

中银中证 800 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：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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
§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 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	14
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64

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	64
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	64
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	64
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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末上市基金前十名持有人	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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的情况	66
§10 开放式基金份额变动	67
§11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
12 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银 800
场内简称	中银中证 800ETF
基金主代码	515610
交易代码	515610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,857,400.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 8 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	姜敏
	联系电话	021-38834999	4006800000
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95558
传真		021-68873488	010-85230024
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020

法定代表人	章砚	朱鹤新
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	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 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,995,918.75	7,476,609.45
本期利润	1,640,387.46	11,967,570.22
加权平均基金份额本期利润	0.0423	0.0608
本期加权平均净值利润率	3.97%	6.05%
本期基金份额净值增长率	-0.50%	7.06%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	2,929,076.86	3,082,897.96
期末可供分配基金份额利润	0.0653	0.0490
期末基金资产净值	47,786,476.86	67,295,332.02
期末基金份额净值	1.0653	1.0706
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	6.53%	7.06%

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.本基金基金合同于 2020 年 7 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满三年。

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	2.04%	0.72%	2.01%	0.73%	0.03%	-0.01%
过去六个月	-2.06%	0.91%	-2.44%	0.93%	0.38%	-0.02%
过去一年	-0.50%	1.05%	-0.76%	1.07%	0.26%	-0.02%
自基金合同生效日起	6.53%	1.02%	5.58%	1.13%	0.95%	-0.11%

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 7 月 16 日至 2021 年 12 月 31 日)

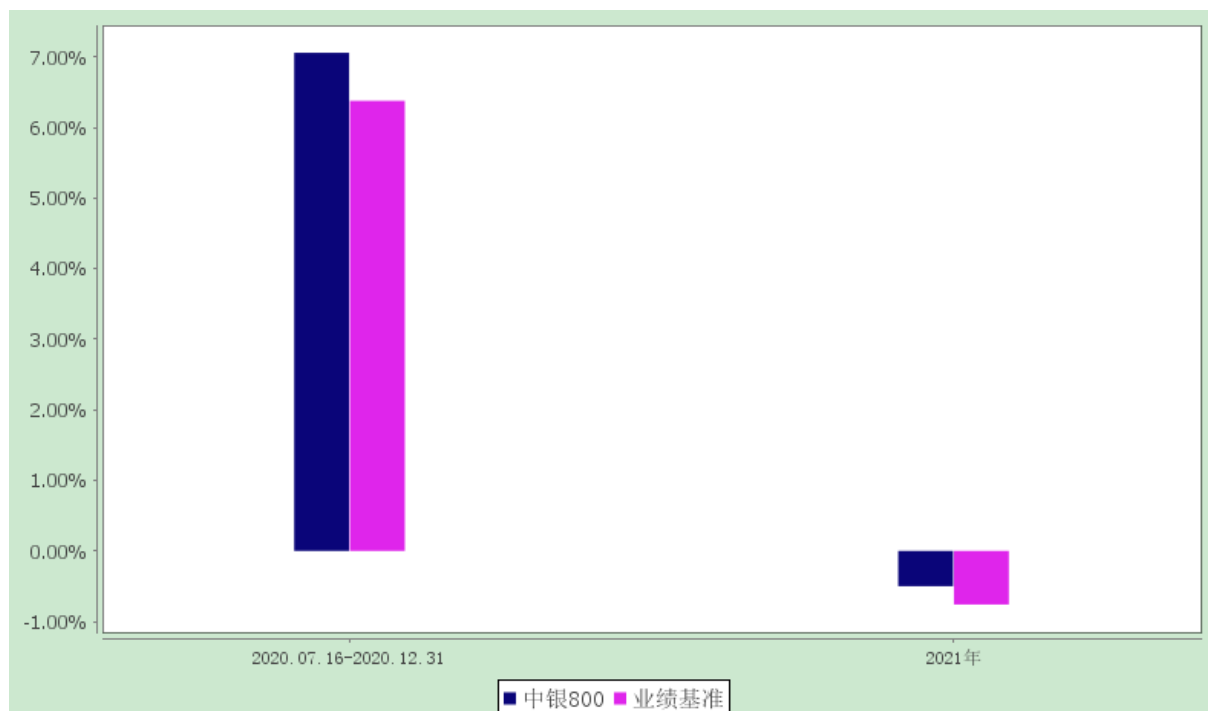


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同于 2020 年 07 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	-	-	-	-	-
2020年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2020年7月16日）至本报告期末未进行利润分配。

§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 12 月 31 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 145 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵建忠	基金经理	2020-07-16	-	15	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中银中证 100 基金经理，2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金经理，2015 年 6 月至今任中银 300E 基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银宏利基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银丰利基金经理，2020 年 4 月至今任中银 100 基金经理，2020 年 7 月至今任中银 800 基金经理，2020 年 8 月至今任中银黄金基金经理，2020 年 9 月至今任中银上海金 ETF 联接基金经理，2020 年 11 月至今任中银中证 100ETF 联接基金经理，2021 年 12 月至今任中银中证 800ETF 联接基金经理。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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价

申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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，2021 年全球经济在复苏中阶段性受疫情扰动。具体而言，美国经济四个季度环比折年增长率分别为 6.3%、6.7%、2.3%、6.9%，除三季度受 Delta 疫情影响较大外，其余季度经济恢复相对平稳。美国消费受财政补贴退坡与通胀上行制约增速逐步放缓；生产端的修复受到了供应链短缺问题的扰动；PCE 通胀连续抬升，从 1 月的 1.41% 逐步上行至 12 月的 5.79%；失业率从 1 月的 6.4% 逐步回落 12 月的 3.9%。在通胀持续超预期的背景下，美联储宣布 11 月开始退出量化宽松 (Taper)，2022 年 3 月完成退出，政策利率 2021 年全年维持零利率。欧元区经济复苏总体慢于美国，前三季度实际 GDP 同比增速分别为 -1.1%、14.7%、4%。欧元区制造业 PMI 一度从 1 月的 54.8% 上行至 6 月的 63.4%，后逐步回落至 12 月的 58%；通胀逐步上行，HICP 通胀率从 1 月的 0.9% 上行至 12 月的 5.0%，失业率逐步回落，从 1 月的 8.2% 回落至 12 月的 7%。欧央行紧急抗疫购债计划 (PEPP) 将至少持续至 2022 年 3 月底，政策利率 2021 年全年维持零利率。日本经济整体缓慢修复，前三季

度实际 GDP 同比增速分别为-1.8%、7.3%、1.2%，CPI 通胀同比增速从 1 月的-0.7%上行至 0.8%，失业率在 2.7-3% 区间震荡。

国内经济方面，上半年经济延续 2020 年的复苏态势，一、二季度实际 GDP 同比增速分别为 18.3%、7.9%；下半年经济面临总量回落与结构冲击双重压力，三、四季度实际 GDP 同比增速分别为 4.9%、4.0%。通胀水平逐步上行，CPI 同比增长由 2020 年 12 月的 0.2% 上行至 2021 年 12 月的 1.5%，PPI 见顶回落，从 2020 年 12 月的-0.4% 一度上行至 13.5%，2021 年 12 月回落至 10.3%。从经济增长动力来看，出口表现亮眼持续上行，2021 年末美元计价出口累计增速较 2020 年末上行 26.3 个百分点至 29.9%；内需出现一定分化，2021 年 12 月消费同比增速较 2020 年 12 月回落 2.9 个百分点至 1.7%，全年固定资产投资累计增速较 2020 年末上行 2 个百分点至 4.9% 的水平。政策方面，货币政策稳中偏松，7 月和 12 月降准，12 月下调 1 年期 LPR 利率 5bp，整体保持流动性合理充裕，M2 同比增速回落 1.1 个百分点至 9.0%，社会融资规模同比增速回落 3 个百分点至 10.3%，新增人民币贷款 20 万亿元。

2、行情回顾

回顾 2021 年，年初涨幅较大的“成长性核心资产”在春节后大幅调整，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。七月，在线教育、互联网、房地产等部分行业受到超预期的严厉监管政策影响，并带动整体市场的风险偏好下移。9 月能源价格、大宗商品价格持续上涨，板块间轮动较快。经济下行压力逐渐加大，美联储 Taper 渐行渐近，部分资金选择低估值板块避险。随着降准落地，中央经济工作会议和政治局会议的政策定调转向稳增长，加上通胀剪刀差收敛、出口超预期，稳增长方向逆势上涨。截至 2021 年 12 月 31 日，从各行业来看，电力设备（47.86%）、有色金属（40.47%）、煤炭（39.60%）等行业涨幅居前，家用电器（-19.54%）、非银金融（-17.55%）、房地产（-11.89%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为-0.24%；中证 100 涨跌幅-10.55%；上证国企指数涨跌幅-0.04%，中证 800 指数涨跌幅-0.76%。

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-0.50%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%。

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 2022 年，1 月份市场普跌，成长周期因估值、市场预期和交易拥挤等原因调整幅度较大，海外流动性预期的负面影响边际上将持续弱化。政策方面，货币财政双宽，节奏更加提前。基本面来看，经济下行压力加大，稳增长政策将加速推进与发力，市场将进一步追求盈利的稳定性。经过前期的下跌，市场底部逐渐清晰，消费、基建和金融等低估值方向的配置价值提升。资金面来看，房地产税的出台将加速中国居民财富的结构向金融资产特别是权益资产倾斜。预计 2022 年公募基金发行仍将维持较高的发行规模，养老金、FOF、银行理财也是 A 股重要的增量资金来源，这些资金更加注重稳定性、偏向于中长期配置。机构化将共同推动 A 股的价值化进程。未来以龙头公司、优质公司为代表的核心资产将成为长期资金共同配置的方向。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从防范风险、保护基金份额持有人利益出发，致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司内控部门与审计部按照制度，通过基金运作监控和内部审计等方法，独立地开展工作，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

