

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：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 03 月 31 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。

基金托管人平安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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 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 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	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
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	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
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	21
§ 6 审计报告	21
6.1 审计报告的基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告	112
8.1 期末基金资产组合情况	113
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	113
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	114

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	151
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	152
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.....	153
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.....	153
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.....	153
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.....	153
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	153
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	154
8.12 投资组合报告附注.....	154
§ 9 基金份额持有人信息	155
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	155
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	156
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	157
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.....	157
§ 10 开放式基金份额变动	157
§ 11 重大事件揭示	157
11.1 基金份额持有人大会决议.....	157
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.....	157
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	157
11.4 基金投资策略的改变.....	158
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	158
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.....	158
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	158
11.8 其他重大事件.....	160
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	161
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	161
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	162
§ 13 备查文件目录	162
13.1 备查文件目录.....	162
13.2 存放地点	162
13.3 查阅方式	162

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,589,437,198.00
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 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

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。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
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，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数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		汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	李帅帅
	联系电话	021-28932888	0755-25878287

电子邮箱	service@99fund.com	LISHUAI SHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95511-3
传真	021-28932998	0755-82080387
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码	200010	518001
法定代表人	李文	谢永林

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.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
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 10 月 08 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	239,618,415.23	545,433,031.71	-190,321,764.97
本期利润	54,953,581.80	742,724,463.18	-4,466,421.67
加权平均基金份额本期利润	0.0341	0.2407	-0.0007
本期加权平均净值利润率	2.59%	22.85%	-0.07%
本期基金份额净值增长	2.04%	29.94%	0.40%

率			
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	526,489,465.14	368,660,974.90	-135,937,806.06
期末可供分配基金份额利润	0.3312	0.2056	-0.0274
期末基金资产净值	2,115,926,663.14	2,339,704,986.91	4,985,112,552.70
期末基金份额净值	1.3312	1.3046	1.0040
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	33.12%	30.46%	0.40%

注：1、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。

2、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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润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。

3.2 基金净值表现

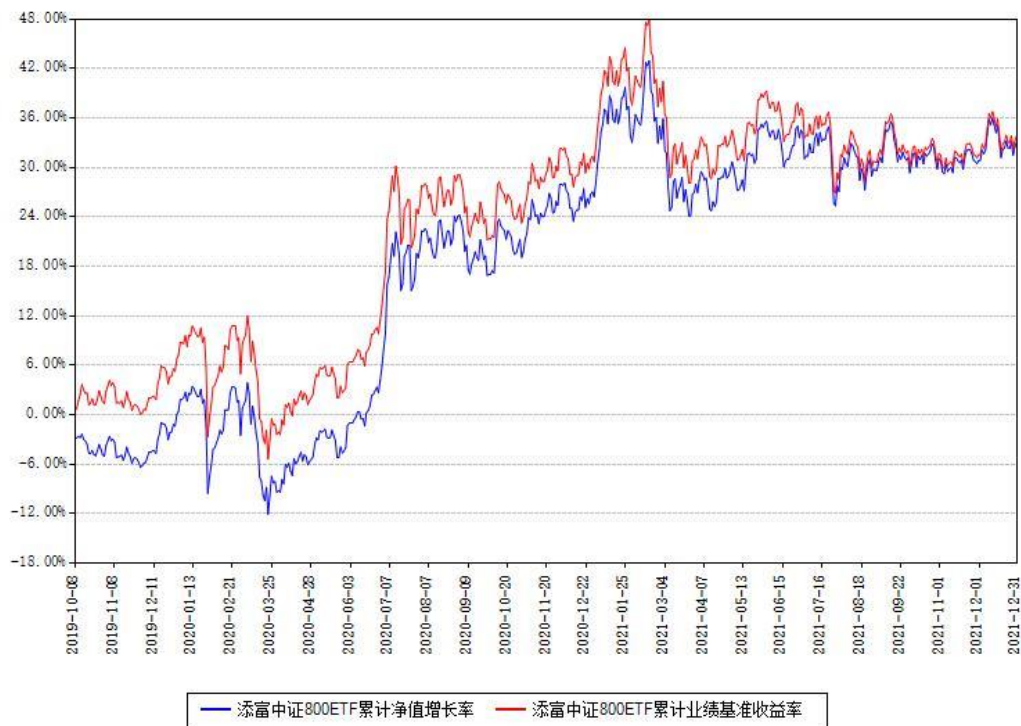
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.09%	0.73%	2.01%	0.73%	0.08%	0.00%
过去六个月	-1.04%	0.93%	-2.44%	0.93%	1.40%	0.00%
过去一年	2.04%	1.07%	-0.76%	1.07%	2.80%	0.00%
自基金合同生效日起	33.12%	1.22%	33.84%	1.23%	-0.72%	-0.01%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

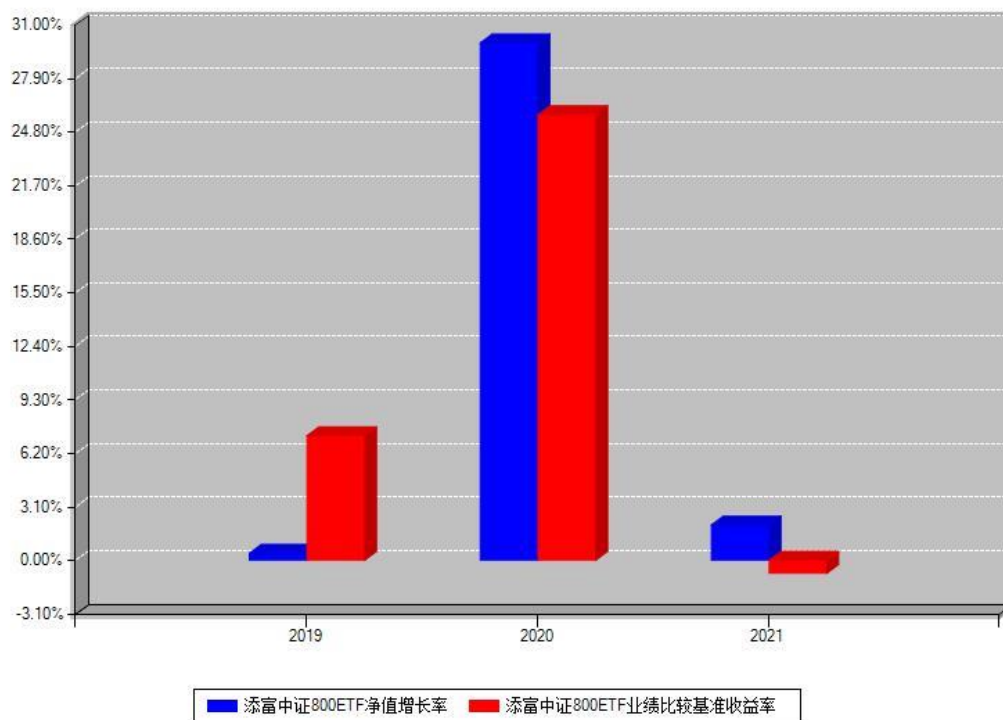
添富中证800ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019年10月08日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

添富中证800ETF每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2019 年 10 月 08 日，合同生效当年按实际存续期计算，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

注：本《基金合同》生效之日为 2019 年 10 月 08 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2021 年，汇添富基金荣获“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2021 年，汇添富基金新成立 58 只公募基金，包括 31 只混合型基金，21 只股票型基金，6 只债券型基金。2021 年底，公司公募基金产品总数达 226 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2021 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。业内开创性地打造基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁；推出包括资产分析、基金转购、亲情宝等在内的多个重磅功能，全方面提升客户体验。汇添富基金于年内取得投顾资格，展业后着力打造全自研的投顾体系，引导客户升级，上线一个月以来升级金额超十亿元，为公司业务拓展打下坚实的基础。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了客户数、活跃度、保有量的齐头并进，力争形成长期增长的良性循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

2021 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任：与银行理财公司合作深入，为银行理财净值化转型提供综合解决方案；获得所有大型银行及保险委外专户组合，且保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模、受托管理组合账户数量持续增加。

2021 年，公司以具有长久生命力、高辨识度的多策略产品体系为基础，通过“前瞻性”、“多层次”、“体系化”、“全方位”的渠道服务和投资者教育，积极利用银行以及券商线上化数字营销工具，力争切实做好客户触达、深入织好连接网络、扎实做好客户服务。全年合计开展超 4000 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动，营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2021 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2021 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式继续深化，并发挥显著成效，国际业务总资产管理规模稳步进步，QDII 及港股通项下公募基金业绩优秀，“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2021 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星五星评级；根据彭博统计，基金在最近三年、五年同类港股基金中业绩分别列第三、第一位。

2021 年，汇添富基金全力助推“共同富裕”，深耕“河流·孩子”项目支持中西部乡村教育发展，投身农业升级、旅游扶持、人才培育等项目赋能乡村全面振兴；同时，在河南、山西灾情发生后第一时间支援灾区抢险防汛、重建家园。在乡村教育发展方面，汇添富连续第十四年开展“河流·孩子”公益助学计划，项目组在做好疫情防护的同时积极邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”提供公益服务，并顺利开展第十四届“河流·孩子”2021 乡村优秀青年教师培训，邀请不同领域的专家为来沪的 88 名乡村青年教师和校长们讲授多元化课程。截至目前，“河流·孩子”项目先后援建 10 所“添富小学”，培训乡村教师、校长超 1,400 人次，受益学生超 10,000 名，累计组织 80 多场“添富之爱”公益行，1,000 多人次志愿者提供公益服务 3 万多小时。在乡村产业振兴方面，汇添富先后在汾西县开展建档立卡贫困学生资助项目，支持内蒙古兴和县开展乡村旅游扶贫项目和返乡青年创业发展特色种植业项目，捐助云南省普洱市孟连县芒信镇海东村开展“千户万头”肉牛养殖场示范产业项目基础设施建设，为推动当地产业脱贫而不懈努力。在应急救灾方面，2021 年 7 月，汇添富第一时间捐赠 300 万元人民币紧急驰援河南特大水灾，全力支持鹤壁、新乡等灾区抢险救灾工作；2021 年 10 月，汇添富再次迅速展开山西水灾支援工作，紧急筹措了 6000 多件总价值 100 万元的救援物资和生活物资，连夜送至山西省临汾市、晋中市、运城市 14 个汛情重灾县的最前线；同时向孝义市捐赠 100 万元，帮助受灾地区群众尽快恢复正常生活，以及灾区灾后重建、生产恢复、防疫消杀等工作。

2022 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019年10月08日		7	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分分析师。2019年4月15日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年7月26日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年10月8日至今任中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年4月29日至今任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年7月8日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

					<p>2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至今任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投	2019 年 10 月 08 日		10	<p>国籍: 中国。学历: 中国科学技术大学金融工程博士。</p>

	<p>资部总监助理</p>			<p>从业资格：证券投资基金从业资格。 从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部总监助理。2015年8月3日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月18日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	---------------	--	--	--

					<p>2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在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

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所

有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3

日内、5 日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的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 29 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2021 年全年市场震荡,大盘年线仅小幅收涨,但行业主题分化显著。一季度周期资源类涨幅靠前,二季度新能源、电子板块表现突出,三季度行情重回周期,四季度周期下挫、而前期下跌较多的其他板块有所修复。

近两年,经济数据受到疫情扰动,出现大起大落。GDP 累计同比数据仍有上年疫情低基数的因素,逐季下降,2021 年全年同比上年增长 8.1%,两年复合为 5.1%,全球横向比较来看仍表现出较强韧性。但四季度起国内经济稳增长压力显现,主要面临需求收缩、供给冲击和预期转弱等多重压力。叠加外部复杂环境和全球疫情升级演变,不确定性提升。12 月召开的中央政治局会议和中央经济工作会议,均指出要保持经济运行在合理区间。货币政策方面,会议指出稳健的货币政策要灵活适度,保持流动性合理充裕。随后即出现接连降准、降息。政策面稳增长发力意图明显。

资本市场方面,金融开放继续升级。今年以来北上资金已累计流入超过 4000 亿元,保持了历年来稳步流入的趋势。12 月,内地及香港两地证监会联合公告,已就 ETF 纳入互联互通标的整体方案达成共识,下一步沪深港交易所及中国结算将积极推进相关技术准备。届时北上或南下资金能够直接进行 ETF 交易,互联互通品种和标的范围进一步扩大,有望提升两地市场活跃度。

中证 800 是 A 股市场代表性宽基指数，覆盖 A 股数千只个股中市值较大、流动性较好的前 800 只股票，风格均衡，是 A 股市场核心资产的代表。而 800ETF 则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓位报告期内基本保持在 95%~100%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 2.04%。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，尽管疫情在全球各地仍有余波，但各国都势必需要逐步进入常态化运作。此前疫情期间带来的一系列宽松政策也将有序收尾。对资本市场来说，流动性收缩的预期始终悬于头顶。全球比较来看，国内经济韧性较强。且稳增长压力之下，政策信号释放明显。市场的稳增长投资主线在四季度也已经逐步浮现，预计 2022 年仍有机会延续。

2021 年全年来看，A 股市场板块切换迅速，如 2019-2020 那样的整体趋势性行情难以再现。高估值高成长板块在四季度大多经历回调，当前估值与成长性较为匹配，其中具有战略地位的新能源车、芯片等板块长期投资逻辑仍然十分清晰明确，但不可避免地存在波动相对高的风险；低估值板块以金融类为代表，能够受益于稳增长的政策背景和适度宽松的流动性环境。整体来看，权益投资还是需要以配置的思路，去着眼长期、适度均衡。

800ETF 是跟踪中证 800 指数的交易型基金产品，覆盖面广、结构均衡，是权益资产的基础性配置工具，在投资运作上将严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

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，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

深入践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，持续宣导“正直”、“客户第一”的公司价值观，不断强化公司合规文化体系建设；持续完善各项制度和流程，制定多项合规审核标准，形成多项合规管理指引，对重点业务流程实施关键风险把控，有效保障各项业务规范开展；积极为各部门提供全面的合规咨询与法务支持，加强一线合规执行；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；严格执行合规考核问责机制，认真组织和落实合规培训，不断提升全体员工的合规执业意识及合规履职能力。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查，以及对重点业务开展专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差错事件开展稽核审查，加强问责力度，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。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，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的

估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定:本基金的收益分配采用现金分红;本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。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。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

§ 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

本报告期,平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期,本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

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	安永华明（2022）审字第 60466941_B140 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	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
审计意见	我们审计了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估中证 800 交易型开放式指数证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中证 800 交易型开放式指数证券投资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。

	<p>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：</p> <p>(1) 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>(2) 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>(3) 评价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>(4) 对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，就可能导致对中证 800 交易型开放式指数证券投资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证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	许培菁 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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	上年度末
----	-----	-----	------

