

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
2022 年中期报告
2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	64
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	66
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66

8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
9 开放式基金份额变动	68
10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	70
11 影响投资者决策的其他重要信息	73
12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中银 800
场内简称	中银中证 800ETF
基金主代码	515610
交易代码	515610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,857,400.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 8 月 18 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-4,084,309.57
本期利润	-4,649,213.14
加权平均基金份额本期利润	-0.1173
本期加权平均净值利润率	-12.58%
本期基金份额净值增长率	-9.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,429,894.42
期末可供分配基金份额利润	-0.0368
期末基金资产净值	37,427,505.58
期末基金份额净值	0.9632
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.68%

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

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

3.2 基金净值表现

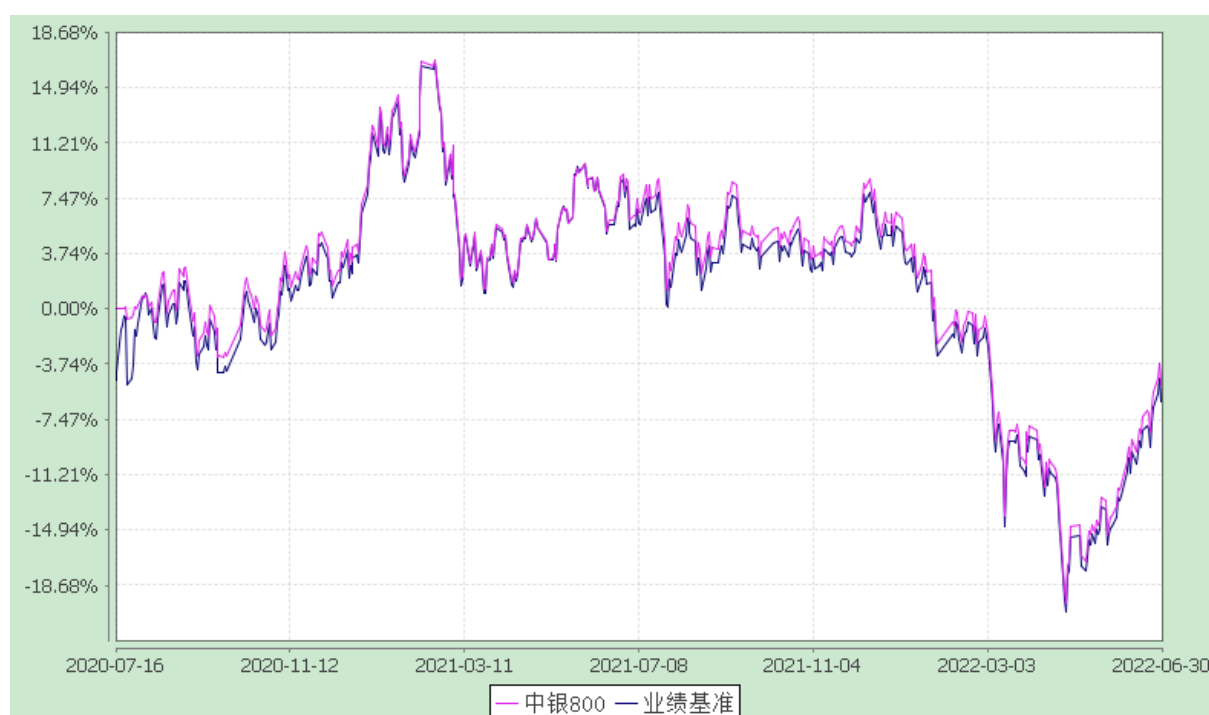
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	9.60%	1.02%	9.00%	1.05%	0.60%	-0.03%
过去三个月	5.75%	1.46%	5.20%	1.48%	0.55%	-0.02%
过去六个月	-9.58%	1.45%	-9.97%	1.46%	0.39%	-0.01%
过去一年	-11.45%	1.20%	-12.16%	1.22%	0.71%	-0.02%
自基金合同生效日起	-3.68%	1.14%	-4.95%	1.22%	1.27%	-0.08%

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2020 年 7 月 16 日至 2022 年 6 月 30 日)



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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 153 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家在高通胀和金融条件收紧背景下经济下行压力加大。美国消费有回落压力，通胀走高，就业市场维持偏紧状态，6 月失业率较 2021 年 12 月下降 0.3 个百分点至 3.6%，6 月制造业 PMI 较 2021 年 12 月回落 5.8 个百分点至 53%，6 月服务业 PMI 较 2021 年 12 月回落 7 个百分点至 55.3%。美联储 3 月、5 月、6 月分别加息 25bps、50bps、75bps，并于 6 月开启缩表。欧元区经济增速放缓，6 月失业率较 2021 年末回落 0.4 个百分点至 6.6%，6 月制造业 PMI 较 2021 年末回落 5.9 个百分点至 52.1%，6 月服务业 PMI 较 2021 年末回落 0.1 个百分点至 53%，欧央行 7 月加息 50bps。日本央行维持基准利率不变，经济恢复速度放缓，通胀有所上行，6 月 CPI 同比较 2021 年末回升 1.4 个百分点至 2.4%，6 月制造业 PMI 较 2021 年末回落 1.6 个百分点至 52.7%。综合来看，全球经济下半年经济下行压力进一步加大，主要经济体央行货币政策依然处于继续收紧状态。

国内经济方面，受疫情冲击国内经济数据先下后上，疫后生产修复明显快于需求，经济结构性分化持续，基建维持高位，出口仍有韧性但下行风险加大，消费增速恢复较慢，地产维持负增长，经济总体处于弱复苏状态，PPI 通胀回落但 CPI 通胀上行。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 先下后上，6 月值较 2021 年 12 月值走低 0.1 个百分点至 50.2%，同步指标工业增加值 6 月同比增长 3.9%，较 2021 年 12 月回落 0.4 个百分点。从经济增长动力来看，出口韧性尚可，投资总体偏强但内部有分化，消费恢复速度偏慢：6 月美元计价出口增速较 2021 年 12 月回落 2.9 个百分点至 17.9%，6 月社会消费品零售总额增速较 2021 年 12 月回升 1.4 个百分点至 3.1%，基建投资与制造业投资较强、房地产投资总体负增长，1-6 月固定资产投资增速较 2021 年末回升 1.2 个百分点至 6.1% 的水平。通胀方面，CPI 震荡上行，6 月同比增速从 2021 年 12 月的 1.5% 上升 1 个百分点至 2.5%，PPI 有所回落，6 月同比增速从 2021 年 12 月的 10.3% 回落 4.2 个百分点至 6.1%。

2、行情回顾

年初到 4 月份，投资者担心中国经济存在硬着陆的风险，对经济增长极度悲观，叠加俄乌事件

带动全球政治格局动荡，导致在疫情防控期间，市场跌幅较大。5 月份以来，随着上海解封，疫情好转，宏观政策积极，疫情防控科学化，投资者对经济的增长预期明显好转，风险偏好有回升，指数反转向。从各行业来看，煤炭（31.38%）、交通运输（-0.71%）、综合（-1.46%）等行业表现较好，电子（-24.46%）、计算机（-23.64%）、传媒（-22.25%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为-10.44%；中证 100 涨跌幅-8.07%；上证国企指数涨跌幅-4.68%，中证 800 指数涨跌-9.97%。

3. 运行分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-9.58%，同期业绩比较基准收益率为-9.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，高通胀压力肆虐全球，海外主要央行不得不调整货币政策收缩的节奏。同时，经济衰退的阴影逐渐成为悬在全球资本市场头上的达摩克利斯之剑，加剧了全球金融市场的波动。国内“稳增长”政策落地叠加疫情冲击逐步消退，基本面预期最悲观时刻或已然过去。疲软的外需或将抑制出口，但国内需求的恢复和刺激政策的落地预计将主导下半年中国经济的复苏。经济预期上修，风险偏好与风险评价积极变化，中国经济有望在下半年迎来企稳的拐点，并将驱动 A 股走强。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本报告期末可供分配利润为 -1,429,894.42 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自本报告期初至 2022 年 2 月 22 日、2022 年 2 月 24 日至 2022 年 5 月 10 日、2022 年 5 月 12 日至本报告期末已出现连续超过 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2022 年中期报告中的财务指标、

净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	885,089.54	705,629.97
结算备付金		161,153.37	9,304.56
存出保证金		21,767.69	21,102.13
交易性金融资产	6.4.7.2	36,502,098.91	47,205,878.37
其中：股票投资		36,497,498.50	47,205,878.37
基金投资		-	-
债券投资		4,600.41	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	48,706.91
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	153.72
资产总计		37,645,725.75	47,990,775.66
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.01	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,447.68	17,495.42
应付托管费		1,383.07	1,943.94
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	204,389.41	184,859.44
负债合计		218,220.17	204,298.80
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	38,857,400.00	44,857,400.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,429,894.42	2,929,076.86
净资产合计		37,427,505.58	47,786,476.86
负债和净资产总计		37,645,725.75	47,990,775.66

