

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	74
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	74
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
§ 9 基金份额持有人信息.....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	77
§ 10 开放式基金份额变动.....	77
§ 11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
11.4 基金投资策略的改变.....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	81
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 13 备查文件目录.....	83
13.1 备查文件目录.....	83
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银沪深 300ETF
场内简称	工银 300、工银沪深 300ETF
基金主代码	510350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 20 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	943,314,701.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 8 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	秦一楠
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031

法定代表人	赵桂才	谷澍
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人或基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 5 月 20 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	313,610,922.53	540,597,708.11	-43,126,075.44
本期利润	-80,328,844.56	911,128,083.91	252,409,949.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1180	1.0965	0.0842
本期加权平均净值利润率	-2.29%	25.29%	4.80%
本期基金份额净值增长率	-3.33%	28.38%	6.96%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	1,100,069,357.11	455,473,001.75	892,158.18
期末可供分配基金份额利润	1.1662	0.7067	0.0009
期末基金资产净值	4,774,685,710.78	3,374,466,540.47	3,942,568,512.77
期末基金	5.0616	5.2357	4.0783

份额净值			
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	32.75%	37.32%	6.96%

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

2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

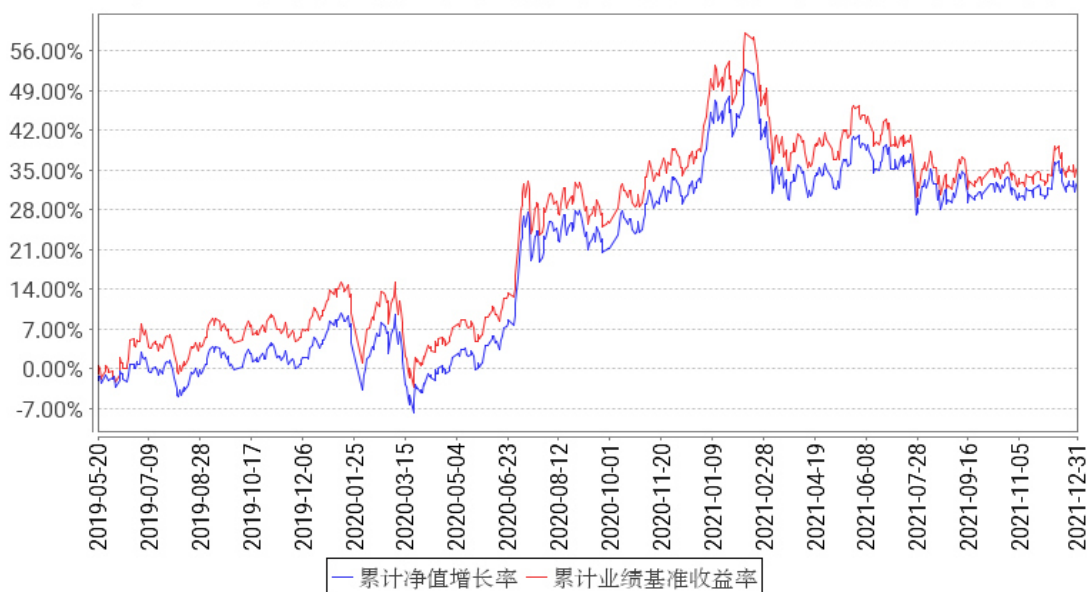
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.48%	0.78%	1.52%	0.79%	-0.04%	-0.01%
过去六个月	-4.38%	1.01%	-5.43%	1.02%	1.05%	-0.01%
过去一年	-3.33%	1.16%	-5.20%	1.17%	1.87%	-0.01%
自基金合同生效起至今	32.75%	1.20%	35.40%	1.22%	-2.65%	-0.02%

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

工银沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

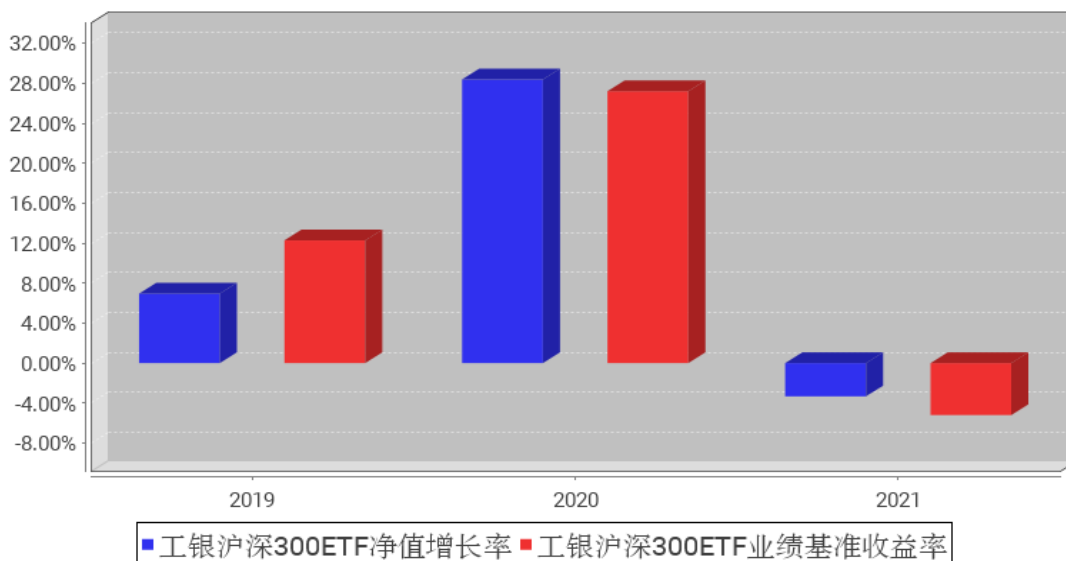


注：1、本基金基金合同于 2019 年 05 月 20 日生效。

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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	指数投资中心投资副总监，本基金的基金经理	2019年5月20日	-	11年	博士；2010年加入工银瑞信，现任指数投资中心投资副总监、基金经理。2014年10月17日至今，担任工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金(自2018年4月17日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF))基金经理；2014年10月17日至今，担任工银瑞信沪深300指数证券投资基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金(自2020年2月18日起变更为工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金)基金经理；2015年5月21日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级证券投资

				<p>基金(自 2020 年 11 月 26 日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金 (LOF)) 基金经理;2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日,担任工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理;2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日,担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金 (LOF) 基金经理;2018 年 6 月 15 日,担任工银瑞信印度市场证券投资基金(LOF)基金经理;2019 年 5 月 20 日至今,担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2019 年 8 月 21 日至今,担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理;2019 年 10 月 17 日至今,担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2019 年 11 月 1 日至今,担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2019 年 12 月 25 日至今,担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理;2020 年 6 月 1 日至今,担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 21 日至今,担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 22 日至今,担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 6 月 11 日至今,担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 7 月 22 日至今,担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理;2021 年 8 月 5 日至今,担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 11 月 26 日至今,担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注: 1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期;离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类投资组合的公平对待做了明确具体的规定，办法涵盖了公平交易的原则、适用范围、部门职责、具体程序和违规问责等。

在研究和投资决策环节，研究人员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等建立投资备选池，投资人员在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合，并确保公平对待其管理的不同投资组合。

在交易执行环节，交易人员根据公司内部权限管理规定获得权限，并遵循价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施等执行原则，保证交易在不同投资组合间的利益公平。

同时本基金管理人在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于满足条件的指令，系统自动通过公平交易模块执行。

在监控和检查环节，风险管理人员对交易价格公允性等进行监控和分析，监察稽核人员定期对公平交易执行情况进行稽核。发现异常情况的，要求投资人员进行解释说明并核查其真实性、合理性。

本基金管理人通过上述措施全面落实公平交易要求，并持续地完善公平交易制度，确保公平对待各类投资人，保护投资人的利益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过

检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 10 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-3.33%，业绩比较基准收益率为-5.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2021 年，A 股市场经历了较大的市场波动，市场风格也出现了一定的分化，后续波动和分化仍然会影响 2022 年的市场行情。展望 2022 年，经济增长压力仍在，但经济有望表现出一定的韧性，“稳增长”和“宽信用”的政策有望得到延续，货币政策上流动性得到边际改善的可能性仍在，对于 A 股市场也可能产生更为积极的促进作用。从板块来看，一方面基本面业绩增速相对有优势的行业或主题，未来仍可能保持较好的景气度，良好的成长性有望得到市场的持续关注，另一方面，前期部分板块已经得到一定的估值回调，未来存在估值修复的可能，其配置的性价比得到了一定的提升，但仍需注意包括美联储加息及缩表等海外因素对于 A 股市场的影响，市场的分化和风格的切换大概率仍会延续。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是严格的事前监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面

覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内。五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员和销售人员的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

监察稽核方面，一是定期对基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 20723 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“工银沪深 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了工银沪深 300ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于工银沪深 300ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>工银沪深 300ETF 基金的基金管理人工银瑞信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估工银沪深 300ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算工银沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督工银沪深 300ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导