		2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	54,246,161.68	67,269,609.28
结算备付金		37,658,495.56	34,996,668.19
存出保证金		12,601,710.09	14,650,533.15
交易性金融资产	7.4.7.2	2,009,986,481.80	2,224,360,052.30
其中: 股票投资		2,007,588,481.80	2,223,252,052.30
基金投资		-	-
债券投资		2,398,000.00	1,108,000.00
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		4,863,087.86	-
应收利息	7.4.7.5	31,931.25	124,420.72
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		2,119,387,868.24	2,341,401,283.64
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		2,443,643.71	486,026.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		269,214.55	285,169.14
应付托管费		89,738.20	95,056.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	223,350.97	330,587.86
应交税费		77,629.38	128,479.32
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	357,628.29	370,977.36
负债合计		3,461,205.10	1,696,296.73
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,589,437,198.00	1,793,437,198.00
未分配利润	7.4.7.10	526,489,465.14	546,267,788.91
所有者权益合计		2,115,926,663.14	2,339,704,986.91

负债和所有者权益总计		2,119,387,868.24	2,341,401,283.64
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3312 元，基金份额总额 1,589,437,198.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日 至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		62,111,843.75	756,689,452.67
1. 利息收入		1,611,653.47	3,182,952.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	790,651.18	1,904,246.67
债券利息收入		860.48	1,301.13
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		820,141.81	1,277,404.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		244,940,344.67	550,088,875.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	199,232,329.23	412,529,747.31
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	975,936.72	2,044,692.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	11,370,757.29	84,553,339.81
股利收益	7.4.7.17	33,361,321.43	50,961,095.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-184,664,833.43	197,291,431.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	224,679.04	6,126,193.50
减：二、费用		7,158,261.95	13,964,989.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,186,847.78	4,898,955.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,062,282.63	1,632,985.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	2,030,825.65	5,948,861.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		40,936.43	304,396.47

7. 其他费用	7.4.7.21	837,369.46	1,179,790.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,953,581.80	742,724,463.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,953,581.80	742,724,463.18

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 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）	1,793,437,198.00	546,267,788.91	2,339,704,986.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,953,581.80	54,953,581.80
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）	-204,000,000.00	-74,731,905.57	-278,731,905.57
其中：1. 基金申购款	352,000,000.00	111,325,782.75	463,325,782.75
2. 基金赎回款	-556,000,000.00	-186,057,688.32	-742,057,688.32
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）	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 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）	4,965,437,198.00	19,675,354.70	4,985,112,552.70
二、本期经营活	-	742,724,463.18	742,724,463.18

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-3,172,000,000.00	-216,132,028.97	-3,388,132,028.97
其中：1. 基金申购款	1,624,000,000.00	91,368,523.02	1,715,368,523.02
2. 基金赎回款	-4,796,000,000.00	-307,500,551.99	-5,103,500,551.99
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）	1,793,437,198.00	546,267,788.91	2,339,704,986.91

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]162 号《关于准予中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效，首次设立募集规模为 6,601,437,198.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易

可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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）。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 800 指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

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

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资和债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票和债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化

所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额

入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金的收益分配采用现金分红；

(3) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。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；

(4) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》

的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

7.4.6.5 个人所得税

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

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

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

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

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	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	54,246,161.68	67,269,609.28
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	54,246,161.68	67,269,609.28

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	1,808,239,120.46	2,007,588,481.80	199,349,361.34	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,398,000.00	2,398,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,398,000.00	2,398,000.00	-
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,810,637,120.46	2,009,986,481.80	199,349,361.34	
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	1,843,911,797.	2,223,252,052.	379,340,254.77	

		53	30	
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,108,000.00	1,108,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	1,108,000.00	1,108,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,845,019,797.53	2,224,360,052.30	379,340,254.77

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	99,497,500.00	-	-	-
（股指期货投资）	99,497,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	99,497,500.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	104,802,360.00	-	-	-
（股指期货投资）	104,802,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	104,802,360.00	-	-	-

注：本期末 2021 年 12 月 31 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC2203	22	31,863,400.00	32,145,520.00	282,120.00
IF2203	8	12,158,940.00	11,881,440.00	-277,500.00
IF2206	37	55,475,160.00	54,603,120.00	-872,040.00
总额合计：		-867,420.00		

减：可抵销期货暂收款 -867,420.00

股指期货投资净额： 0.00

上年度末 2020 年 12 月 31 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC2101	19	23,753,040.00	24,106,440.00	353,400.00
IF2101	54	81,049,320.00	84,502,440.00	3,453,120.00
总额合计：		3,806,520.00		

减：可抵销期货暂收款 3,806,520.00

股指期货投资净额： 0.00

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

注：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

注：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	5,722.74	7,185.49
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	17,079.59	15,264.05
应收债券利息	52.56	87.43
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	9,015.31	101,321.76
其他	61.05	561.99
合计	31,931.25	124,420.72

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

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	223,350.97	330,587.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	223,350.97	330,587.86

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	-	-
应付审计费	80,000.00	80,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	157,628.29	170,977.36
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
其他	-	-
合计	357,628.29	370,977.36

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,793,437,198.00	1,793,437,198.00
本期申购	352,000,000.00	352,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-556,000,000.00	-556,000,000.00
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	1,589,437,198.00	1,589,437,198.00

注：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	368,660,974.90	177,606,814.01	546,267,788.91
本期利润	239,618,415.23	-184,664,833.43	54,953,581.80
本期基金份额交易产生的变动数	-49,479,773.22	-25,252,132.35	-74,731,905.57
其中：基金申购款	97,232,897.90	14,092,884.85	111,325,782.75
基金赎回款	-146,712,671.12	-39,345,017.20	-186,057,688.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	558,799,616.91	-32,310,151.77	526,489,465.14

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	266,392.89	719,185.98
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	518,625.50	1,162,004.17
其他	5,632.79	23,056.52
合计	790,651.18	1,904,246.67

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	139,850,845.94	279,668,000.45
股票投资收益——赎回差价收入	59,381,483.29	132,861,746.86
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	199,232,329.23	412,529,747.31
----	----------------	----------------

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	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	783,127,124.73	2,937,712,555.70
减：卖出股票成本总额	643,276,278.79	2,658,044,555.25
买卖股票差价收入	139,850,845.94	279,668,000.45

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	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	742,057,688.32	5,103,500,551.99
减：现金支付赎回款总额	325,304,130.32	2,151,306,149.99
减：赎回股票成本总额	357,372,074.71	2,819,332,655.14
赎回差价收入	59,381,483.29	132,861,746.86

7.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
出借证券现金清偿总额	-	-
减：出借证券成本总额	-	-
减：应收证券出借利息	-	-
证券出借差价收入	-	-

7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01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	7,795,546.08	9,280,306.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,818,700.00	7,234,300.00
减：应收利息总额	909.36	1,314.22

买卖债券差价收入	975,936.72	2,044,692.75
----------	------------	--------------

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
外汇远期投资收益	-	-
股指期货投资收益	11,370,757.29	84,553,339.81
外汇期货投资收益	-	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	33,361,321.43	50,961,095.29
其中：证券出借权益补偿收入	719,152.87	1,064,659.80
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	33,361,321.43	50,961,095.29

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-179,990,893.43	214,955,271.47
——股票投资	-179,990,893.43	214,955,271.47
——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	-4,673,940.00	-17,663,840.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-4,673,940.00	-17,663,840.00
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	-184,664,833.43	197,291,431.47

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月 31日	2020年01月01日至2020年12月 31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	224,679.04	6,126,193.50
其他	-	-
合计	224,679.04	6,126,193.50

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12 月31日	2020年01月01日至2020年12月 31日
交易所市场交易费用	2,030,825.65	5,948,861.92
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,030,825.65	5,948,861.92

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月 31日	2020年01月01日至2020年12月 31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约 金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	-	-
指数使用费	637,369.46	979,790.92
持有人大会- 公证费	-	-
持有人大会- 律师费	-	-

开户费	-	-
上市费	-	-
其他	-	-
合计	837,369.46	1,179,790.92

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重大或有事项。

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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
平安银行股份有限公司 (“平安银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司

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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	620,827,814.34	42.50	922,432,132.83	19.30

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	3,292,006.01	42.23	2,636,418.29	28.41

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：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债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：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权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	570,091.97	56.94	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	851,821.28	36.24	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,186,847.78	4,898,955.12
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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,062,282.63	1,632,985.06

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

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

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

单位：人民币元

本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日				
关联方名	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

称				
东方 证券	1,936,458,289.00	1,277,404.74	210,334,065.00	101,321.76

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

单位：人民币元

本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率	利息收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末 应收 利息 余额
东方 证券	20210119000003 90	蓝 思 科 技	202 1 年 01 月 19 日	623,714.0 0	16,100.0 0	14	5.0 0	1,212.7 8	-	-
东方 证券	20210119000003 94	晶 盛 机 电	202 1 年 01 月 19 日	311,840.0 0	8,000.00	14	5.0 0	606.36	-	-
东方 证券	20210202000090 95	晶 盛 机 电	202 1 年 02 月 02 日	340,800.0 0	8,000.00	28	5.0 0	757.33	-	-
东方 证券	20210218000424 50	晶 盛 机 电	202 1 年 02 月 18 日	346,800.0 0	8,000.00	42	5.0 0	674.33	-	-

上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率	利息收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末 应收 利息 余额
				-	-		-	-	-	-

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2019 年 10 月 08 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	70,034,650.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	70,034,650.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例 (%)	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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 (%)
东方证券 股份有限 公司	5,560,700.00	0.35	4,539,245.00	0.25

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告

的规定。

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 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 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
平安银行	54,246,161.68	266,392.89	67,269,609.28	719,185.98

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 01 月 01 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）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	002142	宁波银行	原股东优先配售	26,070.00	520,617.90
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 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）	总金额
				-	-

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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券（及基金托管人平安银行发行的股票平安银行）。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 289,200 股，持有平安银行 671,767 股（于上年度末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 367,000 股，持有平安银行 852,267 股）。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

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年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	
300774	倍杰特	2021年07月26日	2022年02月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	
300854	中兰环保	2021年09月08日	2022年03月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	
300994	久祺股份	2021年08月02日	2022年02月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	
301017	漱玉平	2021年06月06日	2022年01月01日	新股流	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	

	民	月	月	通						
		23	05	受						
		日	日	限						
301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	
301026	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	

		日	日	限						
301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月07日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	
301041	金百泽	2021年08月02日	2022年02月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	
301046	能辉科技	2021年08月10日	2022年02月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	
301048	金鹰重工	2021年08月11日	2022年02月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	
301052	果麦文化	2021年08月23日	2022年02月28日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	
30105	远	202	202	新	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	

3	信工业	1年 08月 25日	2年 03月 01日	股 流 通 受 限						
301055	张小泉	2021年 08月 26日	2022年 03月 07日	新 股 流 通 受 限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	
301057	汇隆新材	2021年 08月 31日	2022年 03月 09日	新 股 流 通 受 限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	
301058	中粮工科	2021年 09月 01日	2022年 03月 09日	新 股 流 通 受 限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	
301062	上海艾录	2021年 09月 07日	2022年 03月 14日	新 股 流 通 受 限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	
301063	海锅股份	2021年 09月 09日	2022年 03月 24日	新 股 流 通 受 限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	
301068	大地海洋	2021年 09月 16日	2022年 03月 28日	新 股 流 通 受 限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	
301069	凯盛新	2021年 09月 09日	2022年 03月 03日	新 股 流 通 受 限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	

	材	月 16 日	月 28 日	通 受 限						
30107 2	中捷精工	2021年 09月 22日	2022年 03月 29日	新股 流 通 受 限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	
30107 3	君亭酒店	2021年 09月 22日	2022年 03月 30日	新股 流 通 受 限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	
30107 8	孩子王	2021年 09月 30日	2022年 04月 14日	新股 流 通 受 限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	
30107 9	邵阳液压	2021年 10月 11日	2022年 04月 19日	新股 流 通 受 限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	
30108 2	久盛电气	2021年 10月 14日	2022年 04月 27日	新股 流 通 受 限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	
30109 3	华兰股份	2021年 10月 21日	2022年 05月 05日	新股 流 通 受 限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	
30109 6	百诚医药	2021年 12月 13日	2022年 06月 20日	新股 流 通 受	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	

		日	日	限						
301098	金埔园林	2021年11月04日	2022年05月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	
301177	迪阿股份	2021年12月08日	2022年06月15日	新股流通受限	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	
601728	中国电信	2021年08月11日	2022年02月21日	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	
688110	东芯股份	2021年12月03日	2022年06月10日	新股流通受限	30.18	40.37	14,044	423,847.92	566,956.28	
688187	时代电气	2021年08月30日	2022年03月07日	新股流通受限	31.38	76.65	22,351	701,374.38	1,713,204.15	
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年01月06日	新股流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	
68830	大	202	202	新	21.49	60.51	34,703	745,767.47	2,099,878.5	

3	全能源	1年 07月 15日	2年 01月 24日	股 流 通 受 限						3
688670	金迪克	2021年 07月 23日	2022年 02月 07日	新 股 流 通 受 限	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	
688793	倍轻松	2021年 07月 07日	2022年 01月 17日	新 股 流 通 受 限	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	
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 01月 14日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	23,980	2,398,000.00	2,398,000.00	
7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
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
					-	-	-	-	-	

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	停牌日期	停牌	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	----	------	----	------	------	------	-----------	--------	--------	----

	名称		原因	单价		单价			
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事件停牌	30.12	2022年01月04日	31.00	30,500	1,036,612.44	918,660.00

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

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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:张)	期末估值总额
1	000333	美的集团	2022年01月10日	2022年01月10日	73.81	60,700	4,480,267.00
2	000725	京东方A	2022年01月10日	2022年01月14日	5.05	373,900	1,888,195.00
3	600438	通威股份	2022年01月10日	2022年01月10日	44.96	33,500	1,506,160.00
4	600111	北方稀土	2022年01月10日	2022年01月10日	45.80	27,000	1,236,600.00
5	002129	中环股份	2022年01月10日	2022年01月10日	41.75	28,100	1,173,175.00

			日	日				
6	000338	潍柴动力	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.89	59,000	1,055,510.00
7	601012	隆基股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	86.20	10,000	862,000.00
8	601919	中远海控	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 14 日	18.69	44,300	827,967.00
9	600999	招商证券	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.65	46,100	813,665.00
10	600905	三峡能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.51	106,500	799,815.00
11	600010	包钢股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.79	283,200	790,128.00
12	002311	海大集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	73.30	10,000	733,000.00
13	601669	中国电建	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.08	90,000	727,200.00
14	601985	中国核电	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.30	87,300	724,590.00
15	002352	顺丰控股	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	68.92	10,000	689,200.00
16	002410	广联达	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	63.98	10,000	639,800.00

			日	日				
17	600893	航发动力	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	63.46	10,000	634,600.00
18	600570	恒生电子	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	62.15	10,000	621,500.00
19	601600	中国铝业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.09	97,500	593,775.00
20	300750	宁德时代	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	588.00	1,000	588,000.00
21	002202	金风科技	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	16.47	34,300	564,921.00
22	002241	歌尔股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	54.10	10,000	541,000.00
23	002008	大族激光	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	54.00	10,000	540,000.00
24	601877	正泰电器	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	53.89	10,000	538,900.00
25	002714	牧原股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	53.36	10,000	533,600.00
26	600011	华能国际	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	9.69	54,600	529,074.00
27	002271	东方雨虹	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	52.68	10,000	526,800.00