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9632 元，基金份额总额 38,857,400.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,412,910.79	2,594,612.93
1.利息收入		2,802.26	5,697.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,802.26	5,685.34
债券利息收入		-	12.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,917,813.92	5,243,692.98
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,268,643.87	4,939,835.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,232.41	9,740.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	341,597.54	294,117.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-564,903.57	-2,697,010.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	67,004.44	42,232.90
减：二、营业总支出		236,302.35	357,229.80

1. 管理人报酬	6.4.10.2	82,629.83	100,567.46
2. 托管费	6.4.10.2	9,181.13	11,174.19
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	0.02
8. 其他费用	6.4.7.17	144,491.39	245,488.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,649,213.14	2,237,383.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,649,213.14	2,237,383.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,649,213.14	2,237,383.13

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	44,857,400.00	-	2,929,076.86	47,786,476.86
二、本期期初净资产（基金净值）	44,857,400.00	-	2,929,076.86	47,786,476.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-	-4,358,971.28	-10,358,971.28
（一）、综合收益总额	-	-	-4,649,213.14	-4,649,213.14
（二）、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）	-6,000,000.00	-	290,241.86	-5,709,758.14

其中：1.基金申购款	39,000,000.00	-	-4,299,032.27	34,700,967.73
2.基金赎回款	-45,000,000.00	-	4,589,274.13	-40,410,725.87
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	38,857,400.00	-	-1,429,894.42	37,427,505.58
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	62,857,400.00	-	4,437,932.02	67,295,332.02
二、本期期初净资产(基金净值)	62,857,400.00	-	4,437,932.02	67,295,332.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	-	-1,555,047.81	-31,555,047.81
(一)、综合收益总额	-	-	2,237,383.13	2,237,383.13
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	-	-3,792,430.94	-33,792,430.94
其中：1.基金申购款	18,000,000.00	-	974,041.52	18,974,041.52
2.基金赎回款	-48,000,000.00	-	-4,766,472.46	-52,766,472.46
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	32,857,400.00	-	2,882,884.21	35,740,284.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行人募集,基金合同于 2020 年 7 月 16 日正式生效,首次设立募集规模为 377,857,400.00 份基金份额。

本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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

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

本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及基金管理人中银基金管理股份有限公司于 2022 年 7 月 22 日发布的《中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2022 年 8 月 5 日进入财产清算期，详情参见附注 6.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时,可进行收益分配;收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除

息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：1. 会计政策变更的性质、内容和原因(a) 金融资产和金融负债的分类金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。(1) 金融资产金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。债务工具本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：以摊余成本计量：本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。以公允价值计量且其变动计入当期损益：本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。权益工具权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量

且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。(2) 金融负债金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。(3) 衍生金融工具本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。(b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值

与支付的对价之间的差额，计入当期损益。(c) 收入/(损失)的确认和计量 股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额(a) 金融工具根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 705,629.97 元、9,304.56 元、21,102.13 元、153.72 元和 48,706.91 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 705,769.99 元、9,308.76 元、21,111.63 元、0.00 元和 48,706.91 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 47,205,878.37 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 47,205,878.37 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 17,495.42 元、1,943.94 元、21,571.28 元和 3,288.16 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 17,495.42 元、1,943.94 元、21,571.28 元和 3,288.16 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。(b) 根据中国证监会于 2022 年颁布

的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	885,089.54
等于：本金	884,945.09
加：应计利息	144.45
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	885,089.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		36,926,972.59	-	36,497,498.50	-429,474.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,600.00	0.41	4,600.41	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,600.00	0.41	4,600.41	-
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		36,931,572.59	0.41	36,502,098.91	-429,474.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	24,413.98
其中：交易所市场	24,413.98
银行间市场	-
应付利息	-
IOPV 计算发布费	24,795.19
应付信息披露费	104,795.19
应付审计费	44,876.39
应付指数使用费	5,508.66
合计	204,389.41

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,857,400.00	44,857,400.00
本期申购	39,000,000.00	39,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-45,000,000.00	-45,000,000.00
本期末	38,857,400.00	38,857,400.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	8,272,165.14	-5,343,088.28	2,929,076.86
本期利润	-4,084,309.57	-564,903.57	-4,649,213.14
本期基金份额交易产生的变动数	-411,590.94	701,832.80	290,241.86
其中：基金申购款	6,278,751.03	-10,577,783.30	-4,299,032.27
基金赎回款	-6,690,341.97	11,279,616.10	4,589,274.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,776,264.63	-5,206,159.05	-1,429,894.42

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	505.91

其他	145.15
合计	2,802.26

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,613,914.93
股票投资收益——赎回差价收入	-1,654,728.94
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,268,643.87

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,466,292.79
减：卖出股票成本总额	22,024,204.41
减：交易费用	56,003.31
买卖股票差价收入	-2,613,914.93

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	40,410,725.87
减：现金支付赎回款总额	17,474,806.87
减：赎回股票成本总额	24,590,647.94
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,654,728.94

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	6.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,226.05
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,232.41

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	47,032.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	37,800.00
减：应计利息总额	5.95
减：交易费用	0.26
买卖债券差价收入	9,226.05

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	341,597.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	341,597.54

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-564,903.57
——股票投资	-564,903.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-564,903.57

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
替代损益	67,004.44
合计	67,004.44

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行汇划费	132.00
存托服务费	0.20
IOPV 计算发布费	24,795.19
ETF 注册登记费	74,383.76
指数使用费	5,508.66
合计	144,491.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

2022 年 8 月 4 日为本基金最后运作日，自 2022 年 8 月 5 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回等业务，并且之后不再恢复，且自该日起，本基金停牌直至终止上市。本基金进入清算程序后，不再计提本基金的基金管理费和基金托管费。本基金管理人将根据基金财产清算情况，按照上海证券交易所的规定办理本基金的终止上市等业务。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	82,629.83	100,567.46
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,181.13	11,174.19

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
期初持有的基金份额	12,498,100.00	-
期间申购/买入总份额	-	4,895,200.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,498,100.00	4,895,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.16%	14.90%

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	885,089.54	2,151.20	964,931.07	4,243.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	配债	70	7,000.00
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	0	0.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
113060	浙 22 转债	2022-06-15	1 个月内	配债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.30	-
127064	杭氧转债	2022-05-19	2 个月内	配债未上市	100.00	100.00	6	600.00	600.11	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
002670	国盛金控	2022-06-01	重大事项停牌	9.60	2022-07-14	9.99	1,600	15,179.53	15,360.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末, 本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型, 日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估, 并通过相应决策, 将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资占基金资产净值的比例为 0.01% (于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资)。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	4,000.30	-
AAA 以下	600.11	-
未评级	-	-
合计	4,600.41	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

于 2022 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	885,089.54	-	-	-	885,089.54
结算备付金	161,153.37	-	-	-	161,153.37
存出保证金	21,767.69	-	-	-	21,767.69
交易性金融资产	-	-	4,600.41	36,497,498.50	36,502,098.91
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	1,068,010.60	-	4,600.41	36,573,114.74	37,645,725.75
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付管理人报酬	-	-	-	12,447.68	12,447.68
应付托管费	-	-	-	1,383.07	1,383.07
其他负债	-	-	-	204,389.41	204,389.41

负债总计	-	-	-	218,220.17	218,220.17
利率敏感度缺口	1,068,010.60	-	4,600.41	36,354,894.57	37,427,505.58
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	705,629.97	-	-	-	705,629.97
结算备付金	9,304.56	-	-	-	9,304.56
存出保证金	21,102.13	-	-	-	21,102.13
交易性金融资产	-	-	-	47,205,878.37	47,205,878.37
应收证券清算款	-	-	-	48,706.91	48,706.91
应收利息	-	-	-	153.72	153.72
资产总计	736,036.66	-	-	47,254,739.00	47,990,775.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,495.42	17,495.42
应付托管费	-	-	-	1,943.94	1,943.94
应付交易费用	-	-	-	21,571.28	21,571.28
其他负债	-	-	-	163,288.16	163,288.16
负债总计	-	-	-	204,298.80	204,298.80
利率敏感度缺口	736,036.66	-	-	47,050,440.20	47,786,476.86

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2021 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	36,497,498.50	97.52	47,205,878.37	98.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	36,497,498.50	97.52	47,205,878.37	98.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 184	增加约 233
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 184	减少约 233

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	36,482,138.50	47,178,575.55
第二层次	19,960.41	27,302.82
第三层次	-	-

合计	36,502,098.91	47,205,878.37
----	---------------	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,497,498.50	96.95
	其中：股票	36,497,498.50	96.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,600.41	0.01
	其中：债券	4,600.41	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,046,242.91	2.78
8	其他各项资产	97,383.93	0.26
9	合计	37,645,725.75	100.00

