	600021	上海电力	1,000	6,910.00	0.02
719	002317	众生药业	800	6,888.00	0.02
720	000717	韶钢松山	1,500	6,885.00	0.02
721	000078	海王生物	2,100	6,846.00	0.02
722	002985	北摩高科	70	6,825.00	0.02
723	000062	深圳华强	400	6,764.00	0.02
724	600259	广晟有色	200	6,762.00	0.02
725	600863	内蒙华电	2,900	6,757.00	0.02
726	002244	滨江集团	1,600	6,704.00	0.02
727	002424	贵州百灵	900	6,624.00	0.02
728	600835	上海机电	400	6,500.00	0.02
729	600968	海油发展	2,500	6,475.00	0.02
730	601928	凤凰传媒	900	6,426.00	0.02
731	603888	新华网	300	6,351.00	0.02
732	002375	亚厦股份	800	6,336.00	0.02
733	603355	莱克电气	100	6,223.00	0.02
734	600623	华谊集团	700	6,167.00	0.02
735	003022	联泓新科	200	6,140.00	0.02
736	002468	申通快递	800	6,096.00	0.02
737	601828	美凯龙	500	6,000.00	0.02
738	600299	安迪苏	500	5,980.00	0.02
739	600339	XD 中油工	2,100	5,964.00	0.02
740	000826	启迪环境	1,100	5,885.00	0.02
741	600787	中储股份	1,100	5,863.00	0.02
742	600377	宁沪高速	600	5,856.00	0.02
743	002635	安洁科技	400	5,852.00	0.02
744	600312	平高电气	1,000	5,840.00	0.02
745	601969	海南矿业	500	5,815.00	0.02
746	000031	大悦城	1,600	5,760.00	0.02
747	600823	世茂股份	1,400	5,656.00	0.02
748	600466	蓝光发展	1,900	5,605.00	0.02
749	601298	青岛港	900	5,562.00	0.02
750	002583	海能达	1,100	5,544.00	0.02
751	600639	浦东金桥	400	5,460.00	0.02
751	601778	晶科科技	1,000	5,460.00	0.02

753	000156	华数传媒	700	5,397.00	0.02
754	600566	济川药业	300	5,370.00	0.02
755	603708	家家悦	300	5,211.00	0.01
755	603983	丸美股份	100	5,211.00	0.01
757	603515	欧普照明	200	5,134.00	0.01
758	603377	东方时尚	480	5,131.20	0.01
759	000937	冀中能源	1,300	5,109.00	0.01
760	300010	豆神教育	900	5,103.00	0.01
761	601228	广州港	1,600	5,088.00	0.01
762	001872	招商港口	300	5,076.00	0.01
763	002532	天山铝业	600	5,034.00	0.01
764	000813	德展健康	1,100	4,994.00	0.01
765	002815	崇达技术	400	4,992.00	0.01
766	002948	青岛银行	1,000	4,970.00	0.01
767	600350	山东高速	800	4,920.00	0.01
768	600640	号百控股	400	4,876.00	0.01
769	601869	长飞光纤	200	4,872.00	0.01
770	002302	西部建设	600	4,740.00	0.01
771	600871	石化油服	2,400	4,728.00	0.01
772	000553	安道麦 A	500	4,635.00	0.01
773	000046	泛海控股	2,000	4,600.00	0.01
774	601139	深圳燃气	700	4,592.00	0.01
775	603719	良品铺子	100	4,500.00	0.01
776	000061	农产品	800	4,416.00	0.01
777	603056	德邦股份	400	4,396.00	0.01
778	002653	海思科	200	4,304.00	0.01
779	601568	北元集团	500	4,280.00	0.01
780	603868	飞科电器	100	4,206.00	0.01
781	002945	华林证券	300	4,146.00	0.01
782	601512	中新集团	400	3,984.00	0.01
783	002419	天虹股份	600	3,936.00	0.01
784	600657	信达地产	1,100	3,828.00	0.01
785	601187	厦门银行	400	3,792.00	0.01
786	601801	皖新传媒	800	3,776.00	0.01
787	603379	三美股份	200	3,742.00	0.01
788	000537	广宇发展	700	3,661.00	0.01
789	601003	柳钢股份	600	3,540.00	0.01
790	600917	重庆燃气	400	3,268.00	0.01
791	002946	新乳业	200	3,030.00	0.01
792	600903	贵州燃气	300	2,760.00	0.01
793	000732	泰禾集团	1,200	2,592.00	0.01
794	002818	富森美	200	2,412.00	0.01
795	600956	新天绿能	200	2,342.00	0.01
796	603256	宏和科技	200	1,828.00	0.01