			日	日				
28	002230	科大讯飞	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	52.51	10,000	525,100.00
29	002415	海康威视	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	52.32	10,000	523,200.00
30	600276	恒瑞医药	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	50.71	10,000	507,100.00
31	601318	中国平安	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	50.41	10,000	504,100.00
32	601615	明阳智能	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	26.10	19,000	495,900.00
33	600157	永泰能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	1.82	271,200	493,584.00
34	002475	立讯精密	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	49.20	10,000	492,000.00
35	600196	复星医药	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	48.94	10,000	489,400.00
36	600036	招商银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	48.71	10,000	487,100.00
37	601633	长城汽车	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	48.54	10,000	485,400.00
38	600660	福耀玻璃	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	47.14	10,000	471,400.00

			日	日				
39	600009	上海机场	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	46.69	10,000	466,900.00
40	688036	传音控股	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	156.90	2,900	455,010.00
41	000977	浪潮信息	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	35.83	12,600	451,458.00
42	601117	中国化学	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	12.00	37,200	446,400.00
43	600547	山东黄金	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	18.82	22,400	421,568.00
44	002602	世纪华通	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.39	49,600	416,144.00
45	600887	伊利股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	41.46	10,000	414,600.00
46	601238	广汽集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	15.19	27,000	410,130.00
47	600585	海螺水泥	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	40.30	10,000	403,000.00
48	000963	华东医药	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	40.20	10,000	402,000.00
49	600406	国电南瑞	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	40.03	10,000	400,300.00

			日	日				
50	601336	新华 保险	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	38.88	10,000	388,800.00
51	002142	宁波 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	38.28	10,000	382,800.00
52	300760	迈瑞 医疗	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	380.80	1,000	380,800.00
53	000651	格力 电器	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	37.03	10,000	370,300.00
54	000768	中航 西飞	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	36.50	10,000	365,000.00
55	000625	长安 汽车	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	15.19	23,700	360,003.00
56	000786	北新 建材	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	35.83	10,000	358,300.00
57	600862	中航 高科	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	35.76	10,000	357,600.00
58	600115	中国 东航	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.16	68,000	350,880.00
59	002185	华天 科技	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	12.71	27,300	346,983.00
60	601111	中国 国航	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	9.13	37,100	338,723.00

			日	日				
61	600392	盛和资源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	19.62	17,100	335,502.00
62	601636	旗滨集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.10	19,600	335,160.00
63	000063	中兴通讯	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	33.50	10,000	335,000.00
64	600884	杉杉股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	32.77	10,000	327,700.00
65	300782	卓胜微	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	326.80	1,000	326,800.00
66	300058	蓝色光标	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.73	30,400	326,192.00
67	600418	江淮汽车	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.40	18,400	320,160.00
68	601168	西部矿业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	13.61	23,200	315,752.00
69	000895	双汇发展	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	31.55	10,000	315,500.00
70	600426	华鲁恒升	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	31.30	10,000	313,000.00
71	002001	新和成	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	31.12	10,000	311,200.00

			日	日				
72	600584	长电科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	31.02	10,000	310,200.00
73	300223	北京君正	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	134.00	2,300	308,200.00
74	601628	中国人寿	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	30.09	10,000	300,900.00
75	600516	方大炭素	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.82	27,800	300,796.00
76	600690	海尔智家	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	29.89	10,000	298,900.00
77	600489	中金黄金	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.23	36,100	297,103.00
78	002007	华兰生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	29.14	10,000	291,400.00
79	000703	恒逸石化	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.62	27,300	289,926.00
80	000425	徐工机械	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.99	48,100	288,119.00
81	002601	龙佰集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	28.59	10,000	285,900.00
82	600741	华域汽车	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	28.30	10,000	283,000.00

			日	日				
83	000988	华工科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	27.86	10,000	278,600.00
84	600233	圆通速递	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	16.68	16,700	278,556.00
85	002212	天融信	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	19.17	14,400	276,048.00
86	603019	中科曙光	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	27.57	10,000	275,700.00
87	000519	中兵红箭	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	26.67	10,200	272,034.00
88	601601	中国太保	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	27.12	10,000	271,200.00
89	002384	东山精密	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	27.10	10,000	271,000.00
90	688111	金山办公	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	265.00	1,000	265,000.00
91	000157	中联重科	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.17	36,800	263,856.00
92	600733	北汽蓝谷	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.02	26,100	261,522.00
93	002600	领益智造	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	7.36	35,100	258,336.00

			日	日				
94	603077	和邦生物	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.41	75,400	257,114.00
95	000807	云铝股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	11.17	22,900	255,793.00
96	000039	中集集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.16	14,900	255,684.00
97	600522	中天科技	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	16.96	15,000	254,400.00
98	300296	利亚德	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.25	24,800	254,200.00
99	002050	三花智控	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	25.30	10,000	253,000.00
100	600150	中国船舶	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	24.79	10,000	247,900.00
101	000776	广发证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	24.59	10,000	245,900.00
102	002414	高德红外	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	24.21	10,000	242,100.00
103	601016	节能风电	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.51	36,700	238,917.00
104	000960	锡业股份	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	19.53	12,200	238,266.00

			日	日				
105	600183	生益科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	23.55	10,000	235,500.00
106	600188	兖矿能源	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	23.53	10,000	235,300.00
107	002236	大华股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	23.48	10,000	234,800.00
108	002273	水晶光电	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.39	13,500	234,765.00
109	000998	隆平高科	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	23.26	10,000	232,600.00
110	688521	芯原股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 14 日	77.36	3,000	232,080.00
111	600346	恒力石化	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.97	10,000	229,700.00
112	601198	东兴证券	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	11.63	19,700	229,111.00
113	000938	紫光股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.85	10,000	228,500.00
114	600031	三一重工	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.80	10,000	228,000.00
115	600900	长江电力	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	22.70	10,000	227,000.00

			日	日				
116	600549	厦门钨业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.63	10,000	226,300.00
117	002078	太阳纸业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	11.49	19,600	225,204.00
118	600079	人福医药	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.52	10,000	225,200.00
119	601088	中国神华	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.52	10,000	225,200.00
120	600704	物产中大	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.92	38,000	224,960.00
121	300383	光环新网	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 11 日	14.84	15,100	224,084.00
122	600362	江西铜业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.33	10,000	223,300.00
123	600699	均胜电子	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	21.97	10,000	219,700.00
124	600521	华海药业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	21.66	10,000	216,600.00
125	600027	华电国际	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.35	39,800	212,930.00
126	600160	巨化股份	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	12.91	16,400	211,724.00

			日	日				
127	002092	中泰化学	2022年01月10日	-	2022年01月10日	9.54	22,000	209,880.00
128	600039	四川路桥	2022年01月10日	-	2022年01月10日	12.04	17,400	209,496.00
129	000623	吉林敖东	2022年01月10日	-	2022年01月10日	18.47	11,300	208,711.00
130	000983	山西焦煤	2022年01月10日	-	2022年01月10日	8.27	25,000	206,750.00
131	600104	上汽集团	2022年01月14日	-	2022年01月14日	20.63	10,000	206,300.00
132	000708	中信特钢	2022年01月14日	-	2022年01月14日	20.48	10,000	204,800.00
133	002624	完美世界	2022年01月14日	-	2022年01月14日	20.31	10,000	203,100.00
134	002131	利欧股份	2022年01月04日	-	2022年01月14日	2.46	82,400	202,704.00
135	002373	千方科技	2022年01月10日	-	2022年01月10日	14.95	13,500	201,825.00
136	601607	上海医药	2022年01月14日	-	2022年01月14日	19.87	10,000	198,700.00
137	002603	以岭药业	2022年01月10日	-	2022年01月10日	19.60	10,100	197,960.00

			日	日				
138	000002	万科A	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	19.76	10,000	197,600.00
139	600482	中国动力	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	19.70	10,000	197,000.00
140	000825	太钢不锈	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.04	27,800	195,712.00
141	002156	通富微电	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	19.43	10,000	194,300.00
142	600803	新奥股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	18.36	10,400	190,944.00
143	601166	兴业银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	19.04	10,000	190,400.00
144	600867	通化东宝	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.96	17,300	189,608.00
145	002422	科伦药业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	18.93	10,000	189,300.00
146	002191	劲嘉股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	15.13	12,500	189,125.00
147	300168	万达信息	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	13.02	14,400	187,488.00
148	002266	浙富控股	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	7.12	26,200	186,544.00

			日	日				
149	600236	桂冠 电力	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.42	28,800	184,896.00
150	688065	凯赛 生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	184.28	1,000	184,280.00
151	002002	鸿达 兴业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.06	30,400	184,224.00
152	600008	首创 环保	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.41	53,700	183,117.00
153	600580	卧龙 电驱	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	18.29	10,000	182,900.00
154	601933	永辉 超市	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.05	45,100	182,655.00
155	002065	东华 软件	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.80	23,400	182,520.00
156	600176	中国 巨石	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	18.20	10,000	182,000.00
157	300009	安科 生物	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	13.09	13,900	181,951.00
158	002013	中航 机电	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	18.18	10,000	181,800.00
159	002493	荣盛 石化	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	18.16	10,000	181,600.00

			日	日				
160	600271	航天信息	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	13.39	13,500	180,765.00
161	000021	深科技	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	15.84	11,400	180,576.00
162	002607	中公教育	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.86	22,900	179,994.00
163	002152	广电运通	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	11.90	15,100	179,690.00
164	002408	齐翔腾达	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.50	17,100	179,550.00
165	002203	海亮股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	12.43	14,400	178,992.00
166	601211	国泰君安	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	17.89	10,000	178,900.00
167	601688	华泰证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	17.76	10,000	177,600.00
168	002221	东华能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	12.59	14,000	176,260.00
169	600989	宝丰能源	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	17.36	10,000	173,600.00
170	600348	华阳股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	11.85	14,600	173,010.00

			日	日				
171	300026	红日 药业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.83	21,900	171,477.00
172	300630	普利 制药	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	55.04	3,100	170,624.00
173	000547	航天 发展	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	16.70	10,000	167,000.00
174	000970	中科 三环	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	16.05	10,400	166,920.00
175	000012	南 玻 A	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	9.93	16,700	165,831.00
176	000878	云南 铜业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	13.37	12,400	165,788.00
177	002127	南极 电商	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.90	23,900	164,910.00
178	000001	平安 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	16.48	10,000	164,800.00
179	600201	生物 股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	16.35	10,000	163,500.00
180	002745	木林 森	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	15.13	10,800	163,404.00
181	002195	二三 四五	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	2.34	69,800	163,332.00

			日	日				
182	000723	美锦能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	16.23	10,000	162,300.00
183	300182	捷成股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.33	25,100	158,883.00
184	600535	天士力	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	15.85	10,000	158,500.00
185	600383	金地集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.97	12,200	158,234.00
186	600637	东方明珠	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.45	16,700	157,815.00
187	000690	宝新能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.92	26,500	156,880.00
188	600863	内蒙华电	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.94	39,800	156,812.00
189	600048	保利发展	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	15.63	10,000	156,300.00
190	600208	新湖中宝	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.98	52,400	156,152.00
191	600642	申能股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.37	21,100	155,507.00
192	688363	华熙生物	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	155.30	1,000	155,300.00

			日	日				
193	002739	万达电影	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	15.48	10,000	154,800.00
194	300413	芒果超媒	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	57.22	2,700	154,494.00
195	300251	光线传媒	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.85	12,000	154,200.00
196	300253	卫宁健康	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	16.76	9,200	154,192.00
197	000830	鲁西化工	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	15.26	10,000	152,600.00
198	600517	国网英大	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.29	20,900	152,361.00
199	300474	景嘉微	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	152.20	1,000	152,200.00
200	000876	新希望	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	15.21	10,000	152,100.00
201	300212	易华录	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	35.35	4,300	152,005.00
202	600487	亨通光电	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	15.12	10,000	151,200.00
203	688008	澜起科技	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	83.87	1,800	150,966.00

			日	日				
204	601788	光大 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	14.93	10,000	149,300.00
205	600988	赤峰 黄金	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	14.90	10,000	149,000.00
206	600839	四川 长虹	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.31	45,000	148,950.00
207	600380	健康 元	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	12.84	11,600	148,944.00
208	601866	中远 海发	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.25	45,800	148,850.00
209	600848	上海 临港	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	14.87	10,000	148,700.00
210	002505	鹏都 农牧	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.82	38,900	148,598.00
211	000069	华侨 城 A	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.04	21,000	147,840.00
212	300024	机器 人	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.17	13,200	147,444.00
213	600958	东方 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	14.74	10,000	147,400.00
214	600998	九州 通	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	14.72	10,000	147,200.00

			日	日				
215	600025	华能水电	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.59	22,300	146,957.00
216	300498	温氏股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	19.26	7,600	146,376.00
217	002249	大洋电机	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.79	16,600	145,914.00
218	300274	阳光电源	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	145.80	1,000	145,800.00
219	600390	五矿资本	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.32	27,400	145,768.00
220	000729	燕京啤酒	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.47	17,200	145,684.00
221	600795	国电电力	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.17	45,900	145,503.00
222	300315	掌趣科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.86	29,900	145,314.00
223	002701	奥瑞金	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.00	20,700	144,900.00
224	300088	长信科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	13.28	10,900	144,752.00
225	600170	上海建工	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	3.60	40,200	144,720.00

			日	日				
226	300033	同花顺	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	144.58	1,000	144,580.00
227	300308	中际旭创	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	42.50	3,400	144,500.00
228	600029	南方航空	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.81	21,200	144,372.00
229	000009	中国宝安	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	14.43	10,000	144,300.00
230	600718	东软集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	13.56	10,600	143,736.00
231	002385	大北农	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.49	13,700	143,713.00
232	600886	国投电力	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.47	12,500	143,375.00
233	688099	晶晨股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	130.20	1,100	143,220.00
234	600728	佳都科技	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.33	17,100	142,443.00
235	601800	中国交建	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.58	16,600	142,428.00
236	000066	中国长城	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	14.16	10,000	141,600.00

			日	日				
237	001979	招商蛇口	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	13.34	10,600	141,404.00
238	300759	康龙化成	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	141.27	1,000	141,270.00
239	002252	上海莱士	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.82	20,700	141,174.00
240	300146	汤臣倍健	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	26.96	5,200	140,192.00
241	002004	华邦健康	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.24	19,200	139,008.00
242	300144	宋城演艺	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	14.32	9,700	138,904.00
243	601881	中国银河	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.19	12,400	138,756.00
244	601179	中国西电	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.55	25,000	138,750.00
245	600282	南钢股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.70	37,500	138,750.00
246	002465	海格通信	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.92	12,700	138,684.00
247	601816	京沪高铁	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	4.83	28,700	138,621.00

			日	日				
248	600369	西南 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.29	26,200	138,598.00
249	600177	雅戈 尔	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.89	20,100	138,489.00
250	601236	红塔 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.92	11,600	138,272.00
251	300003	乐普 医疗	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.63	6,100	138,043.00
252	600655	豫园 股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.30	13,400	138,020.00
253	600606	绿地 控股	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.34	31,800	138,012.00
254	601838	成都 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.00	11,500	138,000.00
255	000598	兴蓉 环境	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.32	21,800	137,776.00
256	601992	金隅 集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.84	48,500	137,740.00
257	300244	迪安 诊断	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	33.57	4,100	137,637.00
258	601360	三六 零	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	12.72	10,800	137,376.00