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	420,295.80	1.12
B	采矿业	1,168,417.40	3.12
C	制造业	21,676,231.66	57.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	972,620.00	2.60
E	建筑业	657,249.96	1.76
F	批发和零售业	411,495.84	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	970,283.80	2.59
H	住宿和餐饮业	19,840.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,504,284.48	4.02
J	金融业	6,380,317.43	17.05
K	房地产业	732,203.00	1.96
L	租赁和商务服务业	500,949.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	528,655.36	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	62,952.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,054.00	0.04
Q	卫生和社会工作	260,083.77	0.69
R	文化、体育和娱乐业	151,370.00	0.40
S	综合	65,195.00	0.17
	合计	36,497,498.50	97.52

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

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	903	1,846,635.00	4.93
2	300750	宁德时代	1,800	961,200.00	2.57
3	600036	招商银行	16,400	692,080.00	1.85
4	601318	中国平安	14,300	667,667.00	1.78
5	601012	隆基绿能	7,982	531,840.66	1.42
6	000858	五粮液	2,600	525,018.00	1.40
7	002594	比亚迪	1,200	400,188.00	1.07
8	000333	美的集团	6,500	392,535.00	1.05
9	601166	兴业银行	19,300	384,070.00	1.03
10	300059	东方财富	13,976	354,990.40	0.95
11	600900	长江电力	15,100	349,112.00	0.93
12	601888	中国中免	1,300	302,809.00	0.81
13	600030	中信证券	12,835	278,006.10	0.74
14	603259	药明康德	2,664	277,029.36	0.74
15	600887	伊利股份	6,800	264,860.00	0.71
16	000568	泸州老窖	1,000	246,540.00	0.66
17	002415	海康威视	6,300	228,060.00	0.61
18	601398	工商银行	46,500	221,805.00	0.59
19	600276	恒瑞医药	5,960	221,056.40	0.59
20	002475	立讯精密	6,500	219,635.00	0.59
21	300760	迈瑞医疗	700	219,240.00	0.59
22	600438	通威股份	3,600	215,496.00	0.58
23	600809	山西汾酒	660	214,368.00	0.57
24	000651	格力电器	6,300	212,436.00	0.57
25	600309	万华化学	2,100	203,679.00	0.54
26	002812	恩捷股份	800	200,360.00	0.54
27	002714	牧原股份	3,560	196,761.20	0.53
28	000725	京东方 A	49,600	195,424.00	0.52
29	000001	平安银行	12,900	193,242.00	0.52
30	002142	宁波银行	5,210	186,570.10	0.50
31	000002	万科 A	9,000	184,500.00	0.49
32	601328	交通银行	36,408	181,311.84	0.48
33	601899	紫金矿业	19,100	178,203.00	0.48
34	002129	中环股份	3,000	176,670.00	0.47
35	002466	天齐锂业	1,400	174,720.00	0.47
36	000792	盐湖股份	5,800	173,768.00	0.46
37	600048	保利发展	9,500	165,870.00	0.44

38	002460	赣锋锂业	1,100	163,570.00	0.44
39	300015	爱尔眼科	3,601	161,216.77	0.43
40	603288	海天味业	1,768	159,756.48	0.43
41	603799	华友钴业	1,660	158,729.20	0.42
42	300124	汇川技术	2,400	158,088.00	0.42
43	600031	三一重工	7,900	150,574.00	0.40
44	601668	中国建筑	27,800	147,896.00	0.40
45	002304	洋河股份	800	146,520.00	0.39
46	300014	亿纬锂能	1,500	146,250.00	0.39
47	002352	顺丰控股	2,600	145,106.00	0.39
48	601088	中国神华	4,300	143,190.00	0.38
49	600436	片仔癀	400	142,692.00	0.38
50	300498	温氏股份	6,700	142,643.00	0.38
51	002271	东方雨虹	2,700	138,969.00	0.37
52	300274	阳光电源	1,400	137,550.00	0.37
53	600690	海尔智家	5,000	137,300.00	0.37
54	600089	特变电工	5,000	136,950.00	0.37
55	603986	兆易创新	940	133,677.40	0.36
56	601816	京沪高铁	26,100	131,022.00	0.35
57	601288	农业银行	42,400	128,048.00	0.34
58	600837	海通证券	12,800	125,568.00	0.34
59	600000	浦发银行	15,491	124,082.91	0.33
60	600016	民生银行	32,900	122,388.00	0.33
61	300122	智飞生物	1,100	122,111.00	0.33
62	688981	中芯国际	2,700	121,959.00	0.33
63	603501	韦尔股份	700	121,121.00	0.32
64	600406	国电南瑞	4,416	119,232.00	0.32
65	601919	中远海控	8,400	116,760.00	0.31
66	000625	长安汽车	6,578	113,930.96	0.30
67	600585	海螺水泥	3,200	112,896.00	0.30
68	600919	江苏银行	15,590	111,000.80	0.30
69	601688	华泰证券	7,800	110,760.00	0.30
70	600104	上汽集团	6,200	110,422.00	0.30
71	601225	陕西煤业	5,200	110,136.00	0.29
72	601601	中国太保	4,600	108,238.00	0.29
73	000063	中兴通讯	4,200	107,226.00	0.29
74	300142	沃森生物	2,200	106,458.00	0.28
75	002709	天赐材料	1,700	105,502.00	0.28
76	002241	歌尔股份	3,100	104,160.00	0.28
77	002230	科大讯飞	2,500	103,050.00	0.28
78	600111	北方稀土	2,900	101,964.00	0.27
79	688599	天合光能	1,500	97,875.00	0.26
80	002459	晶澳科技	1,220	96,258.00	0.26
81	002049	紫光国微	500	94,860.00	0.25

82	000661	长春高新	400	93,368.00	0.25
83	600660	福耀玻璃	2,200	91,982.00	0.25
84	601211	国泰君安	6,000	91,200.00	0.24
85	601988	中国银行	27,900	90,954.00	0.24
86	002027	分众传媒	13,400	90,182.00	0.24
87	000338	潍柴动力	7,200	89,784.00	0.24
88	000100	TCL 科技	18,700	89,573.00	0.24
89	601169	北京银行	19,600	88,984.00	0.24
90	300450	先导智能	1,400	88,452.00	0.24
91	601229	上海银行	13,100	85,805.00	0.23
92	601985	中国核电	12,500	85,750.00	0.23
93	600745	闻泰科技	1,000	85,110.00	0.23
94	600050	中国联通	24,500	84,770.00	0.23
95	601766	中国中车	16,200	84,240.00	0.23
96	601390	中国中铁	13,700	84,118.00	0.22
97	600522	中天科技	3,600	83,160.00	0.22
98	002371	北方华创	300	83,136.00	0.22
99	300347	泰格医药	700	80,115.00	0.21
100	601669	中国电建	10,100	79,487.00	0.21
101	601615	明阳智能	2,300	77,740.00	0.21
102	600893	航发动力	1,700	77,367.00	0.21
103	601658	邮储银行	14,300	77,077.00	0.21
104	603659	璞泰来	900	75,960.00	0.20
105	600009	上海机场	1,300	73,710.00	0.20
106	000776	广发证券	3,900	72,930.00	0.19
107	600028	中国石化	17,700	72,216.00	0.19
108	600905	三峡能源	11,400	71,706.00	0.19
109	600019	宝钢股份	11,800	71,036.00	0.19
110	600010	包钢股份	30,200	70,970.00	0.19
111	002410	广联达	1,300	70,772.00	0.19
112	600999	招商证券	4,900	70,609.00	0.19
113	600196	复星医药	1,600	70,544.00	0.19
114	600958	东方证券	6,896	70,408.16	0.19
115	601009	南京银行	6,600	68,772.00	0.18
116	002179	中航光电	1,080	68,385.60	0.18
117	601628	中国人寿	2,200	68,376.00	0.18
118	601857	中国石油	12,900	68,370.00	0.18
119	000895	双汇发展	2,300	67,390.00	0.18
120	600570	恒生电子	1,540	67,051.60	0.18
121	300759	康龙化成	700	66,654.00	0.18
122	600760	中航沈飞	1,100	66,495.00	0.18
123	002311	海大集团	1,100	66,011.00	0.18
124	002050	三花智控	2,400	65,952.00	0.18
125	601818	光大银行	21,800	65,618.00	0.18

