

# 嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 23 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>159</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	159
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	159
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	161
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	169
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	170
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 .....	170
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 .....	171
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 .....	171
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 .....	171
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	171
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	171
8.12 投资组合报告附注 .....	172
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>173</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	173
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	174
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	174
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 .....	175
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>175</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>175</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	175
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 .....	175
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	175
11.4 基金投资策略的改变 .....	176
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	176
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 .....	176
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	176
11.8 其他重大事件 .....	185
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>185</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	185
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>186</b>
13.1 备查文件目录 .....	186
13.2 存放地点 .....	186
13.3 查阅方式 .....	186

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实沪深 300ETF
场内简称	300ETF
基金主代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,824,216,676.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	本基金采取完全复制法，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动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-600-8800	95566	
传真	(010)65215588	(010)66594942	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元	北京西城区复兴门内大街1号	
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层	北京西城区复兴门内大街1号	
邮政编码	100005	100818	
法定代表人	经雷	刘连舸	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年	2019年	2018年
本期已实现收益	6,405,168,933.32	1,879,124,291.73	-6,548,248.53
本期利润	6,526,021,624.50	6,989,012,004.19	-4,684,725,114.57
加权平均基金份额本期利润	1.1083	1.1369	-1.0366
本期加权平均净值利润率	25.34%	30.00%	-26.38%

本期基金份额净值增长率	29.18%	38.10%	-24.03%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	13,729,190,615.15	11,787,249,921.12	4,083,151,385.90
期末可供分配基金份额利润	2.8459	1.8034	0.7287
期末基金资产净值	25,093,040,422.26	27,183,389,199.65	18,743,619,783.58
期末基金份额净值	5.2015	4.1590	3.3450
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	128.08%	76.56%	27.85%

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

（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

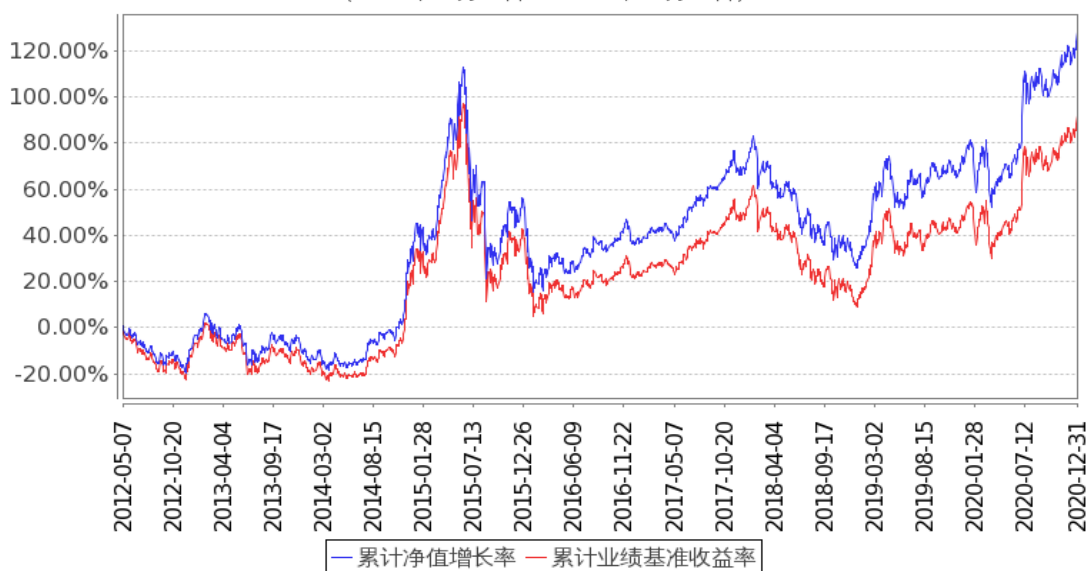
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	13.45%	0.99%	13.60%	0.99%	-0.15%	0.00%
过去六个月	26.20%	1.34%	25.15%	1.35%	1.05%	-0.01%
过去一年	29.18%	1.43%	27.21%	1.43%	1.97%	0.00%

过去三年	35.53%	1.34%	29.28%	1.34%	6.25%	0.00%
过去五年	51.49%	1.24%	39.68%	1.25%	11.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	128.08%	1.45%	91.88%	1.46%	36.20%	-0.01%

