

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	6
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.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	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.....	33
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.....	33
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43

8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）
基金简称	中银沪深 300 等权重指数（LOF）
场内简称	中银 300E
基金主代码	163821
交易代码	163821
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 17 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,752,234.11 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 7 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数相似的回报。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不得超过 4%。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组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及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值收益率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不得超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 等权重指数收益率 $\times 95\%$ + 同期银行活期存款利率 $\times 5\%$
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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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		中银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市银城中路200号中银大	深圳市深南大道7088号招商银

	厦10层、11层、26层、45层	行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	章砚	缪建民

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	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	5,332,640.96
本期利润	1,430,767.51
加权平均基金份额本期利润	0.0457
本期加权平均净值利润率	2.19%
本期基金份额净值增长率	1.87%
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	32,310,938.36
期末可供分配基金份额利润	1.1238
期末基金资产净值	61,063,172.47
期末基金份额净值	2.124
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	112.40%

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

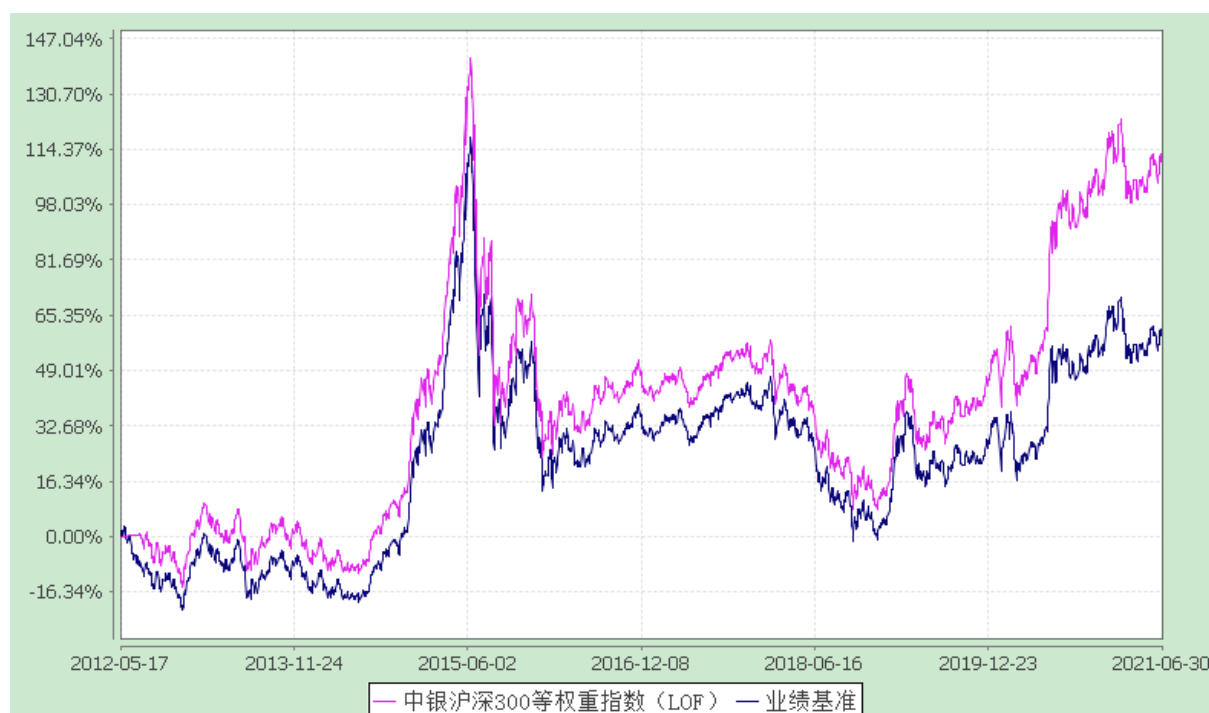
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.00%	0.71%	-0.65%	0.71%	0.65%	0.00%
过去三个月	4.84%	0.76%	3.93%	0.78%	0.91%	-0.02%
过去六个月	1.87%	1.02%	0.75%	1.06%	1.12%	-0.04%
过去一年	30.31%	1.16%	20.78%	1.20%	9.53%	-0.04%
过去三年	65.29%	1.28%	35.30%	1.31%	29.99%	-0.03%
自基金合同生效日起	112.40%	1.42%	60.60%	1.43%	51.80%	-0.01%

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

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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

（2012 年 5 月 17 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：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	2015-06-08	-	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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 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 1.87%, 同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

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。

本基金将严格按照契约规定, 采用完全复制投资策略, 被动跟踪指数, 保持跟踪误差在较小范围内。作为基金管理者, 我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧, 为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人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，本基金每年最多进行收益分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本报告期末可供分配利润为 32,310,938.36 元，未进行利润分配。