(1) 深入开展审计检查，确保基金运作合规性

主要措施有：对基金运作涉及的投资、研究、交易、风险管理、信息资讯等业务环节开展独立检查，及时发现业务流程中存在的风险并督促整改，确保相关业务运作符合法律法规及公司制度的规定。

(2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，定期更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

通过以上工作的开展，在本报告期内，本基金运作过程中未发生违规关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规与审计工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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，由基金运营、风险管理、研究及投资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。

4.7.2 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。

4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的规定，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。

本报告期末可供分配利润为 2,929,076.86 元。本基金本报告期末进行利润分配。

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

本报告期内，本基金自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 4 月 9 日、2021 年 5 月 7 日至 2021 年 7 月 9 日、2021 年 7 月 13 日至 2021 年 9 月 16 日、2021 年 9 月 28 日至 2021 年 12 月 7 日已出现连续超过 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 年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，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 27665 号

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中银中证 800ETF 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。

(二) 我们的意见

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，公允反映了中银中证 800ETF 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。

6.2 形成审计意见的基础

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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中银中证 800ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

中银中证 800ETF 基金的基金管理人中银基金管理有限公司(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。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中银中证 800ETF 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中银中证 800ETF 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中银中证 800ETF 基金的财务报告过程。

6.4 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。

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:

(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。

(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。

(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。

(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,就可能导致对中银中证 800ETF 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中银中证 800ETF 基金不能持续经营。

(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。

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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张 振 波 沈 兆 杰

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 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	705,629.97	796,000.63
结算备付金		9,304.56	291,687.90
存出保证金		21,102.13	225,916.34
交易性金融资产	7.4.7.2	47,205,878.37	66,727,446.46
其中：股票投资		47,205,878.37	66,684,046.46
基金投资		-	-
债券投资		-	43,400.00
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		48,706.91	1,256,216.00
应收利息	7.4.7.5	153.72	393.08
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		47,990,775.66	69,297,660.41
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		-	1,430,396.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,495.42	29,233.21
应付托管费		1,943.94	3,248.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	21,571.28	88,950.04
应交税费		-	0.19
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	163,288.16	450,500.74
负债合计		204,298.80	2,002,328.39
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	44,857,400.00	62,857,400.00
未分配利润	7.4.7.10	2,929,076.86	4,437,932.02
所有者权益合计		47,786,476.86	67,295,332.02
负债和所有者权益总计		47,990,775.66	69,297,660.41

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0653 元，基金份额总额 44,857,400.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 7 月 16 日（基 金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		2,356,491.24	13,483,085.12
1.利息收入		9,532.12	427,633.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,518.83	235,949.06
债券利息收入		13.29	37.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	191,647.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,612,526.68	8,340,693.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,039,378.56	7,781,000.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	14,130.80	53,616.97

资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	559,017.32	506,076.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-4,355,531.29	4,490,960.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	89,963.73	223,797.66
减：二、费用		716,103.78	1,515,514.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2	188,217.59	406,512.23
2. 托管费	7.4.10.2	20,913.11	45,168.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	183,907.62	765,561.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	0.03
7. 其他费用	7.4.7.19	323,065.44	298,272.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,640,387.46	11,967,570.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,640,387.46	11,967,570.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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）	62,857,400.00	4,437,932.02	67,295,332.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,640,387.46	1,640,387.46
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）	-18,000,000.00	-3,149,242.62	-21,149,242.62
其中：1.基金申购款	78,000,000.00	4,804,641.67	82,804,641.67
2.基金赎回款	-96,000,000.00	-7,953,884.29	-103,953,884.29
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)	44,857,400.00	2,929,076.86	47,786,476.86
项目	上年度可比期间 2020 年 7 月 16 日(基金合同生效日)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)	377,857,400.00	-	377,857,400.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,967,570.22	11,967,570.22
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)	-315,000,000.00	-7,529,638.20	-322,529,638.20
其中: 1.基金申购款	18,000,000.00	-168,682.77	17,831,317.23
2.基金赎回款	-333,000,000.00	-7,360,955.43	-340,360,955.43
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)	62,857,400.00	4,437,932.02	67,295,332.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 张家文, 主管会计工作负责人: 陈宇, 会计机构负责人: 乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2049 号《关于准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册, 由中银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《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 377,855,000.00 元(无募集股票市值), 业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第 61062100_B17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 16 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 377,857,400.00 份基金份额, 其中认购资金利息折合 2,400.00 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司, 基金托

管人为中信银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]252 号审核同意, 本基金 377,857,400.00 份基金份额于 2020 年 8 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化; 投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金, 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金还可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为: 标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%; 股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。在正常市场情况下, 本基金对标的指数的跟踪目标是: 力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率。

本基金的基金管理人中银基金管理有限公司以本基金为目标 ETF, 募集成立了中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“中银中证 800ETF 发起式联接基金”)。中银中证 800 ETF 发起式联接基金为交易型开放式基金, 投资目标与本基金类似, 将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2022 年 3 月 29 日批准。

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》、《中银中证 800 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。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2020 年 7 月 16 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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。

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费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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；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，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。

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) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的

指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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	705,629.97	796,000.63
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	705,629.97	796,000.63

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		47,070,448.89	47,205,878.37	135,429.48
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		47,070,448.89	47,205,878.37	135,429.48
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		62,193,085.69	66,684,046.46	4,490,960.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	43,400.00	43,400.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	43,400.00	43,400.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		62,236,485.69	66,727,446.46	4,490,960.77

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	140.02	156.93
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	4.20	131.30
应收债券利息	-	3.25
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	9.50	101.60
合计	153.72	393.08

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

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	21,571.28	88,950.04
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	21,571.28	88,950.04

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	-	-
IOPV 计算发布费	50,000.00	-
应付信息披露费	80,000.00	100,000.00
应付审计费	30,000.00	40,000.00
应付指数使用费	3,288.16	35,000.00
可退替代款	-	193.80
应退退补款	-	275,306.94
合计	163,288.16	450,500.74

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	62,857,400.00	62,857,400.00
本期申购	78,000,000.00	78,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-96,000,000.00	-96,000,000.00
本期末	44,857,400.00	44,857,400.00

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	3,082,897.96	1,355,034.06	4,437,932.02
本期利润	5,995,918.75	-4,355,531.29	1,640,387.46
本期基金份额交易产生的变动数	-806,651.57	-2,342,591.05	-3,149,242.62
其中：基金申购款	12,537,162.74	-7,732,521.07	4,804,641.67
基金赎回款	-13,343,814.31	5,389,930.02	-7,953,884.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,272,165.14	-5,343,088.28	2,929,076.86

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 7 月 16 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,332.36	226,072.39
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	1,167.98	8,748.05
其他	1,018.49	1,128.62
合计	9,518.83	235,949.06

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7月16日（基金合 同生效日）至2020年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,696,956.51	3,337,751.18
股票投资收益——赎回差价收入	2,342,422.05	4,443,249.10
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	6,039,378.56	7,781,000.28

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7月16日（基金合 同生效日）至2020年12月31 日
卖出股票成交总额	64,215,090.24	174,872,603.18
减：卖出股票成本总额	60,518,133.73	171,534,852.00
买卖股票差价收入	3,696,956.51	3,337,751.18

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7月16日（基金合 同生效日）至2020年12月 31日
赎回基金份额对价总额	103,953,884.29	340,360,955.43
减：现金支付赎回款总额	46,271,733.29	148,819,710.43
减：赎回股票成本总额	55,339,728.95	187,097,995.90
赎回差价收入	2,342,422.05	4,443,249.10

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月 31日	上年度可比期间 2020年7月16日（基金合 同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 额	132,747.52	309,651.14

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	118,600.00	256,000.00
减：应收利息总额	16.72	34.17
买卖债券差价收入	14,130.80	53,616.97

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	559,017.32	506,076.20
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	559,017.32	506,076.20

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2020年7月16日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-4,355,531.29	4,490,960.77
——股票投资	-4,355,531.29	4,490,960.77
——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	-4,355,531.29	4,490,960.77

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年7月16日（基金合同生效日）至

		2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	89,963.73	223,797.66
合计	89,963.73	223,797.66

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间
		2020年7月16日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	183,907.62	765,561.88
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	183,907.62	765,561.88

7.4.7.19 其他费用

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7月16日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	517.53	-
指数使用费	12,547.91	64,293.48
ETF 注册登记费	150,000.00	75,000.00
其他	50,000.00	18,979.23
合计	323,065.44	298,272.71

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，本基金无需要披露的或有事项。

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
中银基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司 (“中信银行”)	基金托管人
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金管理人的控股股东
中银国际证券股份有限公司 (“中银证券”)	受中国银行重大影响
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

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。

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7月16日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	188,217.59	406,512.23
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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7月16日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,913.11	45,168.05

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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。

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

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。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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7月16日(基金合同生效日)至2020年12月31日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	14,396,900.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,898,800.00	-
期末持有的基金份额	12,498,100.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.86%	-

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

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

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

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。

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年7月16日(基金合同生效日)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
中信银行股份有限公司	705,629.97	7,332.36	796,000.63	226,072.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 7 月 16 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中银证券	600919	江苏银行	配股	9,060	41,585.40
中银证券	000728	国元证券	配股	4,650	25,296.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有 4,900 股中信银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 23,382.25 元,估值总额为人民币 22,638.00 元,占基金资产净值的比例为 0.05%(2020 年 12 月 31 日:本基金持有 7,900 股中信银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 41,285.30 元,估值总额为人民币 40,369.00 元,占基金资产净值的比例为 0.06%无)。于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有 2,200 股中银证券的 A 股普通股,成本总额为人民币 34,882.93 元,估值总额为人民币 29,590.00 元,占基金资产净值的比例为 0.06%(2020 年 12 月 31 日:本基金持有 900 股中银证券的 A 股普通股,成本总额为人民币 23,211.00 元,估值总额为人民币 24,912.00 元,占基金资产净值的比例为 0.04%无)。于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有 34,100 股中国银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 106,230.03 元,估值总额为人民币 104,005.00 元,占基金资产净值的比例为 0.22%(2020 年 12 月 31 日:本基金持有 55,700 股中国银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 186,517.86 元,估值总额为人民币 177,126.00 元,占基金资产净值的比例为 0.26%)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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
001234	泰慕士	2021-1-2-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	194	3,206.82	3,206.82	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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
002683	广东宏大	2021-12-17	重大事项停牌	30.12	2022-01-04	31.00	800	22,776.84	24,096.00	