126	600256	广汇能源	6,100	64,294.00	0.17
127	002493	荣盛石化	4,050	62,329.50	0.17
128	600346	恒力石化	2,800	62,272.00	0.17
129	300316	晶盛机电	900	60,831.00	0.16
130	300896	爱美客	100	60,001.00	0.16
131	002074	国轩高科	1,300	59,280.00	0.16
132	601633	长城汽车	1,600	59,264.00	0.16
133	688111	金山办公	300	59,136.00	0.16
134	600926	杭州银行	3,900	58,422.00	0.16
135	688012	中微公司	500	58,375.00	0.16
136	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.15
137	600426	华鲁恒升	1,970	57,524.00	0.15
138	600460	士兰微	1,100	57,200.00	0.15
139	000538	云南白药	940	56,766.60	0.15
140	600176	中国巨石	3,258	56,721.78	0.15
141	002001	新和成	2,476	56,477.56	0.15
142	001979	招商蛇口	4,200	56,406.00	0.15
143	601989	中国重工	15,100	56,021.00	0.15
144	002202	金风科技	3,700	54,760.00	0.15
145	300661	圣邦股份	300	54,606.00	0.15
146	000768	中航西飞	1,800	54,522.00	0.15
147	000963	华东医药	1,200	54,192.00	0.14
148	601939	建设银行	8,900	53,934.00	0.14
149	600096	云天化	1,700	53,516.00	0.14
150	603993	洛阳钼业	9,300	53,289.00	0.14
151	603806	福斯特	800	52,416.00	0.14
152	600763	通策医疗	300	52,332.00	0.14
153	300496	中科创达	400	52,192.00	0.14
154	601138	工业富联	5,300	52,152.00	0.14
155	601006	大秦铁路	7,900	52,061.00	0.14
156	300012	华测检测	2,200	51,062.00	0.14
157	000166	申万宏源	11,900	51,051.00	0.14
158	002180	纳思达	1,000	50,620.00	0.14
159	300207	欣旺达	1,600	50,560.00	0.14
160	601877	正泰电器	1,400	50,092.00	0.13
161	601377	兴业证券	7,100	50,055.00	0.13
162	600588	用友网络	2,300	49,933.00	0.13
163	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.13
164	601600	中国铝业	10,400	49,400.00	0.13
165	601066	中信建投	1,700	49,147.00	0.13
166	600029	南方航空	6,700	48,977.00	0.13
167	002497	雅化集团	1,500	48,975.00	0.13
168	002407	多氟多	1,000	48,910.00	0.13
169	600584	长电科技	1,800	48,600.00	0.13

170	600141	兴发集团	1,100	48,389.00	0.13
171	600383	金地集团	3,600	48,384.00	0.13
172	600741	华域汽车	2,100	48,300.00	0.13
173	002240	盛新锂能	800	48,288.00	0.13
174	601186	中国铁建	6,100	48,190.00	0.13
175	601838	成都银行	2,900	48,082.00	0.13
176	600085	同仁堂	900	47,592.00	0.13
177	600188	兖矿能源	1,200	47,376.00	0.13
178	000009	中国宝安	3,500	47,215.00	0.13
179	600885	宏发股份	1,120	46,872.00	0.13
180	600157	永泰能源	29,400	46,746.00	0.12
181	600795	国电电力	11,800	46,138.00	0.12
182	601117	中国化学	4,900	46,109.00	0.12
183	603369	今世缘	900	45,900.00	0.12
184	600150	中国船舶	2,400	45,552.00	0.12
185	601111	中国国航	3,900	45,279.00	0.12
186	300408	三环集团	1,500	45,150.00	0.12
187	000786	北新建材	1,300	45,006.00	0.12
188	600547	山东黄金	2,400	44,544.00	0.12
189	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.12
190	000876	新希望	2,900	44,370.00	0.12
191	601238	广汽集团	2,900	44,196.00	0.12
192	601788	光大证券	2,800	44,128.00	0.12
193	600132	重庆啤酒	300	43,980.00	0.12
194	300390	天华超净	500	43,700.00	0.12
195	003816	中国广核	15,600	43,680.00	0.12
196	601800	中国交建	4,700	43,616.00	0.12
197	603019	中科曙光	1,500	43,530.00	0.12
198	300601	康泰生物	960	43,372.80	0.12
199	300999	金龙鱼	800	43,216.00	0.12
200	601100	恒立液压	700	43,204.00	0.12
201	300782	卓胜微	320	43,200.00	0.12
202	600989	宝丰能源	2,900	42,485.00	0.11
203	300595	欧普康视	740	42,320.60	0.11
204	600015	华夏银行	8,100	42,201.00	0.11
205	600600	青岛啤酒	400	41,568.00	0.11
206	600011	华能国际	5,900	41,536.00	0.11
207	002648	卫星化学	1,600	41,360.00	0.11
208	002384	东山精密	1,800	41,274.00	0.11
209	600115	中国东航	7,500	41,175.00	0.11
210	600563	法拉电子	200	41,032.00	0.11
211	600886	国投电力	3,900	40,950.00	0.11
212	300769	德方纳米	100	40,868.00	0.11
213	601868	中国能建	17,228	40,830.36	0.11

214	600392	盛和资源	1,800	40,680.00	0.11
215	000157	中联重科	6,600	40,656.00	0.11
216	000301	东方盛虹	2,400	40,584.00	0.11
217	688099	晶晨股份	400	40,400.00	0.11
218	300285	国瓷材料	1,100	39,512.00	0.11
219	600418	江淮汽车	2,300	39,468.00	0.11
220	002236	大华股份	2,400	39,408.00	0.11
221	000425	徐工机械	7,300	39,347.00	0.11
222	600765	中航重机	1,220	39,259.60	0.10
223	688005	容百科技	300	38,832.00	0.10
224	603444	吉比特	100	38,800.00	0.10
225	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.10
226	603613	国联股份	435	38,541.00	0.10
227	600399	抚顺特钢	2,100	37,590.00	0.10
228	000938	紫光股份	1,920	37,248.00	0.10
229	601058	赛轮轮胎	3,300	37,191.00	0.10
230	601916	浙商银行	11,100	36,852.00	0.10
231	300037	新宙邦	700	36,792.00	0.10
232	601555	东吴证券	5,300	36,729.00	0.10
233	600233	圆通速递	1,800	36,702.00	0.10
234	603486	科沃斯	300	36,567.00	0.10
235	002008	大族激光	1,100	36,443.00	0.10
236	002736	国信证券	3,800	36,366.00	0.10
237	600487	亨通光电	2,500	36,350.00	0.10
238	688008	澜起科技	600	36,348.00	0.10
239	600732	爱旭股份	1,100	36,322.00	0.10
240	600941	中国移动	600	36,300.00	0.10
241	601901	方正证券	5,400	36,234.00	0.10
242	603456	九洲药业	700	36,190.00	0.10
243	000983	山西焦煤	2,700	36,153.00	0.10
244	300073	当升科技	400	36,136.00	0.10
245	002555	三七互娱	1,700	36,091.00	0.10
246	002601	龙佰集团	1,800	36,090.00	0.10
247	002385	大北农	4,600	35,926.00	0.10
248	600352	浙江龙盛	3,500	35,630.00	0.10
249	300529	健帆生物	700	35,623.00	0.10
250	601995	中金公司	800	35,592.00	0.10
251	601336	新华保险	1,100	35,409.00	0.09
252	603260	合盛硅业	300	35,388.00	0.09
253	600499	科达制造	1,700	35,088.00	0.09
254	600219	南山铝业	9,500	35,055.00	0.09
255	000069	华侨城 A	5,400	35,046.00	0.09
256	603077	和邦生物	8,100	34,506.00	0.09
257	688126	沪硅产业	1,500	34,470.00	0.09

258	000977	浪潮信息	1,300	34,424.00	0.09
259	002268	卫士通	800	34,328.00	0.09
260	601799	星宇股份	200	34,200.00	0.09
261	600298	安琪酵母	700	34,125.00	0.09
262	002120	韵达股份	2,000	34,120.00	0.09
263	601108	财通证券	4,320	33,998.40	0.09
264	603345	安井食品	200	33,574.00	0.09
265	300413	芒果超媒	1,000	33,360.00	0.09
266	601618	中国中冶	9,400	32,900.00	0.09
267	601360	三六零	3,800	32,376.00	0.09
268	002353	杰瑞股份	800	32,240.00	0.09
269	300144	宋城演艺	2,100	32,235.00	0.09
270	000519	中兵红箭	1,100	32,065.00	0.09
271	300763	锦浪科技	150	31,950.00	0.09
272	000630	铜陵有色	9,800	31,948.00	0.09
273	002007	华兰生物	1,400	31,920.00	0.09
274	600332	白云山	1,000	31,590.00	0.08
275	603392	万泰生物	203	31,525.90	0.08
276	002252	上海莱士	5,300	31,429.00	0.08
277	603185	上机数控	200	31,198.00	0.08
278	300363	博腾股份	400	31,196.00	0.08
279	300454	深信服	300	31,134.00	0.08
280	002507	涪陵榨菜	900	31,068.00	0.08
281	600862	中航高科	1,100	30,910.00	0.08
282	601077	渝农商行	8,300	30,710.00	0.08
283	601155	新城控股	1,200	30,516.00	0.08
284	000703	恒逸石化	2,900	30,479.00	0.08
285	300628	亿联网络	400	30,460.00	0.08
286	002756	永兴材料	200	30,442.00	0.08
287	000783	长江证券	5,100	30,243.00	0.08
288	603833	欧派家居	200	30,136.00	0.08
288	688180	君实生物	400	30,136.00	0.08
290	002841	视源股份	400	30,128.00	0.08
291	000988	华工科技	1,300	30,121.00	0.08
292	600845	宝信软件	550	30,030.00	0.08
293	300003	乐普医疗	1,600	29,712.00	0.08
294	601878	浙商证券	2,600	29,588.00	0.08
295	601168	西部矿业	2,500	29,575.00	0.08
296	688396	华润微	500	29,535.00	0.08
297	300751	迈为股份	60	29,454.00	0.08
298	002602	世纪华通	6,100	29,402.00	0.08
299	002625	光启技术	1,700	29,359.00	0.08
300	002056	横店东磁	1,100	29,282.00	0.08
301	601696	中银证券	2,200	29,260.00	0.08