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

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并

根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)

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	760,496.80	274,018.44
结算备付金		21,883.45	-
存出保证金		4,324.62	26,978.90
交易性金融资产	6.4.7.2	60,458,662.91	70,520,071.14
其中：股票投资		57,026,019.81	66,480,229.44
基金投资		-	-
债券投资		3,432,643.10	4,039,841.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,208.99	395,786.71
应收利息	6.4.7.5	90,199.28	58,456.13
应收股利		-	-
应收申购款		23,303.51	19,890.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		61,381,079.56	71,295,202.10
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		-	-
应付赎回款		64,985.85	124,942.17
应付管理人报酬		38,718.37	44,366.89
应付托管费		7,743.64	8,873.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,913.81	24,994.50
应交税费		-	0.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	184,545.42	200,470.87
负债合计		317,907.09	403,648.01
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	28,752,234.11	34,002,811.00
未分配利润	6.4.7.10	32,310,938.36	36,888,743.09
所有者权益合计		61,063,172.47	70,891,554.09
负债和所有者权益总计		61,381,079.56	71,295,202.10

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.124，基金份额总额 28,752,234.11 份。

6.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,962,404.16	9,802,553.96
1.利息收入		63,677.11	136,837.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,634.89	6,840.43
债券利息收入		61,042.22	129,997.04
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）		5,767,979.39	17,299,856.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,368,229.86	16,318,541.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,313.39	19,538.33
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	395,436.14	961,776.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,901,873.45	-7,741,182.22
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	32,621.11	107,041.85
减：二、费用		531,636.65	1,005,252.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2	243,903.28	501,461.50
2. 托管费	6.4.10.2	48,780.57	100,292.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	53,338.72	196,443.66
5. 利息支出		-	142.03
其中：卖出回购金融资产支出		-	142.03
6.税金及附加		0.02	0.09
7. 其他费用	6.4.7.19	185,614.06	206,912.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,430,767.51	8,797,301.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,430,767.51	8,797,301.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)

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）	34,002,811.00	36,888,743.09	70,891,554.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,430,767.51	1,430,767.51
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）	-5,250,576.89	-6,008,572.24	-11,259,149.13
其中：1.基金申购款	8,649,386.32	9,520,542.67	18,169,928.99
2.基金赎回款	-13,899,963.21	-15,529,114.91	-29,429,078.12
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）	28,752,234.11	32,310,938.36	61,063,172.47

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)	105,191,452.66	52,523,653.21	157,715,105.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	8,797,301.79	8,797,301.79
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)	-31,716,945.88	-15,029,227.91	-46,746,173.79
其中: 1.基金申购款	25,646,725.95	12,954,196.89	38,600,922.84
2.基金赎回款	-57,363,671.83	-27,983,424.80	-85,347,096.63
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)	73,474,506.78	46,291,727.09	119,766,233.87

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

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) (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[2011]1752 号《关于核准中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 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 2012 年 5 月 17 日正式生效, 首次设立募集规模为 1,490,796,733.31 份基金份额。本基金为上市契约型开放式, 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, 基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括沪深 300 等权重指数的成份股及备选成份股、新股 (一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他证券品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为: 沪深 300 等权重指数收益率 $\times 95\%$ + 同期银行活期存款利率 $\times 5\%$ 。

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（以下合称“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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 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	760,496.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	760,496.80

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	49,188,571.54	57,026,019.81	7,837,448.27
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	3,466,428.17	3,432,643.10	-33,785.07
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,466,428.17	3,432,643.10	-33,785.07
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		52,654,999.71	60,458,662.91	7,803,663.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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	127.15
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	9.80
应收债券利息	90,058.15
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	2.28
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.90
合计	90,199.28

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	21,913.81

银行间市场应付交易费用	-
合计	21,913.81

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	244.67
应付证券出借违约金	-
应付上市年费	29,752.78
应付信息披露费	39,671.58
应付审计费	14,876.39
应付指数使用费	100,000.00
合计	184,545.42

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	34,002,811.00	34,002,811.00
本期申购	8,649,386.32	8,649,386.32
本期赎回 (以“-”号填列)	-13,899,963.21	-13,899,963.21
本期末	28,752,234.11	28,752,234.11

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	60,054,505.24	-23,165,762.15	36,888,743.09
本期利润	5,332,640.96	-3,901,873.45	1,430,767.51
本期基金份额交易产生的变动数	-9,661,390.33	3,652,818.09	-6,008,572.24
其中：基金申购款	15,789,267.04	-6,268,724.37	9,520,542.67
基金赎回款	-25,450,657.37	9,921,542.46	-15,529,114.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,725,755.87	-23,414,817.51	32,310,938.36