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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。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。

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 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资(2020 年 12 月 31 日：0.06%)。

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

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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、债券投资等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	705,629.97	-	-	-	705,629.97
结算备付金	9,304.56	-	-	-	9,304.56
存出保证金	21,102.13	-	-	-	21,102.13
交易性金融资产	-	-	-	47,205,878.37	47,205,878.37
应收证券清算款	-	-	-	48,706.91	48,706.91
应收利息	-	-	-	153.72	153.72
资产总计	736,036.66	-	-	47,254,739.00	47,990,775.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,495.42	17,495.42
应付托管费	-	-	-	1,943.94	1,943.94
应付交易费用	-	-	-	21,571.28	21,571.28
其他负债	-	-	-	163,288.16	163,288.16
负债总计	-	-	-	204,298.80	204,298.80
利率敏感度缺口	736,036.66	-	-	47,050,440.20	47,786,476.86
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	796,000.63	-	-	-	796,000.63
结算备付金	291,687.90	-	-	-	291,687.90
存出保证金	225,916.34	-	-	-	225,916.34
交易性金融资产	-	-	43,400.00	66,684,046.46	66,727,446.46
应收证券清算款	-	-	-	1,256,216.00	1,256,216.00
应收利息	-	-	-	393.08	393.08
资产总计	1,313,604.87	-	43,400.00	67,940,655.54	69,297,660.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,705,896.81	1,705,896.81
应付管理人报酬	-	-	-	29,233.21	29,233.21
应付托管费	-	-	-	3,248.14	3,248.14
应付交易费用	-	-	-	88,950.04	88,950.04
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
负债总计	-	-	-	2,002,328.39	2,002,328.39
利率敏感度缺口	1,313,604.87	-	43,400.00	65,938,327.15	67,295,332.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于 2021 年 12 月 31 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）。

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

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

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	47,205,878.37	98.79	66,684,046.46	99.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,205,878.37	98.79	66,684,046.46	99.09

注：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 233	-
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 233	-	-

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

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 47,178,575.55 元，属于第二层次的余额为 27,302.82 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 66,615,844.86 元，第二层次 111,601.60 元，无第三层次）。

(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的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

无。

(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(2020 年 12 月 31 日: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) 基金申购款

于 2021 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 82,804,641.67 元,其中包括以股票支付的申购款 45,571,240.00 元和以现金支付的申购款 37,233,401.67 元。

(3) 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、中国银行保险监督管理委员会于 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。

(4)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	47,205,878.37	98.36
	其中:股票	47,205,878.37	98.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	714,934.53	1.49
8	其他各项资产	69,962.76	0.15
9	合计	47,990,775.66	100.00

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	511,889.80	1.07
B	采矿业	1,216,184.80	2.55
C	制造业	28,042,204.18	58.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,303,144.10	2.73
E	建筑业	808,718.34	1.69
F	批发和零售业	572,468.80	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,205,021.00	2.52
H	住宿和餐饮业	64,537.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,109,922.50	4.42
J	金融业	8,341,562.63	17.46
K	房地产业	922,851.00	1.93
L	租赁和商务服务业	621,669.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	651,475.12	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	97,566.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,580.00	0.05
Q	卫生和社会工作	379,398.28	0.79
R	文化、体育和娱乐业	248,561.00	0.52
S	综合	81,918.00	0.17
	合计	47,202,671.55	98.78

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

8.2.2 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	3,206.82	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,206.82	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,003	2,056,150.00	4.30
2	300750	宁德时代	2,200	1,293,600.00	2.71
3	600036	招商银行	19,900	969,329.00	2.03
4	601318	中国平安	17,400	877,134.00	1.84
5	000858	五粮液	3,100	690,246.00	1.44
6	601012	隆基股份	6,944	598,572.80	1.25
7	000333	美的集团	7,900	583,099.00	1.22
8	300059	东方财富	13,280	492,820.80	1.03
9	600900	长江电力	19,700	447,190.00	0.94

10	601166	兴业银行	23,400	445,536.00	0.93
11	600887	伊利股份	9,800	406,308.00	0.85
12	002594	比亚迪	1,500	402,180.00	0.84
13	603259	药明康德	3,364	398,903.12	0.83
14	002475	立讯精密	8,000	393,600.00	0.82
15	002415	海康威视	7,500	392,400.00	0.82
16	600276	恒瑞医药	7,260	368,154.60	0.77
17	600030	中信证券	13,800	364,458.00	0.76
18	601888	中国中免	1,600	351,056.00	0.73
19	000568	泸州老窖	1,200	304,644.00	0.64
20	000651	格力电器	7,600	281,428.00	0.59
21	300760	迈瑞医疗	700	266,560.00	0.56
22	601398	工商银行	56,700	262,521.00	0.55
23	000001	平安银行	15,600	257,088.00	0.54
24	600309	万华化学	2,500	252,500.00	0.53
25	603501	韦尔股份	800	248,616.00	0.52
26	300274	阳光电源	1,700	247,860.00	0.52
27	002142	宁波银行	6,410	245,374.80	0.51
28	000725	京东方 A	48,200	243,410.00	0.51
29	600809	山西汾酒	760	239,992.80	0.50
30	002714	牧原股份	4,260	227,313.60	0.48
31	601899	紫金矿业	23,200	225,040.00	0.47
32	002352	顺丰控股	3,200	220,544.00	0.46
33	600031	三一重工	9,600	218,880.00	0.46
34	603288	海天味业	2,080	218,628.80	0.46
35	600436	片仔癀	500	218,575.00	0.46
36	000002	万科 A	11,000	217,360.00	0.45
37	300014	亿纬锂能	1,800	212,724.00	0.45
38	300124	汇川技术	3,000	205,800.00	0.43
39	002241	歌尔股份	3,800	205,580.00	0.43
40	601328	交通银行	44,300	204,223.00	0.43
41	002812	恩捷股份	800	200,320.00	0.42
42	600438	通威股份	4,300	193,328.00	0.40
43	601919	中远海控	10,200	190,638.00	0.40
44	600837	海通证券	15,500	190,030.00	0.40
45	300015	爱尔眼科	4,401	186,074.28	0.39
46	002460	赣锋锂业	1,300	185,705.00	0.39
47	600690	海尔智家	6,100	182,329.00	0.38
48	002466	天齐锂业	1,700	181,900.00	0.38
49	600048	保利发展	11,600	181,308.00	0.38
50	600406	国电南瑞	4,480	179,334.40	0.38
51	603799	华友钴业	1,600	176,496.00	0.37
52	000063	中兴通讯	5,200	174,200.00	0.36
53	002371	北方华创	500	173,510.00	0.36

54	601668	中国建筑	33,800	169,000.00	0.35
55	601288	农业银行	56,700	166,698.00	0.35
56	600111	北方稀土	3,600	164,880.00	0.35
57	688981	中芯国际	3,100	164,269.00	0.34
58	000661	长春高新	600	162,840.00	0.34
59	300122	智飞生物	1,300	161,980.00	0.34
60	600000	浦发银行	18,973	161,839.69	0.34
61	002230	科大讯飞	3,000	157,530.00	0.33
62	002049	紫光国微	700	157,500.00	0.33
63	600104	上汽集团	7,600	156,788.00	0.33
64	600016	民生银行	40,000	156,000.00	0.33
65	600745	闻泰科技	1,200	155,160.00	0.32
66	002129	中环股份	3,700	154,475.00	0.32
67	600585	海螺水泥	3,800	153,140.00	0.32
68	601816	京沪高铁	31,700	153,111.00	0.32
69	601601	中国太保	5,500	149,160.00	0.31
70	002304	洋河股份	900	148,257.00	0.31
71	603986	兆易创新	840	147,714.00	0.31
72	002271	东方雨虹	2,800	147,504.00	0.31
73	601688	华泰证券	8,300	147,408.00	0.31
74	300142	沃森生物	2,500	140,500.00	0.29
75	000100	TCL 科技	22,700	140,059.00	0.29
76	600893	航发动力	2,200	139,612.00	0.29
77	000338	潍柴动力	7,700	137,753.00	0.29
78	300498	温氏股份	7,100	136,746.00	0.29
79	300450	先导智能	1,800	133,866.00	0.28
80	002027	分众传媒	16,300	133,497.00	0.28
81	300782	卓胜微	400	130,720.00	0.27
82	601211	国泰君安	7,300	130,597.00	0.27
83	002821	凯莱英	300	130,500.00	0.27
84	600570	恒生电子	1,940	120,571.00	0.25
85	601088	中国神华	5,300	119,356.00	0.25
86	601766	中国中车	19,500	118,755.00	0.25
87	000776	广发证券	4,800	118,032.00	0.25
88	600050	中国联通	30,000	117,900.00	0.25
89	601229	上海银行	15,900	113,367.00	0.24
90	600919	江苏银行	19,090	111,294.70	0.23
91	688599	天合光能	1,400	110,460.00	0.23
92	600999	招商证券	6,000	105,900.00	0.22
93	601169	北京银行	23,700	105,228.00	0.22
94	600905	三峡能源	13,900	104,389.00	0.22
95	601988	中国银行	34,100	104,005.00	0.22
96	600660	福耀玻璃	2,200	103,708.00	0.22
97	600010	包钢股份	36,900	102,951.00	0.22