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

**嘉实沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2012年05月07日至2020年12月31日)

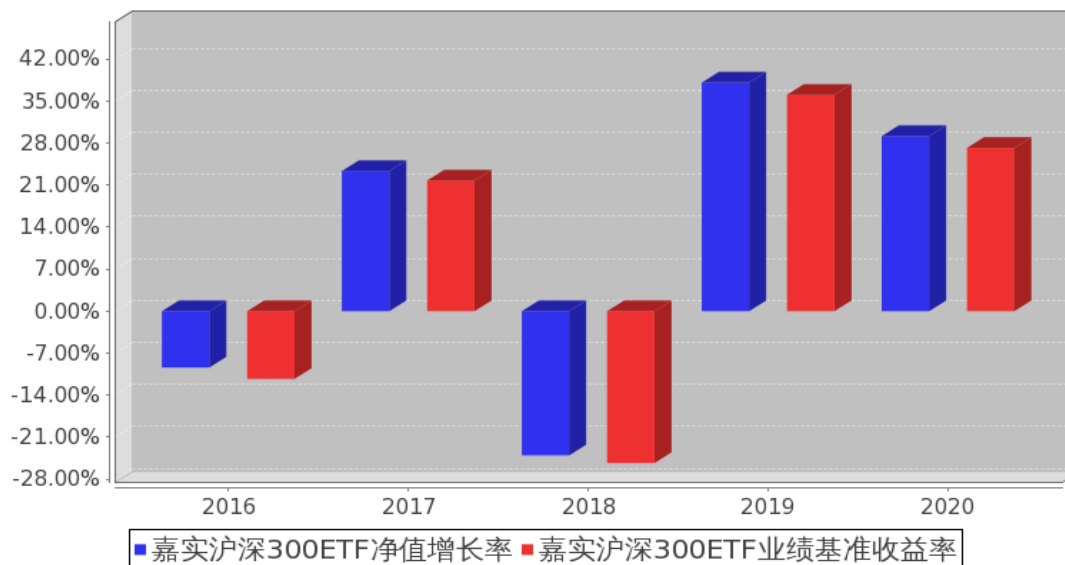


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 过去五年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

嘉实沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	1.5200	757,084,099.57	-	757,084,099.57	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	-	-	-	-	-
合计	1.5200	757,084,099.57	-	757,084,099.57	-

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

截止2020年12月31日，基金管理人共管理205只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、

嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、

嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数	2016 年 1 月 5 日	-	14 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

	( QDII-L OF)、嘉实 中 证 500ETF、 嘉实中证 500ETF 联 接、嘉实 基 本 面 50ETF、嘉 实 沪 深 300 红 利 低 波 动 ETF、嘉实 沪 深 300 红 利 低 波 动 ETF 联 接、嘉实 中 证 500 成 长 估 值 ETF 基 金 经 理				
陈 正 宪	本基金、 嘉实沪深 300ETF 联 接 ( LOF)、 嘉实基本 面 50 指 数 ( LOF)、 嘉实黄金 ( QDII-F OF-LOF ) 、嘉实中 证 500ETF、 嘉实中证 500ETF 联 接、嘉实 恒 生 港 股 通 新 经 济 指 数 ( LOF)、 嘉实基本 面 50ETF、嘉	2016 年 1 月 5 日	-	15 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。

实 沪 深 300 红 利 低 波 动 ETF、嘉 实 沪 深 300 红 利 低 波 动 ETF 联 接、嘉 实 中 证 500 成 长 估 值 ETF 基 金 经 理				
--	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。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，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，

交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

### 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

2020 年沪深 300 指数全年上涨。年初到新年前，市场延续 19 年牛市行情，指数缓慢上行。2 月开年后第一个交易日疫情的恐慌情绪全部释放，随后整个市场迎来一波反弹，到了 3-4 月国内疫情拐点显现，市场开始逐渐复苏，科技、医药、食品饮料等行业开始强势，指数迎来上涨。5-7 月，市场继续走热，军工、生物医药、免税、地摊经济等各类行业、概念百花齐放，市场一片欣欣向荣，沪深 300 也在 6 月底到 7 月初出现了一波超 20%的强烈上涨。8-12 月市场整体开始冷静，宽基行情减弱，行业结构性机会增加，沪深 300 指数开始震荡，整个报告期内沪深 300 指数上涨 27.21%

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回以及成份股调整等工作。报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.03%，年度化拟合偏离度为 0.44%。

本基金的跟踪误差主要来源于本基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红、样本股调整的冲击以及股指期货与现货间的基差波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.2015 元；本报告期基金份额净值增长率为 29.18%，业绩比较基准收益率为 27.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。展望 2021 年，目前以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于较为合理的位置，具有中长期投资价值。

本基金主要采用组合复制策略实现基金的投资目标。作为一只投资于沪深 300 指数的被动投资管理产品，我们将继续秉承指数化被动投资策略，继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的沪深 300 指数的投资工具，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将继续积极推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 工具性的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成合规报告和各项统计、专题报告。

#### 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》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中 and 年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。



## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 23498 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	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实沪深 300ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实沪深 300ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实沪深 300ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实沪深 300ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实沪深 300ETF 基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实沪深 300ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞   周祎
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	53,594,418.71	21,703,693.53
结算备付金		49,976,072.26	26,697,797.36
存出保证金		30,630,057.21	16,519,683.62
交易性金融资产	7.4.7.2	24,878,960,265.54	27,007,495,900.25
其中：股票投资		24,860,452,265.54	27,005,582,800.25
基金投资		-	-
债券投资		18,508,000.00	1,913,100.00
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	187,000,000.00	134,000,000.00
应收证券清算款		170,114,251.96	21,616,190.17
应收利息	7.4.7.5	1,868,475.92	61,641.94
应收股利		18,900.20	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		25,372,162,441.80	27,228,094,906.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		261,571,750.61	27,591,856.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,318,956.53	10,418,555.77
应付托管费		2,063,791.28	2,083,711.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,274,698.55	2,490,274.14
应交税费		776,074.68	42,243.71
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,116,747.89	2,079,066.30
负债合计		279,122,019.54	44,705,707.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	11,363,849,807.11	15,396,139,278.53

未分配利润	7.4.7.10	13,729,190,615.15	11,787,249,921.12
所有者权益合计		25,093,040,422.26	27,183,389,199.65
负债和所有者权益总计		25,372,162,441.80	27,228,094,906.87

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.2015 元，基金份额总额 4,824,216,676.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		6,736,039,268.42	7,145,870,435.60
1. 利息收入		20,642,422.05	1,965,440.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,175,689.46	443,294.52
债券利息收入		10,432.35	10,461.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,815,842.05	1,314,092.16
证券出借利息收入		16,640,458.19	197,592.23
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,564,333,307.13	2,029,827,381.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,978,038,690.01	1,447,146,640.10
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	17,703,783.92	7,419,432.37
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	39,478,368.93	9,501,562.72
股利收益	7.4.7.16	529,112,464.27	565,759,746.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	120,852,691.18	5,109,887,712.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	30,210,848.06	4,189,901.64
减：二、费用		210,017,643.92	156,858,431.41
1. 管理人报酬		128,543,984.57	116,003,316.96
2. 托管费		25,708,796.90	23,200,663.31

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	47,520,534.15	10,277,700.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		178,805.41	32,828.49
7. 其他费用	7.4.7.20	8,065,522.89	7,343,922.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,526,021,624.50	6,989,012,004.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,526,021,624.50	6,989,012,004.19

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,396,139,278.53	11,787,249,921.12	27,183,389,199.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,526,021,624.50	6,526,021,624.50
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）	-4,032,289,471.42	-3,826,996,830.90	-7,859,286,302.32
其中：1. 基金申购款	19,116,274,524.89	17,030,350,231.45	36,146,624,756.34
2. 基金赎回款	-23,148,563,996.31	-20,857,347,062.35	-44,005,911,058.66
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）	-	-757,084,099.57	-757,084,099.57
五、期末所有者权益（基金净值）	11,363,849,807.11	13,729,190,615.15	25,093,040,422.26

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	14,660,468,397.68	4,083,151,385.90	18,743,619,783.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,989,012,004.19	6,989,012,004.19
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)	735,670,880.85	715,086,531.03	1,450,757,411.88
其中：1. 基金申购款	8,859,367,692.55	5,849,276,177.31	14,708,643,869.86
2. 基金赎回款	-8,123,696,811.70	-5,134,189,646.28	-13,257,886,457.98
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)	15,396,139,278.53	11,787,249,921.12	27,183,389,199.65

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：

经雷

罗丽丽

罗丽丽

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

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]393 号《关于核准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

19,333,307,392.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的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，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

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。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的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，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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已宣告但尚未发放的现金股利、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和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息



支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，基金确定以下类别股票投资和债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，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、资产支持证券和私募债券除外)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。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、资产支持证券和私募债券除外)，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。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	53,594,418.71	21,703,693.53
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	53,594,418.71	21,703,693.53

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,001,906,458.24	24,860,452,265.54	3,858,545,807.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	18,508,000.00	18,508,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	18,508,000.00	18,508,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	21,020,414,458.24	24,878,960,265.54	3,858,545,807.30
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,260,432,524.13	27,005,582,800.25	3,745,150,276.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,913,100.00	1,913,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,913,100.00	1,913,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	23,262,345,624.13	27,007,495,900.25	3,745,150,276.12

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	176,088,840.00	-	-	
其中：股指期货投资	176,088,840.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	176,088,840.00	-	-	
项目	上年度末 2019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	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	144,064,680.00	-	-	
其中：股指期货投资	144,064,680.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	144,064,680.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