302	688777	中控技术	400	29,104.00	0.08
303	603026	石大胜华	200	29,070.00	0.08
304	601162	天风证券	9,100	28,938.00	0.08
305	300033	同花顺	300	28,845.00	0.08
305	002797	第一创业	4,500	28,845.00	0.08
307	600489	中金黄金	3,900	28,821.00	0.08
308	300433	蓝思科技	2,600	28,782.00	0.08
309	002028	思源电气	800	28,528.00	0.08
310	688363	华熙生物	200	28,436.00	0.08
311	600918	中泰证券	3,700	28,305.00	0.08
312	300146	汤臣倍健	1,300	28,145.00	0.08
313	000066	中国长城	2,600	28,132.00	0.08
314	002916	深南电路	300	28,113.00	0.08
315	601636	旗滨集团	2,200	28,050.00	0.07
316	603899	晨光股份	500	28,040.00	0.07
317	000932	华菱钢铁	5,500	27,995.00	0.07
318	605117	德业股份	100	27,989.00	0.07
319	688122	西部超导	300	27,660.00	0.07
320	601128	常熟银行	3,600	27,504.00	0.07
321	600521	华海药业	1,200	27,240.00	0.07
322	002185	华天科技	2,900	27,202.00	0.07
323	002938	鹏鼎控股	900	27,189.00	0.07
324	601607	上海医药	1,500	27,120.00	0.07
325	600988	赤峰黄金	1,700	27,115.00	0.07
326	002078	太阳纸业	2,200	27,082.00	0.07
327	603267	鸿远电子	200	26,866.00	0.07
328	601728	中国电信	7,200	26,856.00	0.07
329	300724	捷佳伟创	300	26,805.00	0.07
330	688036	传音控股	300	26,769.00	0.07
331	601865	福莱特	700	26,670.00	0.07
332	600486	扬农化工	200	26,656.00	0.07
333	002326	永太科技	800	26,344.00	0.07
334	600039	四川路桥	2,500	26,325.00	0.07
335	002603	以岭药业	1,080	26,244.00	0.07
336	000708	中信特钢	1,300	26,195.00	0.07
337	600153	建发股份	2,000	26,140.00	0.07
338	600109	国金证券	2,900	26,100.00	0.07
339	002791	坚朗五金	200	25,944.00	0.07
340	000830	鲁西化工	1,500	25,935.00	0.07
341	002624	完美世界	1,800	25,866.00	0.07
342	600183	生益科技	1,500	25,485.00	0.07
343	600497	驰宏锌锗	4,900	25,431.00	0.07
344	600546	山煤国际	1,300	25,298.00	0.07
345	000738	航发控制	900	25,290.00	0.07

346	600705	中航产融	7,300	25,258.00	0.07
347	600177	雅戈尔	3,800	25,194.00	0.07
348	600018	上港集团	4,300	25,069.00	0.07
349	000831	五矿稀土	800	25,000.00	0.07
350	600362	江西铜业	1,400	24,962.00	0.07
351	601898	中煤能源	2,400	24,912.00	0.07
352	300919	中伟股份	200	24,780.00	0.07
353	603882	金域医学	300	24,765.00	0.07
354	002572	索菲亚	900	24,750.00	0.07
355	600348	华阳股份	1,600	24,736.00	0.07
356	600875	东方电气	1,500	24,675.00	0.07
357	601872	招商轮船	4,280	24,652.80	0.07
358	002138	顺络电子	900	24,525.00	0.07
359	300088	长信科技	3,300	24,486.00	0.07
360	000970	中科三环	1,295	24,320.10	0.06
361	002422	科伦药业	1,300	24,310.00	0.06
362	002673	西部证券	3,700	24,198.00	0.06
363	601990	南京证券	2,900	24,186.00	0.06
364	002568	百润股份	800	24,032.00	0.06
365	600143	金发科技	2,500	23,800.00	0.06
366	600549	厦门钨业	1,100	23,782.00	0.06
367	600160	巨化股份	1,800	23,670.00	0.06
368	300699	光威复材	400	23,548.00	0.06
369	603589	口子窖	400	23,444.00	0.06
370	601699	潞安环能	1,600	23,392.00	0.06
371	600859	王府井	900	23,382.00	0.06
372	601021	春秋航空	400	23,340.00	0.06
373	000998	隆平高科	1,400	23,324.00	0.06
374	603517	绝味食品	400	23,128.00	0.06
375	603605	珀莱雅	140	23,125.20	0.06
376	002030	达安基因	1,340	23,034.60	0.06
377	600516	方大炭素	3,000	22,800.00	0.06
378	002557	洽洽食品	400	22,772.00	0.06
379	603127	昭衍新药	200	22,760.00	0.06
380	000807	云铝股份	2,300	22,724.00	0.06
381	601997	贵阳银行	3,900	22,659.00	0.06
382	000999	华润三九	500	22,500.00	0.06
383	002294	信立泰	800	22,480.00	0.06
384	601216	君正集团	4,600	22,448.00	0.06
385	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.06
386	002414	高德红外	1,736	22,342.32	0.06
387	600061	国投资本	3,492	22,209.12	0.06
388	300058	蓝色光标	3,400	22,202.00	0.06
389	000039	中集集团	1,600	22,160.00	0.06

390	000629	攀钢钒钛	5,800	22,040.00	0.06
391	000975	银泰黄金	2,260	22,012.40	0.06
392	600482	中国动力	1,400	21,994.00	0.06
393	300136	信维通信	1,300	21,905.00	0.06
394	600161	天坛生物	900	21,852.00	0.06
395	002465	海格通信	2,400	21,816.00	0.06
396	000960	锡业股份	1,300	21,801.00	0.06
397	002273	水晶光电	1,800	21,798.00	0.06
398	300244	迪安诊断	700	21,770.00	0.06
399	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.06
400	300308	中际旭创	700	21,735.00	0.06
401	002372	伟星新材	900	21,636.00	0.06
402	002508	老板电器	600	21,618.00	0.06
403	600170	上海建工	7,100	21,513.00	0.06
404	300676	华大基因	300	21,510.00	0.06
405	000728	国元证券	3,450	21,459.00	0.06
406	601577	长沙银行	2,700	21,411.00	0.06
407	601319	中国人保	4,200	21,252.00	0.06
408	300223	北京君正	200	21,250.00	0.06
409	603939	益丰药房	400	21,132.00	0.06
410	600606	绿地控股	5,335	21,126.60	0.06
411	600536	中国软件	520	21,106.80	0.06
412	300253	卫宁健康	2,400	21,072.00	0.06
413	600704	物产中大	4,100	21,033.00	0.06
414	002092	中泰化学	2,700	20,952.00	0.06
415	300357	我武生物	400	20,812.00	0.06
416	300418	昆仑万维	1,300	20,800.00	0.06
416	600079	人福医药	1,300	20,800.00	0.06
418	000636	风华高科	1,100	20,669.00	0.06
419	002223	鱼跃医疗	800	20,528.00	0.05
420	300474	景嘉微	300	20,517.00	0.05
421	002739	万达电影	1,500	20,475.00	0.05
422	002506	协鑫集成	5,500	20,460.00	0.05
423	600699	均胜电子	1,300	20,423.00	0.05
424	600739	辽宁成大	1,400	20,412.00	0.05
425	000547	航天发展	1,700	20,298.00	0.05
426	601966	玲珑轮胎	800	20,296.00	0.05
427	601016	节能风电	4,200	20,160.00	0.05
428	000887	中鼎股份	1,100	20,064.00	0.05
429	600415	小商品城	3,600	20,052.00	0.05
430	600171	上海贝岭	800	20,024.00	0.05
431	002439	启明星辰	1,000	19,930.00	0.05
432	600258	首旅酒店	800	19,840.00	0.05
433	600655	豫园股份	2,100	19,824.00	0.05