任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对工银沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银沪深 300ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张勇 魏佳亮
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	23,971,054.87	29,652,508.96
结算备付金		5,889,905.69	2,066,510.63
存出保证金		422,778.52	461,325.40
交易性金融资产	7.4.7.2	4,751,937,165.03	3,345,342,922.99
其中: 股票投资		4,745,143,165.03	3,345,342,922.99
基金投资		-	-
债券投资		6,794,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,518,457.25	8,006,009.11
应收利息	7.4.7.5	108,473.03	15,967.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,783,847,834.39	3,385,545,244.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		674,491.16	1,165,324.77
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,891,719.10	1,184,469.22
应付托管费		420,381.99	263,215.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,394,297.37	746,795.44
应交税费		20,929.63	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	4,760,304.36	7,718,898.97
负债合计		9,162,123.61	11,078,703.78
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,596,780,889.20	2,457,481,216.91
未分配利润	7.4.7.10	1,177,904,821.58	916,985,323.56

所有者权益合计		4,774,685,710.78	3,374,466,540.47
负债和所有者权益总计		4,783,847,834.39	3,385,545,244.25

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

2、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 5.0616 元，基金份额总额为 943,314,701.00 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-55,599,844.00	937,224,587.21
1. 利息收入		3,531,380.21	699,038.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	711,210.28	699,038.95
债券利息收入		148.91	-
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		2,820,021.02	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		331,424,319.71	562,510,411.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	274,584,114.07	488,120,521.50
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	56,840,205.64	74,389,889.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-393,939,767.09	370,530,375.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,384,223.17	3,484,761.06
减：二、费用		24,729,000.56	26,096,503.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,733,855.46	16,213,596.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,496,412.36	3,603,021.32

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,105,858.88	4,798,044.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		10,153.06	-
7. 其他费用	7.4.7.20	1,382,720.80	1,481,841.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-80,328,844.56	911,128,083.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-80,328,844.56	911,128,083.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,457,481,216.91	916,985,323.56	3,374,466,540.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-80,328,844.56	-80,328,844.56
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）	1,139,299,672.29	341,248,342.58	1,480,548,014.87
其中：1. 基金申购款	2,230,556,587.38	738,340,144.89	2,968,896,732.27
2. 基金赎回款	-1,091,256,915.09	-397,091,802.31	-1,488,348,717.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,596,780,889.20	1,177,904,821.58	4,774,685,710.78

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,686,003,152.39	256,565,360.38	3,942,568,512.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	911,128,083.91	911,128,083.91
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)	-1,228,521,935.48	-250,708,120.73	-1,479,230,056.21
其中：1. 基金申购款	2,350,663,480.19	289,714,376.33	2,640,377,856.52
2. 基金赎回款	-3,579,185,415.67	-540,422,497.06	-4,119,607,912.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,457,481,216.91	916,985,323.56	3,374,466,540.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵桂才

郝炜

关亚君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2139 号《关于准予工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,863,688,383.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合

伙) 普华永道中天验字(2019)第 0299 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 6,863,688,383.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交

易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项, 根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分, 将本金部分冲减资产支持证券投资成本, 并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时，可进行收益分配。基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	23,971,054.87	29,652,508.96
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	23,971,054.87	29,652,508.96

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,473,016,531.09	4,745,143,165.03	272,126,633.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,794,000.00	6,794,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,794,000.00	6,794,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,479,810,531.09	4,751,937,165.03	272,126,633.94
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,679,276,521.96	3,345,342,922.99	666,066,401.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,679,276,521.96	3,345,342,922.99	666,066,401.03

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	11,869.96	14,715.69
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	2,915.55	1,023.11
应收债券利息	148.91	-
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	93,329.28	-
其他	209.33	228.36
合计	108,473.03	15,967.16

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,394,297.37	746,795.44
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,394,297.37	746,795.44

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	90,000.00	110,000.00
指数使用费	305,193.01	261,128.92
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
IOPV 服务费	100,000.00	-
应退替代款	4,145,111.35	7,204,512.03
可退替代款	-	23,258.02
合计	4,760,304.36	7,718,898.97

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	644,514,701.00	2,457,481,216.91
本期申购	585,000,000.00	2,230,556,587.38
本期赎回 (以“-”号填列)	-286,200,000.00	-1,091,256,915.09
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	943,314,701.00	3,596,780,889.20

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

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	455,473,001.75	461,512,321.81	916,985,323.56
本期利润	313,610,922.53	-393,939,767.09	-80,328,844.56
本期基金份额交易产生的变动数	330,985,432.83	10,262,909.75	341,248,342.58
其中：基金申购款	608,072,707.87	130,267,437.02	738,340,144.89
基金赎回款	-277,087,275.04	-120,004,527.27	-397,091,802.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,100,069,357.11	77,835,464.47	1,177,904,821.58

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	679,074.55
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	27,269.42	33,610.49
其他	4,866.31	7,444.03
合计	711,210.28	699,038.95

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	股票投资收益——买卖	175,056,369.87

股票差价收入		
股票投资收益——赎回 差价收入	99,527,744.20	172,334,884.76
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	274,584,114.07	488,120,521.50

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	1,424,637,630.39	2,080,817,600.78
减：卖出股票成本总 额	1,249,581,260.52	1,765,031,964.04
买卖股票差价收入	175,056,369.87	315,785,636.74

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
赎回基金份额对价总 额	1,488,348,717.40	4,119,607,912.73
减：现金支付赎回款总 额	601,669,604.40	1,530,982,461.73
减：赎回股票成本总额	787,151,368.80	2,416,290,566.24
赎回差价收入	99,527,744.20	172,334,884.76

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	56,840,205.64	74,389,889.90
其中：证券出借权益补偿收入	2,694,969.14	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	56,840,205.64	74,389,889.90

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-393,939,767.09	370,530,375.80
股票投资	-393,939,767.09	370,530,375.80
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	-393,939,767.09	370,530,375.80

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	3,384,223.17	3,484,761.06
合计	3,384,223.17	3,484,761.06

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,105,858.88	4,798,044.73
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,105,858.88	4,798,044.73

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
IOPV 服务费	100,000.00	100,000.00
持有人大会公证费	-	10,000.00

律师费用	-	30,000.00
指数使用费	1,048,923.67	1,080,906.46
银行费用	23,797.13	30,934.79
合计	1,382,720.80	1,481,841.25

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,733,855.46	16,213,596.00
其中：支付销售机构的客户维护费	47,495.39	27,418.40

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

$$H = E \times 0.45\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,496,412.36	3,603,021.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	240,868,500.00	25.53	38,920,200.00	6.04

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	23,971,054.87	679,074.55	29,652,508.96	657,984.43

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2021年12月31日，本基金持有7,486,100.00股农业银行的A股普通股，估值总额为人民币22,009,134.00元，占基金资产净值的比例为0.46%；本基金持有7,470,500.00股工商银行的A股普通股，估值总额为人民币34,588,415.00元，占基金资产净值的比例为0.72%。

于2020年12月31日，本基金持有4,864,100.00股农业银行的A股普通股，估值总额为人民币15,273,274.00元，占基金资产净值的比例为0.45%；本基金持有5,943,100.00股工商银行的A股普通股，估值总额为人民币29,656,069.00元，占基金资产净值的比例为0.88%。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688032	禾迈股份	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	557.80	650.66	1,810	1,009,618.00	1,177,694.60	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
688511	天微电子	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
688787	海天瑞声	2021年8月5日	2022年2月14日	新股锁定	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-
688272	富吉瑞	2021年10月8日	2022年4月18日	新股锁定	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-

301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301101	明月镜片	2021年12月	2022年6月	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-

		月 9 日	16 日								
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-	
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股锁定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股锁定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-	
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-	
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-	
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-	
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-	
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-	
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	
301021	英诺	2021	2022	新股锁	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	

	激光	年 6 月 28 日	年 1 月 6 日	定							
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁 定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股锁 定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-	
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁 定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-	
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁 定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-	
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新股锁 定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	新股锁 定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-	
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁 定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-	
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁 定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股锁 定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-	
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁 定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁 定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-	
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	新股锁 定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-	
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	新股锁 定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	

301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021年7月	2022年2月	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

		22 日	7 日							
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	67,940	6,794,000.00	6,794,000.00	-