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	2,339.57
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	146.25
其他	149.07
合计	2,634.89

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,492,220.62
减：卖出股票成本总额	16,123,990.76
买卖股票差价收入	5,368,229.86

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	1,009,595.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	996,441.76
减：应收利息总额	8,839.94
买卖债券差价收入	4,313.39

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	395,436.14
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	395,436.14

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	-3,901,873.45
——股票投资	-3,896,851.61
——债券投资	-5,021.84
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,901,873.45

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	32,621.11
合计	32,621.11

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	53,338.72
银行间市场交易费用	-
合计	53,338.72

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	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-

银行汇划费	1,313.31
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	185,614.06

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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	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	243,903.28	501,461.50
其中：支付销售机构的客户维护费	88,389.51	74,626.82

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	48,780.57	100,292.33

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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		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	2020年1月1日至2020年6月30日	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
招商银行股份有限公司	760,496.80	2,339.57	1,555,995.55	5,876.00

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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**

本基金本报告期内及上年度可比期间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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	配债未上市	100.00	100.00	460	46,000.00	46,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	26	2,600.00	2,600.00	-

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	22,300	220,410.28	124,657.00	-

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**

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

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 0.08%(2020 年 12 月 31 日: 0.10%)。

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 按短期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	119,844.00
合计	-	119,844.00

注: 未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

6.4.13.2.2 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	46,000.00	68,000.00
AAA 以下	2,600.00	3,000.00
未评级	3,384,043.10	3,848,997.70
合计	3,432,643.10	3,919,997.70

注: 未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

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公司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 6.4.12 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同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、存出保证金及部分应收申购款等。

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	760,496.80	-	-	-	760,496.80
结算备付金	21,883.45	-	-	-	21,883.45
存出保证金	4,324.62	-	-	-	4,324.62
交易性金融资产	3,384,043.10	-	48,600.00	57,026,019.81	60,458,662.91

应收证券清算款	-	-	-	22,208.99	22,208.99
应收利息	-	-	-	90,199.28	90,199.28
应收申购款	129.99	-	-	23,173.52	23,303.51
资产总计	4,170,877.96	-	48,600.00	57,161,601.60	61,381,079.56
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	64,985.85	64,985.85
应付管理人报酬	-	-	-	38,718.37	38,718.37
应付托管费	-	-	-	7,743.64	7,743.64
应付交易费用	-	-	-	21,913.81	21,913.81
其他负债	-	-	-	184,545.42	184,545.42
负债总计	-	-	-	317,907.09	317,907.09
利率敏感度缺口	4,170,877.96	-	48,600.00	56,843,694.51	61,063,172.47
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	274,018.44	-	-	-	274,018.44
存出保证金	26,978.90	-	-	-	26,978.90
交易性金融资产	3,968,841.70	-	71,000.00	66,480,229.44	70,520,071.14
应收证券清算款	-	-	-	395,786.71	395,786.71
应收利息	-	-	-	58,456.13	58,456.13
应收申购款	299.97	-	-	19,590.81	19,890.78
资产总计	4,270,139.01	-	71,000.00	66,954,063.09	71,295,202.10
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	124,942.17	124,942.17
应付管理人报酬	-	-	-	44,366.89	44,366.89
应付托管费	-	-	-	8,873.38	8,873.38
应付交易费用	-	-	-	24,994.50	24,994.50
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
其他负债	-	-	-	200,470.87	200,470.87
负债总计	-	-	-	403,648.01	403,648.01
利率敏感度缺口	4,270,139.01	-	71,000.00	66,550,415.08	70,891,554.09

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交易的股票和债券，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。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组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及其权重的变动进行相应调整。

本基金力求基金净值收益率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于沪深 300 等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为 5%-10%，其中权证的投资比例不超过基金净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过特定指标测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	57,026,019.81	93.39	66,480,229.44	93.78
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	57,026,019.81	93.39	66,480,229.44	93.78

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 294	增加约 347
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 294	减少约 347

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	57,026,019.81	92.90
	其中: 股票	57,026,019.81	92.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,432,643.10	5.59
	其中: 债券	3,432,643.10	5.59
	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	782,380.25	1.27
8	其他各项资产	140,036.40	0.23
9	合计	61,381,079.56	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	370,993.16	0.61
B	采矿业	1,599,940.78	2.62
C	制造业	30,819,264.42	50.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,327,654.72	2.17
E	建筑业	1,090,718.03	1.79
F	批发和零售业	1,167,683.77	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	2,422,518.80	3.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,843,933.48	4.66
J	金融业	11,061,343.03	18.11
K	房地产业	1,793,291.35	2.94
L	租赁和商务服务业	365,688.24	0.60
M	科学研究和技术服务业	363,969.76	0.60
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	139,963.00	0.23
Q	卫生和社会工作	981,129.62	1.61
R	文化、体育和娱乐业	559,203.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	56,907,295.16	93.19