于2020年12月31日，本基金买入IF2103持仓量为30手，对应合约市值46,904,400.00元，公允价值变动6,234,120.00元；买入IF2106持仓量为94手，对应合约市值145,737,600.00元，公允价值变动10,319,040.00元；公允价值变动总额合计16,553,160.00元，可抵消期货暂收款16,553,160.00元，股指期货投资净额为零（于2019年12月31日：买入IF2003持仓量为30手，对应合约市值37,078,200.00元，公允价值变动2,410,500.00元；买入IF2006持仓量为94手，对应合约市值116,082,480.00元，公允价值变动6,685,500.00元；公允价值变动总额合

计 9,096,000.00 元，可抵消期货暂收款 9,096,000.00 元，股指期货投资净额为零)。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	187,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	187,000,000.00	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	134,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	134,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	13,050.61	4,122.24
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	23,043.94	12,037.36
应收债券利息	1,392.85	176.77
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-31,857.53	-10,956.16
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	1,859,465.15	55,720.03
其他	3,380.90	541.70
合计	1,868,475.92	61,641.94

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,274,698.55	2,490,274.14
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,274,698.55	2,490,274.14

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	290,000.00	290,000.00
应付指数使用费	1,826,747.89	1,789,066.30
合计	2,116,747.89	2,079,066.30

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,536,016,676.00	15,396,139,278.53
本期申购	8,115,300,000.00	19,116,274,524.89
本期赎回（以“-”号填列）	-9,827,100,000.00	-23,148,563,996.31
- 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	4,824,216,676.00	11,363,849,807.11

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	16,824,235,927.64	-5,036,986,006.52	11,787,249,921.12
本期利润	6,405,168,933.32	120,852,691.18	6,526,021,624.50
本期基金份额交易产生的变动数	-5,159,809,528.47	1,332,812,697.57	-3,826,996,830.90
其中：基金申购款	24,358,364,290.34	-7,328,014,058.89	17,030,350,231.45
基金赎回款	-29,518,173,818.81	8,660,826,756.46	-20,857,347,062.35
本期已分配利润	-757,084,099.57	-	-757,084,099.57
本期末	17,312,511,232.92	-3,583,320,617.77	13,729,190,615.15



## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	438,312.64	156,278.15
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	664,312.45	282,470.57
其他	73,064.37	4,545.80
合计	1,175,689.46	443,294.52

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,938,850,813.29	63,081,965.91
股票投资收益——赎回差价收入	3,039,187,876.72	1,384,064,674.19
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	5,978,038,690.01	1,447,146,640.10

## 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	32,455,968,902.65	4,343,955,829.97
减：卖出股票成本总额	29,517,118,089.36	4,280,873,864.06
买卖股票差价收入	2,938,850,813.29	63,081,965.91

## 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	44,005,911,058.66	13,257,886,457.98
减：现金支付赎回款总额	26,519,450,781.66	1,414,484,429.98
减：赎回股票成本总额	14,447,272,400.28	10,459,337,353.81
赎回差价收入	3,039,187,876.72	1,384,064,674.19

## 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	17,703,783.92	7,419,432.37
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	17,703,783.92	7,419,432.37

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	82,946,892.56	105,375,574.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	65,233,600.00	97,945,500.00
减：应收利息总额	9,508.64	10,642.44
买卖债券差价收入	17,703,783.92	7,419,432.37

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间
----	--------	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	收益金额 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	39,478,368.93	9,501,562.72

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	529,112,464.27	565,759,746.10
其中：证券出借权益补偿收入	13,514,417.18	3,000.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	529,112,464.27	565,759,746.10

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	113,395,531.18	5,099,819,482.06
股票投资	113,395,531.18	5,099,819,482.06
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	7,457,160.00	10,068,230.40
权证投资	-	-
期货投资	7,457,160.00	10,068,230.40
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	120,852,691.18	5,109,887,712.46

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	30,210,848.06	4,189,901.64
合计	30,210,848.06	4,189,901.64

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	47,520,534.15	10,277,700.40
银行间市场交易费用	-	-
合计	47,520,534.15	10,277,700.40

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	170,000.00	170,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	62,883.82	28,723.23
上市年费	-	60,000.00
指数使用费	7,712,639.07	6,960,199.02
其他	-	5,000.00
合计	8,065,522.89	7,343,922.25

## 7.4.7.21 分部报告

无。

## 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

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司
嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“嘉实沪深300ETF联接(LOF)”)	本基金的联接基金

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	128,543,984.57	116,003,316.96
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	25,708,796.90	23,200,663.31

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2020年12月31日		2019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 (%)
嘉实沪深300ETF联接(LOF)	2,810,066,905.00	58.25	4,491,383,192.00	68.72