注：以上“可流通日”的日期，最终以发行人公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000001	平安银行	2022年1月6日-2022年1月11日	16.48	118,100	1,946,288.00
2	000002	万科A	2022年1月6日	19.76	52,400	1,035,424.00
3	000063	中兴通讯	2022年1月6日-2022年1月11日	33.50	67,600	2,264,600.00
4	000066	中国长城	2022年1月6日	14.16	23,800	337,008.00
5	000069	华侨城A	2022年1月6日	7.04	54,400	382,976.00
6	000100	TCL科技	2022年1月6日-2022年1月11日	6.17	278,100	1,715,877.00
7	000157	中联重科	2022年1月6日-2022年1月11日	7.17	68,100	488,277.00
8	000166	申万宏源	2022年1月6日-2022年1月11日	5.12	255,300	1,307,136.00
9	000333	美的集团	2022年1月6日-2022年1月14日	73.81	54,500	4,022,645.00
10	000338	潍柴动力	2022年1月6日	17.89	52,200	933,858.00
11	000425	徐工机械	2022年1月6日	5.99	56,300	337,237.00
12	000538	云南白药	2022年1月6日	104.65	10,000	1,046,500.00
13	000568	泸州老窖	2022年1月6日	253.87	10,000	2,538,700.00
14	000625	长安汽车	2022年1月6日-2022年1月11日	15.19	39,200	595,448.00
15	000651	格力电器	2022年1月6日-2022年1月11日	37.03	66,300	2,455,089.00
16	000703	恒逸石化	2022年1月6日	10.62	12,300	130,626.00
17	000708	中信特钢	2022年1月6日	20.48	20,000	409,600.00
18	000725	京东方A	2022年1月6日-2022年1月11日	5.05	346,600	1,750,330.00
19	000768	中航西飞	2022年1月6日	36.50	10,000	365,000.00
20	000776	广发证	2022年1月6日-2022年	24.59	65,800	1,618,022.00

		券	1月14日			.00
21	000783	长江证 券	2022年1月6日	7.54	87,500	659,750.0 0
22	000786	北新建 材	2022年1月6日	35.83	20,000	716,600.0 0
23	000800	一汽解 放	2022年1月6日	10.29	10,000	102,900.0 0
24	000858	五 粮 液	2022年1月6日-2022年 1月11日	222.66	27,800	6,189,948 .00
25	000876	新 希 望	2022年1月6日	15.21	25,900	393,939.0 0
26	000895	双汇发 展	2022年1月6日-2022年 1月11日	31.55	36,000	1,135,800 .00
27	000938	紫光股 份	2022年1月6日	22.85	10,000	228,500.0 0
28	000963	华东医 药	2022年1月6日	40.20	10,000	402,000.0 0
29	000977	浪潮信 息	2022年1月6日	35.83	20,000	716,600.0 0
30	001979	招商蛇 口	2022年1月6日-2022年 1月14日	13.34	41,800	557,612.0 0
31	002001	新 和 成	2022年1月6日	31.12	12,200	379,664.0 0
32	002007	华兰生 物	2022年1月6日	29.14	10,000	291,400.0 0
33	002008	大族激 光	2022年1月6日	54.00	10,000	540,000.0 0
34	002024	苏宁易 购	2022年1月6日	4.12	19,000	78,280.00
35	002027	分众传 媒	2022年1月6日-2022年 1月11日	8.19	196,300	1,607,697 .00
36	002044	美年健 康	2022年1月6日	7.85	39,000	306,150.0 0
37	002050	三花智 控	2022年1月6日	25.30	21,600	546,480.0 0
38	002120	韵达股 份	2022年1月6日	20.46	20,000	409,200.0 0
39	002129	中环股 份	2022年1月6日	41.75	23,800	993,650.0 0
40	002157	正邦科 技	2022年1月6日	9.66	10,000	96,600.00
41	002179	中航光 电	2022年1月6日	100.56	12,400	1,246,944 .00
42	002202	金风科	2022年1月6日	16.47	19,700	324,459.0

		技				0
43	002230	科大讯飞	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	52.51	38,100	2,000,631.00
44	002236	大华股份	2022 年 1 月 6 日	23.48	23,800	558,824.00
45	002241	歌尔股份	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	54.10	36,300	1,963,830.00
46	002252	上海莱士	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	6.82	90,200	615,164.00
47	002271	东方雨虹	2022 年 1 月 6 日	52.68	15,100	795,468.00
48	002304	洋河股份	2022 年 1 月 6 日	164.73	10,000	1,647,300.00
49	002311	海大集团	2022 年 1 月 6 日	73.30	10,000	733,000.00
50	002410	广联达	2022 年 1 月 6 日	63.98	10,200	652,596.00
51	002414	高德红外	2022 年 1 月 6 日	24.21	10,000	242,100.00
52	002415	海康威视	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	52.32	61,400	3,212,448.00
53	002460	赣锋锂业	2022 年 1 月 6 日	142.85	10,000	1,428,500.00
54	002475	立讯精密	2022 年 1 月 6 日	49.20	53,100	2,612,520.00
55	002493	荣盛石化	2022 年 1 月 6 日	18.16	27,600	501,216.00
56	002555	三七互娱	2022 年 1 月 6 日	27.02	20,000	540,400.00
57	002594	比亚迪	2022 年 1 月 6 日	268.12	10,000	2,681,200.00
58	002600	领益智造	2022 年 1 月 6 日	7.36	12,100	89,056.00
59	002601	龙佰集团	2022 年 1 月 6 日	28.59	10,000	285,900.00
60	002602	世纪华通	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	8.39	103,800	870,882.00
61	002607	中公教育	2022 年 1 月 6 日	7.86	20,000	157,200.00
62	002624	完美世界	2022 年 1 月 6 日	20.31	20,000	406,200.00
63	002714	牧原股份	2022 年 1 月 6 日	53.36	35,100	1,872,936.00
64	002736	国信证	2022 年 1 月 6 日-2022 年	11.48	42,100	483,308.00

		券	1 月 11 日			0
65	002812	恩捷股份	2022 年 1 月 11 日	250.40	10,000	2,504,000.00
66	300003	乐普医疗	2022 年 1 月 6 日	22.63	20,300	459,389.00
67	300014	亿纬锂能	2022 年 1 月 6 日	118.18	21,200	2,505,416.00
68	300015	爱尔眼科	2022 年 1 月 6 日	42.28	25,100	1,061,228.00
69	300033	同花顺	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	144.58	3,100	448,198.00
70	300059	东方财富	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	37.11	127,500	4,731,525.00
71	300122	智飞生物	2022 年 1 月 6 日	124.60	14,500	1,806,700.00
72	300124	汇川技术	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	68.60	42,400	2,908,640.00
73	300142	沃森生物	2022 年 1 月 6 日	56.20	29,300	1,646,660.00
74	300144	宋城演艺	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	14.32	30,800	441,056.00
75	300274	阳光电源	2022 年 1 月 6 日	145.80	18,800	2,741,040.00
76	300347	泰格医药	2022 年 1 月 6 日	127.80	4,100	523,980.00
77	300408	三环集团	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	44.60	23,300	1,039,180.00
78	300413	芒果超媒	2022 年 1 月 6 日	57.22	3,400	194,548.00
79	300433	蓝思科技	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	22.98	13,200	303,336.00
80	300450	先导智能	2022 年 1 月 6 日	74.37	18,800	1,398,156.00
81	300498	温氏股份	2022 年 1 月 6 日	19.26	49,700	957,222.00
82	300529	健帆生物	2022 年 1 月 6 日	53.30	3,400	181,220.00
83	300558	贝达药业	2022 年 1 月 6 日	79.83	5,600	447,048.00
84	300595	欧普康视	2022 年 1 月 6 日	57.37	3,500	200,795.00
85	300601	康泰生物	2022 年 1 月 6 日	98.54	1,000	98,540.00
86	300628	亿联网络	2022 年 1 月 6 日-2022 年	81.45	7,500	610,875.00

		络	1 月 14 日			0
87	300676	华大基因	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	87.80	4,700	412,660.00
88	300677	英科医疗	2022 年 1 月 6 日	57.84	1,500	86,760.00
89	300866	安克创新	2022 年 1 月 14 日	102.50	3,000	307,500.00
90	300888	稳健医疗	2022 年 1 月 14 日	82.45	1,000	82,450.00
91	300896	爱美客	2022 年 1 月 14 日	536.11	1,000	536,110.00
92	300999	金龙鱼	2022 年 1 月 14 日	62.93	9,000	566,370.00
93	600000	浦发银行	2022 年 1 月 6 日	8.53	184,000	1,569,520.00
94	600009	上海机场	2022 年 1 月 6 日	46.69	10,000	466,900.00
95	600010	包钢股份	2022 年 1 月 6 日	2.79	133,000	371,070.00
96	600011	华能国际	2022 年 1 月 6 日	9.69	22,500	218,025.00
97	600015	华夏银行	2022 年 1 月 6 日	5.60	27,500	154,000.00
98	600016	民生银行	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	3.90	548,200	2,137,980.00
99	600018	上港集团	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	5.48	38,600	211,528.00
100	600019	宝钢股份	2022 年 1 月 6 日	7.16	90,700	649,412.00
101	600028	中国石化	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	4.23	253,600	1,072,728.00
102	600029	南方航空	2022 年 1 月 6 日	6.81	48,600	330,966.00
103	600030	中信证券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	26.41	152,200	4,019,602.00
104	600031	三一重工	2022 年 1 月 6 日	22.80	54,500	1,242,600.00
105	600036	招商银行	2022 年 1 月 6 日	48.71	146,700	7,145,757.00
106	600048	保利发展	2022 年 1 月 6 日	15.63	94,200	1,472,346.00
107	600050	中国联通	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	3.93	272,800	1,072,104.00
108	600061	国投资	2022 年 1 月 6 日	8.22	12,700	104,394.00