7.2.2 积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,558.42	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,900.10	0.07
E	建筑业	11,014.44	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,001.60	0.02
J	金融业	34,238.43	0.06
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	9,011.66	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	118,724.65	0.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

截至本报告期末本基金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	601919	中远海控	8,800	268,752.00	0.44
2	300274	阳光电源	2,300	264,638.00	0.43
3	688396	华润微	2,900	263,958.00	0.43
4	603806	福斯特	2,500	262,825.00	0.43
5	002812	恩捷股份	1,100	257,510.00	0.42
6	300124	汇川技术	3,448	256,048.48	0.42
7	688169	石头科技	200	252,200.00	0.41
8	002129	中环股份	6,500	250,900.00	0.41
9	688363	华熙生物	900	250,074.00	0.41
10	002371	北方华创	900	249,642.00	0.41
11	601012	隆基股份	2,769	245,997.96	0.40
12	601009	南京银行	23,177	243,822.04	0.40
13	601696	中银证券	11,700	240,903.00	0.39
14	000001	平安银行	10,631	240,473.22	0.39
15	002594	比亚迪	954	239,454.00	0.39
16	603986	兆易创新	1,272	239,008.80	0.39
17	300677	英科医疗	1,900	237,120.00	0.39
18	601166	兴业银行	11,525	236,838.75	0.39
19	600919	江苏银行	33,170	235,507.00	0.39
20	603799	华友钴业	2,050	234,110.00	0.38
21	688012	中微公司	1,400	232,288.00	0.38
22	603659	璞泰来	1,700	232,220.00	0.38
23	002142	宁波银行	5,933	231,209.01	0.38
24	688036	传音控股	1,100	230,450.00	0.38
25	603501	韦尔股份	700	225,400.00	0.37

26	600438	通威股份	5,200	225,004.00	0.37
27	600436	片仔癀	500	224,150.00	0.37
28	603882	金域医学	1,400	223,678.00	0.37
29	600703	三安光电	6,920	221,786.00	0.36
30	300015	爱尔眼科	3,083	218,831.34	0.36
31	300628	亿联网络	2,600	217,880.00	0.36
32	600132	重庆啤酒	1,100	217,745.00	0.36
33	000625	长安汽车	8,280	217,598.40	0.36
34	601633	长城汽车	4,972	216,729.48	0.35
35	002414	高德红外	7,840	216,227.20	0.35
36	002049	紫光国微	1,400	215,866.00	0.35
37	002938	鹏鼎控股	6,000	215,280.00	0.35
38	601100	恒立液压	2,504	215,143.68	0.35
39	600332	白云山	6,349	214,913.65	0.35
40	600196	复星医药	2,979	214,875.27	0.35
41	002230	科大讯飞	3,172	214,363.76	0.35
42	600745	闻泰科技	2,200	213,180.00	0.35
43	002475	立讯精密	4,630	212,980.00	0.35
44	002624	完美世界	8,900	212,799.00	0.35
45	600893	航发动力	4,000	212,760.00	0.35
46	601990	南京证券	20,200	212,504.00	0.35
47	002241	歌尔股份	4,972	212,503.28	0.35
48	002945	华林证券	15,300	211,446.00	0.35
49	601857	中国石油	39,950	211,335.50	0.35
50	600760	中航沈飞	3,500	211,050.00	0.35
51	002384	东山精密	10,100	210,484.00	0.34
52	600900	长江电力	10,188	210,280.32	0.34
53	601328	交通银行	42,804	209,739.60	0.34
54	002600	领益智造	22,700	208,613.00	0.34
55	603392	万泰生物	800	207,344.00	0.34
56	600085	同仁堂	5,056	206,537.60	0.34
57	600763	通策医疗	500	205,500.00	0.34
58	002415	海康威视	3,184	205,368.00	0.34
59	600845	宝信软件	4,030	205,127.00	0.34
60	300413	芒果超媒	2,990	205,114.00	0.34
61	002493	荣盛石化	11,850	204,649.50	0.34
62	300450	先导智能	3,400	204,476.00	0.33
63	002311	海大集团	2,500	204,000.00	0.33
64	600926	杭州银行	13,820	203,845.00	0.33
65	601877	正泰电器	6,100	203,618.00	0.33
66	300408	三环集团	4,800	203,616.00	0.33
67	600079	人福医药	7,200	203,544.00	0.33
68	601799	星宇股份	900	203,148.00	0.33
69	601995	中金公司	3,300	202,950.00	0.33