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司活期	53,594,418.71	438,312.64	21,703,693.53	156,278.15

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2020年12月31日)，本基金持有26,698,729股中国银行的A股普通股，估值总额为人民币84,901,958.22元，占基金资产净值的比例为0.34%(2019年12月31日：41,308,229股，估值总额为人民币152,427,365.01元，占基金资产净值的比例为0.56%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020年09月11日	2020年9月14日		1.520	757,084,099.57	-	757,084,099.57	-
合计	-	-	-	1.520	757,084,099.57	-	757,084,099.57	-

#### 7.4.12 期末(2020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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300864	南大环境	2020年8月	2021年2	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-



		13日	月25日							
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新股锁定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020年9月	2021年3	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-

		21日	月29日							
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股锁定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	新股锁定	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股锁定	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新发未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月	2021年7月	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-

		月 29 日	月 7 日							
300927	江天 化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新发 未上 市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天 化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
600919	江苏 银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	配股 未上 市	4.59	5.46	3,846,720	17,656,444.80	21,003,091.20	-
605277	新亚 电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新发 未上 市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688095	福昕 软件	2020 年 9 月 1 日	2021 年 3 月 8 日	新股 锁定	238.53	228.79	1,981	472,527.93	453,232.99	-
688229	博睿 数据	2020 年 8 月 7 日	2021 年 2 月 18 日	新股 锁定	65.82	101.25	1,643	108,142.26	166,353.75	-
688551	科威 尔	2020 年 9 月 1 日	2021 年 3 月 10 日	新股 锁定	37.94	33.34	2,211	83,885.34	73,714.74	-
688589	力合 微	2020 年 7 月 15 日	2021 年 1 月 22 日	新股 锁定	17.91	35.33	3,562	63,795.42	125,845.46	-
688590	新致 软件	2020 年 11 月 27 日	2021 年 6 月 7 日	新股 锁定	10.73	15.79	4,171	44,754.83	65,860.09	-
688617	惠泰 医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新发 未上 市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688686	奥普 特	2020 年 12 月	2021 年 7 月	新股 锁定	78.49	170.53	2,330	182,881.70	397,334.90	-

月 24 日	月 1 日									
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
113044	大秦转债	2020年12月15日	2021年1月15日	新债未上市	100.00	100.00	174,080	17,408,000.00	17,408,000.00	-
113616	韦尔转债	2020年12月29日	2021年1月22日	新债未上市	100.00	100.00	11,000	1,100,000.00	1,100,000.00	-

注：1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

2. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
202012180000883	000063	中兴通讯	2020-12-18	2021-01-04	33.65	10,000	336,500.00
20201218	000425	徐工机械	2020-12-18	2021-01-04	5.37	15,100	81,087.00

0000 0946							
2020 1218 0000 0969	000425	徐工机械	2020-12-18	2021-01-0 4	5.37	14,800	79,476. 00
2020 1218 0000 1060	000708	中信特钢	2020-12-18	2021-01-0 4	21.79	10,000	217,900 .00
2020 1218 0000 1127	000786	北新建材	2020-12-18	2021-01-0 4	40.05	10,000	400,500 .00
2020 1218 0000 1209	000963	华东医药	2020-12-18	2021-01-0 4	26.56	10,000	265,600 .00
2020 1218 0000 1249	002001	新和成	2020-12-18	2021-01-0 4	33.68	10,000	336,800 .00
2020 1218 0000 1258	002007	华兰生物	2020-12-18	2021-01-0 4	42.24	10,000	422,400 .00
2020 1218 0000 1275	002024	苏宁易购	2020-12-18	2021-01-0 4	7.71	13,300	102,543 .00
2020 1218 0000 1290	002044	美年健康	2020-12-18	2021-01-0 4	11.33	10,000	113,300 .00
2020 1218 0000 1326	002032	苏泊尔	2020-12-18	2021-01-0 4	77.99	10,000	779,900 .00
2020 1218 0000 1361	002120	韵达股份	2020-12-18	2021-01-0 4	15.7	10,000	157,000 .00
2020 1218 0000	002415	海康威视	2020-12-18	2021-01-0 4	48.51	10,000	485,100 .00