		本				0
109	600079	人福医药	2022 年 1 月 6 日	22.52	20,000	450,400.00
110	600085	同仁堂	2022 年 1 月 6 日	44.98	10,000	449,800.00
111	600104	上汽集团	2022 年 1 月 6 日	20.63	13,600	280,568.00
112	600109	国金证券	2022 年 1 月 6 日	11.33	36,400	412,412.00
113	600111	北方稀土	2022 年 1 月 6 日	45.80	21,900	1,003,020.00
114	600115	中国东航	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	5.16	115,000	593,400.00
115	600143	金发科技	2022 年 1 月 6 日	12.58	19,500	245,310.00
116	600150	中国船舶	2022 年 1 月 6 日	24.79	20,000	495,800.00
117	600161	天坛生物	2022 年 1 月 6 日	28.96	10,000	289,600.00
118	600176	中国巨石	2022 年 1 月 6 日	18.20	18,600	338,520.00
119	600183	生益科技	2022 年 1 月 6 日	23.55	20,000	471,000.00
120	600196	复星医药	2022 年 1 月 6 日	48.94	10,000	489,400.00
121	600276	恒瑞医药	2022 年 1 月 6 日	50.71	36,600	1,855,986.00
122	600309	万华化学	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	101.00	20,000	2,020,000.00
123	600332	白云山	2022 年 1 月 6 日	34.20	10,000	342,000.00
124	600346	恒力石化	2022 年 1 月 6 日	22.97	20,700	475,479.00
125	600352	浙江龙盛	2022 年 1 月 6 日	12.63	38,800	490,044.00
126	600362	江西铜业	2022 年 1 月 6 日	22.33	10,000	223,300.00
127	600383	金地集团	2022 年 1 月 6 日	12.97	50,700	657,579.00
128	600406	国电南瑞	2022 年 1 月 6 日	40.03	27,200	1,088,816.00
129	600426	华鲁恒升	2022 年 1 月 6 日	31.30	13,500	422,550.00
130	600438	通威股	2022 年 1 月 6 日	44.96	41,800	1,879,328

		份				.00
131	600489	中金黄金	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	8.23	64,300	529,189.00
132	600519	贵州茅台	2022 年 1 月 6 日	2,050.00	10,000	20,500.00
133	600547	山东黄金	2022 年 1 月 6 日	18.82	20,000	376,400.00
134	600570	恒生电子	2022 年 1 月 6 日	62.15	10,000	621,500.00
135	600584	长电科技	2022 年 1 月 6 日	31.02	10,100	313,302.00
136	600585	海螺水泥	2022 年 1 月 6 日	40.30	23,400	943,020.00
137	600588	用友网络	2022 年 1 月 6 日	35.88	21,000	753,480.00
138	600606	绿地控股	2022 年 1 月 6 日	4.34	19,400	84,196.00
139	600655	豫园股份	2022 年 1 月 6 日	10.30	20,000	206,000.00
140	600660	福耀玻璃	2022 年 1 月 6 日	47.14	11,000	518,540.00
141	600690	海尔智家	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	29.89	49,400	1,476,566.00
142	600741	华域汽车	2022 年 1 月 6 日	28.30	20,000	566,000.00
143	600745	闻泰科技	2022 年 1 月 6 日	129.30	10,000	1,293,000.00
144	600760	中航沈飞	2022 年 1 月 6 日	68.04	10,000	680,400.00
145	600795	国电电力	2022 年 1 月 6 日	3.17	145,800	462,186.00
146	600809	山西汾酒	2022 年 1 月 6 日	315.78	10,000	3,157,800.00
147	600837	海通证券	2022 年 1 月 6 日	12.26	77,100	945,246.00
148	600845	宝信软件	2022 年 1 月 6 日	60.83	10,000	608,300.00
149	600848	上海临港	2022 年 1 月 6 日	14.87	10,000	148,700.00
150	600872	中炬高新	2022 年 1 月 6 日	37.97	10,000	379,700.00
151	600886	国投电力	2022 年 1 月 6 日	11.47	28,100	322,307.00
152	600887	伊利股	2022 年 1 月 6 日-2022 年	41.46	113,700	4,714,002

		份	1 月 11 日			.00
153	600893	航发动 力	2022 年 1 月 6 日	63.46	20,000	1,269,200 .00
154	600900	长江电 力	2022 年 1 月 14 日	22.70	81,000	1,838,700 .00
155	600918	中泰证 券	2022 年 1 月 6 日	9.97	12,000	119,640.0 0
156	600919	江苏银 行	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	5.83	230,300	1,342,649 .00
157	600926	杭州银 行	2022 年 1 月 6 日	12.82	34,000	435,880.0 0
158	600958	东方证 券	2022 年 1 月 6 日	14.74	60,900	897,666.0 0
159	600989	宝丰能 源	2022 年 1 月 6 日	17.36	11,200	194,432.0 0
160	600999	招商证 券	2022 年 1 月 6 日	17.65	35,100	619,515.0 0
161	601006	大秦铁 路	2022 年 1 月 6 日	6.40	60,200	385,280.0 0
162	601009	南京银 行	2022 年 1 月 6 日	8.96	59,100	529,536.0 0
163	601012	隆基股 份	2022 年 1 月 6 日	86.20	54,900	4,732,380 .00
164	601066	中信建 投	2022 年 1 月 6 日	29.25	10,000	292,500.0 0
165	601088	中国神 华	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	22.52	61,800	1,391,736 .00
166	601100	恒立液 压	2022 年 1 月 6 日	81.80	10,000	818,000.0 0
167	601108	财通证 券	2022 年 1 月 6 日	11.12	35,700	396,984.0 0
168	601111	中国国 航	2022 年 1 月 6 日	9.13	25,200	230,076.0 0
169	601138	工业富 联	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	11.92	77,200	920,224.0 0
170	601155	新城控 股	2022 年 1 月 6 日	29.13	10,000	291,300.0 0
171	601162	天风证 券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	4.05	94,800	383,940.0 0
172	601166	兴业银 行	2022 年 1 月 6 日	19.04	236,900	4,510,576 .00
173	601169	北京银 行	2022 年 1 月 6 日	4.44	214,700	953,268.0 0
174	601186	中国铁	2022 年 1 月 6 日	7.80	24,600	191,880.0

		建				0
175	601211	国泰君安	2022 年 1 月 6 日	17.89	51,600	923,124.00
176	601216	君正集团	2022 年 1 月 6 日	5.23	17,100	89,433.00
177	601225	陕西煤业	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	12.20	70,200	856,440.00
178	601229	上海银行	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	7.13	182,600	1,301,938.00
179	601231	环旭电子	2022 年 1 月 6 日	16.06	10,000	160,600.00
180	601236	红塔证券	2022 年 1 月 6 日	11.92	10,000	119,200.00
181	601288	农业银行	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	2.94	725,100	2,131,794.00
182	601318	中国平安	2022 年 1 月 6 日	50.41	134,900	6,800,309.00
183	601319	中国人保	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	4.70	64,500	303,150.00
184	601328	交通银行	2022 年 1 月 6 日	4.61	280,300	1,292,183.00
185	601336	新华保险	2022 年 1 月 6 日	38.88	10,000	388,800.00
186	601360	三六零	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	12.72	26,000	330,720.00
187	601377	兴业证券	2022 年 1 月 6 日	9.88	51,400	507,832.00
188	601390	中国中铁	2022 年 1 月 6 日	5.79	100,000	579,000.00
189	601398	工商银行	2022 年 1 月 6 日	4.63	223,800	1,036,194.00
190	601600	中国铝业	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	6.09	108,800	662,592.00
191	601601	中国太保	2022 年 1 月 6 日	27.12	20,100	545,112.00
192	601607	上海医药	2022 年 1 月 6 日	19.87	10,000	198,700.00
193	601618	中国中冶	2022 年 1 月 6 日	3.83	34,100	130,603.00
194	601628	中国人寿	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	30.09	30,000	902,700.00
195	601633	长城汽车	2022 年 1 月 6 日	48.54	10,000	485,400.00
196	601658	邮储银	2022 年 1 月 6 日-2022 年	5.10	101,200	516,120.00