			日	日				
259	002044	美年健康	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.85	17,500	137,375.00
260	600415	小商品城	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.85	28,300	137,255.00
261	002926	华西证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.85	13,900	136,915.00
262	300418	昆仑万维	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	23.15	5,900	136,585.00
263	600155	华创阳安	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.96	13,700	136,452.00
264	300072	三聚环保	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.93	17,200	136,396.00
265	600705	中航产融	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.97	34,300	136,171.00
266	002797	第一创业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.32	18,600	136,152.00
267	601390	中国中铁	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.79	23,500	136,065.00
268	601668	中国建筑	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.00	27,200	136,000.00
269	002500	山西证券	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	6.60	20,600	135,960.00

			日	日				
270	600109	国金 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.33	12,000	135,960.00
271	601998	中信 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.62	29,400	135,828.00
272	600909	华安 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.41	25,100	135,791.00
273	601186	中国 铁建	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.80	17,400	135,720.00
274	601108	财通 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.12	12,200	135,664.00
275	000750	国海 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.11	33,000	135,630.00
276	300037	新宙 邦	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	113.00	1,200	135,600.00
277	002736	国信 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.48	11,800	135,464.00
278	000540	中天 金融	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.64	51,300	135,432.00
279	000050	深天 马 A	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	13.02	10,400	135,408.00
280	000629	攀钢 钒钛	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	3.89	34,800	135,372.00

			日	日				
281	600019	宝钢股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.16	18,900	135,324.00
282	600985	淮北矿业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	11.18	12,100	135,278.00
283	300699	光威复材	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	84.48	1,600	135,168.00
284	600153	建发股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.07	14,900	135,143.00
285	600879	航天电子	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.24	16,400	135,136.00
286	688208	道通科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	79.40	1,700	134,980.00
287	000783	长江证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.54	17,900	134,966.00
288	600970	中材国际	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.43	11,800	134,874.00
289	600837	海通证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.26	11,000	134,860.00
290	601005	重庆钢铁	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.09	64,500	134,805.00
291	000728	国元证券	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	7.70	17,500	134,750.00

			日	日				
292	601328	交通银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.61	29,200	134,612.00
293	601162	天风证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.05	33,200	134,460.00
294	601006	大秦铁路	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.40	21,000	134,400.00
295	002027	分众传媒	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.19	16,400	134,316.00
296	300463	迈克生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	29.19	4,600	134,274.00
297	601288	农业银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.94	45,600	134,064.00
298	601077	渝农商行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.85	34,800	133,980.00
299	688009	中国通号	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.98	26,900	133,962.00
300	600028	中国石化	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.23	31,600	133,668.00
301	601169	北京银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.44	30,100	133,644.00
302	000656	金科股份	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	4.48	29,800	133,504.00

			日	日				
303	601916	浙商银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.50	38,100	133,350.00
304	601398	工商银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.63	28,800	133,344.00
305	002157	正邦科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.66	13,800	133,308.00
306	300529	健帆生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	53.30	2,500	133,250.00
307	600050	中国联通	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.93	33,900	133,227.00
308	300677	英科医疗	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	57.84	2,300	133,032.00
309	601939	建设银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.86	22,700	133,022.00
310	600528	中铁工业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.21	16,200	133,002.00
311	600016	民生银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.90	34,100	132,990.00
312	601988	中国银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.05	43,600	132,980.00
313	601989	中国重工	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	4.22	31,500	132,930.00

			日	日				
314	601997	贵阳银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.51	20,400	132,804.00
315	600015	华夏银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.60	23,700	132,720.00
316	601229	上海银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.13	18,600	132,618.00
317	600352	浙江龙盛	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.63	10,500	132,615.00
318	600667	太极实业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.08	16,400	132,512.00
319	601901	方正证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.84	16,900	132,496.00
320	300017	网宿科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.69	19,800	132,462.00
321	002673	西部证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.07	16,400	132,348.00
322	601138	工业富联	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.92	11,100	132,312.00
323	600066	宇通客车	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.02	12,000	132,240.00
324	600497	驰宏锌锗	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	4.99	26,500	132,235.00

			日	日				
325	300999	金龙鱼	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	62.93	2,100	132,153.00
326	601857	中国石油	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.91	26,900	132,079.00
327	300285	国瓷材料	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	42.57	3,100	131,967.00
328	601818	光大银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.32	39,700	131,804.00
329	601990	南京证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.91	13,300	131,803.00
330	601878	浙商证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	13.18	10,000	131,800.00
331	300136	信维通信	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	25.32	5,200	131,664.00
332	000401	冀东水泥	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.96	11,000	131,560.00
333	601766	中国中车	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.09	21,600	131,544.00
334	600061	国投资本	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.22	16,000	131,520.00
335	600018	上港集团	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	5.48	24,000	131,520.00

			日	日				
336	601377	兴业 证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.88	13,300	131,404.00
337	600409	三友 化工	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.70	15,100	131,370.00
338	600000	浦发 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.53	15,400	131,362.00
339	601319	中国 人保	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.70	27,900	131,130.00
340	000060	中金 岭南	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.91	26,700	131,097.00
341	300433	蓝思 科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	22.98	5,700	130,986.00
342	002958	青农 商行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.86	33,900	130,854.00
343	000975	银泰 黄金	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.78	14,900	130,822.00
344	601009	南京 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.96	14,600	130,816.00
345	002670	国盛 金控	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.60	13,600	130,560.00
346	000930	中粮 科技	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	10.87	12,000	130,440.00

			日	日				
347	300124	汇川技术	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	68.60	1,900	130,340.00
348	300628	亿联网络	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	81.45	1,600	130,320.00
349	601699	潞安环能	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.31	11,500	130,065.00
350	600919	江苏银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.83	22,300	130,009.00
351	300059	东方财富	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	37.11	3,500	129,885.00
352	601717	郑煤机	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	11.59	11,200	129,808.00
353	600755	厦门国贸	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.21	18,000	129,780.00
354	002010	传化智联	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.70	14,900	129,630.00
355	600567	山鹰国际	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.29	39,400	129,626.00
356	601898	中煤能源	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.29	20,600	129,574.00
357	000166	申万宏源	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	5.12	25,300	129,536.00

			日	日				
358	601658	邮储 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.10	25,300	129,030.00
359	600166	福田 汽车	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.44	37,500	129,000.00
360	600256	广汇 能源	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.54	19,700	128,838.00
361	300271	华宇 软件	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.70	10,100	128,270.00
362	600926	杭州 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.82	10,000	128,200.00
363	300347	泰格 医药	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	127.80	1,000	127,800.00
364	000932	华菱 钢铁	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.11	25,000	127,750.00
365	300558	贝达 药业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	79.83	1,600	127,728.00
366	000709	河钢 股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.46	51,800	127,428.00
367	688981	中芯 国际	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	52.99	2,400	127,176.00
368	688005	容百 科技	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	115.58	1,100	127,138.00

			日	日				
369	300015	爱尔眼科	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	42.28	3,000	126,840.00
370	688012	中微公司	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	126.60	1,000	126,600.00
371	000778	新兴铸管	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.33	29,200	126,436.00
372	300450	先导智能	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	74.37	1,700	126,429.00
373	601128	常熟银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.61	19,100	126,251.00
374	688599	天合光能	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	78.90	1,600	126,240.00
375	603993	洛阳钼业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.58	22,600	126,108.00
376	000100	TCL 科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.17	20,400	125,868.00
377	600500	中化国际	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.56	14,700	125,832.00
378	600143	金发科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.58	10,000	125,800.00
379	002506	协鑫集成	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	3.80	33,100	125,780.00

			日	日				
380	002183	怡亚通	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.62	19,000	125,780.00
381	688002	睿创微纳	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	78.57	1,600	125,712.00
382	601225	陕西煤业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	12.20	10,300	125,660.00
383	601618	中国中冶	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.83	32,800	125,624.00
384	002075	沙钢股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.83	21,500	125,345.00
385	002064	华峰化学	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.44	12,000	125,280.00
386	002340	格林美	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.35	12,100	125,235.00
387	601899	紫金矿业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.70	12,900	125,130.00
388	300316	晶盛机电	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	69.50	1,800	125,100.00
389	300122	智飞生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	124.60	1,000	124,600.00
390	600967	内蒙一机	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	11.95	10,400	124,280.00

			日	日				
391	600325	华发股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.02	20,600	124,012.00
392	601216	君正集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.23	23,700	123,951.00
393	688126	沪硅产业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	25.82	4,800	123,936.00
394	600820	隧道股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.38	23,000	123,740.00
395	300142	沃森生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	56.20	2,200	123,640.00
396	600782	新钢股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.28	23,300	123,024.00
397	300866	安克创新	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	102.50	1,200	123,000.00
398	300676	华大基因	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	87.80	1,400	122,920.00
399	688396	华润微	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	64.60	1,900	122,740.00
400	600918	中泰证券	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.97	12,300	122,631.00
401	600507	方大特钢	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	7.80	15,700	122,460.00

			日	日				
402	600737	中粮糖业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.40	13,000	122,200.00
403	300595	欧普康视	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	57.37	2,100	120,477.00
404	600673	东阳光	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	8.88	13,500	119,880.00
405	600022	山东钢铁	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	1.79	66,800	119,572.00
406	601880	辽港股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	1.73	69,100	119,543.00
407	600707	彩虹股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.82	17,500	119,350.00
408	688006	杭可科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	107.58	1,100	118,338.00
409	000800	一汽解放	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.29	11,500	118,335.00
410	000987	越秀金控	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.70	13,600	118,320.00
411	300601	康泰生物	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	98.54	1,200	118,248.00
412	300014	亿纬锂能	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	118.18	1,000	118,180.00

			日	日				
413	300001	特锐德	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	24.87	4,700	116,889.00
414	600435	北方导航	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.68	10,900	116,412.00
415	601106	中国一重	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.48	33,400	116,232.00
416	600663	陆家嘴	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.86	10,700	116,202.00
417	002124	天邦股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.44	17,900	115,276.00
418	601577	长沙银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.81	14,700	114,807.00
419	688561	奇安信	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	87.92	1,300	114,296.00
420	600572	康恩贝	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.00	22,700	113,500.00
421	300618	寒锐钴业	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	80.18	1,400	112,252.00
422	601118	海南橡胶	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.28	20,800	109,824.00
423	002390	信邦制药	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	7.42	14,800	109,816.00

			日	日				
424	000898	鞍钢股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.75	29,200	109,500.00
425	600811	东方集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.01	36,200	108,962.00
426	002440	闰土股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.59	11,200	107,408.00
427	002429	兆驰股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.86	22,100	107,406.00
428	600808	马钢股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.69	29,100	107,379.00
429	002233	塔牌集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	10.58	10,100	106,858.00
430	300166	东方国信	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	10.80	9,800	105,840.00
431	688321	微芯生物	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	35.01	3,000	105,030.00
432	000559	万向钱潮	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.37	16,100	102,557.00
433	600037	歌华有线	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.68	11,800	102,424.00
434	002085	万丰奥威	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	5.49	18,600	102,114.00

			日	日				
435	002110	三钢闽光	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.80	14,900	101,320.00
436	600398	海澜之家	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.41	15,800	101,278.00
437	600026	中远海能	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.92	16,900	100,048.00
438	600167	联美控股	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	9.01	11,100	100,011.00
439	601000	唐山港	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.75	36,100	99,275.00
440	002081	金螳螂	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.08	16,300	99,104.00
441	600064	南京高科	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	9.34	10,500	98,070.00
442	000528	柳工	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.71	12,600	97,146.00
443	000961	中南建设	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.14	23,300	96,462.00
444	601718	际华集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.98	32,100	95,658.00
445	000685	中山公用	2022 年 01 月 10	-	2022 年 01 月 10	8.85	10,800	95,580.00

			日	日				
446	002024	苏宁易购	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.12	23,100	95,172.00
447	300133	华策影视	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.77	13,900	94,103.00
448	002387	维信诺	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	9.28	10,100	93,728.00
449	600120	浙江东方	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.42	21,200	93,704.00
450	000959	首钢股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.73	16,300	93,399.00
451	000090	天健集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.87	15,900	93,333.00
452	000027	深圳能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	8.10	11,500	93,150.00
453	601333	广深铁路	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.24	41,400	92,736.00
454	000758	中色股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.46	16,800	91,728.00
455	000089	深圳机场	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.32	12,500	91,500.00
456	600376	首开股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.66	15,700	88,862.00

			日	日				
457	600582	天地科技	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.38	20,200	88,476.00
458	000415	渤海租赁	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.91	30,200	87,882.00
459	000718	苏宁环球	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.71	18,500	87,135.00
460	601598	中国外运	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.48	19,200	86,016.00
461	000488	晨鸣纸业	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	7.24	11,700	84,708.00
462	000967	盈峰环境	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	7.33	11,500	84,295.00
463	600126	杭钢股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.13	16,400	84,132.00
464	600307	酒钢宏兴	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.20	38,200	84,040.00
465	000402	金融街	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.66	14,500	82,070.00
466	601958	金钼股份	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	6.85	11,800	80,830.00
467	601872	招商轮船	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.10	19,700	80,770.00

			日	日				
468	600643	爱建集团	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.76	11,800	79,768.00
469	000563	陕国投 A	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.23	24,100	77,843.00
470	300257	开山股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	15.88	4,800	76,224.00
471	601860	紫金银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	3.35	22,300	74,705.00
472	600266	城建发展	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.50	16,500	74,250.00
473	600901	江苏租赁	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	5.09	14,500	73,805.00
474	600717	天津港	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	4.19	17,600	73,744.00
475	600968	海油发展	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	2.93	24,800	72,664.00
476	000937	冀中能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.51	12,900	71,079.00
477	002244	滨江集团	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.66	15,100	70,366.00
478	000717	韶钢松山	2022 年 01 月 14	-	2022 年 01 月 14	4.75	14,700	69,825.00

			日	日				
479	600928	西安 银行	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.30	16,200	69,660.00
480	600787	中储 股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	6.24	10,700	66,768.00
481	600297	广汇 汽车	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.67	24,800	66,216.00
482	600649	城投 控股	2022 年 01 月 14 日	-	2022 年 01 月 14 日	4.11	15,400	63,294.00
483	000883	湖北 能源	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	5.24	12,000	62,880.00
484	000031	大悦 城	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.73	15,600	58,188.00
485	000046	泛海 控股	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	1.88	25,300	47,564.00
486	600823	世茂 股份	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.28	13,700	44,936.00
487	600657	信达 地产	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	3.73	10,400	38,792.00
488	600466	蓝光 发展	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	2.04	18,500	37,740.00
合计	-	-	-	-	-	-	9,748,400	105,135,479.00

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财务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。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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可随时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。

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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及时变现。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资产的公允价值。

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。

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和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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	54,246,161.68	-	-	-	-	-	54,246,161.68
结算备付金	37,658,495.56	-	-	-	-	-	37,658,495.56
存	123,190.09	-	-	-	-	12,478,520.00	12,601,710.09