70	002050	三花智控	8,462	202,918.76	0.33
71	600115	中国东航	39,900	202,692.00	0.33
72	603517	绝味食品	2,400	202,296.00	0.33
73	002916	深南电路	1,820	202,256.60	0.33
74	600482	中国动力	11,600	202,072.00	0.33
75	603195	公牛集团	1,000	202,000.00	0.33
76	600000	XD 浦发银	20,166	201,660.00	0.33
77	600025	华能水电	34,800	201,492.00	0.33
78	002939	长城证券	18,100	201,453.00	0.33
79	688126	沪硅产业	6,900	201,342.00	0.33
80	601238	广汽集团	15,540	201,243.00	0.33
81	600741	华域汽车	7,650	200,965.50	0.33
82	601398	工商银行	38,850	200,854.50	0.33
83	300136	信维通信	6,500	200,720.00	0.33
84	600660	福耀玻璃	3,581	199,998.85	0.33
85	688008	澜起科技	3,200	199,616.00	0.33
86	002236	大华股份	9,420	198,762.00	0.33
87	300059	东方财富	6,045	198,215.55	0.32
88	000063	中兴通讯	5,960	198,050.80	0.32
89	603259	药明康德	1,264	197,929.76	0.32
90	002410	广联达	2,900	197,780.00	0.32
91	600848	上海临港	11,040	197,616.00	0.32
92	002179	中航光电	2,500	197,550.00	0.32
93	300014	亿纬锂能	1,900	197,467.00	0.32
94	688111	金山办公	500	197,400.00	0.32
95	300595	欧普康视	1,900	196,745.00	0.32
96	600600	青岛啤酒	1,700	196,605.00	0.32
97	601360	三六零	16,100	196,581.00	0.32
98	601998	中信银行	38,500	196,350.00	0.32
99	000656	金科股份	33,900	196,281.00	0.32
100	600521	华海药业	9,400	196,272.00	0.32
101	601169	北京银行	40,267	196,100.29	0.32
102	600584	长电科技	5,200	195,936.00	0.32
103	300433	蓝思科技	6,650	195,576.50	0.32
104	002508	老板电器	4,200	195,300.00	0.32
105	002202	金风科技	16,042	195,070.72	0.32
106	600029	南方航空	32,400	195,048.00	0.32
107	000725	京东方 A	31,200	194,688.00	0.32
108	603160	汇顶科技	1,500	194,445.00	0.32
109	601006	大秦铁路	29,550	194,439.00	0.32
110	000963	华东医药	4,221	194,208.21	0.32
111	600143	金发科技	9,300	193,998.00	0.32
112	002008	大族激光	4,800	193,872.00	0.32
113	601600	中国铝业	36,522	193,566.60	0.32

114	000661	长春高新	500	193,500.00	0.32
115	600015	华夏银行	31,249	193,431.31	0.32
116	601231	环旭电子	11,500	193,315.00	0.32
117	003816	中国广核	72,400	193,308.00	0.32
118	300347	泰格医药	1,000	193,300.00	0.32
119	601872	招商轮船	41,760	192,931.20	0.32
120	000800	一汽解放	17,800	192,596.00	0.32
121	601236	红塔证券	14,200	192,552.00	0.32
122	000876	新希望	13,114	192,382.38	0.32
123	600570	恒生电子	2,063	192,374.75	0.32
124	600340	华夏幸福	36,710	192,360.40	0.32
125	601669	中国电建	49,699	192,335.13	0.31
126	601878	浙商证券	14,700	192,276.00	0.31
127	300033	同花顺	1,700	191,726.00	0.31
128	300498	温氏股份	13,340	191,695.80	0.31
129	601989	中国重工	46,510	191,621.20	0.31
130	000596	古井贡酒	800	191,600.00	0.31
131	601916	浙商银行	48,200	191,354.00	0.31
132	000977	浪潮信息	6,800	191,284.00	0.31
133	600352	浙江龙盛	13,908	191,095.92	0.31
134	000538	云南白药	1,650	190,938.00	0.31
135	002271	东方雨虹	3,450	190,854.00	0.31
136	000703	恒逸石化	15,960	190,722.00	0.31
137	600019	宝钢股份	24,898	190,220.72	0.31
138	002456	欧菲光	21,405	190,076.40	0.31
139	603019	中科曙光	6,880	189,956.80	0.31
140	600018	上港集团	39,800	189,846.00	0.31
141	601390	中国中铁	36,200	189,688.00	0.31
142	600309	万华化学	1,740	189,346.80	0.31
143	601818	XD 光大银	49,950	188,811.00	0.31
144	600918	中泰证券	17,400	188,268.00	0.31
145	000338	潍柴动力	10,532	188,206.84	0.31
146	601766	中国中车	30,915	187,963.20	0.31
147	600588	用友网络	5,649	187,885.74	0.31
148	601939	建设银行	28,250	187,862.50	0.31
149	601788	光大证券	10,500	187,845.00	0.31
150	603338	浙江鼎力	3,200	187,808.00	0.31
151	688009	中国通号	33,000	187,770.00	0.31
152	601216	君正集团	36,868	187,658.12	0.31
153	600690	海尔智家	7,234	187,432.94	0.31
154	600886	国投电力	19,440	186,818.40	0.31
155	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.31
156	300003	乐普医疗	5,809	186,585.08	0.31
157	002841	视源股份	1,500	186,435.00	0.31