1598							
2020 1218 0000 1599	002414	高德红外	2020-12-18	2021-01-04	41.75	16,200	676,350.00
2020 1218 0000 1601	002415	海康威视	2020-12-18	2021-01-04	48.51	10,000	485,100.00
2020 1218 0000 1649	002475	立讯精密	2020-12-18	2021-01-04	56.12	10,000	561,200.00
2020 1218 0000 1711	002594	比 亚 迪	2020-12-18	2021-01-04	194.3	10,000	1,943,000.00
2020 1218 0000 1721	002601	龙鳞佰利	2020-12-18	2021-01-04	30.77	10,000	307,700.00
2020 1218 0000 1785	002739	万达电影	2020-12-18	2021-01-04	18.08	10,000	180,800.00
2020 1218 0000 1794	002812	恩捷股份	2020-12-18	2021-01-04	141.78	11,000	1,559,580.00
2020 1218 0000 1797	002841	视源股份	2020-12-18	2021-01-04	115.03	10,000	1,150,300.00
2020 1218 0000 1888	600346	恒力石化	2020-12-18	2021-01-04	27.97	10,000	279,700.00
2020 1218 0000 1910	601229	上海银行	2020-12-18	2021-01-04	7.84	10,000	78,400.00
2020 1218 0000 1952	600588	用友网络	2020-12-18	2021-01-04	43.87	10,000	438,700.00

2020 1218 0000 1961	600369	西南证券	2020-12-18	2021-01-0 4	5.38	26,000	139,880 .00
2020 1218 0000 1986	601628	中国人寿	2020-12-18	2021-01-0 4	38.39	10,000	383,900 .00
2020 1218 0000 2123	600050	中国联通	2020-12-18	2021-01-0 4	4.46	33,900	151,194 .00
2020 1218 0000 2145	601933	永辉超市	2020-12-18	2021-01-0 4	7.18	17,300	124,214 .00
2020 1218 0000 2163	601857	中国石油	2020-12-18	2021-01-0 4	4.15	10,000	41,500. 00
2020 1218 0000 2194	600436	片仔癀	2020-12-18	2021-01-0 4	267.51	10,000	2,675,1 00.00
2020 1218 0000 2238	603833	欧派家居	2020-12-18	2021-01-0 4	134.5	24,000	3,228,0 00.00
2020 1218 0000 2253	603833	欧派家居	2020-12-18	2021-01-0 4	134.5	10,000	1,345,0 00.00
2020 1218 0000 2290	600352	浙江龙盛	2020-12-18	2021-01-0 4	13.62	11,400	155,268 .00
2020 1218 0000 2396	601919	中远海控	2020-12-18	2021-01-0 4	12.21	59,200	722,832 .00
2020 1218 0000 2408	600763	通策医疗	2020-12-18	2021-01-0 4	276.52	10,000	2,765,2 00.00
2020	601899	紫金矿业	2020-12-18	2021-01-0	9.29	90,600	841,674

1218 0000 2474				4			.00
2020 1218 0000 2492	600000	浦发银行	2020-12-18	2021-01-04	9.68	10,000	96,800.00
2020 1218 0000 2538	601800	中国交建	2020-12-18	2021-01-04	7.26	16,200	117,612.00
2020 1218 0000 2614	601766	中国中车	2020-12-18	2021-01-04	5.31	29,300	155,583.00
2020 1218 0000 2621	600340	华夏幸福	2020-12-18	2021-01-04	12.93	11,500	148,695.00
2020 1218 0000 2635	603899	晨光文具	2020-12-18	2021-01-04	88.56	10,000	885,600.00
2020 1218 0000 2644	600585	海螺水泥	2020-12-18	2021-01-04	51.62	10,000	516,200.00
2020 1218 0000 2698	601877	正泰电器	2020-12-18	2021-01-04	39.16	10,000	391,600.00
2020 1218 0000 2775	600705	中航资本	2020-12-18	2021-01-04	4.38	73,700	322,806.00
2020 1218 0000 2825	600390	五矿资本	2020-12-18	2021-01-04	6.98	10,000	69,800.00
2020 1218 0000 2878	600233	圆通速递	2020-12-18	2021-01-04	11.5	10,000	115,000.00
2020 1218	600109	国金证券	2020-12-18	2021-01-04	16.27	230,000	3,742,100.00



0000 2930							
2020 1218 0000 2938	600109	国金证券	2020-12-18	2021-01-0 4	16.27	126,000	2,050,0 20.00
2020 1218 0000 2946	600016	民生银行	2020-12-18	2021-01-0 4	5.2	30,700	159,640 .00
2020 1218 0000 2961	601808	中海油服	2020-12-18	2021-01-0 4	12.77	10,000	127,700 .00
2020 1218 0000 2963	600297	广汇汽车	2020-12-18	2021-01-0 4	2.86	10,000	28,600. 00
2020 1218 0000 3024	601111	中国国航	2020-12-18	2021-01-0 4	7.49	11,800	88,382. 00
2020 1218 0000 3037	601669	中国电建	2020-12-18	2021-01-0 4	3.88	10,300	39,964. 00
2020 1218 0000 3048	603369	今世缘	2020-12-18	2021-01-0 4	57.38	52,000	2,983,7 60.00
2020 1218 0000 3054	603369	今世缘	2020-12-18	2021-01-0 4	57.38	10,000	573,800 .00
2020 1218 0000 3056	600926	杭州银行	2020-12-18	2021-01-0 4	14.92	10,000	149,200 .00
2020 1218 0000 3058	600111	北方稀土	2020-12-18	2021-01-0 4	13.09	84,400	1,104,7 96.00
2020 1218 0000	600030	中信证券	2020-12-18	2021-01-0 4	29.4	10,000	294,000 .00