98	300347	泰格医药	800	102,240.00	0.21
99	600019	宝钢股份	14,200	101,672.00	0.21
100	600958	东方证券	6,700	98,758.00	0.21
101	601669	中国电建	12,200	98,576.00	0.21
102	600196	复星医药	2,000	97,880.00	0.20
103	002709	天赐材料	850	97,452.50	0.20
104	601633	长城汽车	2,000	97,080.00	0.20
105	601877	正泰电器	1,800	97,002.00	0.20
106	603659	璞泰来	600	96,366.00	0.20
107	002410	广联达	1,500	95,970.00	0.20
108	002311	海大集团	1,300	95,290.00	0.20
109	601390	中国中铁	16,400	94,956.00	0.20
110	300408	三环集团	2,100	93,660.00	0.20
111	000625	长安汽车	6,160	93,570.40	0.20
112	600588	用友网络	2,600	93,288.00	0.20
113	000166	申万宏源	18,200	93,184.00	0.20
114	601985	中国核电	11,200	92,960.00	0.19
115	002459	晶澳科技	1,000	92,700.00	0.19
116	603806	福斯特	700	91,385.00	0.19
117	600028	中国石化	21,400	90,522.00	0.19
118	601658	邮储银行	17,600	89,760.00	0.19
119	000895	双汇发展	2,800	88,340.00	0.18
120	002493	荣盛石化	4,850	88,076.00	0.18
121	601818	光大银行	26,500	87,980.00	0.18
122	601377	兴业证券	8,600	84,968.00	0.18
123	000538	云南白药	800	83,720.00	0.18
124	601628	中国人寿	2,700	81,243.00	0.17
125	002179	中航光电	800	80,448.00	0.17
126	000768	中航西飞	2,200	80,300.00	0.17
127	002340	格林美	7,700	79,695.00	0.17
128	600763	通策医疗	400	79,600.00	0.17
129	688111	金山办公	300	79,500.00	0.17
130	600346	恒力石化	3,400	78,098.00	0.16
131	601989	中国重工	18,300	77,226.00	0.16
132	002001	新 和 成	2,480	77,177.60	0.16
133	601225	陕西煤业	6,300	76,860.00	0.16
134	601138	工业富联	6,400	76,288.00	0.16
135	601600	中国铝业	12,500	76,125.00	0.16
136	601857	中国石油	15,500	76,105.00	0.16
137	002008	大族激光	1,400	75,600.00	0.16
138	600009	上海机场	1,600	74,704.00	0.16
139	000733	振华科技	600	74,568.00	0.16
140	300433	蓝思科技	3,200	73,536.00	0.15
141	002050	三花智控	2,900	73,370.00	0.15

142	002202	金风科技	4,400	72,468.00	0.15
143	600150	中国船舶	2,900	71,891.00	0.15
144	601009	南京银行	8,000	71,680.00	0.15
145	600426	华鲁恒升	2,270	71,051.00	0.15
146	600741	华域汽车	2,500	70,750.00	0.15
147	300759	康龙化成	500	70,635.00	0.15
148	600176	中国巨石	3,858	70,215.60	0.15
149	300316	晶盛机电	1,000	69,500.00	0.15
150	001979	招商蛇口	5,200	69,368.00	0.15
151	300601	康泰生物	700	68,978.00	0.14
152	300413	芒果超媒	1,200	68,664.00	0.14
153	002236	大华股份	2,900	68,092.00	0.14
154	600011	华能国际	7,000	67,830.00	0.14
155	688008	澜起科技	800	67,096.00	0.14
156	000723	美锦能源	4,100	66,543.00	0.14
157	600522	中天科技	3,900	66,144.00	0.14
158	601100	恒立液压	800	65,440.00	0.14
159	601615	明阳智能	2,500	65,250.00	0.14
160	600157	永泰能源	35,700	64,974.00	0.14
161	300751	迈为股份	100	64,230.00	0.13
162	688012	中微公司	500	63,300.00	0.13
163	601939	建设银行	10,800	63,288.00	0.13
164	603993	洛阳钼业	11,300	63,054.00	0.13
165	600989	宝丰能源	3,600	62,496.00	0.13
166	002384	东山精密	2,300	62,330.00	0.13
167	600884	杉杉股份	1,900	62,263.00	0.13
168	600584	长电科技	2,000	62,040.00	0.13
169	600399	抚顺特钢	2,500	61,925.00	0.13
170	600926	杭州银行	4,800	61,536.00	0.13
171	601066	中信建投	2,100	61,425.00	0.13
172	600760	中航沈飞	900	61,236.00	0.13
173	000977	浪潮信息	1,700	60,911.00	0.13
174	601006	大秦铁路	9,500	60,800.00	0.13
175	000009	中国宝安	4,200	60,606.00	0.13
176	600132	重庆啤酒	400	60,528.00	0.13
177	603486	科沃斯	400	60,380.00	0.13
178	605358	立昂微	500	60,005.00	0.13
179	600885	宏发股份	800	59,712.00	0.12
180	002602	世纪华通	7,100	59,569.00	0.12
181	002555	三七互娱	2,200	59,444.00	0.12
182	600600	青岛啤酒	600	59,400.00	0.12
183	003816	中国广核	18,900	59,157.00	0.12
184	601117	中国化学	4,900	58,800.00	0.12
185	601360	三六零	4,600	58,512.00	0.12

186	002013	中航机电	3,200	58,176.00	0.12
187	300033	同花顺	400	57,832.00	0.12
188	688005	容百科技	500	57,790.00	0.12
189	601555	东吴证券	6,500	57,590.00	0.12
190	601868	中国能建	21,028	57,406.44	0.12
191	000157	中联重科	8,000	57,360.00	0.12
192	000786	北新建材	1,600	57,328.00	0.12
193	601186	中国铁建	7,300	56,940.00	0.12
194	300037	新宙邦	500	56,500.00	0.12
195	000963	华东医药	1,400	56,280.00	0.12
196	000876	新希望	3,700	56,277.00	0.12
197	603882	金域医学	500	55,685.00	0.12
198	300285	国瓷材料	1,300	55,341.00	0.12
199	600015	华夏银行	9,800	54,880.00	0.11
200	601238	广汽集团	3,600	54,684.00	0.11
201	600547	山东黄金	2,900	54,578.00	0.11
202	002385	大北农	5,200	54,548.00	0.11
203	600029	南方航空	8,000	54,480.00	0.11
204	603369	今世缘	1,000	54,400.00	0.11
205	002601	龙佰集团	1,900	54,321.00	0.11
206	002736	国信证券	4,700	53,956.00	0.11
207	300363	博腾股份	600	53,670.00	0.11
208	300896	爱美客	100	53,611.00	0.11
209	603392	万泰生物	240	53,160.00	0.11
210	600352	浙江龙盛	4,200	53,046.00	0.11
211	000425	徐工机械	8,800	52,712.00	0.11
212	002007	华兰生物	1,800	52,452.00	0.11
213	603019	中科曙光	1,900	52,383.00	0.11
214	688099	晶晨股份	400	52,080.00	0.11
215	300088	长信科技	3,900	51,792.00	0.11
216	601901	方正证券	6,600	51,744.00	0.11
217	600886	国投电力	4,500	51,615.00	0.11
218	000938	紫光股份	2,220	50,727.00	0.11
219	601336	新华保险	1,300	50,544.00	0.11
220	600765	中航重机	1,000	50,490.00	0.11
221	002268	卫士通	900	50,346.00	0.11
222	600085	同仁堂	1,100	49,478.00	0.10
223	002028	思源电气	1,000	49,210.00	0.10
224	300628	亿联网络	600	48,870.00	0.10
225	002841	视源股份	600	48,840.00	0.10
226	000596	古井贡酒	200	48,800.00	0.10
227	600298	安琪酵母	800	48,288.00	0.10
228	601800	中国交建	5,600	48,048.00	0.10
229	600383	金地集团	3,700	47,989.00	0.10

230	601788	光大证券	3,200	47,776.00	0.10
231	002180	纳思达	1,000	47,760.00	0.10
232	600256	广汇能源	7,300	47,742.00	0.10
233	300003	乐普医疗	2,100	47,523.00	0.10
234	688036	传音控股	300	47,070.00	0.10
235	002185	华天科技	3,700	47,027.00	0.10
236	300253	卫宁健康	2,800	46,928.00	0.10
237	601916	浙商银行	13,400	46,900.00	0.10
238	600487	亨通光电	3,100	46,872.00	0.10
239	000783	长江证券	6,200	46,748.00	0.10
240	002938	鹏鼎控股	1,100	46,673.00	0.10
241	600862	中航高科	1,300	46,488.00	0.10
242	600563	法拉电子	200	46,480.00	0.10
243	000069	华侨城 A	6,600	46,464.00	0.10
244	601865	福莱特	800	46,352.00	0.10
245	300763	锦浪科技	200	46,310.00	0.10
246	300724	捷佳伟创	400	45,720.00	0.10
247	300474	景嘉微	300	45,660.00	0.10
248	600141	兴发集团	1,200	45,456.00	0.10
249	600795	国电电力	14,300	45,331.00	0.09
250	603456	九洲药业	800	45,008.00	0.09
251	600115	中国东航	8,700	44,892.00	0.09
252	600918	中泰证券	4,500	44,865.00	0.09
253	600183	生益科技	1,900	44,745.00	0.09
254	000988	华工科技	1,600	44,576.00	0.09
255	000301	东方盛虹	2,300	44,482.00	0.09
256	601108	财通证券	4,000	44,480.00	0.09
257	601636	旗滨集团	2,600	44,460.00	0.09
258	002252	上海莱士	6,500	44,330.00	0.09
259	603833	欧派家居	300	44,250.00	0.09
260	600109	国金证券	3,900	44,187.00	0.09
261	300999	金龙鱼	700	44,051.00	0.09
262	688561	奇安信	500	43,960.00	0.09
263	601111	中国国航	4,800	43,824.00	0.09
264	601155	新城控股	1,500	43,695.00	0.09
265	601618	中国中冶	11,400	43,662.00	0.09
266	600392	盛和资源	2,200	43,164.00	0.09
267	603160	汇顶科技	400	43,108.00	0.09
268	603613	国联股份	400	43,000.00	0.09
269	300058	蓝色光标	4,000	42,920.00	0.09
270	603589	口子窖	600	42,522.00	0.09
271	300595	欧普康视	740	42,453.80	0.09
272	601689	拓普集团	800	42,400.00	0.09
273	300699	光威复材	500	42,240.00	0.09