158	000425	徐工机械	29,260	186,386.20	0.31
159	002821	凯莱英	500	186,300.00	0.31
160	603899	晨光文具	2,200	186,032.00	0.30
161	600426	华鲁恒升	6,000	185,700.00	0.30
162	300144	宋城演艺	11,020	185,136.00	0.30
162	002558	巨人网络	13,920	185,136.00	0.30
164	600010	包钢股份	119,440	185,132.00	0.30
165	601211	国泰君安	10,800	185,112.00	0.30
166	300142	沃森生物	3,000	185,100.00	0.30
167	600183	生益科技	7,900	184,939.00	0.30
168	600989	宝丰能源	13,500	184,680.00	0.30
169	002153	石基信息	7,840	184,318.40	0.30
170	600104	上汽集团	8,378	184,064.66	0.30
171	002157	正邦科技	15,400	184,030.00	0.30
172	300558	贝达药业	1,700	184,008.00	0.30
173	603288	海天味业	1,426	183,882.70	0.30
174	601618	中国中冶	61,700	183,866.00	0.30
175	002736	国信证券	17,100	183,825.00	0.30
176	601377	兴业证券	19,020	183,733.20	0.30
177	601888	中国中免	612	183,661.20	0.30
178	601727	上海电气	43,300	183,592.00	0.30
179	001979	招商蛇口	16,747	183,379.65	0.30
180	000776	广发证券	12,112	183,375.68	0.30
181	002601	龙佰集团	5,300	183,274.00	0.30
182	000100	TCL 科技	23,950	183,217.50	0.30
183	600299	安迪苏	15,300	182,988.00	0.30
184	600028	中国石化	41,957	182,932.52	0.30
185	002773	康弘药业	7,890	182,495.70	0.30
186	601225	陕西煤业	15,400	182,490.00	0.30
187	601138	工业富联	14,700	182,427.00	0.30
188	600050	中国联通	42,200	182,304.00	0.30
189	000938	紫光股份	8,324	182,129.12	0.30
190	002027	分众传媒	19,344	182,027.04	0.30
191	600795	国电电力	74,900	182,007.00	0.30
192	002460	赣锋锂业	1,500	181,635.00	0.30
193	601901	方正证券	19,400	181,584.00	0.30
194	002120	韵达股份	13,418	181,545.54	0.30
195	600109	国金证券	14,296	181,416.24	0.30
196	000651	格力电器	3,482	181,412.20	0.30
197	601229	上海银行	22,118	181,367.60	0.30
198	300529	健帆生物	2,100	181,356.00	0.30
199	600233	圆通速递	18,100	181,181.00	0.30
200	603658	安图生物	2,390	181,090.30	0.30
201	000066	中国长城	12,400	181,040.00	0.30