434	000408	藏格控股	600	19,764.00	0.05
435	688521	芯原股份	400	19,760.00	0.05
436	300296	利亚德	2,700	19,710.00	0.05
437	002600	领益智造	3,923	19,693.46	0.05
438	600867	通化东宝	1,900	19,646.00	0.05
439	601198	东兴证券	2,200	19,580.00	0.05
440	603198	迎驾贡酒	300	19,542.00	0.05
441	002683	宏大爆破	700	19,481.00	0.05
442	600372	中航电子	1,000	19,390.00	0.05
443	600637	东方明珠	2,700	19,305.00	0.05
444	300026	红日药业	2,500	19,250.00	0.05
445	000400	许继电气	1,000	19,200.00	0.05
446	002299	圣农发展	1,000	19,180.00	0.05
447	601998	中信银行	4,000	19,000.00	0.05
448	600985	淮北矿业	1,300	18,928.00	0.05
449	600236	桂冠电力	3,100	18,879.00	0.05
450	600879	航天电子	2,900	18,821.00	0.05
451	002408	齐翔腾达	2,320	18,815.20	0.05
452	600642	申能股份	3,300	18,744.00	0.05
453	002936	郑州银行	6,950	18,695.50	0.05
454	600026	中远海能	1,800	18,594.00	0.05
455	603160	汇顶科技	300	18,579.00	0.05
456	600380	健康元	1,500	18,525.00	0.05
457	002156	通富微电	1,200	18,480.00	0.05
458	002065	东华软件	2,900	18,328.00	0.05
459	300558	贝达药业	300	18,240.00	0.05
460	000750	国海证券	5,000	18,150.00	0.05
461	600166	福田汽车	6,400	18,112.00	0.05
462	000513	丽珠集团	500	18,105.00	0.05
463	600038	中直股份	400	18,080.00	0.05
464	300832	新产业	400	18,044.00	0.05
465	002183	怡亚通	2,500	18,025.00	0.05
466	002195	二三四五	8,000	18,000.00	0.05
467	600673	东阳光	2,000	17,980.00	0.05
468	600909	华安证券	3,920	17,836.00	0.05
469	689009	九号公司	400	17,800.00	0.05
470	603218	日月股份	700	17,780.00	0.05
471	601005	重庆钢铁	9,300	17,763.00	0.05
472	600820	隧道股份	2,900	17,748.00	0.05
473	002064	华峰化学	2,100	17,724.00	0.05
474	000623	吉林敖东	1,200	17,712.00	0.05
475	300017	网宿科技	3,300	17,688.00	0.05
476	600848	上海临港	1,300	17,628.00	0.05
477	600801	华新水泥	900	17,559.00	0.05

478	600025	华能水电	2,500	17,475.00	0.05
479	600369	西南证券	4,400	17,468.00	0.05
480	600008	首创环保	6,010	17,429.00	0.05
481	600325	华发股份	2,300	17,411.00	0.05
482	300618	寒锐钴业	300	17,376.00	0.05
483	002203	海亮股份	1,500	17,325.00	0.05
484	300001	特锐德	1,000	17,310.00	0.05
485	600580	卧龙电驱	1,200	17,304.00	0.05
486	601717	郑煤机	1,200	17,292.00	0.05
487	002131	利欧股份	8,900	17,266.00	0.05
488	600315	上海家化	400	17,100.00	0.05
489	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.05
490	000878	云南铜业	1,500	17,085.00	0.05
491	002444	巨星科技	900	16,956.00	0.05
492	002958	青农商行	5,100	16,932.00	0.05
493	600027	华电国际	4,300	16,899.00	0.05
494	600529	山东药玻	600	16,770.00	0.04
495	688561	奇安信	300	16,740.00	0.04
496	603568	伟明环保	500	16,685.00	0.04
497	300383	光环新网	1,600	16,672.00	0.04
498	002409	雅克科技	300	16,653.00	0.04
499	600056	中国医药	1,120	16,598.40	0.04
500	000739	普洛药业	800	16,512.00	0.04
501	002926	华西证券	2,100	16,464.00	0.04
502	601881	中国银河	1,700	16,439.00	0.04
503	000729	燕京啤酒	1,700	16,422.00	0.04
504	600271	航天信息	1,500	16,410.00	0.04
505	002250	联化科技	1,000	16,370.00	0.04
506	000825	太钢不锈	3,000	16,350.00	0.04
507	300024	机器人	1,600	16,128.00	0.04
508	002191	劲嘉股份	1,500	16,080.00	0.04
509	002500	山西证券	2,800	16,072.00	0.04
510	600118	中国卫星	800	16,064.00	0.04
511	000027	深圳能源	2,500	16,025.00	0.04
512	600208	新湖中宝	5,800	16,008.00	0.04
513	002249	大洋电机	2,600	15,964.00	0.04
514	000050	深天马 A	1,600	15,952.00	0.04
515	300182	捷成股份	2,900	15,950.00	0.04
516	603156	养元饮品	700	15,904.00	0.04
517	688009	中国通号	3,500	15,855.00	0.04
518	603858	步长制药	800	15,768.00	0.04
519	600863	内蒙华电	4,300	15,695.00	0.04
520	002430	杭氧股份	500	15,630.00	0.04
521	000060	中金岭南	3,500	15,610.00	0.04

522	601866	中远海发	5,200	15,600.00	0.04
523	002373	千方科技	1,400	15,568.00	0.04
524	600970	中材国际	1,600	15,504.00	0.04
525	000778	新兴铸管	3,200	15,424.00	0.04
526	300009	安科生物	1,520	15,367.20	0.04
527	002670	国盛金控	1,600	15,360.00	0.04
528	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.04
529	601992	金隅集团	5,500	15,235.00	0.04
530	002212	天融信	1,500	15,225.00	0.04
531	300677	英科医疗	600	15,216.00	0.04
532	000987	越秀金控	2,160	15,184.80	0.04
533	600316	洪都航空	500	15,120.00	0.04
534	300070	碧水源	2,900	15,109.00	0.04
535	002607	中公教育	2,600	15,054.00	0.04
536	603233	大参林	480	15,024.00	0.04
537	600297	广汇汽车	5,700	14,877.00	0.04
538	002152	广电运通	1,600	14,832.00	0.04
539	002831	裕同科技	500	14,775.00	0.04
540	002966	苏州银行	2,420	14,762.00	0.04
541	600598	北大荒	1,000	14,760.00	0.04
542	000401	冀东水泥	1,400	14,728.00	0.04
543	600066	宇通客车	1,700	14,705.00	0.04
544	600839	四川长虹	5,100	14,688.00	0.04
545	600201	生物股份	1,600	14,656.00	0.04
546	600755	厦门国贸	1,946	14,595.00	0.04
547	600827	百联股份	1,100	14,531.00	0.04
547	000997	新大陆	1,100	14,531.00	0.04
549	600498	烽火通信	1,000	14,480.00	0.04
550	000930	中粮科技	1,600	14,464.00	0.04
551	002127	南极电商	2,700	14,418.00	0.04
552	603885	吉祥航空	800	14,392.00	0.04
553	603087	甘李药业	300	14,391.00	0.04
554	600021	上海电力	1,400	14,350.00	0.04
555	002128	电投能源	1,000	14,320.00	0.04
556	000656	金科股份	5,000	14,300.00	0.04
557	600998	九州通	1,200	14,292.00	0.04
558	002505	鹏都农牧	4,200	14,238.00	0.04
559	300251	光线传媒	1,500	14,205.00	0.04
560	600390	五矿资本	2,900	14,181.00	0.04
561	300168	万达信息	1,500	14,160.00	0.04
562	600667	太极实业	1,900	14,022.00	0.04
563	688006	杭可科技	200	14,012.00	0.04
564	002019	亿帆医药	1,000	13,980.00	0.04
565	000021	深科技	1,200	13,968.00	0.04