		行	1 月 11 日			0
197	601668	中国建筑	2022 年 1 月 6 日	5.00	114,800	574,000.00
198	601669	中国电建	2022 年 1 月 6 日	8.08	43,000	347,440.00
199	601688	华泰证券	2022 年 1 月 6 日	17.76	67,600	1,200,576.00
200	601696	中银证券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	13.45	21,000	282,450.00
201	601766	中国中车	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	6.09	164,600	1,002,414.00
202	601788	光大证券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	14.93	44,000	656,920.00
203	601800	中国交建	2022 年 1 月 6 日	8.58	27,800	238,524.00
204	601808	中海油服	2022 年 1 月 6 日	15.00	10,000	150,000.00
205	601816	京沪高铁	2022 年 1 月 6 日	4.83	159,400	769,902.00
206	601818	光大银行	2022 年 1 月 6 日	3.32	374,400	1,243,008.00
207	601838	成都银行	2022 年 1 月 6 日	12.00	27,300	327,600.00
208	601857	中国石油	2022 年 1 月 6 日	4.91	18,300	89,853.00
209	601877	正泰电器	2022 年 1 月 6 日	53.89	20,000	1,077,800.00
210	601878	浙商证券	2022 年 1 月 6 日	13.18	20,000	263,600.00
211	601881	中国银河	2022 年 1 月 6 日	11.19	20,000	223,800.00
212	601888	中国中免	2022 年 1 月 6 日	219.41	20,000	4,388,200.00
213	601899	紫金矿业	2022 年 1 月 6 日	9.70	180,600	1,751,820.00
214	601901	方正证券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 11 日	7.84	84,500	662,480.00
215	601919	中远海控	2022 年 1 月 6 日	18.69	52,200	975,618.00
216	601933	永辉超市	2022 年 1 月 6 日	4.05	26,800	108,540.00
217	601939	建设银行	2022 年 1 月 6 日	5.86	44,200	259,012.00
218	601985	中国核	2022 年 1 月 6 日-2022 年	8.30	63,900	530,370.00

		电	1月11日			0
219	601988	中国银行	2022年1月6日	3.05	126,400	385,520.00
220	601989	中国重工	2022年1月6日-2022年1月11日	4.22	76,900	324,518.00
221	601990	南京证券	2022年1月6日	9.91	42,100	417,211.00
222	601998	中信银行	2022年1月6日	4.62	29,400	135,828.00
223	603019	中科曙光	2022年1月6日	27.57	22,200	612,054.00
224	603259	药明康德	2022年1月6日	118.58	33,500	3,972,430.00
225	603288	海天味业	2022年1月6日-2022年1月11日	105.11	20,000	2,102,200.00
226	603369	今世缘	2022年1月6日	54.40	10,000	544,000.00
227	603501	韦尔股份	2022年1月6日	310.77	10,000	3,107,700.00
228	603799	华友钴业	2022年1月6日-2022年1月11日	110.31	22,000	2,426,820.00
229	603986	兆易创新	2022年1月6日	175.85	10,000	1,758,500.00
230	603993	洛阳钼业	2022年1月6日	5.58	37,800	210,924.00
231	688008	澜起科技	2022年1月6日	83.87	2,300	192,901.00
232	688009	中国通号	2022年1月6日-2022年1月14日	4.98	59,300	295,314.00
233	688012	中微公司	2022年1月11日	126.60	1,000	126,600.00
234	688036	传音控股	2022年1月6日-2022年1月14日	156.90	3,000	470,700.00
235	688111	金山办公	2022年1月6日	265.00	1,000	265,000.00
236	688126	沪硅产业	2022年1月6日-2022年1月14日	25.82	8,400	216,888.00
237	688363	华熙生物	2022年1月6日-2022年1月14日	155.30	2,000	310,600.00
238	688396	华润微	2022年1月6日	64.60	5,900	381,140.00
239	688981	中芯国际	2022年1月14日	52.99	4,000	211,960.00
合计	-	-	-	-	12,749,900	252,569,200

						14.00
--	--	--	--	--	--	-------

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、信用风险管理团队、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时，对于每一战略环节、业务环节，公司都制定了系统化的风险管理程序，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由三大防线共同筑成的风险管理体系。其中：

(1) 各业务部门是风险管理的第一道防线，将管控好风险作为开展业务的前提和保障，落实各项风险管理措施，承担风险管理的第一责任。第一道防线按照法律法规的规定，制定本业务条线的制度和流程，对经营和业务流程中的风险主动识别、评估和控制，收集和报告风险点，针对薄弱环节及时进行完善。通过对业务和产品相关制度、流程、系统的自我评估、自我检查、自我完善、自我培训，履行业务经营过程中的自我风险控制职能。

(2) 风险管理部、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查等，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

同时，公司董事会确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对

重大事件、重大决策的风险评估意见和风险管理报告进行审议，审批重大风险的解决方案；公司管理层根据董事会的风险管理战略，制定并确保公司风险管理制度得以全面、有效执行，在董事会授权范围内批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案，组织各业务部门开展风险管控工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人通过信用评级团队和中央交易室建立了内部评级体系和交易对手库，对债券发行主体及债券进行内部评级并跟踪进行评级调整，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	6,794,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	6,794,000.00	-

注：上述评级均取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	23,971,054.87	-	-	-	-	-	23,971,054.87
结算备付金	5,889,905.69	-	-	-	-	-	5,889,905.69
存出保证金	422,778.52	-	-	-	-	-	422,778.52
交易性金融资产	-	-	-	-	6,794,000.00	4,745,143,165.03	4,751,937,165.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,518,457.25	1,518,457.25
应收利息	-	-	-	-	-	108,473.03	108,473.03
资产总计	30,283,739.08	-	-	-	6,794,000.00	4,746,770,095.31	4,783,847,834.39
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	674,491.16	674,491.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,891,719.10	1,891,719.10
应付托管费	-	-	-	-	-	420,381.99	420,381.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,394,297.37	1,394,297.37
应付税费	-	-	-	-	-	20,929.63	20,929.63
其他负债	-	-	-	-	-	4,760,304.36	4,760,304.36
负债总计	-	-	-	-	-	9,162,123.61	9,162,123.61
利率敏感度缺口	30,283,739.08	-	-	-	6,794,000.00	4,737,607,971.70	4,774,685,710.78
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	29,652,508.96	-	-	-	-	-	29,652,508.96

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

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	利率增加 25 基准点	-96,969.13	-
	利率减少 25 基准点	98,626.36	-

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	4,745,143,165.03	99.38	3,345,342,922.99	99.14
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	6,794,000.00	0.14	—	—
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	4,751,937,165.03	99.52	3,345,342,922.99	99.14

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	

	动	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	236,197,617.82	166,979,667.18
	业绩比较基准减少 5%	-236,197,617.82	-166,979,667.18

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,742,428,937.89 元，属于第二层次的余额为 7,174,229.35 元，属于第三层次的余额为 2,333,997.79 元（2020 年 12 月 31 日：第一层次 3,345,318,067.45 元，第二层次 24,855.54 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当年年初为确认各层次之间的转换时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产—股票投资。于 2021 年 1 月 1 日，本基金未持

有第三层次资产。2021 年度购买第三层次资产金额为 1,676,321.19 元，计入当期损益的利得或损失金额为 657,676.60 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为 2,333,997.79 元。2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额为 657,676.60 元。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,745,143,165.03	99.19
	其中：股票	4,745,143,165.03	99.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,794,000.00	0.14

	其中：债券	6,794,000.00	0.14
	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	29,860,960.56	0.62
8	其他各项资产	2,049,708.80	0.04
9	合计	4,783,847,834.39	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 252,569,214.00 元，占期末资产净值比例为 5.29%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	51,411,502.48	1.08
B	采矿业	104,361,779.75	2.19
C	制造业	2,795,781,687.15	58.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,939,787.69	2.39
E	建筑业	80,062,168.26	1.68
F	批发和零售业	29,512,080.82	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	125,632,991.30	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	155,279,081.86	3.25
J	金融业	997,667,339.64	20.89
K	房地产业	82,598,771.96	1.73
L	租赁和商务服务业	63,870,479.84	1.34
M	科学研究和技术服务业	78,690,413.16	1.65
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	3,079,406.52	0.06

Q	卫生和社会工作	45,473,687.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	13,899,018.28	0.29
S	综合	-	-
	合计	4,741,260,195.71	99.30

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,609,875.77	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	141,783.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	776,410.72	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	298,532.02	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,992.19	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	16,891.92	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,882,969.32	0.08