202	600887	伊利股份	4,908	180,761.64	0.30
203	002252	上海莱士	24,120	180,658.80	0.30
204	600031	三一重工	6,200	180,234.00	0.30
205	600276	恒瑞医药	2,645	179,780.65	0.29
206	600176	中国巨石	11,587	179,714.37	0.29
207	603939	益丰药房	3,200	179,488.00	0.29
208	601816	京沪高铁	33,900	179,331.00	0.29
209	002714	牧原股份	2,948	179,297.36	0.29
210	600809	山西汾酒	400	179,200.00	0.29
211	601668	中国建筑	38,466	178,866.90	0.29
212	000858	五粮液	600	178,734.00	0.29
213	601088	中国神华	9,150	178,608.00	0.29
214	600406	国电南瑞	7,672	178,297.28	0.29
215	601808	中海油服	12,400	178,064.00	0.29
216	600346	恒力石化	6,780	177,907.20	0.29
217	601607	上海医药	8,400	177,492.00	0.29
218	601985	中国核电	35,050	177,353.00	0.29
219	600383	金地集团	17,300	177,152.00	0.29
220	600111	北方稀土	8,550	176,985.00	0.29
221	601186	中国铁建	23,800	176,834.00	0.29
222	600011	华能国际	41,800	176,396.00	0.29
223	603833	欧派家居	1,240	176,030.40	0.29
224	601066	中信建投	5,600	176,008.00	0.29
225	600522	中天科技	17,600	176,000.00	0.29
226	600118	中国卫星	6,012	175,911.12	0.29
227	601336	新华保险	3,823	175,513.93	0.29
228	603993	洛阳钼业	33,900	174,924.00	0.29
229	601155	新城控股	4,200	174,720.00	0.29
230	601658	邮储银行	34,800	174,696.00	0.29
231	600161	天坛生物	5,100	174,675.00	0.29
232	601319	中国人保	29,400	174,342.00	0.29
233	600489	中金黄金	20,220	174,296.40	0.29
234	600061	国投资本	20,520	174,214.80	0.29
235	600705	中航产融	45,000	174,150.00	0.29
236	000728	国元证券	21,845	174,104.65	0.29
237	601288	农业银行	57,350	173,770.50	0.28
238	601318	中国平安	2,700	173,556.00	0.28
239	601111	中国国航	22,300	173,494.00	0.28
240	000783	长江证券	23,700	173,484.00	0.28
241	600150	中国船舶	10,500	173,355.00	0.28
242	000895	双汇发展	5,449	173,278.20	0.28
243	000166	申万宏源	37,020	173,253.60	0.28
244	002673	西部证券	21,000	173,250.00	0.28
245	600048	保利地产	14,385	173,195.40	0.28

246	000708	中信特钢	8,300	172,972.00	0.28
247	002555	三七互娱	7,200	172,944.00	0.28
248	601698	中国卫通	10,681	172,925.39	0.28
249	002001	新和成	6,020	172,653.60	0.28
250	600362	江西铜业	7,700	172,326.00	0.28
251	600872	中炬高新	4,100	172,282.00	0.28
252	002032	苏泊尔	2,700	172,233.00	0.28
253	601077	渝农商行	43,100	171,969.00	0.28
254	600958	东方证券	17,200	171,828.00	0.28
255	603233	大参林	3,360	171,729.60	0.28
256	601021	春秋航空	3,000	170,700.00	0.28
257	601838	成都银行	13,500	170,640.00	0.28
258	600837	海通证券	14,837	170,625.50	0.28
259	603369	今世缘	3,137	169,899.92	0.28
260	600606	绿地控股	31,074	169,353.30	0.28
261	002352	顺丰控股	2,500	169,250.00	0.28
262	601800	中国交建	26,100	169,128.00	0.28
263	002739	万达电影	10,700	168,953.00	0.28
264	600999	招商证券	8,823	167,813.46	0.27
265	000768	中航西飞	6,371	167,429.88	0.27
266	000069	华侨城 A	22,490	167,325.60	0.27
267	600030	中信证券	6,700	167,098.00	0.27
268	600016	民生银行	37,712	166,309.92	0.27
269	300676	华大基因	1,400	166,040.00	0.27
270	601881	中国银河	15,400	166,012.00	0.27
271	601555	东吴证券	19,867	165,690.78	0.27
272	601688	华泰证券	10,450	165,110.00	0.27
273	300601	康泰生物	1,100	163,900.00	0.27
274	601899	紫金矿业	16,900	163,761.00	0.27
275	002602	世纪华通	25,498	163,697.16	0.27
276	002304	洋河股份	787	163,066.40	0.27
277	601933	XD 永辉超	34,352	162,484.96	0.27
278	000002	万科 A	6,800	161,908.00	0.27
279	601162	天风证券	33,020	160,477.20	0.26
280	603087	甘李药业	1,500	159,870.00	0.26
281	601628	中国人寿	4,700	159,283.00	0.26
282	000157	中联重科	17,150	158,466.00	0.26
283	000333	美的集团	2,211	157,799.07	0.26
284	600655	豫园股份	13,600	157,624.00	0.26
285	601108	财通证券	15,000	157,350.00	0.26
286	000786	北新建材	4,000	157,000.00	0.26
287	000568	泸州老窖	665	156,900.10	0.26
288	002463	沪电股份	10,100	156,247.00	0.26
289	002007	华兰生物	4,212	154,496.16	0.25

290	600547	山东黄金	7,988	153,529.36	0.25
291	601601	中国太保	5,260	152,382.20	0.25
292	600585	海螺水泥	3,710	152,295.50	0.25
293	600519	贵州茅台	70	143,969.00	0.24
294	002607	中公教育	6,700	139,963.00	0.23
295	002044	美年健康	15,348	139,820.28	0.23
296	000860	顺鑫农业	3,200	134,976.00	0.22
297	002024	苏宁易购	22,300	124,657.00	0.20
298	600009	上海机场	2,562	123,309.06	0.20