274	601168	西部矿业	3,100	42,191.00	0.09
275	603444	吉比特	100	42,185.00	0.09
276	601838	成都银行	3,500	42,000.00	0.09
277	600418	江淮汽车	2,400	41,760.00	0.09
278	603605	珀莱雅	200	41,662.00	0.09
279	603893	瑞芯微	300	41,070.00	0.09
280	600754	锦江酒店	700	41,020.00	0.09
281	603517	绝味食品	600	40,998.00	0.09
282	601799	星宇股份	200	40,850.00	0.09
283	000630	铜陵有色	11,700	40,716.00	0.09
284	002409	雅克科技	500	40,585.00	0.08
285	300136	信维通信	1,600	40,512.00	0.08
286	300677	英科医疗	700	40,488.00	0.08
287	601966	玲珑轮胎	1,100	40,205.00	0.08
288	300223	北京君正	300	40,200.00	0.08
289	600038	中直股份	500	40,150.00	0.08
290	600516	方大炭素	3,700	40,034.00	0.08
291	688208	道通科技	500	39,700.00	0.08
292	000066	中国长城	2,800	39,648.00	0.08
293	603260	合盛硅业	300	39,591.00	0.08
294	000998	隆平高科	1,700	39,542.00	0.08
295	600486	扬农化工	300	39,360.00	0.08
296	688002	睿创微纳	500	39,285.00	0.08
297	002120	韵达股份	1,900	38,874.00	0.08
298	002797	第一创业	5,300	38,796.00	0.08
299	603899	晨光文具	600	38,706.00	0.08
300	600489	中金黄金	4,700	38,681.00	0.08
301	002624	完美世界	1,900	38,589.00	0.08
302	600875	东方电气	1,800	38,556.00	0.08
303	300308	中际旭创	900	38,250.00	0.08
304	000703	恒逸石化	3,600	38,232.00	0.08
305	002138	顺络电子	1,000	38,180.00	0.08
306	000728	国元证券	4,950	38,115.00	0.08
307	603290	斯达半导	100	38,100.00	0.08
308	600362	江西铜业	1,700	37,961.00	0.08
309	601607	上海医药	1,900	37,753.00	0.08
310	300146	汤臣倍健	1,400	37,744.00	0.08
311	601077	渝农商行	9,800	37,730.00	0.08
312	600332	白云山	1,100	37,620.00	0.08
313	002080	中材科技	1,100	37,422.00	0.08
314	300529	健帆生物	700	37,310.00	0.08
315	002414	高德红外	1,540	37,283.40	0.08
316	300418	昆仑万维	1,600	37,040.00	0.08
317	688065	凯赛生物	200	36,856.00	0.08

318	002916	深南电路	300	36,546.00	0.08
319	600143	金发科技	2,900	36,482.00	0.08
320	002212	天融信	1,900	36,423.00	0.08
321	002791	坚朗五金	200	36,318.00	0.08
322	600079	人福医药	1,600	36,032.00	0.08
323	002353	杰瑞股份	900	36,000.00	0.08
324	002568	百润股份	600	35,898.00	0.08
325	603267	鸿远电子	200	35,888.00	0.08
326	300144	宋城演艺	2,500	35,800.00	0.07
327	601990	南京证券	3,600	35,676.00	0.07
328	600482	中国动力	1,800	35,460.00	0.07
329	600699	均胜电子	1,600	35,152.00	0.07
330	300676	华大基因	400	35,120.00	0.07
331	000547	航天发展	2,100	35,070.00	0.07
331	600733	北汽蓝谷	3,500	35,070.00	0.07
333	002673	西部证券	4,300	34,701.00	0.07
334	000519	中兵红箭	1,300	34,671.00	0.07
335	603127	昭衍新药	300	34,629.00	0.07
336	002044	美年健康	4,400	34,540.00	0.07
337	000039	中集集团	2,000	34,320.00	0.07
338	002439	启明星辰	1,200	34,236.00	0.07
339	600872	中炬高新	900	34,173.00	0.07
340	601021	春秋航空	600	34,080.00	0.07
341	002223	鱼跃医疗	900	34,020.00	0.07
342	300296	利亚德	3,300	33,825.00	0.07
343	603077	和邦生物	9,900	33,759.00	0.07
344	600705	中航产融	8,500	33,745.00	0.07
345	000932	华菱钢铁	6,600	33,726.00	0.07
346	600061	国投资本	4,092	33,636.24	0.07
347	688126	沪硅产业	1,300	33,566.00	0.07
348	002444	巨星科技	1,100	33,561.00	0.07
349	000807	云铝股份	3,000	33,510.00	0.07
350	600845	宝信软件	550	33,456.50	0.07
351	600233	圆通速递	2,000	33,360.00	0.07
352	002600	领益智造	4,523	33,289.28	0.07
353	600739	辽宁成大	1,700	33,184.00	0.07
354	603939	益丰药房	600	33,066.00	0.07
355	601878	浙商证券	2,500	32,950.00	0.07
356	600188	兖矿能源	1,400	32,942.00	0.07
357	002030	达安基因	1,640	32,898.40	0.07
358	000636	风华高科	1,100	32,780.00	0.07
358	600988	赤峰黄金	2,200	32,780.00	0.07
360	000708	中信特钢	1,600	32,768.00	0.07
361	002465	海格通信	3,000	32,760.00	0.07

362	002985	北摩高科	270	32,524.20	0.07
363	688396	华润微	500	32,300.00	0.07
364	603338	浙江鼎力	400	32,104.00	0.07
365	300618	寒锐钴业	400	32,072.00	0.07
366	601728	中国电信	7,400	32,042.00	0.07
367	300558	贝达药业	400	31,932.00	0.07
368	600161	天坛生物	1,100	31,856.00	0.07
369	600549	厦门钨业	1,400	31,682.00	0.07
370	000739	普洛药业	900	31,581.00	0.07
371	002273	水晶光电	1,800	31,302.00	0.07
372	601016	节能风电	4,800	31,248.00	0.07
372	000960	锡业股份	1,600	31,248.00	0.07
374	600637	东方明珠	3,300	31,185.00	0.07
375	688363	华熙生物	200	31,060.00	0.06
376	688521	芯原股份	400	30,944.00	0.06
377	300866	安克创新	300	30,750.00	0.06
378	600529	山东药玻	700	30,730.00	0.06
379	600018	上港集团	5,600	30,688.00	0.06
380	002557	洽洽食品	500	30,680.00	0.06
381	600732	爱旭股份	1,300	30,368.00	0.06
382	600521	华海药业	1,400	30,324.00	0.06
383	600177	雅戈尔	4,400	30,316.00	0.06
384	000738	航发控制	1,000	30,280.00	0.06
385	002507	涪陵榨菜	800	30,240.00	0.06
386	601198	东兴证券	2,600	30,238.00	0.06
387	002078	太阳纸业	2,600	29,874.00	0.06
388	300383	光环新网	2,000	29,680.00	0.06
389	600704	物产中大	5,000	29,600.00	0.06
390	601696	中银证券	2,200	29,590.00	0.06
391	600201	生物股份	1,800	29,430.00	0.06
392	601995	中金公司	600	29,418.00	0.06
393	002156	通富微电	1,500	29,145.00	0.06
394	601128	常熟银行	4,400	29,084.00	0.06
395	002299	圣农发展	1,200	29,004.00	0.06
396	000830	鲁西化工	1,900	28,994.00	0.06
397	600879	航天电子	3,500	28,840.00	0.06
398	600642	申能股份	3,900	28,743.00	0.06
399	300357	我武生物	500	28,650.00	0.06
400	600497	驰宏锌锗	5,700	28,443.00	0.06
401	600160	巨化股份	2,200	28,402.00	0.06
402	601216	君正集团	5,400	28,242.00	0.06
403	600369	西南证券	5,300	28,037.00	0.06
404	601162	天风证券	6,900	27,945.00	0.06
405	002739	万达电影	1,800	27,864.00	0.06

406	600027	华电国际	5,200	27,820.00	0.06
407	603198	迎驾贡酒	400	27,780.00	0.06
408	000623	吉林敖东	1,500	27,705.00	0.06
409	600039	四川路桥	2,300	27,692.00	0.06
410	002092	中泰化学	2,900	27,666.00	0.06
411	600580	卧龙电驱	1,500	27,435.00	0.06
412	600316	洪都航空	700	27,342.00	0.06
413	000983	山西焦煤	3,300	27,291.00	0.06
414	002603	以岭药业	1,380	27,048.00	0.06
415	300115	长盈精密	1,360	26,982.40	0.06
416	002373	千方科技	1,800	26,910.00	0.06
417	600372	中航电子	1,200	26,868.00	0.06
418	002131	利欧股份	10,900	26,814.00	0.06
419	601997	贵阳银行	4,100	26,691.00	0.06
420	600606	绿地控股	6,135	26,625.90	0.06
421	002422	科伦药业	1,400	26,502.00	0.06
422	000629	攀钢钒钛	6,800	26,452.00	0.06
423	002249	大洋电机	3,000	26,370.00	0.06
424	000887	中鼎股份	1,200	26,172.00	0.05
425	300017	网宿科技	3,900	26,091.00	0.05
426	002936	郑州银行	8,250	26,070.00	0.05
427	000825	太钢不锈	3,700	26,048.00	0.05
428	603707	健友股份	620	26,040.00	0.05
428	000050	深天马 A	2,000	26,040.00	0.05
430	300070	碧水源	3,600	25,884.00	0.05
431	600655	豫园股份	2,500	25,750.00	0.05
432	002191	劲嘉股份	1,700	25,721.00	0.05
433	600803	新奥股份	1,400	25,704.00	0.05
434	600170	上海建工	7,100	25,560.00	0.05
435	600166	福田汽车	7,400	25,456.00	0.05
436	002508	老板电器	700	25,214.00	0.05
437	300009	安科生物	1,920	25,132.80	0.05
438	000027	深圳能源	3,100	25,110.00	0.05
439	002506	协鑫集成	6,600	25,080.00	0.05
440	000750	国海证券	6,100	25,071.00	0.05
441	600536	中国软件	500	24,965.00	0.05
442	002266	浙富控股	3,500	24,920.00	0.05
443	300001	特锐德	1,000	24,870.00	0.05
444	300168	万达信息	1,900	24,738.00	0.05
445	002926	华西证券	2,500	24,625.00	0.05
446	002056	横店东磁	1,300	24,531.00	0.05
447	600153	建发股份	2,700	24,489.00	0.05
448	600909	华安证券	4,520	24,453.20	0.05
449	600118	中国卫星	900	24,435.00	0.05