出保证金							
交易性金融资产	-	-	2,398,000.00	-	-	2,007,588,481.80	2,009,986,481.80
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	31,931.25	31,931.25
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,863,087.86	4,863,087.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	92,027,847.33	-	2,398,000.00	-	-	2,024,962,020.91	2,119,387,868.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	269,214.55	269,214.55
应付托管费	-	-	-	-	-	89,738.20	89,738.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,443,643.71	2,443,643.71
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	223,350.97	223,350.97
应交税费	-	-	-	-	-	77,629.38	77,629.38
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	357,628.29	357,628.29
负债总计	-	-	-	-	-	3,461,205.10	3,461,205.10
利率敏感度缺口	92,027,847.33	-	2,398,000.00	-	-	2,021,500,815.81	2,115,926,663.14
上年度末	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

2020年12月31日							
资产							
银行存款	67,269,609.28	-	-	-	-	-	67,269,609.28
结算备付金	34,996,668.19	-	-	-	-	-	34,996,668.19
存出保证金	1,135,338.75	-	-	-	-	13,515,194.40	14,650,533.15
交易性金融资产	-	-	1,108,000.00	-	-	2,223,252,052.30	2,224,360,052.30
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	124,420.72	124,420.72
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	103,401,616.22	-	1,108,000.00	-	-	2,236,891,667.42	2,341,401,283.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	285,169.14	285,169.14
应付托	-	-	-	-	-	95,056.38	95,056.38

管费							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	486,026.67	486,026.67
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	330,587.86	330,587.86
应交税费	-	-	-	-	-	128,479.32	128,479.32
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	370,977.36	370,977.36

他 负 债							
负 债 总 计	-	-	-	-	-	1,696,296.73	1,696,296.73
利 率 敏 感 度 缺 口	103,401,616. 22	-	1,108,000.0 0	-	-	2,235,195,370. 69	2,339,704,986. 91

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	2,007,588,481.80	94.88	2,223,252,052.30	95.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,398,000.00	0.11	1,108,000.00	0.05

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	2,009,986,48 1.80	94.99	2,224,360,05 2.30	95.07

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

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. 以下分析中，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：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证 800 指数 上涨 5%	105,096,262.51	115,363,521.67
	中证 800 指数 下跌 5%	-105,096,262.51	-115,363,521.67

本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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人民币 1,999,458,424.79 元,属于第二层次的余额为人民币 3,696,889.35 元,属于第三层次的余额为人民币 6,831,167.66 元(于 2020 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人民币 2,218,370,795.17 元,属于第二层次的余额为人民币 1,711,189.54 元,属于第三层次的余额为人民币 4,278,067.59 元)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币 6,831,167.66 元,期初余额为人民币 4,278,067.59 元,本期增加人民币 2,553,100.07 元。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《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。

除上述事项外,截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,007,588,481.80	94.72
	其中：股票	2,007,588,481.80	94.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,398,000.00	0.11
	其中：债券	2,398,000.00	0.11
	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	91,904,657.24	4.34
8	其他各项资产	17,496,729.20	0.83
9	合计	2,119,387,868.24	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 105,135,479.00 元，占期末基金资产净值比例 4.97%。

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	22,012,826.08	1.04
B	采矿业	51,313,581.40	2.43
C	制造业	1,185,781,085.82	56.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,639,475.40	2.58
E	建筑业	34,765,049.45	1.64
F	批发和零售业	23,653,237.61	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	51,438,324.08	2.43
H	住宿和餐饮业	2,875,499.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,073,057.99	4.26
J	金融业	357,712,666.55	16.91
K	房地产业	39,227,491.66	1.85
L	租赁和商务服务业	26,417,268.92	1.25
M	科学研究和技术服务业	27,232,862.98	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	4,110,180.50	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,006,080.00	0.05

Q	卫生和社会工作	15,640,343.32	0.74
R	文化、体育和娱乐业	10,696,168.40	0.51
S	综合	3,441,222.00	0.16
	合计	2,002,036,421.16	94.62

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	4,937,650.98	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	114,322.20	0.01
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	299,275.42	0.01
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	146,440.42	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	16,891.92	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,552,060.64	0.26

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	43,515	89,205,750.00	4.22

		台			
2	300750	宁德时代	96,900	56,977,200.00	2.69
3	600036	招商银行	856,900	41,739,599.00	1.97
4	601318	中国平安	749,956	37,805,281.96	1.79
5	000858	五粮液	134,370	29,918,824.20	1.41
6	601012	隆基股份	299,780	25,841,036.00	1.22
7	000333	美的集团	338,461	24,981,806.41	1.18
8	300059	东方财富	572,424	21,242,654.64	1.00
9	601166	兴业银行	1,006,700	19,167,568.00	0.91
10	600900	长江电力	790,177	17,937,017.90	0.85
11	002415	海康威视	323,200	16,909,824.00	0.80
12	002594	比亚迪	62,800	16,837,936.00	0.80
13	603259	药明康德	141,981	16,836,106.98	0.80
14	002475	立讯精密	341,584	16,805,932.80	0.79
15	600276	恒瑞医药	309,942	15,717,158.82	0.74
16	600030	中信证券	589,800	15,576,618.00	0.74
17	601888	中国中免	67,642	14,841,331.22	0.70
18	600887	伊利股份	355,900	14,755,614.00	0.70
19	000568	泸州老窖	50,700	12,871,209.00	0.61
20	300760	迈瑞医疗	33,700	12,832,960.00	0.61
21	000651	格力电器	327,540	12,128,806.20	0.57
22	601398	工商银行	2,426,300	11,233,769.00	0.53
23	603501	韦尔股	36,109	11,221,593.93	0.53

		份			
24	000001	平安银行	671,767	11,070,720.16	0.52
25	600309	万华化学	108,700	10,978,700.00	0.52
26	600809	山西汾酒	33,760	10,660,732.80	0.50
27	002142	宁波银行	274,470	10,506,711.60	0.50
28	300274	阳光电源	72,000	10,497,600.00	0.50
29	000725	京东方 A	2,077,300	10,490,365.00	0.50
30	002714	牧原股份	182,158	9,719,950.88	0.46
31	601899	紫金矿业	997,800	9,678,660.00	0.46
32	600031	三一重工	411,500	9,382,200.00	0.44
33	002352	顺丰控股	135,944	9,369,260.48	0.44
34	000002	万科 A	471,200	9,310,912.00	0.44
35	002812	恩捷股份	37,100	9,289,840.00	0.44
36	300014	亿纬锂能	78,383	9,263,302.94	0.44
37	603288	海天味业	87,466	9,193,551.26	0.43
38	600436	片仔癀	20,900	9,136,435.00	0.43
39	002241	歌尔股份	165,500	8,953,550.00	0.42
40	601328	交通银行	1,902,000	8,768,220.00	0.41
41	300124	汇川技术	127,250	8,729,350.00	0.41
42	600438	通威股份	187,000	8,407,520.00	0.40
43	600837	海通证券	668,400	8,194,584.00	0.39
44	601919	中远海控	438,160	8,189,210.40	0.39
45	002460	赣锋锂	55,700	7,956,745.00	0.38

		业			
46	300015	爱尔眼科	187,144	7,912,448.32	0.37
47	600690	海尔智家	262,000	7,831,180.00	0.37
48	600048	保利发展	497,200	7,771,236.00	0.37
49	600406	国电南瑞	191,904	7,681,917.12	0.36
50	002466	天齐锂业	71,600	7,661,200.00	0.36
51	603799	华友钴业	67,700	7,467,987.00	0.35
52	000063	中兴通讯	220,050	7,371,675.00	0.35
53	601668	中国建筑	1,451,900	7,259,500.00	0.34
54	601288	农业银行	2,431,000	7,147,140.00	0.34
55	688981	中芯国际	134,200	7,111,258.00	0.34
56	600000	浦发银行	812,700	6,932,331.00	0.33
57	600111	北方稀土	150,900	6,911,220.00	0.33
58	300122	智飞生物	55,300	6,890,380.00	0.33
59	002304	洋河股份	41,700	6,869,241.00	0.32
60	600016	民生银行	1,718,400	6,701,760.00	0.32
61	600585	海螺水泥	166,100	6,693,830.00	0.32
62	002230	科大讯飞	127,400	6,689,774.00	0.32
63	600745	闻泰科技	51,700	6,684,810.00	0.32
64	600104	上汽集团	323,600	6,675,868.00	0.32
65	002049	紫光国微	29,400	6,615,000.00	0.31
66	601816	京沪高铁	1,359,800	6,567,834.00	0.31

67	002129	中环股份	156,600	6,538,050.00	0.31
68	603986	兆易创新	36,968	6,500,822.80	0.31
69	002271	东方雨虹	122,300	6,442,764.00	0.30
70	601601	中国太保	236,900	6,424,728.00	0.30
71	601688	华泰证券	356,500	6,331,440.00	0.30
72	002371	北方华创	18,176	6,307,435.52	0.30
73	000661	长春高新	22,500	6,106,500.00	0.29
74	300142	沃森生物	108,400	6,092,080.00	0.29
75	000100	TCL 科技	971,300	5,992,921.00	0.28
76	300498	温氏股份	307,740	5,927,072.40	0.28
77	000338	潍柴动力	328,700	5,880,443.00	0.28
78	600893	航发动力	92,178	5,849,615.88	0.28
79	002027	分众传媒	699,800	5,731,362.00	0.27
80	300450	先导智能	75,800	5,637,246.00	0.27
81	601211	国泰君安	312,200	5,585,258.00	0.26
82	300782	卓胜微	16,100	5,261,480.00	0.25
83	601088	中国神华	228,340	5,142,216.80	0.24
84	601766	中国中车	842,000	5,127,780.00	0.24
85	600050	中国联通	1,287,200	5,058,696.00	0.24
86	000776	广发证券	204,800	5,036,032.00	0.24
87	600570	恒生电子	80,908	5,028,432.20	0.24
88	601229	上海银行	688,400	4,908,292.00	0.23
89	600919	江苏银	817,950	4,768,648.50	0.23

		行			
90	300347	泰格医药	36,300	4,639,140.00	0.22
91	600660	福耀玻璃	97,100	4,577,294.00	0.22
92	601169	北京银行	1,024,500	4,548,780.00	0.21
93	600999	招商证券	256,910	4,534,461.50	0.21
94	002709	天赐材料	39,530	4,532,114.50	0.21
95	688599	天合光能	57,300	4,520,970.00	0.21
96	600905	三峡能源	593,400	4,456,434.00	0.21
97	601988	中国银行	1,459,000	4,449,950.00	0.21
98	600019	宝钢股份	616,600	4,414,856.00	0.21
99	600010	包钢股份	1,577,900	4,402,341.00	0.21
100	002821	凯莱英	10,100	4,393,500.00	0.21
101	601669	中国电建	529,500	4,278,360.00	0.20
102	600958	东方证券	289,200	4,262,808.00	0.20
103	002311	海大集团	57,500	4,214,750.00	0.20
104	002410	广联达	65,793	4,209,436.14	0.20
105	601633	长城汽车	84,962	4,124,055.48	0.19
106	002459	晶澳科技	44,300	4,106,610.00	0.19
107	600196	复星医药	83,500	4,086,490.00	0.19
108	601390	中国中铁	704,900	4,081,371.00	0.19
109	600588	用友网络	113,250	4,063,410.00	0.19
110	601985	中国核电	485,100	4,026,330.00	0.19
111	601877	正泰电器	74,451	4,012,164.39	0.19

112	000625	长安汽车	263,840	4,007,729.60	0.19
113	000166	申万宏源	780,100	3,994,112.00	0.19
114	300408	三环集团	88,000	3,924,800.00	0.19
115	600028	中国石化	926,100	3,917,403.00	0.19
116	603659	璞泰来	24,100	3,870,701.00	0.18
117	601658	邮储银行	753,178	3,841,207.80	0.18
118	002179	中航光电	38,100	3,831,336.00	0.18
119	002493	荣盛石化	210,350	3,819,956.00	0.18
120	601818	光大银行	1,145,100	3,801,732.00	0.18
121	000895	双汇发展	119,902	3,782,908.10	0.18
122	000538	云南白药	35,400	3,704,610.00	0.18
123	601377	兴业证券	370,900	3,664,492.00	0.17
124	000768	中航西飞	95,900	3,500,350.00	0.17
125	601628	中国人寿	115,313	3,469,768.17	0.16
126	603806	福斯特	26,416	3,448,608.80	0.16
127	002340	格林美	325,300	3,366,855.00	0.16
128	688111	金山办公	12,700	3,365,500.00	0.16
129	600346	恒力石化	146,200	3,358,214.00	0.16
130	002001	新和成	107,140	3,334,196.80	0.16
131	601989	中国重工	789,300	3,330,846.00	0.16
132	601600	中国铝业	543,200	3,308,088.00	0.16
133	601857	中国石油	672,600	3,302,466.00	0.16
134	601138	工业富联	275,000	3,278,000.00	0.15

135	601225	陕西煤业	268,400	3,274,480.00	0.15
136	300896	爱美客	6,000	3,216,660.00	0.15
137	600426	华鲁恒升	102,360	3,203,868.00	0.15
138	002008	大族激光	59,100	3,191,400.00	0.15
139	300433	蓝思科技	137,800	3,166,644.00	0.15
140	002202	金风科技	191,100	3,147,417.00	0.15
141	002050	三花智控	124,280	3,144,284.00	0.15
142	600522	中天科技	184,800	3,134,208.00	0.15
143	600009	上海机场	66,700	3,114,223.00	0.15
144	601009	南京银行	346,400	3,103,744.00	0.15
145	300316	晶盛机电	44,500	3,092,750.00	0.15
146	600741	华域汽车	109,100	3,087,530.00	0.15
147	600763	通策医疗	15,500	3,084,500.00	0.15
148	600150	中国船舶	123,768	3,068,208.72	0.15
149	000733	振华科技	24,500	3,044,860.00	0.14
150	600176	中国巨石	166,223	3,025,258.60	0.14
151	300413	芒果超媒	51,800	2,963,996.00	0.14
152	601100	恒立液压	36,148	2,956,906.40	0.14
153	600011	华能国际	304,500	2,950,605.00	0.14
154	001979	招商蛇口	219,400	2,926,796.00	0.14
155	002236	大华股份	124,400	2,920,912.00	0.14
156	000723	美锦能源	174,300	2,828,889.00	0.13