3066							
2020 1218 0000 3080	600547	山东黄金	2020-12-18	2021-01-0 4	23.62	10,000	236,200 .00
2020 1218 0000 3193	600703	三安光电	2020-12-18	2021-01-0 4	27.01	10,000	270,100 .00
2020 1218 0000 3202	600660	福耀玻璃	2020-12-18	2021-01-0 4	48.05	10,000	480,500 .00
2020 1218 0000 3208	600010	包钢股份	2020-12-18	2021-01-0 4	1.17	300,000	351,000 .00
2020 1218 0000 3214	600010	包钢股份	2020-12-18	2021-01-0 4	1.17	1,000,00 0	1,170,0 00.00
2020 1221 0000 1058	002049	紫光国微	2020-12-21	2021-01-0 4	133.81	16,500	2,207,8 65.00
2020 1221 0000 1086	002027	分众传媒	2020-12-21	2021-01-0 4	9.87	100,000	987,000 .00
2020 1221 0000 1261	002415	海康威视	2020-12-21	2021-01-0 4	48.51	14,000	679,140 .00
2020 1221 0000 1399	600998	九州通	2020-12-21	2021-01-0 4	18.16	14,400	261,504 .00
2020 1221 0000 1413	600161	天坛生物	2020-12-21	2021-01-0 4	41.7	10,000	417,000 .00
2020 1221 0000 1525	601225	陕西煤业	2020-12-21	2021-01-0 4	9.34	33,800	315,692 .00

2020 1221 0000 1760	601888	中国中免	2020-12-21	2021-01-0 4	282.45	10,000	2,824,5 00.00
2020 1221 0000 1779	601899	紫金矿业	2020-12-21	2021-01-0 4	9.29	87,000	808,230 .00
2020 1221 0000 1789	601899	紫金矿业	2020-12-21	2021-01-0 4	9.29	100,000	929,000 .00
2020 1221 0000 1803	600438	通威股份	2020-12-21	2021-01-0 4	38.44	276,400	10,624, 816.00
2020 1221 0000 1987	601012	隆基股份	2020-12-21	2021-01-0 4	92.2	110,000	10,142, 000.00
2020 1221 0000 2045	600837	海通证券	2020-12-21	2021-01-0 4	12.86	770,000	9,902,2 00.00
2020 1221 0000 2070	600109	国金证券	2020-12-21	2021-01-0 4	16.27	55,200	898,104 .00
2020 1221 0000 2164	600809	山西汾酒	2020-12-21	2021-01-0 4	375.29	10,000	3,752,9 00.00
2020 1228 0000 1396	600660	福耀玻璃	2020-12-28	2021-01-0 4	48.05	20,000	961,000 .00
2020 1222 0000 1318	000425	徐工机械	2020-12-22	2021-01-0 5	5.37	10,000	53,700. 00
2020 1222 0000 1437	000625	长安汽车	2020-12-22	2021-01-0 5	21.88	94,000	2,056,7 20.00
2020	000723	美锦能源	2020-12-22	2021-01-0	6.68	89,800	599,864

1222 0000 1518				5			.00
2020 1222 0000 1642	000860	顺鑫农业	2020-12-22	2021-01-05	72.54	22,700	1,646,658.00
2020 1222 0000 1995	002146	荣盛发展	2020-12-22	2021-01-05	6.53	48,900	319,317.00
2020 1222 0000 2197	002304	洋河股份	2020-12-22	2021-01-05	235.99	10,000	2,359,900.00
2020 1222 0000 2230	002371	北方华创	2020-12-22	2021-01-05	180.74	10,000	1,807,400.00
2020 1222 0000 2501	002607	中公教育	2020-12-22	2021-01-05	35.13	10,000	351,300.00
2020 1222 0000 2603	002958	青农商行	2020-12-22	2021-01-05	5.09	20,300	103,327.00
2020 1222 0000 2604	002958	青农商行	2020-12-22	2021-01-05	5.09	30,000	152,700.00
2020 1222 0000 2609	002958	青农商行	2020-12-22	2021-01-05	5.09	25,000	127,250.00
2020 1222 0000 2774	601727	上海电气	2020-12-22	2021-01-05	5.4	47,700	257,580.00
2020 1222 0000 2785	601727	上海电气	2020-12-22	2021-01-05	5.4	47,700	257,580.00
2020 1222	601727	上海电气	2020-12-22	2021-01-05	5.4	10,000	54,000.00