450	300251	光线传媒	1,900	24,415.00	0.05
451	600236	桂冠电力	3,800	24,396.00	0.05
452	002372	伟星新材	1,000	24,320.00	0.05
453	002024	苏宁易购	5,900	24,308.00	0.05
454	600859	王府井	900	24,300.00	0.05
455	600315	上海家化	600	24,246.00	0.05
456	600066	宇通客车	2,200	24,244.00	0.05
457	002065	东华软件	3,100	24,180.00	0.05
458	002157	正邦科技	2,500	24,150.00	0.05
459	000513	丽珠集团	600	24,126.00	0.05
460	600867	通化东宝	2,200	24,112.00	0.05
461	600271	航天信息	1,800	24,102.00	0.05
462	002683	宏大爆破	800	24,096.00	0.05
463	000999	华润三九	700	23,968.00	0.05
464	002221	东华能源	1,900	23,921.00	0.05
465	600008	首创环保	7,010	23,904.10	0.05
466	002152	广电运通	2,000	23,800.00	0.05
467	600848	上海临港	1,600	23,792.00	0.05
468	600535	天士力	1,500	23,775.00	0.05
469	000021	深科技	1,500	23,760.00	0.05
470	600348	华阳股份	2,000	23,700.00	0.05
471	002002	鸿达兴业	3,900	23,634.00	0.05
472	002203	海亮股份	1,900	23,617.00	0.05
473	002607	中公教育	3,000	23,580.00	0.05
474	000997	新大陆	1,300	23,556.00	0.05
475	600258	首旅酒店	900	23,517.00	0.05
476	601881	中国银河	2,100	23,499.00	0.05
476	300244	迪安诊断	700	23,499.00	0.05
478	601933	永辉超市	5,800	23,490.00	0.05
478	000400	许继电气	900	23,490.00	0.05
480	000975	银泰黄金	2,660	23,354.80	0.05
481	300463	迈克生物	800	23,352.00	0.05
482	300212	易华录	660	23,331.00	0.05
483	002408	齐翔腾达	2,220	23,310.00	0.05
484	000656	金科股份	5,200	23,296.00	0.05
485	002500	山西证券	3,500	23,100.00	0.05
486	600171	上海贝岭	900	23,094.00	0.05
487	603218	日月股份	700	23,065.00	0.05
488	002064	华峰化学	2,200	22,968.00	0.05
489	000878	云南铜业	1,700	22,729.00	0.05
490	603156	养元饮品	800	22,728.00	0.05
491	300026	红日药业	2,900	22,707.00	0.05
492	601998	中信银行	4,900	22,638.00	0.05
493	601699	潞安环能	2,000	22,620.00	0.05

494	000970	中科三环	1,400	22,470.00	0.05
495	601005	重庆钢铁	10,700	22,363.00	0.05
496	300024	机器人	2,000	22,340.00	0.05
497	002572	索菲亚	1,000	22,200.00	0.05
498	600998	九州通	1,500	22,080.00	0.05
499	600511	国药股份	700	22,071.00	0.05
500	300630	普利制药	400	22,016.00	0.05
501	603568	伟明环保	600	21,918.00	0.05
502	002294	信立泰	800	21,856.00	0.05
503	000012	南玻A	2,200	21,846.00	0.05
504	002153	石基信息	760	21,842.40	0.05
505	002511	中顺洁柔	1,300	21,723.00	0.05
506	000537	广宇发展	900	21,690.00	0.05
507	603712	七一二	500	21,650.00	0.05
508	601319	中国人保	4,600	21,620.00	0.05
509	002250	联化科技	1,200	21,564.00	0.05
510	002195	二三四五	9,200	21,528.00	0.05
511	688006	杭可科技	200	21,516.00	0.05
512	002127	南极电商	3,100	21,390.00	0.04
513	300315	掌趣科技	4,400	21,384.00	0.04
514	600415	小商品城	4,400	21,340.00	0.04
515	600673	东阳光	2,400	21,312.00	0.04
516	601872	招商轮船	5,180	21,238.00	0.04
517	600801	华新水泥	1,100	21,230.00	0.04
518	002745	木林森	1,400	21,182.00	0.04
519	002019	亿帆医药	1,200	21,144.00	0.04
520	603087	甘李药业	300	21,102.00	0.04
521	603233	大参林	500	21,055.00	0.04
522	002430	杭氧股份	700	21,007.00	0.04
523	300182	捷成股份	3,300	20,889.00	0.04
524	000690	宝新能源	3,500	20,720.00	0.04
525	600970	中材国际	1,800	20,574.00	0.04
526	600863	内蒙华电	5,200	20,488.00	0.04
527	300482	万孚生物	520	20,477.60	0.04
528	688009	中国通号	4,100	20,418.00	0.04
529	000401	冀东水泥	1,700	20,332.00	0.04
530	600764	中国海防	500	20,330.00	0.04
531	600208	新潮中宝	6,800	20,264.00	0.04
532	002831	裕同科技	600	20,214.00	0.04
533	000060	中金岭南	4,100	20,131.00	0.04
534	600155	华创阳安	2,000	19,920.00	0.04
535	603866	桃李面包	700	19,880.00	0.04
536	603658	安图生物	360	19,821.60	0.04
537	600498	烽火通信	1,100	19,778.00	0.04

538	600517	国网英大	2,700	19,683.00	0.04
539	000930	中粮科技	1,800	19,566.00	0.04
540	600839	四川长虹	5,900	19,529.00	0.04
541	601866	中远海发	6,000	19,500.00	0.04
542	002505	鹏都农牧	5,100	19,482.00	0.04
543	002595	豪迈科技	700	19,432.00	0.04
544	002939	长城证券	1,500	19,425.00	0.04
545	000686	东北证券	2,200	19,316.00	0.04
546	002368	太极股份	700	19,278.00	0.04
547	600380	健康元	1,500	19,260.00	0.04
548	600390	五矿资本	3,600	19,152.00	0.04
549	600025	华能水电	2,900	19,111.00	0.04
550	300376	易事特	1,900	19,095.00	0.04
551	600718	东软集团	1,400	18,984.00	0.04
552	603858	步长制药	900	18,981.00	0.04
553	002701	奥瑞金	2,700	18,900.00	0.04
554	600500	中化国际	2,200	18,832.00	0.04
555	600216	浙江医药	1,100	18,788.00	0.04
556	601992	金隅集团	6,600	18,744.00	0.04
557	002690	美亚光电	500	18,730.00	0.04
558	601236	红塔证券	1,570	18,714.40	0.04
559	002032	苏泊尔	300	18,672.00	0.04
560	000729	燕京啤酒	2,200	18,634.00	0.04
561	600667	太极实业	2,300	18,584.00	0.04
562	600282	南钢股份	5,000	18,500.00	0.04
563	002925	盈趣科技	540	18,376.20	0.04
564	000598	兴蓉环境	2,900	18,328.00	0.04
565	600728	佳都科技	2,200	18,326.00	0.04
566	601179	中国西电	3,300	18,315.00	0.04
567	002174	游族网络	1,200	18,288.00	0.04
568	601898	中煤能源	2,900	18,241.00	0.04
569	002670	国盛金控	1,900	18,240.00	0.04
570	605499	东鹏饮料	100	18,184.00	0.04
571	600158	中体产业	1,200	18,144.00	0.04
572	002004	华邦健康	2,500	18,100.00	0.04
573	600895	张江高科	1,200	18,072.00	0.04
574	600528	中铁工业	2,200	18,062.00	0.04
575	002532	天山铝业	2,200	17,930.00	0.04
576	002382	蓝帆医疗	1,100	17,919.00	0.04
577	600985	淮北矿业	1,600	17,888.00	0.04
578	603638	艾迪精密	560	17,875.20	0.04
579	603225	新凤鸣	1,200	17,820.00	0.04
579	002128	电投能源	1,200	17,820.00	0.04
581	603883	老百姓	360	17,776.80	0.04