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

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	134,160	275,028,000.00	5.76
2	300750	宁德时代	298,100	175,282,800.00	3.67
3	600036	招商银行	2,638,941	128,542,816.11	2.69
4	601318	中国平安	2,309,588	116,426,331.08	2.44
5	000858	五粮液	413,728	92,120,676.48	1.93
6	601012	隆基股份	922,961	79,559,238.20	1.67
7	000333	美的集团	1,041,883	76,901,384.23	1.61
8	300059	东方财富	1,761,786	65,379,878.46	1.37
9	601166	兴业银行	3,099,550	59,015,432.00	1.24
10	600900	长江电力	2,423,813	55,020,555.10	1.15
11	002415	海康威视	994,985	52,057,615.20	1.09
12	603259	药明康德	437,202	51,843,413.16	1.09
13	002594	比亚迪	193,081	51,768,877.72	1.08
14	002475	立讯精密	1,051,966	51,756,727.20	1.08
15	600276	恒瑞医药	954,066	48,380,686.86	1.01
16	600030	中信证券	1,816,014	47,960,929.74	1.00
17	601888	中国中免	210,724	46,234,952.84	0.97
18	600887	伊利股份	1,091,118	45,237,752.28	0.95
19	000568	泸州老窖	155,753	39,541,014.11	0.83
20	300760	迈瑞医疗	103,700	39,488,960.00	0.83
21	000651	格力电器	1,008,797	37,355,752.91	0.78
22	603501	韦尔股份	112,100	34,837,317.00	0.73
23	601398	工商银行	7,470,500	34,588,415.00	0.72
24	000001	平安银行	2,067,200	34,067,456.00	0.71
25	600309	万华化学	335,021	33,837,121.00	0.71
26	600809	山西汾酒	103,898	32,808,910.44	0.69
27	002142	宁波银行	845,594	32,369,338.32	0.68
28	300274	阳光电源	221,700	32,323,860.00	0.68
29	000725	京东方 A	6,397,600	32,307,880.00	0.68
30	601899	紫金矿业	3,101,177	30,081,416.90	0.63
31	002714	牧原股份	560,807	29,924,661.52	0.63
32	600031	三一重工	1,266,872	28,884,681.60	0.60
33	603288	海天味业	274,680	28,871,614.80	0.60
34	002352	顺丰控股	418,493	28,842,537.56	0.60
35	000002	万科 A	1,451,601	28,683,635.76	0.60
36	002812	恩捷股份	114,200	28,595,680.00	0.60
37	300014	亿纬锂能	241,615	28,554,060.70	0.60

38	600436	片仔癀	64,000	27,977,600.00	0.59
39	002241	歌尔股份	509,500	27,563,950.00	0.58
40	601328	交通银行	5,854,100	26,987,401.00	0.57
41	300124	汇川技术	391,382	26,848,805.20	0.56
42	600438	通威股份	575,293	25,865,173.28	0.54
43	601919	中远海控	1,375,590	25,709,777.10	0.54
44	600837	海通证券	2,059,591	25,250,585.66	0.53
45	002460	赣锋锂业	171,200	24,455,920.00	0.51
46	300015	爱尔眼科	575,575	24,335,311.00	0.51
47	600690	海尔智家	806,597	24,109,184.33	0.50
48	600048	保利发展	1,530,600	23,923,278.00	0.50
49	600406	国电南瑞	590,867	23,652,406.01	0.50
50	002466	天齐锂业	220,400	23,582,800.00	0.49
51	603799	华友钴业	208,044	22,949,333.64	0.48
52	601668	中国建筑	4,565,300	22,826,500.00	0.48
53	000063	中兴通讯	677,549	22,697,891.50	0.48
54	601288	农业银行	7,486,100	22,009,134.00	0.46
55	688981	中芯国际	412,900	21,879,571.00	0.46
56	600000	浦发银行	2,500,667	21,330,689.51	0.45
57	600111	北方稀土	465,000	21,297,000.00	0.45
58	002304	洋河股份	128,595	21,183,454.35	0.44
59	300122	智飞生物	170,000	21,182,000.00	0.44
60	600016	民生银行	5,296,000	20,654,400.00	0.43
61	601816	京沪高铁	4,274,800	20,647,284.00	0.43
62	600585	海螺水泥	511,501	20,613,490.30	0.43
63	002230	科大讯飞	391,929	20,580,191.79	0.43
64	600745	闻泰科技	159,000	20,558,700.00	0.43
65	600104	上汽集团	996,045	20,548,408.35	0.43
66	002049	紫光国微	90,500	20,362,500.00	0.43
67	603986	兆易创新	114,652	20,161,554.20	0.42
68	002129	中环股份	481,700	20,110,975.00	0.42
69	002271	东方雨虹	376,660	19,842,448.80	0.42
70	601688	华泰证券	1,115,098	19,804,140.48	0.41
71	601601	中国太保	728,744	19,763,537.28	0.41
72	002371	北方华创	55,531	19,270,367.62	0.40
73	300142	沃森生物	334,150	18,779,230.00	0.39
74	000661	长春高新	68,754	18,659,835.60	0.39
75	000100	TCL 科技	2,988,100	18,436,577.00	0.39
76	300498	温氏股份	946,896	18,237,216.96	0.38
77	000338	潍柴动力	1,010,993	18,086,664.77	0.38
78	600893	航发动力	283,580	17,995,986.80	0.38
79	002027	分众传媒	2,153,300	17,635,527.00	0.37

80	300450	先导智能	233,600	17,372,832.00	0.36
81	601211	国泰君安	962,315	17,215,815.35	0.36
82	300782	卓胜微	50,200	16,405,360.00	0.34
83	601766	中国中车	2,643,756	16,100,474.04	0.34
84	601088	中国神华	702,400	15,818,048.00	0.33
85	600050	中国联通	3,957,800	15,554,154.00	0.33
86	000776	广发证券	631,600	15,531,044.00	0.33
87	600570	恒生电子	249,782	15,523,951.30	0.33
88	601229	上海银行	2,117,763	15,099,650.19	0.32
89	600919	江苏银行	2,517,531	14,677,205.73	0.31
90	300347	泰格医药	112,100	14,326,380.00	0.30
91	600660	福耀玻璃	299,194	14,104,005.16	0.30
92	601169	北京银行	3,154,000	14,003,760.00	0.29
93	002709	天赐材料	122,100	13,998,765.00	0.29
94	600999	招商证券	790,210	13,947,206.50	0.29
95	601988	中国银行	4,572,000	13,944,600.00	0.29
96	688599	天合光能	175,775	13,868,647.50	0.29
97	002821	凯莱英	31,600	13,746,000.00	0.29
98	600905	三峡能源	1,823,600	13,695,236.00	0.29
99	600019	宝钢股份	1,900,761	13,609,448.76	0.29
100	600010	包钢股份	4,857,600	13,552,704.00	0.28
101	601669	中国电建	1,665,262	13,455,316.96	0.28
102	600958	东方证券	888,800	13,100,912.00	0.27
103	002311	海大集团	177,000	12,974,100.00	0.27
104	601633	长城汽车	267,004	12,960,374.16	0.27
105	002410	广联达	202,468	12,953,902.64	0.27
106	002459	晶澳科技	136,600	12,662,820.00	0.27
107	600196	复星医药	257,492	12,601,658.48	0.26
108	601390	中国中铁	2,169,800	12,563,142.00	0.26
109	600588	用友网络	348,461	12,502,780.68	0.26
110	601877	正泰电器	231,015	12,449,398.35	0.26
111	601985	中国核电	1,495,800	12,415,140.00	0.26
112	000625	长安汽车	811,400	12,325,166.00	0.26
113	000166	申万宏源	2,401,000	12,293,120.00	0.26
114	601658	邮储银行	2,376,100	12,118,110.00	0.25
115	600028	中国石化	2,854,100	12,072,843.00	0.25
116	601818	光大银行	3,594,800	11,934,736.00	0.25
117	603659	璞泰来	73,800	11,853,018.00	0.25
118	002179	中航光电	117,180	11,783,620.80	0.25
119	002493	荣盛石化	646,955	11,748,702.80	0.25
120	000895	双汇发展	368,800	11,635,640.00	0.24
121	000538	云南白药	109,000	11,406,850.00	0.24

122	601377	兴业证券	1,142,812	11,290,982.56	0.24
123	601857	中国石油	2,249,369	11,044,401.79	0.23
124	300408	三环集团	245,508	10,949,656.80	0.23
125	688111	金山办公	40,952	10,852,280.00	0.23
126	603806	福斯特	82,800	10,809,540.00	0.23
127	000768	中航西飞	294,671	10,755,491.50	0.23
128	601628	中国人寿	355,009	10,682,220.81	0.22
129	600346	恒力石化	449,780	10,331,446.60	0.22
130	002001	新和成	330,619	10,288,863.28	0.22
131	601989	中国重工	2,431,000	10,258,820.00	0.21
132	601600	中国铝业	1,676,136	10,207,668.24	0.21
133	601138	工业富联	848,399	10,112,916.08	0.21
134	601225	陕西煤业	826,200	10,079,640.00	0.21
135	300896	爱美客	18,500	9,918,035.00	0.21
136	600426	华鲁恒升	315,600	9,878,280.00	0.21
137	002008	大族激光	181,611	9,806,994.00	0.21
138	300433	蓝思科技	424,699	9,759,583.02	0.20
139	002202	金风科技	589,224	9,704,519.28	0.20
140	002050	三花智控	382,749	9,683,549.70	0.20
141	600763	通策医疗	48,300	9,611,700.00	0.20
142	600009	上海机场	205,026	9,572,663.94	0.20
143	601009	南京银行	1,067,200	9,562,112.00	0.20
144	300316	晶盛机电	137,000	9,521,500.00	0.20
145	600741	华域汽车	336,140	9,512,762.00	0.20
146	600150	中国船舶	381,300	9,452,427.00	0.20
147	600176	中国巨石	511,366	9,306,861.20	0.19
148	300413	芒果超媒	159,230	9,111,140.60	0.19
149	600011	华能国际	939,756	9,106,235.64	0.19
150	688036	传音控股	58,019	9,103,181.10	0.19
151	601100	恒立液压	111,056	9,084,380.80	0.19
152	001979	招商蛇口	675,951	9,017,186.34	0.19
153	002236	大华股份	382,000	8,969,360.00	0.19
154	300601	康泰生物	87,900	8,661,666.00	0.18
155	603993	洛阳钼业	1,537,100	8,577,018.00	0.18
156	600760	中航沈飞	125,680	8,551,267.20	0.18
157	601939	建设银行	1,459,200	8,550,912.00	0.18
158	600584	长电科技	265,000	8,220,300.00	0.17
159	600989	宝丰能源	469,600	8,152,256.00	0.17
160	600926	杭州银行	632,353	8,106,765.46	0.17
161	601006	大秦铁路	1,264,500	8,092,800.00	0.17
162	601066	中信建投	276,201	8,078,879.25	0.17
163	688008	澜起科技	96,105	8,060,326.35	0.17