797	002423	中粮资本	200	1,810.00	0.01
798	601068	中铝国际	400	1,380.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	1,568,622.00	2.33
2	000858	五粮液	382,854.00	0.57
3	000333	美的集团	355,091.00	0.53
4	002415	海康威视	288,525.00	0.43
5	000651	格力电器	234,813.00	0.35
6	603501	韦尔股份	231,180.00	0.34
7	000725	京东方 A	197,404.00	0.29
8	300122	智飞生物	196,336.00	0.29
9	300347	泰格医药	194,772.00	0.29
10	002714	牧原股份	188,373.00	0.28
11	002304	洋河股份	185,786.00	0.28
12	300059	东方财富	185,625.00	0.28
13	000001	平安银行	179,663.00	0.27
14	000002	万科 A	178,211.00	0.26
15	000568	泸州老窖	171,000.00	0.25
16	002475	立讯精密	166,171.00	0.25
17	002812	恩捷股份	158,666.00	0.24
18	002594	比亚迪	155,645.00	0.23
19	002049	紫光国微	149,132.00	0.22
20	000538	云南白药	136,514.00	0.20

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	1,286,097.00	1.91
2	000333	美的集团	942,502.04	1.40
3	000651	格力电器	625,810.00	0.93
4	300059	东方财富	554,949.00	0.82

5	002415	海康威视	525,341.00	0.78
6	000001	平安银行	479,523.00	0.71
7	000568	泸州老窖	442,377.00	0.66
8	000002	万 科 A	440,568.00	0.65
9	002714	牧原股份	438,698.00	0.65
10	002594	比亚迪	425,728.00	0.63
11	002475	立讯精密	420,038.00	0.62
12	000725	京东方 A	369,177.00	0.55
13	002304	洋河股份	362,720.00	0.54
14	002352	顺丰控股	348,758.00	0.52
15	300122	智飞生物	325,218.00	0.48
16	300347	泰格医药	305,258.00	0.45
17	600809	山西汾酒	302,871.00	0.45
18	300015	爱尔眼科	264,017.00	0.39
19	000100	TCL 科技	261,745.00	0.39
20	002027	分众传媒	260,274.00	0.39

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	16,294,730.43
卖出股票的收入（成交）总额	31,613,370.01

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,000.00	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	140	14,000.00	0.04

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**

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,751.17
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	196.78
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	102,564.19

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
588	55,879.93	10,771,000.00	32.7810%	22,086,400.00	67.2190%

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	中银基金管理有限公司	4,895,200.00	14.90%
2	海南家美太阳能有限公司	3,000,000.00	9.13%
3	广发证券股份有限公司	2,335,700.00	7.11%
4	陈潜	1,500,000.00	4.57%
5	金祖森	1,002,300.00	3.05%

6	叶星华	552,000.00	1.68%
7	华泰证券股份有限公司	540,100.00	1.64%
8	吕志坤	349,800.00	1.06%
9	鄧耀輝	310,000.00	0.94%
10	庞建新	300,000.00	0.91%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本开放式基金。

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的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年7月16日）基金份额总额	377,857,400.00
本报告期期初基金份额总额	62,857,400.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
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	-
本报告期期末基金份额总额	32,857,400.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
华创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	28,233,227.95	58.94%	25,729.60	58.64%	-
东方证券	2	19,671,118.89	41.06%	18,150.12	41.36%	-

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	107,954.59	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
2	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-04
3	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-17
4	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-03-24
5	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021-03-29
6	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021-03-29
7	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 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》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-29
8	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2021-03-29
9	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
10	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-04-08
11	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
12	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
13	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-29

14	中银基金管理有限公司关于新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-21
15	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-28
16	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-06-19

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。

11.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日