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	占基金资产净值比例(%)
1	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.06
2	601528	瑞丰银行	2,199	34,238.43	0.06
3	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
4	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
5	603171	税友股份	573	11,001.60	0.02
6	603836	海程邦达	413	9,011.66	0.01
7	605011	杭州热电	515	4,573.20	0.01

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	688169	石头科技	241,400.00	0.34
2	600029	南方航空	216,116.00	0.30
3	688396	华润微	211,195.00	0.30
4	688363	华熙生物	205,159.00	0.29
5	688111	金山办公	200,723.00	0.28
6	603882	金域医学	198,606.00	0.28
7	300595	欧普康视	197,729.00	0.28
8	600521	华海药业	195,986.00	0.28
9	600426	华鲁恒升	195,978.00	0.28
10	603338	浙江鼎力	195,900.00	0.28
11	603160	汇顶科技	195,833.00	0.28
12	300450	先导智能	195,670.00	0.28
13	600143	金发科技	195,535.00	0.28
14	000800	一汽解放	195,444.00	0.28
15	601995	中金公司	195,077.00	0.28

16	600079	人福医药	194,577.00	0.27
17	603939	益丰药房	194,420.00	0.27
18	300558	贝达药业	193,648.00	0.27
19	603517	绝味食品	193,504.00	0.27
20	300274	阳光电源	193,330.00	0.27

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	688027	国盾量子	346,591.49	0.49
2	601919	中远海控	309,939.00	0.44
3	688277	天智航	262,428.40	0.37
4	000723	美锦能源	256,388.00	0.36
5	688185	康希诺	252,276.70	0.36
6	601577	长沙银行	251,755.00	0.36
7	601117	中国化学	242,917.00	0.34
8	600029	南方航空	234,894.00	0.33
9	600068	葛洲坝	230,448.00	0.33
10	603156	养元饮品	225,224.00	0.32
11	300059	东方财富	223,041.00	0.31
12	600809	山西汾酒	222,720.00	0.31
13	002422	科伦药业	222,033.00	0.31
14	600177	雅戈尔	218,954.84	0.31
15	600369	西南证券	217,264.04	0.31
16	600208	新湖中宝	216,402.75	0.31
17	600519	贵州茅台	213,439.00	0.30
18	600027	华电国际	211,582.00	0.30
19	600998	九州通	209,867.00	0.30
20	600271	航天信息	208,561.00	0.29

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	10,566,632.74
卖出股票的收入（成交）总额	21,492,220.62

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	606,210.00	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,777,833.10	4.55
	其中：政策性金融债	2,777,833.10	4.55
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）	48,600.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,432,643.10	5.62

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	108802	进出 1902	27,770	2,777,833.10	4.55
2	010107	21 国债(7)	6,050	606,210.00	0.99
3	113050	南银转债	460	46,000.00	0.08
4	123117	健帆转债	26	2,600.00	0.00

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没有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	4,324.62
2	应收证券清算款	22,208.99
3	应收股利	-
4	应收利息	90,199.28
5	应收申购款	23,303.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,036.40

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

本基金本报告期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	605287	德才股份	11,014.44	0.02	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
2,342	12,276.79	21,053.78	0.0732%	28,731,180.33	99.9268%

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	杨凯	98,005.00	17.74%
2	林凤英	49,500.00	8.96%
3	钱中明	39,387.00	7.13%
4	周曲	37,575.00	6.80%
5	唐勇	29,204.00	5.29%
6	陈锋	26,800.00	4.85%
7	周凯	22,200.00	4.02%
8	叶坚广	20,000.00	3.62%
9	欧阳文	17,314.00	3.13%
10	关海燕	15,822.00	2.86%

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	82,264.46	0.2861%

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（2012 年 5 月 17 日）基金份额总额	1,490,796,733.31
本报告期期初基金份额总额	34,002,811.00
本报告期基金总申购份额	8,649,386.32
减：本报告期基金总赎回份额	13,899,963.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,752,234.11

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	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	21,263,645.36	67.68%	19,803.00	68.15%	-
方正证券	1	10,153,973.17	32.32%	9,253.34	31.85%	-

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》，然后根据评分高低进行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：报告期内退租华信证券上海交易单元。

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		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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,223,050.60	97.75%	-	-	-	-
方正证券	28,093.67	2.25%	-	-	-	-

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	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 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	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 基金合同	中国证监会规定媒介	2021-03-29
5	中银基金管理有限公司关于中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 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
6	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2021 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2021-03-29
7	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金	中国证监会规定媒介	2021-03-29

	(LOF) 基金产品资料概要更新		
8	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
9	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
10	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
11	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
12	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
13	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

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）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