566	002221	东华能源	1,500	13,965.00	0.04
567	600282	南钢股份	4,400	13,860.00	0.04
568	002244	滨江集团	1,600	13,840.00	0.04
569	600718	东软集团	1,200	13,812.00	0.04
570	000883	湖北能源	2,700	13,797.00	0.04
571	002511	中顺洁柔	1,100	13,772.00	0.04
572	600060	海信视像	1,100	13,750.00	0.04
573	002153	石基信息	864	13,711.68	0.04
574	600528	中铁工业	1,700	13,685.00	0.04
575	002396	星网锐捷	600	13,584.00	0.04
576	601179	中国西电	2,900	13,572.00	0.04
577	600155	华创阳安	1,600	13,568.00	0.04
578	000581	威孚高科	700	13,475.00	0.04
579	002266	浙富控股	2,800	13,412.00	0.04
580	600511	国药股份	500	13,390.00	0.04
581	000012	南玻 A	1,800	13,356.00	0.04
582	002155	湖南黄金	1,100	13,354.00	0.04
583	300888	稳健医疗	200	13,300.00	0.04
584	300866	安克创新	200	13,264.00	0.04
585	601880	辽港股份	7,800	13,260.00	0.04
586	002939	长城证券	1,300	13,208.00	0.04
587	600064	南京高科	1,200	13,200.00	0.04
588	600037	歌华有线	1,400	13,146.00	0.04
589	600409	三友化工	1,600	13,104.00	0.04
590	600022	山东钢铁	7,500	13,050.00	0.03
591	600959	江苏有线	4,000	13,040.00	0.03
592	300482	万孚生物	320	13,027.20	0.03
593	002985	北摩高科	221	12,946.18	0.03
594	688256	寒武纪	200	12,940.00	0.03
595	603866	桃李面包	780	12,909.00	0.03
596	600062	华润双鹤	500	12,830.00	0.03
597	000598	兴蓉环境	2,500	12,775.00	0.03
598	603658	安图生物	260	12,711.40	0.03
599	000709	河钢股份	5,600	12,656.00	0.03
600	600500	中化国际	1,900	12,635.00	0.03
601	002124	天邦股份	1,880	12,633.60	0.03
602	600535	天士力	1,200	12,612.00	0.03
603	603712	七一二	400	12,600.00	0.03
603	600782	新钢股份	2,500	12,600.00	0.03
605	601236	红塔证券	1,370	12,508.10	0.03
606	600895	张江高科	1,000	12,450.00	0.03
607	600663	陆家嘴	1,200	12,432.00	0.03
608	601778	晶科科技	2,300	12,420.00	0.03
609	600216	浙江医药	900	12,285.00	0.03

610	601456	国联证券	1,000	12,270.00	0.03
611	000690	宝新能源	2,800	12,264.00	0.03
612	002002	鸿达兴业	3,300	12,243.00	0.03
613	300376	易事特	1,500	12,180.00	0.03
614	000800	一汽解放	1,300	12,142.00	0.03
615	600808	马钢股份	3,200	12,128.00	0.03
616	002701	奥瑞金	2,300	11,960.00	0.03
617	300115	长盈精密	1,160	11,959.60	0.03
618	600517	国网英大	2,300	11,937.00	0.03
619	002468	申通快递	1,000	11,920.00	0.03
620	688002	睿创微纳	300	11,916.00	0.03
621	600567	山鹰国际	4,300	11,911.00	0.03
622	000686	东北证券	1,700	11,883.00	0.03
623	603707	健友股份	420	11,844.00	0.03
624	002745	木林森	1,200	11,724.00	0.03
625	002004	华邦健康	2,100	11,718.00	0.03
626	601106	中国一重	3,800	11,666.00	0.03
627	000785	居然之家	2,600	11,570.00	0.03
628	603225	新凤鸣	1,000	11,540.00	0.03
629	002429	兆驰股份	3,000	11,520.00	0.03
630	600572	康恩贝	2,600	11,518.00	0.03
631	601958	金铝股份	1,300	11,492.00	0.03
632	603883	老百姓	338	11,451.44	0.03
633	600597	光明乳业	900	11,367.00	0.03
634	600737	中粮糖业	1,500	11,280.00	0.03
635	002032	苏泊尔	200	11,268.00	0.03
636	002048	宁波华翔	700	11,214.00	0.03
637	601860	紫金银行	3,900	11,193.00	0.03
638	000937	冀中能源	1,500	11,190.00	0.03
639	002595	豪迈科技	500	11,170.00	0.03
640	601808	中海油服	800	11,160.00	0.03
640	601718	际华集团	3,600	11,160.00	0.03
642	300072	三聚环保	2,200	11,132.00	0.03
643	002532	天山铝业	1,700	11,101.00	0.03
644	002390	信邦制药	1,600	11,056.00	0.03
645	601118	海南橡胶	2,300	10,994.00	0.03
646	600728	佳都科技	1,700	10,982.00	0.03
647	600967	内蒙一机	1,200	10,944.00	0.03
648	600398	海澜之家	2,300	10,925.00	0.03
649	600566	济川药业	400	10,864.00	0.03
650	601000	唐山港	4,200	10,836.00	0.03
651	000540	中天金融	5,600	10,808.00	0.03
651	000089	深圳机场	1,400	10,808.00	0.03
653	300630	普利制药	300	10,545.00	0.03

654	600582	天地科技	2,200	10,516.00	0.03
655	600507	方大特钢	1,500	10,485.00	0.03
656	000537	广宇发展	800	10,392.00	0.03
657	600435	北方导航	1,200	10,344.00	0.03
658	002010	传化智联	1,600	10,288.00	0.03
659	300463	迈克生物	500	10,245.00	0.03
660	600871	石化油服	5,400	10,206.00	0.03
661	300166	东方国信	1,100	10,142.00	0.03
662	600259	广晟有色	200	10,130.00	0.03
663	000402	金融街	1,700	10,115.00	0.03
664	000559	万向钱潮	1,700	10,098.00	0.03
665	000959	首钢股份	2,100	9,996.00	0.03
666	000898	鞍钢股份	3,100	9,982.00	0.03
667	601568	北元集团	1,570	9,953.80	0.03
668	688208	道通科技	300	9,876.00	0.03
668	600556	天下秀	1,200	9,876.00	0.03
670	000990	诚志股份	900	9,855.00	0.03
671	000877	天山股份	800	9,840.00	0.03
672	601333	广深铁路	4,500	9,810.00	0.03
673	600195	中牧股份	800	9,808.00	0.03
674	603927	中科软	420	9,794.40	0.03
675	002174	游族网络	1,000	9,770.00	0.03
676	002690	美亚光电	450	9,756.00	0.03
677	002110	三钢闽光	1,600	9,744.00	0.03
678	600167	联美控股	1,300	9,737.00	0.03
679	002233	塔牌集团	1,100	9,735.00	0.03
680	600811	东方集团	3,400	9,622.00	0.03
681	002368	太极股份	500	9,605.00	0.03
682	000158	常山北明	1,600	9,600.00	0.03
683	000156	华数传媒	1,200	9,564.00	0.03
684	002382	蓝帆医疗	1,000	9,550.00	0.03
685	003035	南网能源	1,500	9,525.00	0.03
686	601098	中南传媒	1,000	9,440.00	0.03
687	603638	艾迪精密	460	9,430.00	0.03
688	002146	荣盛发展	3,100	9,393.00	0.03
689	600120	浙江东方	2,340	9,383.40	0.03
690	600446	金证股份	900	9,342.00	0.02
691	600376	首开股份	1,900	9,329.00	0.02
692	002416	爱施德	1,000	9,300.00	0.02
693	601611	中国核建	1,100	9,229.00	0.02
694	000685	中山公用	1,200	9,216.00	0.02
695	001965	招商公路	1,200	9,156.00	0.02
696	601200	上海环境	900	9,144.00	0.02
697	601608	中信重工	2,400	9,096.00	0.02

698	000488	晨鸣纸业	1,600	9,024.00	0.02
699	600373	中文传媒	900	8,991.00	0.02
700	001914	招商积余	500	8,985.00	0.02
701	603000	人民网	800	8,960.00	0.02
702	002705	新宝股份	400	8,796.00	0.02
703	002399	海普瑞	500	8,790.00	0.02
703	002281	光迅科技	500	8,790.00	0.02
705	688289	圣湘生物	296	8,764.56	0.02
706	002387	维信诺	1,300	8,736.00	0.02
706	000563	陕国投 A	2,800	8,736.00	0.02
708	600901	江苏租赁	1,700	8,721.00	0.02
709	600126	杭钢股份	1,700	8,704.00	0.02
710	002948	青岛银行	2,390	8,651.80	0.02
711	002081	金螳螂	1,700	8,636.00	0.02
712	000967	盈峰环境	1,700	8,602.00	0.02
713	600307	酒钢宏兴	4,400	8,536.00	0.02
714	000528	柳工	1,300	8,463.00	0.02
715	600095	湘财股份	1,100	8,459.00	0.02
716	601187	厦门银行	1,400	8,344.00	0.02
717	600006	东风汽车	1,100	8,305.00	0.02
718	600623	华谊集团	1,000	8,300.00	0.02
719	000961	中南建设	2,700	8,235.00	0.02
720	601825	沪农商行	1,300	8,151.00	0.02
721	601598	中国外运	2,100	8,148.00	0.02
722	600131	国网信通	600	8,070.00	0.02
723	002423	中粮资本	1,200	8,052.00	0.02
724	601991	大唐发电	3,300	8,019.00	0.02
725	300212	易华录	460	8,004.00	0.02
726	600707	彩虹股份	1,700	7,956.00	0.02
727	002867	周大生	500	7,765.00	0.02
728	002434	万里扬	900	7,695.00	0.02
729	000031	大悦城	1,900	7,600.00	0.02
730	603868	飞科电器	100	7,575.00	0.02
731	600764	中国海防	300	7,572.00	0.02
732	688321	微芯生物	300	7,557.00	0.02
733	600968	海油发展	2,900	7,482.00	0.02
734	300257	开山股份	500	7,480.00	0.02
735	600329	达仁堂	300	7,374.00	0.02
736	000718	苏宁环球	2,000	7,360.00	0.02
737	002242	九阳股份	400	7,344.00	0.02
738	002925	盈趣科技	340	7,316.80	0.02
739	300979	华利集团	100	7,308.00	0.02
740	000671	阳光城	3,300	7,227.00	0.02
741	600717	天津港	1,800	7,218.00	0.02