164	002602	世纪华通	953,238	7,997,666.82	0.17
165	300759	康龙化成	56,000	7,911,120.00	0.17
166	003816	中国广核	2,522,300	7,894,799.00	0.17
167	600132	重庆啤酒	52,000	7,868,640.00	0.16
168	000977	浪潮信息	216,900	7,771,527.00	0.16
169	601360	三六零	608,700	7,742,664.00	0.16
170	000786	北新建材	215,700	7,728,531.00	0.16
171	603486	科沃斯	51,000	7,698,450.00	0.16
172	601186	中国铁建	983,200	7,668,960.00	0.16
173	002555	三七互娱	283,417	7,657,927.34	0.16
174	000157	中联重科	1,060,923	7,606,817.91	0.16
175	601868	中国能建	2,765,600	7,550,088.00	0.16
176	600600	青岛啤酒	75,600	7,484,400.00	0.16
177	000963	华东医药	185,900	7,473,180.00	0.16
178	600029	南方航空	1,078,190	7,342,473.90	0.15
179	600015	华夏银行	1,309,831	7,335,053.60	0.15
180	603369	今世缘	134,700	7,327,680.00	0.15
181	000876	新希望	479,305	7,290,229.05	0.15
182	600886	国投电力	633,961	7,271,532.67	0.15
183	002601	龙佰集团	253,900	7,259,001.00	0.15
184	600547	山东黄金	383,733	7,221,855.06	0.15
185	002736	国信证券	616,100	7,072,828.00	0.15
186	601238	广汽集团	464,020	7,048,463.80	0.15
187	600352	浙江龙盛	556,661	7,030,628.43	0.15
188	000425	徐工机械	1,168,400	6,998,716.00	0.15
189	000938	紫光股份	303,976	6,945,851.60	0.15
190	603882	金域医学	62,300	6,938,351.00	0.15
191	601336	新华保险	177,740	6,910,531.20	0.14
192	601901	方正证券	880,708	6,904,750.72	0.14
193	603019	中科曙光	249,480	6,878,163.60	0.14
194	002007	华兰生物	234,120	6,822,256.80	0.14
195	300033	同花顺	46,120	6,668,029.60	0.14
196	688012	中微公司	52,628	6,662,704.80	0.14
197	601800	中国交建	771,400	6,618,612.00	0.14
198	600085	同仁堂	146,200	6,576,076.00	0.14
199	601799	星宇股份	31,800	6,495,150.00	0.14
200	000596	古井贡酒	26,328	6,424,032.00	0.13
201	601916	浙商银行	1,814,900	6,352,150.00	0.13
202	002938	鹏鼎控股	149,200	6,330,556.00	0.13
203	601788	光大证券	421,642	6,295,115.06	0.13
204	601865	福莱特	108,500	6,286,490.00	0.13
205	300595	欧普康视	108,700	6,236,119.00	0.13

206	300628	亿联网络	76,500	6,230,925.00	0.13
207	000783	长江证券	825,717	6,225,906.18	0.13
208	600383	金地集团	479,900	6,224,303.00	0.13
209	603160	汇顶科技	57,473	6,193,865.21	0.13
210	000069	华侨城 A	871,600	6,136,064.00	0.13
211	300003	乐普医疗	268,900	6,085,207.00	0.13
212	600115	中国东航	1,168,362	6,028,747.92	0.13
213	600795	国电电力	1,895,400	6,008,418.00	0.13
214	603833	欧派家居	40,660	5,997,350.00	0.13
215	603392	万泰生物	27,040	5,989,360.00	0.13
216	601108	财通证券	536,601	5,967,003.12	0.12
217	000301	东方盛虹	308,100	5,958,654.00	0.12
218	600918	中泰证券	595,200	5,934,144.00	0.12
219	002252	上海莱士	863,800	5,891,116.00	0.12
220	300999	金龙鱼	92,700	5,833,611.00	0.12
221	601618	中国中冶	1,521,200	5,826,196.00	0.12
222	600109	国金证券	514,031	5,823,971.23	0.12
223	600183	生益科技	246,947	5,815,601.85	0.12
224	601111	中国国航	635,400	5,801,202.00	0.12
225	002841	视源股份	70,981	5,777,853.40	0.12
226	601838	成都银行	476,498	5,717,976.00	0.12
227	601155	新城控股	192,002	5,593,018.26	0.12
228	300529	健帆生物	102,900	5,484,570.00	0.11
229	601966	玲珑轮胎	147,104	5,376,651.20	0.11
230	603517	绝味食品	78,400	5,357,072.00	0.11
231	000066	中国长城	374,500	5,302,920.00	0.11
232	603899	晨光文具	81,316	5,245,695.16	0.11
233	600332	白云山	150,000	5,130,000.00	0.11
234	002916	深南电路	42,038	5,121,069.16	0.11
235	600489	中金黄金	620,400	5,105,892.00	0.11
236	688561	奇安信	58,000	5,099,360.00	0.11
237	002120	韵达股份	248,788	5,090,202.48	0.11
238	002624	完美世界	249,150	5,060,236.50	0.11
239	002791	坚朗五金	27,700	5,030,043.00	0.11
240	000703	恒逸石化	469,980	4,991,187.60	0.10
241	600362	江西铜业	222,000	4,957,260.00	0.10
242	601607	上海医药	247,256	4,912,976.72	0.10
243	002414	高德红外	199,680	4,834,252.80	0.10
244	600143	金发科技	383,600	4,825,688.00	0.10
245	603338	浙江鼎力	60,000	4,815,600.00	0.10
246	300144	宋城演艺	334,349	4,787,877.68	0.10
247	002568	百润股份	80,000	4,786,400.00	0.10

248	300677	英科医疗	82,200	4,754,448.00	0.10
249	603260	合盛硅业	35,900	4,737,723.00	0.10
250	600079	人福医药	209,700	4,722,444.00	0.10
251	688169	石头科技	5,796	4,712,148.00	0.10
252	601990	南京证券	471,200	4,669,592.00	0.10
253	300676	华大基因	52,500	4,609,500.00	0.10
254	002044	美年健康	584,500	4,588,325.00	0.10
255	600061	国投资本	549,237	4,514,728.14	0.09
256	600872	中炬高新	118,899	4,514,595.03	0.09
257	601878	浙商证券	338,050	4,455,499.00	0.09
258	002600	领益智造	604,400	4,448,384.00	0.09
259	601021	春秋航空	77,768	4,417,222.40	0.09
260	600845	宝信软件	72,566	4,414,189.78	0.09
261	000708	中信特钢	214,600	4,395,008.00	0.09
262	603939	益丰药房	78,900	4,348,179.00	0.09
263	601728	中国电信	997,100	4,317,443.00	0.09
264	600161	天坛生物	147,400	4,268,704.00	0.09
265	300558	贝达药业	52,400	4,183,092.00	0.09
266	688126	沪硅产业	158,814	4,100,577.48	0.09
267	600018	上港集团	746,000	4,088,080.00	0.09
268	601696	中银证券	296,500	3,987,925.00	0.08
269	601216	君正集团	723,700	3,784,951.00	0.08
270	601162	天风证券	918,230	3,718,831.50	0.08
271	688396	华润微	56,275	3,635,365.00	0.08
272	300866	安克创新	34,800	3,567,000.00	0.07
273	600606	绿地控股	818,745	3,553,353.30	0.07
274	600655	豫园股份	330,500	3,404,150.00	0.07
275	601995	中金公司	68,600	3,363,458.00	0.07
276	688363	华熙生物	21,325	3,311,772.50	0.07
277	601933	永辉超市	809,082	3,276,782.10	0.07
278	002024	苏宁易购	789,900	3,254,388.00	0.07
279	002157	正邦科技	336,400	3,249,624.00	0.07
280	601881	中国银河	280,000	3,133,200.00	0.07
281	601998	中信银行	670,900	3,099,558.00	0.06
282	002064	华峰化学	296,100	3,091,284.00	0.06
283	002607	中公教育	391,782	3,079,406.52	0.06
284	600848	上海临港	203,180	3,021,286.60	0.06
285	603195	公牛集团	17,400	2,911,020.00	0.06
286	603658	安图生物	52,590	2,895,605.40	0.06
287	601319	中国人保	605,000	2,843,500.00	0.06
288	603233	大参林	67,500	2,842,425.00	0.06
289	688009	中国通号	564,541	2,811,414.18	0.06