157	300601	康泰生物	28,600	2,818,244.00	0.13
158	601615	明阳智能	106,400	2,777,040.00	0.13
159	600760	中航沈飞	40,700	2,769,228.00	0.13
160	600157	永泰能源	1,510,800	2,749,656.00	0.13
161	603993	洛阳钼业	489,200	2,729,736.00	0.13
162	601939	建设银行	464,900	2,724,314.00	0.13
163	600584	长电科技	86,200	2,673,924.00	0.13
164	600399	抚顺特钢	107,300	2,657,821.00	0.13
165	600989	宝丰能源	152,300	2,643,928.00	0.12
166	600885	宏发股份	35,421	2,643,823.44	0.12
167	601006	大秦铁路	411,640	2,634,496.00	0.12
168	600926	杭州银行	205,200	2,630,664.00	0.12
169	601066	中信建投	89,900	2,629,575.00	0.12
170	688008	澜起科技	31,200	2,616,744.00	0.12
171	688036	传音控股	16,600	2,604,540.00	0.12
172	002602	世纪华通	309,520	2,596,872.80	0.12
173	600884	杉杉股份	78,790	2,581,948.30	0.12
174	300759	康龙化成	18,200	2,571,114.00	0.12
175	003816	中国广核	816,800	2,556,584.00	0.12
176	000009	中国宝安	175,400	2,531,022.00	0.12
177	600132	重庆啤酒	16,700	2,527,044.00	0.12
178	000977	浪潮信息	70,500	2,526,015.00	0.12

179	002384	东山精密	93,000	2,520,300.00	0.12
180	601360	三六零	197,800	2,516,016.00	0.12
181	000786	北新建材	70,200	2,515,266.00	0.12
182	601117	中国化学	207,800	2,493,600.00	0.12
183	002555	三七互娱	92,100	2,488,542.00	0.12
184	601186	中国铁建	318,500	2,484,300.00	0.12
185	000157	中联重科	343,700	2,464,329.00	0.12
186	601868	中国能建	897,965	2,451,444.45	0.12
187	000963	华东医药	60,600	2,436,120.00	0.12
188	600600	青岛啤酒	24,600	2,435,400.00	0.12
189	601555	东吴证券	273,702	2,424,999.72	0.11
190	002013	中航机电	132,100	2,401,578.00	0.11
191	600029	南方航空	350,900	2,389,629.00	0.11
192	600015	华夏银行	426,100	2,386,160.00	0.11
193	603486	科沃斯	15,800	2,385,010.00	0.11
194	000876	新希望	155,900	2,371,239.00	0.11
195	603369	今世缘	43,457	2,364,060.80	0.11
196	002385	大北农	225,300	2,363,397.00	0.11
197	002601	龙佰集团	82,400	2,355,816.00	0.11
198	600547	山东黄金	125,100	2,354,382.00	0.11
199	300285	国瓷材料	54,600	2,324,322.00	0.11
200	002736	国信证券	199,600	2,291,408.00	0.11
201	601238	广汽集团	150,800	2,290,652.00	0.11
202	600352	浙江龙	180,200	2,275,926.00	0.11

		盛			
203	000425	徐工机械	379,600	2,273,804.00	0.11
204	000938	紫光股份	99,060	2,263,521.00	0.11
205	002268	卫士通	40,300	2,254,382.00	0.11
206	300751	迈为股份	3,500	2,248,050.00	0.11
207	601336	新华保险	57,765	2,245,903.20	0.11
208	605358	立昂微	18,700	2,244,187.00	0.11
209	603019	中科曙光	81,020	2,233,721.40	0.11
210	601901	方正证券	284,800	2,232,832.00	0.11
211	300088	长信科技	166,900	2,216,432.00	0.10
212	300037	新宙邦	19,600	2,214,800.00	0.10
213	600886	国投电力	192,900	2,212,563.00	0.10
214	002007	华兰生物	75,820	2,209,394.80	0.10
215	688099	晶晨股份	16,700	2,174,340.00	0.10
216	600765	中航重机	42,900	2,166,021.00	0.10
217	603882	金域医学	19,400	2,160,578.00	0.10
218	688012	中微公司	17,000	2,152,200.00	0.10
219	300033	同花顺	14,800	2,139,784.00	0.10
220	600563	法拉电子	9,200	2,138,080.00	0.10
221	600085	同仁堂	47,400	2,132,052.00	0.10
222	688005	容百科技	18,200	2,103,556.00	0.10
223	601800	中国交建	243,900	2,092,662.00	0.10
224	000596	古井贡酒	8,500	2,074,000.00	0.10
225	600298	安琪酵母	34,000	2,052,240.00	0.10

226	002938	鹏鼎控股	48,200	2,045,126.00	0.10
227	600256	广汇能源	312,500	2,043,750.00	0.10
228	002028	思源电气	41,500	2,042,215.00	0.10
229	601865	福莱特	35,200	2,039,488.00	0.10
230	300628	亿联网络	25,000	2,036,250.00	0.10
231	600862	中航高科	56,900	2,034,744.00	0.10
232	002180	纳思达	42,600	2,034,576.00	0.10
233	300595	欧普康视	35,360	2,028,603.20	0.10
234	600383	金地集团	156,300	2,027,211.00	0.10
235	601916	浙商银行	578,500	2,024,750.00	0.10
236	601799	星宇股份	9,900	2,022,075.00	0.10
237	000783	长江证券	268,000	2,020,720.00	0.10
238	601788	光大证券	135,300	2,020,029.00	0.10
239	600141	兴发集团	52,900	2,003,852.00	0.09
240	000069	华侨城 A	283,800	1,997,952.00	0.09
241	300363	博腾股份	22,200	1,985,790.00	0.09
242	300003	乐普医疗	87,388	1,977,590.44	0.09
243	600115	中国东航	379,300	1,957,188.00	0.09
244	600795	国电电力	617,300	1,956,841.00	0.09
245	300253	卫宁健康	116,500	1,952,540.00	0.09
246	600487	亨通光电	128,500	1,942,920.00	0.09
247	000301	东方盛虹	100,400	1,941,736.00	0.09
248	002185	华天科	152,500	1,938,275.00	0.09

		技			
249	601108	财通证 券	174,000	1,934,880.00	0.09
250	600918	中泰证 券	193,000	1,924,210.00	0.09
251	603456	九洲药 业	34,000	1,912,840.00	0.09
252	002252	上海莱 士	279,900	1,908,918.00	0.09
253	000988	华工科 技	68,400	1,905,624.00	0.09
254	600109	国金证 券	167,400	1,896,642.00	0.09
255	601618	中国中 冶	494,300	1,893,169.00	0.09
256	601111	中国国 航	206,800	1,888,084.00	0.09
257	300999	金龙鱼	30,000	1,887,900.00	0.09
258	600183	生益科 技	79,920	1,882,116.00	0.09
259	002841	视源股 份	23,100	1,880,340.00	0.09
260	601636	旗滨集 团	109,600	1,874,160.00	0.09
261	600392	盛和资 源	95,500	1,873,710.00	0.09
262	603833	欧派家 居	12,620	1,861,450.00	0.09
263	603392	万泰生 物	8,400	1,860,600.00	0.09
264	601155	新城控 股	62,600	1,823,538.00	0.09
265	600754	锦江酒 店	31,100	1,822,460.00	0.09
266	300058	蓝色光 标	169,400	1,817,662.00	0.09
267	601838	成都银 行	150,000	1,800,000.00	0.09
268	600418	江淮汽 车	103,000	1,792,200.00	0.08
269	300699	光威复 材	21,200	1,790,976.00	0.08
270	300529	健帆生	33,500	1,785,550.00	0.08

		物			
271	601168	西部矿业	129,600	1,763,856.00	0.08
272	300223	北京君正	13,100	1,755,400.00	0.08
273	603613	国联股份	16,300	1,752,250.00	0.08
274	000630	铜陵有色	501,000	1,743,480.00	0.08
275	603517	绝味食品	25,500	1,742,415.00	0.08
276	603589	口子窖	24,500	1,736,315.00	0.08
277	601966	玲珑轮胎	47,500	1,736,125.00	0.08
278	000066	中国长城	122,000	1,727,520.00	0.08
279	603267	鸿远电子	9,500	1,704,680.00	0.08
280	603160	汇顶科技	15,800	1,702,766.00	0.08
281	688536	思瑞浦	2,200	1,689,600.00	0.08
282	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.08
283	600516	方大炭素	155,320	1,680,562.40	0.08
284	002797	第一创业	228,600	1,673,352.00	0.08
285	002138	顺络电子	43,800	1,672,284.00	0.08
286	000998	隆平高科	71,700	1,667,742.00	0.08
287	300136	信维通信	65,800	1,666,056.00	0.08
288	600332	白云山	48,600	1,662,120.00	0.08
289	603899	晨光文具	25,700	1,657,907.00	0.08
290	600489	中金黄金	201,300	1,656,699.00	0.08
291	600486	扬农化工	12,600	1,653,120.00	0.08
292	688561	奇安信	18,800	1,652,896.00	0.08
293	002916	深南电路	13,500	1,644,570.00	0.08

294	002120	韵达股份	80,370	1,644,370.20	0.08
295	002624	完美世界	80,550	1,635,970.50	0.08
296	601077	渝农商行	420,900	1,620,465.00	0.08
297	600875	东方电气	75,600	1,619,352.00	0.08
298	300308	中际旭创	38,100	1,619,250.00	0.08
299	000703	恒逸石化	152,310	1,617,532.20	0.08
300	002791	坚朗五金	8,900	1,616,151.00	0.08
301	600038	中直股份	20,100	1,614,030.00	0.08
302	300724	捷佳伟创	14,100	1,611,630.00	0.08
303	600362	江西铜业	71,800	1,603,294.00	0.08
304	000728	国元证券	207,730	1,599,521.00	0.08
305	601689	拓普集团	30,000	1,590,000.00	0.08
306	601607	上海医药	79,900	1,587,613.00	0.08
307	002409	雅克科技	19,500	1,582,815.00	0.07
308	002414	高德红外	64,966	1,572,826.86	0.07
309	600143	金发科技	124,700	1,568,726.00	0.07
310	688065	凯赛生物	8,500	1,566,380.00	0.07
311	002353	杰瑞股份	39,100	1,564,000.00	0.07
312	300146	汤臣倍健	57,900	1,560,984.00	0.07
313	600233	圆通速递	93,500	1,559,580.00	0.07
314	002568	百润股份	26,000	1,555,580.00	0.07
315	300144	宋城演艺	108,620	1,555,438.40	0.07

316	300474	景嘉微	10,200	1,552,440.00	0.07
317	300763	锦浪科技	6,700	1,551,385.00	0.07
318	002080	中材科技	45,600	1,551,312.00	0.07
319	603893	瑞芯微	11,300	1,546,970.00	0.07
320	002223	鱼跃医疗	40,900	1,546,020.00	0.07
321	002212	天融信	80,600	1,545,102.00	0.07
322	300677	英科医疗	26,650	1,541,436.00	0.07
323	600079	人福医药	67,900	1,529,108.00	0.07
324	000519	中兵红箭	56,900	1,517,523.00	0.07
325	601990	南京证券	153,100	1,517,221.00	0.07
326	300418	昆仑万维	65,100	1,507,065.00	0.07
327	300676	华大基因	17,100	1,501,380.00	0.07
328	002044	美年健康	189,700	1,489,145.00	0.07
329	002673	西部证券	182,400	1,471,968.00	0.07
330	600872	中炬高新	38,603	1,465,755.91	0.07
331	603260	合盛硅业	11,100	1,464,867.00	0.07
332	688169	石头科技	1,800	1,463,400.00	0.07
333	600061	国投资本	177,996	1,463,127.12	0.07
334	600733	北汽蓝谷	145,800	1,460,916.00	0.07
335	000547	航天发展	87,200	1,456,240.00	0.07
336	688208	道通科技	18,300	1,453,020.00	0.07
337	000636	风华高科	48,696	1,451,140.80	0.07
338	002439	启明星辰	50,800	1,449,324.00	0.07

339	600482	中国动力	73,500	1,447,950.00	0.07
340	600705	中航产融	364,000	1,445,080.00	0.07
341	601021	春秋航空	25,400	1,442,720.00	0.07
342	000932	华菱钢铁	281,900	1,440,509.00	0.07
343	002600	领益智造	195,700	1,440,352.00	0.07
344	600845	宝信软件	23,570	1,433,763.10	0.07
345	603077	和邦生物	420,400	1,433,564.00	0.07
346	000039	中集集团	83,500	1,432,860.00	0.07
347	000708	中信特钢	69,900	1,431,552.00	0.07
348	600699	均胜电子	65,100	1,430,247.00	0.07
349	600188	兖矿能源	60,700	1,428,271.00	0.07
350	000807	云铝股份	127,600	1,425,292.00	0.07
351	600529	山东药玻	32,400	1,422,360.00	0.07
352	002444	巨星科技	46,600	1,421,766.00	0.07
353	600739	辽宁成大	72,800	1,421,056.00	0.07
354	688002	睿创微纳	18,083	1,420,781.31	0.07
355	300296	利亚德	138,400	1,418,600.00	0.07
356	603605	珀莱雅	6,800	1,416,508.00	0.07
357	601878	浙商证券	107,400	1,415,532.00	0.07
358	000739	普洛药业	40,100	1,407,109.00	0.07
359	600161	天坛生物	47,460	1,374,441.60	0.06
360	300558	贝达药业	17,200	1,373,076.00	0.06
361	603939	益丰药	24,900	1,372,239.00	0.06

		房			
362	002507	涪陵榨菜	36,200	1,368,360.00	0.06
363	002465	海格通信	125,300	1,368,276.00	0.06
364	000738	航发控制	44,700	1,353,516.00	0.06
365	600988	赤峰黄金	90,500	1,348,450.00	0.06
366	603338	浙江鼎力	16,740	1,343,552.40	0.06
367	002030	达安基因	66,832	1,340,649.92	0.06
368	603290	斯达半导	3,500	1,333,500.00	0.06
369	688126	沪硅产业	51,600	1,332,312.00	0.06
370	601016	节能风电	204,500	1,331,295.00	0.06
371	000960	锡业股份	68,100	1,329,993.00	0.06
372	600018	上港集团	241,700	1,324,516.00	0.06
373	600521	华海药业	60,900	1,319,094.00	0.06
374	600637	东方明珠	139,330	1,316,668.50	0.06
375	002273	水晶光电	75,700	1,316,423.00	0.06
376	600549	厦门钨业	57,900	1,310,277.00	0.06
377	600177	雅戈尔	188,900	1,301,521.00	0.06
378	688521	芯原股份	16,800	1,299,648.00	0.06
379	601696	中银证券	96,200	1,293,890.00	0.06
380	600732	爱旭股份	55,300	1,291,808.00	0.06
381	601198	东兴证券	109,900	1,278,137.00	0.06
382	002557	洽洽食品	20,700	1,270,152.00	0.06
383	002078	太阳纸	109,600	1,259,304.00	0.06

		业			
384	603127	昭衍新 药	10,900	1,258,187.00	0.06
385	600704	物产中 大	212,000	1,255,040.00	0.06
386	002985	北摩高 科	10,400	1,252,784.00	0.06
387	600201	生物股 份	76,600	1,252,410.00	0.06
388	300383	光环新 网	83,900	1,245,076.00	0.06
389	600642	申能股 份	167,200	1,232,264.00	0.06
390	601128	常熟银 行	186,400	1,232,104.00	0.06
391	002156	通富微 电	63,300	1,229,919.00	0.06
392	300357	我武生 物	21,400	1,226,220.00	0.06
393	002299	圣农发 展	50,700	1,225,419.00	0.06
394	603444	吉比特	2,900	1,223,365.00	0.06
395	601216	君正集 团	233,600	1,221,728.00	0.06
396	600879	航天电 子	147,900	1,218,696.00	0.06
397	601162	天风证 券	299,960	1,214,838.00	0.06
398	600497	驰宏锌 锗	242,300	1,209,077.00	0.06
399	600369	西南证 券	225,900	1,195,011.00	0.06
400	600027	华电国 际	221,800	1,186,630.00	0.06
401	000830	鲁西化 工	77,700	1,185,702.00	0.06
402	600160	巨化股 份	91,700	1,183,847.00	0.06
403	300618	寒锐钻 业	14,700	1,178,646.00	0.06
404	688396	华润微	18,200	1,175,720.00	0.06
405	600039	四川路 桥	97,500	1,173,900.00	0.06