742	600906	财达证券	800	7,192.00	0.02
743	000415	渤海租赁	3,300	7,161.00	0.02
744	601928	凤凰传媒	1,000	7,150.00	0.02
745	603228	景旺电子	300	6,999.00	0.02
746	688819	天能股份	200	6,916.00	0.02
747	601969	海南矿业	800	6,872.00	0.02
748	603317	天味食品	240	6,832.80	0.02
749	600787	中储股份	1,200	6,828.00	0.02
750	600648	外高桥	500	6,800.00	0.02
751	600339	中油工程	2,300	6,647.00	0.02
752	601228	广州港	1,800	6,606.00	0.02
753	603650	彤程新材	200	6,516.00	0.02
754	002563	森马服饰	1,100	6,512.00	0.02
755	688088	虹软科技	200	6,318.00	0.02
756	000717	韶钢松山	1,800	6,300.00	0.02
757	600928	西安银行	1,700	6,239.00	0.02
758	603786	科博达	100	6,157.00	0.02
759	000553	安道麦 A	500	6,055.00	0.02
760	600377	宁沪高速	700	5,999.00	0.02
761	000028	国药一致	200	5,958.00	0.02
762	000869	张裕 A	200	5,948.00	0.02
763	601698	中国卫通	500	5,655.00	0.02
764	300869	康泰医学	200	5,652.00	0.02
765	300741	华宝股份	200	5,564.00	0.01
766	600835	上海机电	400	5,492.00	0.01
767	603056	德邦股份	400	5,372.00	0.01
768	002815	崇达技术	400	5,124.00	0.01
769	000062	深圳华强	400	5,080.00	0.01
770	601298	青岛港	900	4,923.00	0.01
771	601139	深圳燃气	700	4,858.00	0.01
772	002653	海思科	300	4,833.00	0.01
773	600299	安迪苏	500	4,790.00	0.01
774	600823	世茂股份	1,600	4,768.00	0.01
775	001872	招商港口	300	4,680.00	0.01
776	002945	华林证券	300	4,575.00	0.01
777	603379	三美股份	200	4,450.00	0.01
778	001227	兰州银行	900	4,428.00	0.01
779	001289	龙源电力	200	4,352.00	0.01
780	601828	美凯龙	700	4,242.00	0.01
781	600350	山东高速	800	4,200.00	0.01
782	600927	永安期货	200	4,034.00	0.01
783	601156	东航物流	200	3,960.00	0.01
784	002901	大博医疗	100	3,914.00	0.01
785	603355	莱克电气	140	3,532.20	0.01

786	603515	欧普照明	200	3,490.00	0.01
787	001203	大中矿业	300	3,390.00	0.01
788	601869	长飞光纤	100	3,092.00	0.01
789	601665	齐鲁银行	600	2,928.00	0.01
790	603719	良品铺子	100	2,863.00	0.01
791	603983	丸美股份	100	2,680.00	0.01
792	002946	新乳业	200	2,598.00	0.01
793	600956	新天绿能	200	2,464.00	0.01
794	601003	柳钢股份	600	2,430.00	0.01
795	600917	重庆燃气	200	1,444.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,136,249.00	2.38
2	300760	迈瑞医疗	464,647.00	0.97
3	000858	五粮液	438,607.00	0.92
4	000333	美的集团	390,924.00	0.82
5	300059	东方财富	359,056.00	0.75
6	002812	恩捷股份	338,528.00	0.71
7	002594	比亚迪	334,044.00	0.70
8	000568	泸州老窖	272,225.00	0.57
9	002415	海康威视	250,696.00	0.52
10	002304	洋河股份	226,206.00	0.47
11	000651	格力电器	224,374.00	0.47
12	002475	立讯精密	220,924.00	0.46
13	000001	平安银行	213,080.00	0.45
14	002714	牧原股份	207,729.00	0.43
15	000725	京东方 A	205,616.00	0.43
16	600519	贵州茅台	185,517.00	0.39
17	000792	盐湖股份	184,325.00	0.39
18	002142	宁波银行	183,821.00	0.38
19	000002	万科 A	171,787.00	0.36
20	002460	赣锋锂业	159,415.00	0.33

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,336,057.00	2.80
2	000858	五粮液	530,992.41	1.11
3	000333	美的集团	480,846.00	1.01
4	300760	迈瑞医疗	466,475.00	0.98
5	002594	比亚迪	410,656.00	0.86
6	300059	东方财富	407,498.00	0.85
7	002812	恩捷股份	339,167.00	0.71
8	000568	泸州老窖	314,630.00	0.66
9	002415	海康威视	298,146.00	0.62
10	002475	立讯精密	278,324.00	0.58
11	000651	格力电器	272,188.00	0.57
12	000001	平安银行	255,110.00	0.53
13	002304	洋河股份	242,753.00	0.51
14	002714	牧原股份	242,306.20	0.51
15	002142	宁波银行	227,297.00	0.48
16	000002	万科 A	210,281.00	0.44
17	000725	京东方 A	207,240.00	0.43
18	300124	汇川技术	190,076.00	0.40
19	002460	赣锋锂业	183,491.00	0.38
20	002241	歌尔股份	177,003.00	0.37

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	17,151,351.67
卖出股票的收入（成交）总额	19,466,292.79

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,600.41	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,600.41	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113060	浙 22 转债	40	4,000.30	0.01
2	127064	杭氧转债	6	600.11	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,767.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	97,383.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中信银行股份有限公司— 中银中证 800 交易型开放 式指数证券投资基金发起 式联接基金	
		持有份 额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例
360	107,937.2 2	28,539,00 0.00	73.4455 %	10,318,4 00.00	26.5545%	11,843,800. 00	30.4802%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中银基金管理有限公司	12,498,100.00	32.16%
2	广发证券股份有限公司	2,969,200.00	7.64%
3	海南家美太阳能有限公司	1,000,000.00	2.57%
4	庞建新	300,000.00	0.77%
5	周旭	266,900.00	0.69%
6	陆晓敏	250,000.00	0.64%
7	华泰证券股份有限公司	227,900.00	0.59%
8	翁国骏	200,000.00	0.51%
9	左凡	200,000.00	0.51%
10	陈慧芹	200,000.00	0.51%
11	中信银行股份有限公司—中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	11,843,800.00	30.48%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本开放式基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 7 月 16 日）基金份额总额	377,857,400.00
本报告期期初基金份额总额	44,857,400.00
本报告期基金总申购份额	39,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	45,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	38,857,400.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经董事会决议通过，陈卫星先生担任副执行总裁，详情请参见基金管理人 2022 年 6 月 7 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	30,052,060.60	82.34%	27,589.74	82.21%	-
东方证券	2	6,444,156.65	17.66%	5,971.07	17.79%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问

题的通知》（证监基字<1998>29 号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元，并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新租用兴业证券上海、深圳、北京交易单元各一个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	47,032.26	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	中银基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-05
3	中银基金管理有限公司关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的	中国证监会规定媒介	2022-01-10

	公告		
4	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-13
5	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-14
6	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-17
7	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-18
8	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-21
9	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-21
10	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
11	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-25
12	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的	中国证监会规定媒介	2022-01-25
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-27
14	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-02-15
15	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-02-22
16	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-24
17	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-25
18	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
19	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-04-09

20	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-11
21	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-18
22	中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-21
23	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-04-23
24	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-04-30
25	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-06
26	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加中信证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-09
27	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-09
28	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-18
29	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
30	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-02
31	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-06
32	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-06-07
33	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-13
34	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-14
35	中银基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-18

36	中银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员和分支机构负责人的人员名单	中国证监会规定媒介	2022-06-21
37	中银基金管理有限公司关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
38	中银基金管理有限公司关于新增济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22
39	中银基金管理有限公司关于中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-06-24

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220510 20220512-20220630	12,498,100.00	0.00	0.00	12,498,100.00	32.1640%
	2	20220223-20220223	6,013,100.00	51,807,300.00	57,592,500.00	227,900.00	0.5865%
中信银行股份有限公司—中银中证800交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2022-01-01至2022-02-22	9,000,000.00	4,094,800.00	1,251,000.00	11,843,800.00	30.4802%
	2	2022-02-24至2022-05-10	9,000,000.00	4,094,800.00	1,251,000.00	11,843,800.00	30.4802%
	3	2022-05-13至2022-06-30	9,000,000.00	4,094,800.00	1,251,000.00	11,843,800.00	30.4802%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日