290	603087	甘李药业	37,300	2,623,682.00	0.05
291	600025	华能水电	383,592	2,527,871.28	0.05
292	601898	中煤能源	388,500	2,443,665.00	0.05
293	601236	红塔证券	200,090	2,385,072.80	0.05
294	601231	环旭电子	140,800	2,261,248.00	0.05
295	002032	苏泊尔	34,848	2,168,939.52	0.05
296	000800	一汽解放	199,000	2,047,710.00	0.04
297	601808	中海油服	127,800	1,917,000.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	9,800	1,782,032.00	0.04
299	300888	稳健医疗	18,300	1,508,835.00	0.03
300	601698	中国卫通	95,200	1,369,928.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688032	禾迈股份	1,810	1,177,694.60	0.02
2	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.01
3	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
4	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.00
5	688265	南模生物	2,374	166,298.70	0.00
6	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.00
7	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.00
8	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
9	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.00
10	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
11	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
12	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
13	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.00
14	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
15	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
16	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
17	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
18	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
19	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
20	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
21	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
22	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
23	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
24	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
25	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
26	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
27	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00

28	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
29	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
30	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
31	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
32	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
33	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
34	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
35	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
36	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
37	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
38	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
39	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
40	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
41	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
42	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
43	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
44	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
45	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
46	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
47	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
48	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
49	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
50	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
51	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
52	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
53	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
54	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
55	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
56	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
57	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
58	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
59	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
60	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
61	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
62	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
63	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
64	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
65	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
66	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
67	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
68	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
69	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
70	301059	金三江	259	4,998.70	0.00

71	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
72	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
73	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
74	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
75	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
76	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
77	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	203,827,964.47	6.04
2	000858	五粮液	65,056,266.50	1.93
3	000333	美的集团	55,829,355.13	1.65
4	002415	海康威视	43,372,978.89	1.29
5	300059	东方财富	41,638,541.96	1.23
6	300760	迈瑞医疗	41,620,485.00	1.23
7	600519	贵州茅台	38,887,643.92	1.15
8	002594	比亚迪	36,682,341.48	1.09
9	002475	立讯精密	32,449,692.23	0.96
10	300274	阳光电源	31,096,839.64	0.92
11	000651	格力电器	30,776,995.00	0.91
12	000568	泸州老窖	30,654,898.36	0.91
13	000725	京东方 A	28,580,088.00	0.85
14	000001	平安银行	28,141,531.31	0.83
15	002466	天齐锂业	27,282,155.00	0.81
16	002371	北方华创	24,335,599.00	0.72
17	688981	中芯国际	24,175,160.89	0.72
18	002142	宁波银行	23,711,910.23	0.70
19	300015	爱尔眼科	23,574,498.40	0.70
20	002714	牧原股份	23,348,718.39	0.69

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	53,119,420.80	1.57
2	000333	美的集团	41,488,577.24	1.23
3	300059	东方财富	29,713,466.92	0.88
4	000651	格力电器	25,672,612.60	0.76

5	000568	泸州老窖	25,587,739.35	0.76
6	002415	海康威视	24,999,357.20	0.74
7	002594	比亚迪	23,594,417.89	0.70
8	600703	三安光电	23,097,921.36	0.68
9	600036	招商银行	22,666,160.10	0.67
10	000001	平安银行	21,588,182.48	0.64
11	000725	京东方 A	19,453,947.84	0.58
12	002475	立讯精密	19,076,111.64	0.57
13	601318	中国平安	18,220,218.15	0.54
14	000661	长春高新	17,818,918.49	0.53
15	002371	北方华创	17,440,489.05	0.52
16	000002	万科 A	17,264,823.42	0.51
17	300014	亿纬锂能	17,248,364.76	0.51
18	600887	伊利股份	17,218,292.09	0.51
19	002714	牧原股份	15,955,878.42	0.47
20	300122	智飞生物	14,131,662.41	0.42

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,114,336,468.35
卖出股票收入（成交）总额	1,424,637,630.39

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,794,000.00	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,794,000.00	0.14

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

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	67,940	6,794,000.00	0.14

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	422,778.52
2	应收证券清算款	1,518,457.25
3	应收股利	-
4	应收利息	108,473.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,049,708.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600519	贵州茅台	20,500,000.00	0.43	转融通流通受限
2	600036	招商银行	7,145,757.00	0.15	转融通流通受限
3	601318	中国平安	6,800,309.00	0.14	转融通流通受限
4	000858	五粮液	6,189,948.00	0.13	转融通流通受限
5	601012	隆基股份	4,732,380.00	0.10	转融通流通受限
6	300059	东方财富	4,731,525.00	0.10	转融通流通受限
7	601166	兴业银行	4,510,576.00	0.09	转融通流通受限
8	000333	美的集团	4,022,645.00	0.08	转融通流通受限
9	600900	长江电力	1,838,700.00	0.04	转融通流通受限

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688032	禾迈股份	1,177,694.60	0.02	新股锁定
2	688262	国芯科技	299,275.42	0.01	新股未上市

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
4,672	201,908.11	935,359,446.00	99.16	7,955,255.00	0.84

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

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国农业银行股份有限公司-工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	240,868,500.00	25.53

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国石油天然气集团有限公司	584,129,672.00	61.92
2	中信证券-工行-中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	90,912,997.00	9.64
3	中信证券股份有限公司	10,462,105.00	1.11
4	方正证券股份有限公司	3,820,124.00	0.40
5	中信建投证券股份有限公司	1,564,855.00	0.17
6	华泰证券股份有限公司	1,490,100.00	0.16
7	泰康资管-中国银行	1,178,100.00	0.12

	一泰康资产管理有限 责任公司益泰 6 号资产 管理产品		
8	华夏基金—华夏银行 —华夏基金—瑞衡多 资产策略 1 号集合资产 管理计划	601,268.00	0.06
9	彭跃	524,534.00	0.06
10	冉浩宇	262,267.00	0.03
11	中国农业银行股份有 限公司—工银瑞信沪 深 300 交易型开放式指 数证券投资基金联接 基金	240,868,500.00	25.53

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年5月20日） 基金份额总额	6,863,688,383.00
本报告期期初基金份额总额	644,514,701.00
本报告期基金总申购份额	585,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	286,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	943,314,701.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

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

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

基金管理人于 2021 年 7 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告》，赵桂才先生自 2021 年 7 月 6 日起担任工银瑞信基金管理有限公司法定代表人。

基金管理人于 2021 年 7 月 24 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告》，高翀先生自 2021 年 7 月 22 日起担任工银瑞信基金管理有限公司总经理。

2、基金托管人：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 90,000.00 元，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	1,789,343,789.28	50.96%	1,093,834.86	47.79%	-
方正证券	3	843,887,978.66	24.03%	600,258.16	26.22%	-
光大证券	2	471,543,679.78	13.43%	335,410.57	14.65%	-
银河证券	1	354,484,213.78	10.10%	223,786.84	9.78%	-
华西证券	2	21,062,369.01	0.60%	14,981.72	0.65%	-
兴业证券	2	16,929,409.46	0.48%	12,041.84	0.53%	-
国信证券	1	13,723,707.72	0.39%	8,389.42	0.37%	-
广发证券	3	141,909.18	0.00%	100.92	0.00%	-
天风证券	2	109,487.84	0.00%	77.78	0.00%	-
申万宏源	1	43,437.72	0.00%	30.89	0.00%	-
中金公司	2	29,028.79	0.00%	20.64	0.00%	-
中信证券	2	16,441.70	0.00%	11.70	0.00%	-
瑞银证券	1	10,380.46	0.00%	6.34	0.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。

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

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

(2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

本报告期内本基金新增德邦证券 2 个交易单元，新增华西证券 2 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

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

4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 5 月 27 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 7 月 8 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 7 月 24 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资上交所上市股票的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 11 月 17 日
8	工银瑞信基金管理有限公司住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 12 月 21 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20211231	584,129,672.00	-	-	584,129,672.00	61.92
	2	20211118-20211231	38,920,200.00	583,850,000.00	381,901,700.00	240,868,500.00	25.53
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》的规定,对《基金合同》和《托管协议》进行了修订,并在投资范围中增加存托凭证,修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 3 月 31 日起生效,详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日