406	002739	万达电 影	75,800	1,173,384.00	0.06
407	600372	中航电 子	52,400	1,173,236.00	0.06
408	002092	中泰化 学	122,600	1,169,604.00	0.06
409	000623	吉林敖 东	63,300	1,169,151.00	0.06
410	002508	老板电 器	32,300	1,163,446.00	0.05
411	000983	山西焦 煤	139,340	1,152,341.80	0.05
412	600606	绿地控 股	265,350	1,151,619.00	0.05
413	300866	安克创 新	11,200	1,148,000.00	0.05
414	600580	卧龙电 驱	62,600	1,144,954.00	0.05
415	600316	洪都航 空	29,300	1,144,458.00	0.05
416	000629	攀钢钒 钛	292,100	1,136,269.00	0.05
417	300115	长盈精 密	57,240	1,135,641.60	0.05
418	601997	贵阳银 行	174,038	1,132,987.38	0.05
419	603198	迎驾贡 酒	16,300	1,132,035.00	0.05
420	002249	大洋电 机	128,600	1,130,394.00	0.05
421	002131	利欧股 份	459,300	1,129,878.00	0.05
422	002373	千方科 技	75,300	1,125,735.00	0.05
423	002603	以岭药 业	56,820	1,113,672.00	0.05
424	300017	网宿科 技	166,400	1,113,216.00	0.05
425	600655	豫园股 份	107,700	1,109,310.00	0.05
426	002936	郑州银 行	349,743	1,105,187.88	0.05
427	002422	科伦药 业	58,200	1,101,726.00	0.05

428	601995	中金公司	22,300	1,093,369.00	0.05
429	600118	中国卫星	40,200	1,091,430.00	0.05
430	000825	太钢不锈	154,900	1,090,496.00	0.05
431	600170	上海建工	302,800	1,090,080.00	0.05
432	000050	深天马A	83,500	1,087,170.00	0.05
433	000887	中鼎股份	49,800	1,086,138.00	0.05
434	603218	日月股份	32,900	1,084,055.00	0.05
435	300070	碧水源	150,600	1,082,814.00	0.05
436	600859	王府井	39,900	1,077,300.00	0.05
437	600166	福田汽车	313,000	1,076,720.00	0.05
438	000400	许继电气	41,100	1,072,710.00	0.05
439	600803	新奥股份	58,100	1,066,716.00	0.05
440	000750	国海证券	259,190	1,065,270.90	0.05
441	002024	苏宁易购	257,800	1,062,136.00	0.05
442	600867	通化东宝	96,904	1,062,067.84	0.05
443	002506	协鑫集成	278,800	1,059,440.00	0.05
444	600153	建发股份	116,800	1,059,376.00	0.05
445	002191	劲嘉股份	70,000	1,059,100.00	0.05
446	002926	华西证券	107,100	1,054,935.00	0.05
447	300001	特锐德	42,400	1,054,488.00	0.05
448	002372	伟星新材	43,300	1,053,056.00	0.05
449	600258	首旅酒店	40,300	1,053,039.00	0.05
450	002157	正邦科技	108,900	1,051,974.00	0.05

451	300168	万达信息	80,700	1,050,714.00	0.05
452	000027	深圳能源	129,400	1,048,140.00	0.05
453	002056	横店东磁	55,300	1,043,511.00	0.05
454	603707	健友股份	24,840	1,043,280.00	0.05
455	002266	浙富控股	146,100	1,040,232.00	0.05
456	600909	华安证券	191,670	1,036,934.70	0.05
457	600236	桂冠电力	160,800	1,032,336.00	0.05
458	002002	鸿达兴业	169,700	1,028,382.00	0.05
459	300251	光线传媒	79,800	1,025,430.00	0.05
460	688363	华熙生物	6,600	1,024,980.00	0.05
461	000513	丽珠集团	25,400	1,021,334.00	0.05
462	600008	首创环保	299,490	1,021,260.90	0.05
463	002065	东华软件	130,800	1,020,240.00	0.05
464	300009	安科生物	77,940	1,020,234.60	0.05
465	000997	新大陆	56,200	1,018,344.00	0.05
466	601933	永辉超市	251,300	1,017,765.00	0.05
467	600066	宇通客车	92,259	1,016,694.18	0.05
468	600271	航天信息	75,600	1,012,284.00	0.05
469	000021	深科技	63,736	1,009,578.24	0.05
470	600536	中国软件	20,200	1,008,586.00	0.05
471	002607	中公教育	128,000	1,006,080.00	0.05
472	002064	华峰化学	96,300	1,005,372.00	0.05

473	002152	广电运通	84,400	1,004,360.00	0.05
474	002408	齐翔腾达	95,580	1,003,590.00	0.05
475	601881	中国银河	89,200	998,148.00	0.05
476	002203	海亮股份	80,200	996,886.00	0.05
477	600171	上海贝岭	38,800	995,608.00	0.05
478	000975	银泰黄金	113,260	994,422.80	0.05
479	300244	迪安诊断	29,600	993,672.00	0.05
480	002221	东华能源	78,500	988,315.00	0.05
481	600848	上海临港	66,300	985,881.00	0.05
482	601998	中信银行	212,200	980,364.00	0.05
483	600535	天士力	61,800	979,530.00	0.05
484	603156	养元饮品	34,432	978,213.12	0.05
485	300630	普利制药	17,752	977,070.08	0.05
486	000656	金科股份	217,900	976,192.00	0.05
487	600348	华阳股份	81,800	969,330.00	0.05
488	002500	山西证券	146,480	966,768.00	0.05
489	002572	索菲亚	43,400	963,480.00	0.05
490	300212	易华录	27,220	962,227.00	0.05
491	300026	红日药业	122,500	959,175.00	0.05
492	601005	重庆钢铁	455,900	952,831.00	0.05
493	300024	机器人	84,900	948,333.00	0.04
494	600998	九州通	63,718	937,928.96	0.04
495	603568	伟明环保	25,650	936,994.50	0.04
496	600315	上海家化	23,100	933,471.00	0.04

497	000970	中科三环	58,000	930,900.00	0.04
498	000878	云南铜业	69,400	927,878.00	0.04
499	000012	南玻A	93,300	926,469.00	0.04
500	601319	中国人保	196,578	923,916.60	0.04
501	603233	大参林	21,900	922,209.00	0.04
502	002127	南极电商	133,600	921,840.00	0.04
503	601699	潞安环能	81,400	920,634.00	0.04
504	002683	广东宏大	30,500	918,660.00	0.04
505	002745	木林森	60,600	916,878.00	0.04
506	000537	广宇发展	38,000	915,800.00	0.04
507	000999	华润三九	26,700	914,208.00	0.04
508	300315	掌趣科技	187,500	911,250.00	0.04
509	002195	二三四五	389,200	910,728.00	0.04
510	600673	东阳光	102,500	910,200.00	0.04
511	603712	七一二	21,000	909,300.00	0.04
512	600415	小商品城	186,700	905,495.00	0.04
513	601872	招商轮船	220,560	904,296.00	0.04
514	002250	联化科技	50,200	902,094.00	0.04
515	600801	华新水泥	46,300	893,590.00	0.04
516	002511	中顺洁柔	53,400	892,314.00	0.04
517	688009	中国通号	179,100	891,918.00	0.04
518	603658	安图生物	16,150	889,219.00	0.04
519	300182	捷成股份	140,100	886,833.00	0.04
520	002019	亿帆医	50,300	886,286.00	0.04

		药			
521	300463	迈克生物	30,300	884,457.00	0.04
522	688006	杭可科技	8,200	882,156.00	0.04
523	002153	石基信息	30,580	878,869.20	0.04
524	000690	宝新能源	148,000	876,160.00	0.04
525	600863	内蒙华电	221,900	874,286.00	0.04
526	600208	新湖中宝	292,400	871,352.00	0.04
527	600970	中材国际	75,400	861,822.00	0.04
528	000060	中金岭南	173,800	853,358.00	0.04
529	002831	裕同科技	25,300	852,357.00	0.04
530	600517	国网英大	116,600	850,014.00	0.04
531	601778	晶科科技	98,400	839,352.00	0.04
532	000686	东北证券	95,500	838,490.00	0.04
533	300482	万孚生物	21,270	837,612.60	0.04
534	600380	健康元	64,800	832,032.00	0.04
535	601866	中远海发	255,200	829,400.00	0.04
536	600839	四川长虹	250,500	829,155.00	0.04
537	600498	烽火通信	46,100	828,878.00	0.04
538	002505	鹏都农牧	216,800	828,176.00	0.04
539	002294	信立泰	30,300	827,796.00	0.04
540	000930	中粮科技	76,100	827,207.00	0.04
541	600155	华创阳安	82,800	824,688.00	0.04
542	600025	华能水电	124,600	821,114.00	0.04

543	002939	长城证 券	63,300	819,735.00	0.04
544	603858	步长制 药	38,800	818,292.00	0.04
545	600390	五矿资 本	152,900	813,428.00	0.04
546	000729	燕京啤 酒	95,900	812,273.00	0.04
547	600667	太极实 业	100,300	810,424.00	0.04
548	600511	国药股 份	25,700	810,321.00	0.04
549	002701	奥瑞金	115,500	808,500.00	0.04
550	601992	金隅集 团	283,620	805,480.80	0.04
551	600500	中化国 际	94,044	805,016.64	0.04
552	000401	冀东水 泥	67,200	803,712.00	0.04
553	600718	东软集 团	59,200	802,752.00	0.04
554	600728	佳都科 技	95,700	797,181.00	0.04
555	601898	中煤能 源	126,700	796,943.00	0.04
556	600895	张江高 科	52,623	792,502.38	0.04
557	300376	易事特	78,600	789,930.00	0.04
558	600158	中体产 业	52,200	789,264.00	0.04
559	002430	杭氧股 份	26,300	789,263.00	0.04
560	600764	中国海 防	19,400	788,804.00	0.04
561	600216	浙江医 药	45,900	783,972.00	0.04
562	002382	蓝帆医 疗	47,900	780,291.00	0.04
563	002004	华邦健 康	107,700	779,748.00	0.04
564	601236	红塔证 券	65,160	776,707.20	0.04
565	002128	电投能	52,200	775,170.00	0.04

		源			
566	600282	南钢股份	209,400	774,780.00	0.04
567	601179	中国西电	139,500	774,225.00	0.04
568	002532	天山铝业	94,900	773,435.00	0.04
569	603225	新凤鸣	52,000	772,200.00	0.04
570	000598	兴蓉环境	121,800	769,776.00	0.04
571	002966	苏州银行	113,300	767,041.00	0.04
572	300072	三聚环保	95,900	760,487.00	0.04
573	002368	太极股份	27,599	760,076.46	0.04
574	002174	游族网络	49,800	758,952.00	0.04
575	002670	国盛金控	78,900	757,440.00	0.04
576	002595	豪迈科技	27,200	755,072.00	0.04
577	000540	中天金融	285,900	754,776.00	0.04
578	600985	淮北矿业	67,500	754,650.00	0.04
579	002396	星网锐捷	31,700	747,169.00	0.04
580	600528	中铁工业	90,600	743,826.00	0.04
581	002048	宁波华翔	34,100	737,583.00	0.03
582	601231	环旭电子	45,900	737,154.00	0.03
583	600297	广汇汽车	275,700	736,119.00	0.03
584	603866	桃李面包	25,900	735,560.00	0.03
585	000581	威孚高科	34,100	734,514.00	0.03
586	600409	三友化工	84,200	732,540.00	0.03
587	603638	艾迪精	22,940	732,244.80	0.03

		密			
588	002958	青农商行	188,900	729,154.00	0.03
589	600755	厦门国贸	100,800	726,768.00	0.03
590	600827	百联股份	54,500	726,485.00	0.03
591	002010	传化智联	83,500	726,450.00	0.03
592	002925	盈趣科技	21,290	724,498.70	0.03
593	601717	郑煤机	62,500	724,375.00	0.03
594	600567	山鹰国际	219,700	722,813.00	0.03
595	600060	海信视像	53,300	716,885.00	0.03
596	300271	华宇软件	56,400	716,280.00	0.03
597	603885	吉祥航空	40,100	711,775.00	0.03
598	000709	河钢股份	288,900	710,694.00	0.03
599	600131	国网信通	32,500	710,125.00	0.03
600	000778	新兴铸管	162,800	704,924.00	0.03
601	600598	北大荒	48,300	703,248.00	0.03
602	002183	怡亚通	106,000	701,720.00	0.03
603	002075	沙钢股份	120,000	699,600.00	0.03
604	000883	湖北能源	132,800	695,872.00	0.03
605	600325	华发股份	115,200	693,504.00	0.03
606	600967	内蒙一机	58,000	693,100.00	0.03
607	600820	隧道股份	128,200	689,716.00	0.03
608	600782	新钢股份	130,000	686,400.00	0.03
609	600507	方大特钢	87,962	686,103.60	0.03

610	600566	济川药业	24,207	686,026.38	0.03
611	002690	美亚光电	18,294	685,293.24	0.03
612	600021	上海电力	53,330	683,690.60	0.03
613	600737	中粮糖业	72,700	683,380.00	0.03
614	603883	老百姓	13,820	682,431.60	0.03
615	601456	国联证券	48,700	680,339.00	0.03
616	000990	诚志股份	42,600	673,932.00	0.03
617	002434	万里扬	45,500	670,670.00	0.03
618	601880	辽港股份	385,400	666,742.00	0.03
619	600022	山东钢铁	372,200	666,238.00	0.03
620	002281	光迅科技	28,600	666,094.00	0.03
621	600707	彩虹股份	97,600	665,632.00	0.03
622	603927	中科软	24,300	664,848.00	0.03
623	000800	一汽解放	64,400	662,676.00	0.03
624	000987	越秀金控	75,800	659,460.00	0.03
625	600663	陆家嘴	59,900	650,514.00	0.03
626	600435	北方导航	60,800	649,344.00	0.03
627	601106	中国一重	186,494	648,999.12	0.03
628	002124	天邦股份	100,120	644,772.80	0.03
629	600446	金证股份	44,800	641,536.00	0.03
630	002146	荣盛发展	147,400	641,190.00	0.03
631	601577	长沙银行	82,000	640,420.00	0.03
632	600572	康恩贝	126,900	634,500.00	0.03
633	601808	中海油服	41,000	615,000.00	0.03