582	000540	中天金融	6,700	17,688.00	0.04
583	688088	虹软科技	400	17,624.00	0.04
584	002966	苏州银行	2,600	17,602.00	0.04
585	688321	微芯生物	500	17,505.00	0.04
586	600060	海信视像	1,300	17,485.00	0.04
587	300072	三聚环保	2,200	17,446.00	0.04
588	002010	传化智联	2,000	17,400.00	0.04
588	600409	三友化工	2,000	17,400.00	0.04
590	601717	郑煤机	1,500	17,385.00	0.04
591	600297	广汇汽车	6,500	17,355.00	0.04
592	600827	百联股份	1,300	17,329.00	0.04
593	002048	宁波华翔	800	17,304.00	0.04
594	000581	威孚高科	800	17,232.00	0.04
595	600567	山鹰国际	5,200	17,108.00	0.04
596	600566	济川药业	600	17,004.00	0.04
597	002958	青农商行	4,400	16,984.00	0.04
598	603927	中科软	620	16,963.20	0.04
599	600967	内蒙一机	1,400	16,730.00	0.04
599	603195	公牛集团	100	16,730.00	0.04
601	600755	厦门国贸	2,300	16,583.00	0.03
602	002183	怡亚通	2,500	16,550.00	0.03
603	300271	华宇软件	1,300	16,510.00	0.03
604	002396	星网锐捷	700	16,499.00	0.03
605	000709	河钢股份	6,700	16,482.00	0.03
606	000778	新兴铸管	3,800	16,454.00	0.03
607	600507	方大特钢	2,100	16,380.00	0.03
608	600782	新钢股份	3,100	16,368.00	0.03
609	002075	沙钢股份	2,800	16,324.00	0.03
610	002281	光迅科技	700	16,303.00	0.03
611	600325	华发股份	2,700	16,254.00	0.03
612	000883	湖北能源	3,100	16,244.00	0.03
613	002434	万里扬	1,100	16,214.00	0.03
614	600820	隧道股份	3,000	16,140.00	0.03
615	601231	环旭电子	1,000	16,060.00	0.03
616	600598	北大荒	1,100	16,016.00	0.03
617	600737	中粮糖业	1,700	15,980.00	0.03
618	603885	吉祥航空	900	15,975.00	0.03
619	000990	诚志股份	1,000	15,820.00	0.03
620	600329	中新药业	500	15,705.00	0.03
621	000987	越秀金控	1,800	15,660.00	0.03
622	601577	长沙银行	2,000	15,620.00	0.03
623	600022	山东钢铁	8,700	15,573.00	0.03
624	601880	辽港股份	9,000	15,570.00	0.03
625	000800	一汽解放	1,500	15,435.00	0.03

626	600021	上海电力	1,200	15,384.00	0.03
627	601456	国联证券	1,100	15,367.00	0.03
628	601106	中国一重	4,400	15,312.00	0.03
629	600131	国网信通	700	15,295.00	0.03
630	002146	荣盛发展	3,500	15,225.00	0.03
631	600663	陆家嘴	1,400	15,204.00	0.03
632	603650	彤程新材	300	15,096.00	0.03
633	600707	彩虹股份	2,200	15,004.00	0.03
634	600572	康恩贝	3,000	15,000.00	0.03
635	600435	北方导航	1,400	14,952.00	0.03
636	002390	信邦制药	2,000	14,840.00	0.03
637	002705	新宝股份	600	14,820.00	0.03
638	600259	广晟有色	300	14,772.00	0.03
639	002124	天邦股份	2,280	14,683.20	0.03
640	600597	光明乳业	1,000	14,520.00	0.03
641	601778	晶科科技	1,700	14,501.00	0.03
642	000488	晨鸣纸业	2,000	14,480.00	0.03
643	600811	东方集团	4,800	14,448.00	0.03
644	002440	闰土股份	1,500	14,385.00	0.03
645	600446	金证股份	1,000	14,320.00	0.03
646	601118	海南橡胶	2,700	14,256.00	0.03
647	000898	鞍钢股份	3,800	14,250.00	0.03
648	002867	周大生	800	14,224.00	0.03
649	001914	招商积余	700	14,182.00	0.03
650	002429	兆驰股份	2,900	14,094.00	0.03
651	300166	东方国信	1,300	14,040.00	0.03
652	600808	马钢股份	3,800	14,022.00	0.03
653	000559	万向钱潮	2,200	14,014.00	0.03
654	600037	歌华有线	1,600	13,888.00	0.03
655	601200	上海环境	1,100	13,849.00	0.03
656	603228	景旺电子	400	13,812.00	0.03
657	000877	天山股份	900	13,779.00	0.03
658	002233	塔牌集团	1,300	13,754.00	0.03
659	002416	爱施德	1,200	13,656.00	0.03
660	600026	中远海能	2,300	13,616.00	0.03
661	002110	三钢闽光	2,000	13,600.00	0.03
662	600373	中文传媒	1,100	13,596.00	0.03
663	600167	联美控股	1,500	13,515.00	0.03
664	601808	中海油服	900	13,500.00	0.03
665	002155	湖南黄金	1,300	13,468.00	0.03
666	600398	海澜之家	2,100	13,461.00	0.03
667	002081	金螳螂	2,200	13,376.00	0.03
668	601000	唐山港	4,800	13,200.00	0.03
669	002085	万丰奥威	2,400	13,176.00	0.03

670	600546	山煤国际	1,600	13,136.00	0.03
671	000528	柳 工	1,700	13,107.00	0.03
672	600064	南京高科	1,400	13,076.00	0.03
673	600195	中牧股份	1,000	13,070.00	0.03
674	600908	无锡银行	2,300	13,041.00	0.03
675	603000	人民网	900	12,978.00	0.03
676	601611	中国核建	1,300	12,961.00	0.03
677	000961	中南建设	3,100	12,834.00	0.03
678	600906	财达证券	1,000	12,760.00	0.03
679	601991	大唐发电	3,900	12,636.00	0.03
680	000959	首钢股份	2,200	12,606.00	0.03
681	601718	际华集团	4,200	12,516.00	0.03
682	601608	中信重工	2,800	12,488.00	0.03
683	000158	常山北明	1,800	12,456.00	0.03
684	000685	中山公用	1,400	12,390.00	0.03
685	000090	天健集团	2,100	12,327.00	0.03
686	300133	华策影视	1,800	12,186.00	0.03
687	600120	浙江东方	2,740	12,110.80	0.03
688	601333	广深铁路	5,400	12,096.00	0.03
689	002387	维信诺	1,300	12,064.00	0.03
690	000758	中色股份	2,200	12,012.00	0.03
691	002038	双鹭药业	1,100	11,891.00	0.02
692	600376	首开股份	2,100	11,886.00	0.02
693	688289	圣湘生物	200	11,800.00	0.02
694	000671	阳 光 城	3,900	11,778.00	0.02
695	000089	深圳机场	1,600	11,712.00	0.02
696	002242	九阳股份	500	11,600.00	0.02
697	601698	中国卫通	800	11,512.00	0.02
698	600582	天地科技	2,600	11,388.00	0.02
699	000415	渤海租赁	3,900	11,349.00	0.02
700	000718	苏宁环球	2,400	11,304.00	0.02
701	600126	杭钢股份	2,200	11,286.00	0.02
702	601598	中国外运	2,500	11,200.00	0.02
703	300257	开山股份	700	11,116.00	0.02
704	000028	国药一致	300	11,094.00	0.02
705	601975	招商南油	5,500	11,055.00	0.02
706	600307	酒钢宏兴	5,000	11,000.00	0.02
707	000967	盈峰环境	1,500	10,995.00	0.02
708	003022	联泓新科	300	10,932.00	0.02
709	600643	爱建集团	1,600	10,816.00	0.02
710	000402	金 融 街	1,900	10,754.00	0.02
711	001965	招商公路	1,400	10,738.00	0.02
712	600062	华润双鹤	800	10,696.00	0.02
713	600959	江苏有线	3,200	10,528.00	0.02

714	601098	中南传媒	1,100	10,527.00	0.02
715	000563	陕国投 A	3,200	10,336.00	0.02
716	601958	金铂股份	1,500	10,275.00	0.02
717	002399	海普瑞	600	10,260.00	0.02
718	002458	益生股份	900	10,179.00	0.02
719	002815	崇达技术	600	10,110.00	0.02
720	002563	森马服饰	1,300	10,049.00	0.02
721	003035	南网能源	1,200	9,948.00	0.02
722	600266	城建发展	2,200	9,900.00	0.02
723	600556	天下秀	800	9,880.00	0.02
724	601860	紫金银行	2,900	9,715.00	0.02
725	601928	凤凰传媒	1,200	9,708.00	0.02
726	600901	江苏租赁	1,900	9,671.00	0.02
727	600968	海油发展	3,300	9,669.00	0.02
728	600717	天津港	2,300	9,637.00	0.02
729	300741	华宝股份	200	9,570.00	0.02
730	600835	上海机电	600	9,552.00	0.02
731	000717	韶钢松山	2,000	9,500.00	0.02
732	600928	西安银行	2,200	9,460.00	0.02
733	600056	中国医药	800	9,448.00	0.02
734	000937	冀中能源	1,700	9,367.00	0.02
735	002244	滨江集团	2,000	9,320.00	0.02
736	603317	天味食品	340	9,115.40	0.02
737	600095	湘财股份	900	9,108.00	0.02
738	002423	中粮资本	1,100	8,910.00	0.02
739	600006	东风汽车	1,300	8,853.00	0.02
740	600787	中储股份	1,400	8,736.00	0.02
741	600649	城投控股	2,100	8,631.00	0.02
742	600299	安迪苏	700	8,624.00	0.02
743	000062	深圳华强	500	8,615.00	0.02
744	601969	海南矿业	700	8,407.00	0.02
745	002424	贵州百灵	1,100	8,360.00	0.02
746	600339	中油工程	2,700	8,316.00	0.02
747	300888	稳健医疗	100	8,245.00	0.02
748	600623	华谊集团	900	8,190.00	0.02
749	002468	申通快递	900	8,181.00	0.02
750	002653	海思科	400	8,160.00	0.02
751	300869	康泰医学	200	8,110.00	0.02
752	600776	东方通信	700	8,057.00	0.02
753	603786	科博达	100	8,030.00	0.02
754	601139	深圳燃气	900	7,947.00	0.02
755	600648	外高桥	600	7,938.00	0.02
756	000031	大悦城	2,100	7,833.00	0.02
757	600729	重庆百货	300	7,806.00	0.02