634	601118	海南橡胶	116,400	614,592.00	0.03
635	002390	信邦制药	82,700	613,634.00	0.03
636	600329	中新药业	19,500	612,495.00	0.03
637	000898	鞍钢股份	163,000	611,250.00	0.03
638	000877	天山股份	39,700	607,807.00	0.03
639	600811	东方集团	201,900	607,719.00	0.03
640	600597	光明乳业	41,600	604,032.00	0.03
641	000488	晨鸣纸业	83,300	603,092.00	0.03
642	002233	塔牌集团	56,800	600,944.00	0.03
643	002440	闰土股份	62,600	600,334.00	0.03
644	603228	景旺电子	17,380	600,131.40	0.03
645	600808	马钢股份	162,300	598,887.00	0.03
646	002429	兆驰股份	123,100	598,266.00	0.03
647	002155	湖南黄金	57,300	593,628.00	0.03
648	300166	东方国信	54,800	591,840.00	0.03
649	688321	微芯生物	16,733	585,822.33	0.03
650	001914	招商积余	28,900	585,514.00	0.03
651	601200	上海环境	45,800	576,622.00	0.03
652	600037	歌华有线	66,300	575,484.00	0.03
653	002416	爱施德	50,500	574,690.00	0.03
654	600908	无锡银行	101,300	574,371.00	0.03
655	000559	万向钱潮	89,800	572,026.00	0.03

656	002085	万丰奥威	104,100	571,509.00	0.03
657	600373	中文传媒	46,100	569,796.00	0.03
658	002110	三钢闽光	83,300	566,440.00	0.03
659	600398	海澜之家	88,100	564,721.00	0.03
660	600906	财达证券	44,100	562,716.00	0.03
661	600167	联美控股	62,300	561,323.00	0.03
662	600026	中远海能	94,300	558,256.00	0.03
663	002705	新宝股份	22,500	555,750.00	0.03
664	601000	唐山港	201,500	554,125.00	0.03
665	600546	山煤国际	67,400	553,354.00	0.03
666	002081	金螳螂	90,800	552,064.00	0.03
667	600064	南京高科	58,900	550,126.00	0.03
668	601991	大唐发电	168,700	546,588.00	0.03
669	603000	人民网	37,600	542,192.00	0.03
670	600195	中牧股份	41,452	541,777.64	0.03
671	000528	柳工	70,200	541,242.00	0.03
672	000961	中南建设	130,200	539,028.00	0.03
673	601611	中国核建	54,000	538,380.00	0.03
674	601718	际华集团	179,200	534,016.00	0.03
675	000685	中山公用	60,200	532,770.00	0.03
676	002867	周大生	29,800	529,844.00	0.03
677	002038	双鹭药业	48,900	528,609.00	0.02
678	000158	常山北明	76,100	526,612.00	0.02

679	601608	中信重工	118,000	526,280.00	0.02
680	300133	华策影视	77,600	525,352.00	0.02
681	002387	维信诺	56,400	523,392.00	0.02
682	600120	浙江东方	118,156	522,249.52	0.02
683	000090	天健集团	88,900	521,843.00	0.02
684	000959	首钢股份	90,900	520,857.00	0.02
685	601333	广深铁路	230,600	516,544.00	0.02
686	000758	中色股份	93,800	512,148.00	0.02
687	000089	深圳机场	69,700	510,204.00	0.02
688	000671	阳光城	168,500	508,870.00	0.02
689	600376	首开股份	87,700	496,382.00	0.02
690	600582	天地科技	112,600	493,188.00	0.02
691	000415	渤海租赁	168,300	489,753.00	0.02
692	000718	苏宁环球	103,200	486,072.00	0.02
693	002242	九阳股份	20,900	484,880.00	0.02
694	601598	中国外运	107,200	480,256.00	0.02
695	600062	华润双鹤	35,500	474,635.00	0.02
696	000967	盈峰环境	64,600	473,518.00	0.02
697	601975	招商南油	235,200	472,752.00	0.02
698	600126	杭钢股份	91,800	470,934.00	0.02
699	600307	酒钢宏兴	213,000	468,600.00	0.02
700	601098	中南传媒	48,800	467,016.00	0.02

701	000402	金融街	81,300	460,158.00	0.02
702	002458	益生股份	40,500	458,055.00	0.02
703	600556	天下秀	36,900	455,715.00	0.02
704	001965	招商公路	58,900	451,763.00	0.02
705	601958	金铂股份	65,800	450,730.00	0.02
706	600959	江苏有线	136,100	447,769.00	0.02
707	600643	爱建集团	66,200	447,512.00	0.02
708	601698	中国卫通	30,500	438,895.00	0.02
709	002399	海普瑞	25,500	436,050.00	0.02
710	000563	陕国投A	134,800	435,404.00	0.02
711	300257	开山股份	27,100	430,348.00	0.02
712	600056	中国医药	36,305	428,762.05	0.02
713	003035	南网能源	51,500	426,935.00	0.02
714	002563	森马服饰	54,800	423,604.00	0.02
715	601928	凤凰传媒	51,900	419,871.00	0.02
716	601860	紫金银行	124,400	416,740.00	0.02
717	600266	城建发展	92,040	414,180.00	0.02
718	600901	江苏租赁	81,200	413,308.00	0.02
719	600717	天津港	98,400	412,296.00	0.02
720	603317	天味食品	15,368	412,016.08	0.02
721	600968	海油发展	138,300	405,219.00	0.02
722	002815	崇达技术	23,900	402,715.00	0.02
723	000937	冀中能源	72,100	397,271.00	0.02

724	002244	滨江集团	84,600	394,236.00	0.02
725	600095	湘财股份	38,800	392,656.00	0.02
726	000717	韶钢松山	82,200	390,450.00	0.02
727	600928	西安银行	90,600	389,580.00	0.02
728	002423	中粮资本	47,000	380,700.00	0.02
729	002468	申通快递	41,600	378,144.00	0.02
730	600776	东方通信	32,500	374,075.00	0.02
731	600787	中储股份	59,900	373,776.00	0.02
732	600006	东风汽车	54,400	370,464.00	0.02
733	000062	深圳华强	21,400	368,722.00	0.02
734	002424	贵州百灵	48,000	364,800.00	0.02
735	600729	重庆百货	13,800	359,076.00	0.02
736	600649	城投控股	86,000	353,460.00	0.02
737	600339	中油工程	113,900	350,812.00	0.02
738	600623	华谊集团	38,501	350,359.10	0.02
739	600835	上海机电	22,000	350,240.00	0.02
740	601139	深圳燃气	39,100	345,253.00	0.02
741	002375	亚厦股份	45,500	340,795.00	0.02
742	600299	安迪苏	27,400	337,568.00	0.02
743	600648	外高桥	25,500	337,365.00	0.02
744	601969	海南矿业	27,500	330,275.00	0.02
745	000031	大悦城	87,400	326,002.00	0.02
746	000156	华数传媒	37,800	319,788.00	0.02

747	002653	海思科	14,600	297,840.00	0.01
748	600639	浦东金 桥	23,200	296,264.00	0.01
749	600871	石化油 服	138,400	296,176.00	0.01
750	600377	宁沪高 速	33,700	290,494.00	0.01
751	601828	美凯龙	31,970	281,655.70	0.01
752	601228	广州港	84,200	280,386.00	0.01
753	002302	西部建 设	34,300	275,429.00	0.01
754	603708	家家悦	16,500	274,560.00	0.01
755	601298	青岛港	47,600	270,844.00	0.01
756	000046	泛海控 股	141,400	265,832.00	0.01
757	001872	招商港 口	15,400	261,030.00	0.01
758	002948	青岛银 行	56,000	259,280.00	0.01
759	600823	世茂股 份	76,476	250,841.28	0.01
760	002945	华林证 券	18,300	249,978.00	0.01
761	000553	安道麦 A	29,600	249,824.00	0.01
762	001203	大中矿 业	15,300	230,724.00	0.01
763	601568	北元集 团	27,000	219,510.00	0.01
764	600350	山东高 速	42,500	219,300.00	0.01
765	600657	信达地 产	58,200	217,086.00	0.01
766	603056	德邦股 份	21,000	214,830.00	0.01
767	600466	蓝光发 展	102,900	209,916.00	0.01
768	601665	齐鲁银 行	34,300	191,394.00	0.01
769	601003	柳钢股 份	34,900	182,178.00	0.01
770	600917	重庆燃 气	21,400	179,546.00	0.01
771	600903	贵州燃	15,400	149,072.00	0.01

		气			
772	601187	厦门银行	19,800	136,620.00	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（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	688303	大全能源	34,703	2,099,878.53	0.10
2	688187	时代电气	22,351	1,713,204.15	0.08
3	688110	东芯股份	14,044	566,956.28	0.03
4	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
5	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.01
6	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.01
7	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
8	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
9	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
10	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
11	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
12	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
13	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
14	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
15	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
16	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
17	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00

18	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
19	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
20	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
21	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
22	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
23	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
24	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
25	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
26	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
27	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
28	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
29	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
30	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
31	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
32	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
33	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
34	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
35	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
36	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
37	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
38	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
39	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
40	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
41	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
42	301073	君亭酒	144	4,608.00	0.00

		店			
43	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
44	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
45	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
46	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	61,812,732.92	2.64
2	600519	贵州茅台	18,734,470.55	0.80
3	300760	迈瑞医疗	12,704,620.00	0.54
4	000858	五粮液	11,524,759.00	0.49
5	000333	美的集团	8,649,656.30	0.37
6	002466	天齐锂业	8,274,013.00	0.35
7	002415	海康威视	8,268,689.00	0.35
8	688981	中芯国际	7,475,737.28	0.32
9	601816	京沪高铁	7,281,036.00	0.31
10	000725	京东方A	5,940,587.00	0.25
11	300782	卓胜微	5,828,853.00	0.25
12	688111	金山办公	5,821,531.03	0.25
13	000651	格力电器	5,525,256.00	0.24
14	300450	先导智能	5,494,091.00	0.23
15	002475	立讯精密	5,373,005.87	0.23
16	000661	长春高新	5,343,997.84	0.23
17	300059	东方财富	5,268,858.20	0.23
18	002594	比亚迪	4,989,100.70	0.21
19	300015	爱尔眼科	4,596,762.70	0.20
20	000568	泸州老窖	4,586,873.00	0.20

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	21,986,568.95	0.94
2	000333	美的集团	16,619,388.55	0.71
3	000651	格力电器	10,553,935.34	0.45
4	300059	东方财富	10,323,886.82	0.44
5	002594	比亚迪	9,292,224.00	0.40
6	600519	贵州茅台	8,690,283.00	0.37
7	002415	海康威视	8,471,888.86	0.36
8	000001	平安银行	8,369,975.52	0.36
9	600036	招商银行	8,140,588.00	0.35
10	000568	泸州老窖	8,133,559.00	0.35
11	601318	中国平安	8,035,342.00	0.34
12	000725	京东方A	7,803,809.00	0.33
13	600703	三安光电	7,632,748.00	0.33
14	002475	立讯精密	7,399,956.80	0.32
15	000002	万 科A	7,169,457.59	0.31
16	002714	牧原股份	6,675,024.00	0.29
17	000661	长春高新	6,625,063.00	0.28
18	600089	特变电工	6,397,850.00	0.27
19	600276	恒瑞医药	5,807,609.80	0.25
20	002074	国轩高科	5,682,983.00	0.24

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	707,089,751.07
卖出股票收入（成交）总额	783,127,124.73

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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）	2,398,000.00	0.11

8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	2,398,000.00	0.11

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	23,980	2,398,000.00	0.11

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2203	IC2203	22.00	32,145,520.00	282,120.00	
IF2203	IF2203	8.00	11,881,440.00	-277,500.00	
IF2206	IF2206	37.00	54,603,120.00	-872,040.00	
公允价值变动总额合计					-867,420.00
股指期货投资本期收益					11,370,757.29
股指期货投资本期公允价值变动					-4,673,940.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	12,601,710.09
2	应收证券清算款	4,863,087.86
3	应收股利	-
4	应收利息	31,931.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,496,729.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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	000333	美的集团	4,480,267.00	0.21	转融通出借流通受限
2	601012	隆基股份	862,000.00	0.04	转融通出

					借流通受限
3	300750	宁德时代	588,000.00	0.03	转融通出借流通受限
4	601318	中国平安	504,100.00	0.02	转融通出借流通受限
5	600036	招商银行	487,100.00	0.02	转融通出借流通受限
6	600900	长江电力	227,000.00	0.01	转融通出借流通受限
7	601166	兴业银行	190,400.00	0.01	转融通出借流通受限
8	300059	东方财富	129,885.00	0.01	转融通出借流通受限

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	688303	大全能源	2,099,878.53	0.10	新股流通受限
2	688187	时代电气	1,713,204.15	0.08	新股流通受限
3	688110	东芯股份	566,956.28	0.03	新股流通受限
4	688262	国芯科技	299,275.42	0.01	新股流通受限
5	688670	金迪克	171,194.10	0.01	新股流通受限

§ 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	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	汇添富中证 800

数 (户)	额					交易型开放式指 数证券投资基金 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 (%)
2,112	752,574.4 3	1,438,296,967. 00	90.4 9	151,140,231. 00	9.51	3,085,00 0	0.19

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 800 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。

9.2 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	中央汇金资产管理有限责任公司	1,307,627,911.00	82.27
2	张虹	77,900,019.00	4.90
3	中国人寿保险股份有限公司	72,999,974.00	4.59
4	广发证券股份有限公司	8,311,274.00	0.52
5	中国国际金融股份有限公司	7,052,670.00	0.44
6	华泰证券股份有限公司	6,808,967.00	0.43
7	中信建投证券股份有限公司	6,308,032.00	0.40
8	东方证券股份有限公司	5,560,700.00	0.35
9	中信证券股份有限公司	4,756,995.00	0.30
10	国泰君安证券股份有限公司	4,450,476.00	0.28
11	平安银行股份有限公司—汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,085,000.00	0.19

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：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10月08日） 基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	1,793,437,198.00
本报告期基金总申购份额	352,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	556,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,589,437,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

2021年1月26日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021年2月26日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2019年10月08日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 80,000.00 元。

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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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 (%)	
东方证券	2	620,827,814.34	42.50	570,091.97	56.94	
中泰证券	1	504,648,019.79	34.55	157,101.81	15.69	
兴业证券	2	256,493,028.07	17.56	233,741.61	23.35	
海通证券	2	78,782,374.37	5.39	40,282.45	4.02	
广发证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	3,292,006.01	42.23	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	3,519,480.80	45.15	-	-	-	-	-	-
海通证券	984,059.27	12.62	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用, 基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定, 同一基金管理机构托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元: 中信证券 (深交所单元)。

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	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 03 月 30 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、基金产品资料概要	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 05 月 19 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 06 月 09 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金财富证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 06 月 29 日

		所	
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 07 月 21 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于获准设立子公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 08 月 26 日
12	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年中期报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 08 月 31 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 09 月 16 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于本公司及上海分公司办公地址变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 10 月 09 日
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 10 月 27 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 12 月 04 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司投顾业务中通过投资者投顾账户交易本公司旗下基金免除相关费用的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 12 月 23 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者超过 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		超过 20%的 时间 区间					
机构	1	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	82.27
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com

查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 03 月 31 日