758	600639	浦东金桥	600	7,662.00	0.02
759	002375	亚厦股份	1,000	7,490.00	0.02
760	600871	石化油服	3,300	7,062.00	0.01
761	603355	莱克电气	240	7,036.80	0.01
762	603379	三美股份	300	6,834.00	0.01
763	002945	华林证券	500	6,830.00	0.01
764	001872	招商港口	400	6,780.00	0.01
765	000156	华数传媒	800	6,768.00	0.01
766	601228	广州港	2,000	6,660.00	0.01
767	603708	家家悦	400	6,656.00	0.01
768	601156	东航物流	300	6,564.00	0.01
769	601869	长飞光纤	200	6,548.00	0.01
770	002302	西部建设	800	6,424.00	0.01
771	000046	泛海控股	3,400	6,392.00	0.01
772	000869	张裕 A	200	6,372.00	0.01
773	601298	青岛港	1,100	6,259.00	0.01
774	603515	欧普照明	300	6,228.00	0.01
775	601828	美凯龙	700	6,167.00	0.01
776	600377	宁沪高速	700	6,034.00	0.01
777	001203	大中矿业	400	6,032.00	0.01
778	002948	青岛银行	1,300	6,019.00	0.01
779	000553	安道麦 A	700	5,908.00	0.01
780	600823	世茂股份	1,800	5,904.00	0.01
781	601568	北元集团	700	5,691.00	0.01
782	600657	信达地产	1,400	5,222.00	0.01
783	600350	山东高速	1,000	5,160.00	0.01
784	603056	德邦股份	500	5,115.00	0.01
785	002901	大博医疗	100	5,062.00	0.01
786	600466	蓝光发展	2,400	4,896.00	0.01
787	002946	新乳业	300	4,782.00	0.01
788	601665	齐鲁银行	800	4,464.00	0.01
789	603868	飞科电器	100	4,342.00	0.01
790	603719	良品铺子	100	4,247.00	0.01
791	600917	重庆燃气	500	4,195.00	0.01
792	601003	柳钢股份	800	4,176.00	0.01
793	600903	贵州燃气	400	3,872.00	0.01
794	601187	厦门银行	500	3,450.00	0.01
795	600956	新天绿能	200	3,442.00	0.01
796	603983	丸美股份	100	3,187.00	0.01

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	001234	泰慕士	194	3,206.82	0.01
---	--------	-----	-----	----------	------

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	600519	贵州茅台	2,072,426.00	3.08
2	300750	宁德时代	1,500,105.22	2.23
3	000858	五粮液	1,367,723.00	2.03
4	000333	美的集团	1,222,599.00	1.82
5	002415	海康威视	994,738.00	1.48
6	300059	东方财富	901,016.00	1.34
7	002812	恩捷股份	802,260.00	1.19
8	000651	格力电器	745,672.00	1.11
9	002594	比亚迪	741,323.00	1.10
10	000001	平安银行	669,163.00	0.99
11	002475	立讯精密	657,618.00	0.98
12	000725	京东方 A	627,660.00	0.93
13	000568	泸州老窖	626,143.00	0.93
14	002049	紫光国微	619,620.00	0.92
15	002304	洋河股份	565,958.00	0.84
16	300347	泰格医药	563,874.00	0.84
17	000002	万科 A	522,630.00	0.78
18	002714	牧原股份	515,171.00	0.77
19	300122	智飞生物	508,506.00	0.76
20	300015	爱尔眼科	467,842.26	0.70

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。

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	2,155,517.00	3.20
2	000333	美的集团	1,714,355.04	2.55
3	002415	海康威视	1,168,210.99	1.74
4	600519	贵州茅台	1,167,210.00	1.73
5	300059	东方财富	1,157,919.20	1.72
6	000651	格力电器	1,100,492.00	1.64
7	002594	比亚迪	951,548.00	1.41
8	000001	平安银行	910,103.35	1.35
9	002475	立讯精密	854,744.00	1.27

10	000568	泸州老窖	854,310.00	1.27
11	002812	恩捷股份	826,857.00	1.23
12	000725	京东方 A	769,374.00	1.14
13	000002	万 科 A	750,207.00	1.11
14	002714	牧原股份	736,997.00	1.10
15	002304	洋河股份	726,614.00	1.08
16	300347	泰格医药	669,834.00	1.00
17	002049	紫光国微	643,897.00	0.96
18	300122	智飞生物	600,524.00	0.89
19	300015	爱尔眼科	573,682.00	0.85
20	002352	顺丰控股	572,443.00	0.85

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。

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

买入股票的成本（成交）总额	55,163,985.88
卖出股票的收入（成交）总额	64,215,090.24

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞

口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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

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	21,102.13
2	应收证券清算款	48,706.91
3	应收股利	-
4	应收利息	153.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,962.76

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	001234	泰慕士	3,206.82	0.01	网下新股未上市

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§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

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		中信银行股份有限公司—中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
370	121,236.2 2	33,727,200. 00	75.1876 %	11,130,200. 00	24.8124 %	9,000,000. 00	20.0636 %

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中信银行股份有限公司—中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中银基金管理有限公司	12,498,100.00	27.86%
2	华泰证券股份有限公司	6,013,100.00	13.40%
3	广发证券股份有限公司	2,795,500.00	6.23%
4	长安财富资产—中信银行—中信银行股份有限公司	2,420,500.00	5.40%
5	海南家美太阳能有限公司	1,000,000.00	2.23%
6	叶星华	552,000.00	1.23%
7	庞建新	300,000.00	0.67%
8	周旭	266,900.00	0.60%
9	陆晓敏	250,000.00	0.56%
10	周坚强	220,000.00	0.49%
11	中信银行股份有限公司—中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	9,000,000.00	20.06%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年7月16日)基金份额总额	377,857,400.00
本报告期期初基金份额总额	62,857,400.00
本报告期基金总申购份额	78,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	96,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,857,400.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

§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

本报告期内，经董事会决议通过，赵永东先生担任副执行总裁，详情请参见基金管理人 2021 年 7 月 23 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告》；陈宇先生担任首席信息官，详情请参见基金管理人 2021 年 10 月 27 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》；李道滨先生不再担任执行总裁，详情请参见基金管理人 2021 年 11 月 6 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；邢科先生担任联席投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2021 年 11 月 20 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；程明先生担任业务总监（机构销售），详情请参见基金管理人 2021 年 11 月 20 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；张家文先生担任执行总裁，详情请参见基金管理人 2022 年 1 月 1 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

本报告期内，经股东会审议同意，李道滨先生不再担任公司董事，由张家文先生担任公司董事。

2021 年 3 月 15 日，中信银行股份有限公司对外公告，李庆萍女士因工作安排原因，辞去本行董事长、执行董事及董事会战略发展委员会主席和委员职务。2021 年 6 月 23 日，中信银行股份有限公司收到《中国银保监会关于中信银行朱鹤新任职资格的批复》（银保监【2021】492 号），中国银行保险监督管理委员会（简称“银保监会”）已核准朱鹤新先生担任本行非执行董事、董事长的任职资格。2021 年 9 月 4 日，中信银行股份有限公司收到已完成法定代表人变更的工商登记手续的通知，自 2021 年 9 月 2 日起，法定代表人由李庆萍女士变更为朱鹤新先生。

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，没有涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，没有发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 30,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

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没有受稽查或处罚等情况。

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	
华创证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	74,139,981.18	62.19%	67,565.25	61.91%	-
东方证券	2	45,071,617.57	37.81%	41,570.48	38.09%	-

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

2.报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：退租民生证券上海、深圳交易单元各一个。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	132,747.52	100.00%	-	-	-	-

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	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
2	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-04
3	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-17
4	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-03-24
5	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021-03-29
6	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-29
7	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2021-03-29
8	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021-03-29

9	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
10	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-04-08
11	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
12	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
13	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-29
14	中银基金管理有限公司关于新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-21
15	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-28
16	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-06-19
17	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-07-03
18	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-07-10
19	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-07-20
20	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告	中国证监会规定媒介	2021-07-23
21	中银基金管理有限公司关于新增奕丰基金销售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公告	中国证监会规定媒介	2021-08-06
22	中银基金管理有限公司关于新增奕丰基金销售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公告	中国证监会规定媒介	2021-08-10
23	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021-08-17
24	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2021-08-17
25	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交	中国证监会规定媒介	2021-08-24

	易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告		
26	中银基金管理有限公司关于通过直销中心柜台申购基金的养老金客户实施特定申购费率的公告	中国证监会规定媒介	2021-08-30
27	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-08-30
28	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会规定媒介	2021-08-31
29	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-09-07
30	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-09-14
31	中银基金管理有限公司关于新增东方财富证券股份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公告	中国证监会规定媒介	2021-09-24
32	中银基金管理有限公司关于新增东方财富证券股份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公告	中国证监会规定媒介	2021-09-30
33	中银基金管理有限公司深圳分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2021-10-18
34	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-10-25
35	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-10-26
36	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-10-27
37	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-10-28
38	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-11-06
39	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-11-16
40	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-11-20
41	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-11-20
42	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金	中国证监会规定媒介	2021-11-30

	合同终止情形的提示性公告		
43	中银基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-02
44	中银基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-12-04
45	中银基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-06
46	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提	中国证监会规定媒介	2021-12-07
47	中银基金管理有限公司关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-09
48	中银基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-17
49	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-31
50	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定媒介	2021-12-31

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	20210823-20210915 20210917-20211231	-	14,396,900.00	1,898,800.00	12,498,100.00	27.8618%
	2	20210712-20210714 20210916-20210916 20210923-20211014	2,043,600.00	99,072,900.00	95,103,400.00	6,013,100.00	13.4049%
中信银	1	20211213-202112	-	9,000,	-	9,000,000.0	20.0636%

行股份 有限公司—中 银中证 800 交易 型开放 式指数 证券投 资基金 发起式 联接基 金		31		000.00		0	
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。</p>							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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。

13.3 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

二〇二二年三月三十日