0000 2802							
2020 1222 0000 2927	600066	宇通客车	2020-12-22	2021-01-0 5	16.92	71,000	1,201,3 20.00
2020 1222 0000 3042	600061	国投资本	2020-12-22	2021-01-0 5	13.83	10,000	138,300 .00
2020 1222 0000 3084	601198	东兴证券	2020-12-22	2021-01-0 5	13.32	16,500	219,780 .00
2020 1222 0000 3168	600918	中泰证券	2020-12-22	2021-01-0 5	18.5	11,300	209,050 .00
2020 1222 0000 3351	601633	长城汽车	2020-12-22	2021-01-0 5	37.81	12,600	476,406 .00
2020 1222 0000 3363	601633	长城汽车	2020-12-22	2021-01-0 5	37.81	12,600	476,406 .00
2020 1222 0000 3415	600438	通威股份	2020-12-22	2021-01-0 5	38.44	101,900	3,917,0 36.00
2020 1222 0000 3441	603799	华友钴业	2020-12-22	2021-01-0 5	79.3	14,500	1,149,8 50.00
2020 1222 0000 3450	603799	华友钴业	2020-12-22	2021-01-0 5	79.3	14,500	1,149,8 50.00
2020 1222 0000 3634	601169	北京银行	2020-12-22	2021-01-0 5	4.84	18,200	88,088. 00
2020 1222 0000	600177	雅戈尔	2020-12-22	2021-01-0 5	7.19	37,000	266,030 .00

3815							
2020 1222 0000 3839	601788	光大证券	2020-12-22	2021-01-05	18.52	35,000	648,200.00
2020 1222 0000 3933	600196	复星医药	2020-12-22	2021-01-05	53.99	35,000	1,889,650.00
2020 1222 0000 3977	601336	新华保险	2020-12-22	2021-01-05	57.97	23,200	1,344,904.00
2020 1222 0000 4018	601012	隆基股份	2020-12-22	2021-01-05	92.2	20,000	1,844,000.00
2020 1222 0000 4163	600362	江西铜业	2020-12-22	2021-01-05	19.95	14,700	293,265.00
2020 1222 0000 4169	600109	国金证券	2020-12-22	2021-01-05	16.27	113,300	1,843,391.00
2020 1222 0000 4325	600637	东方明珠	2020-12-22	2021-01-05	8.94	28,800	257,472.00
2020 1222 0000 4340	601216	君正集团	2020-12-22	2021-01-05	4.95	35,700	176,715.00
2020 1222 0000 4348	601216	君正集团	2020-12-22	2021-01-05	4.95	35,700	176,715.00
2020 1222 0000 4357	601216	君正集团	2020-12-22	2021-01-05	4.95	35,700	176,715.00
2020 1222 0000 4367	601872	招商轮船	2020-12-22	2021-01-05	5.65	19,400	109,610.00

2020 1222 0000 4460	601238	广汽集团	2020-12-22	2021-01-0 5	13.29	38,700	514,323 .00
2020 1222 0000 4503	601618	中国中冶	2020-12-22	2021-01-0 5	2.73	119,000	324,870 .00
2020 1223 0000 1145	000066	中国长城	2020-12-23	2021-01-0 6	18.99	40,000	759,600 .00
2020 1223 0000 1150	000157	中联重科	2020-12-23	2021-01-0 6	9.9	279,200	2,764,0 80.00
2020 1223 0000 1151	000157	中联重科	2020-12-23	2021-01-0 6	9.9	1,000,00 0	9,900,0 00.00
2020 1223 0000 1299	000703	恒逸石化	2020-12-23	2021-01-0 6	12.8	74,000	947,200 .00
2020 1223 0000 1302	000708	中信特钢	2020-12-23	2021-01-0 6	21.79	50,000	1,089,5 00.00
2020 1223 0000 1502	000963	华东医药	2020-12-23	2021-01-0 6	26.56	222,800	5,917,5 68.00
2020 1223 0000 1522	000977	浪潮信息	2020-12-23	2021-01-0 6	26.88	37,600	1,010,6 88.00
2020 1223 0000 1561	002007	华兰生物	2020-12-23	2021-01-0 6	42.24	42,200	1,782,5 28.00
2020 1223 0000 1562	002007	华兰生物	2020-12-23	2021-01-0 6	42.24	31,500	1,330,5 60.00
2020	002007	华兰生物	2020-12-23	2021-01-0	42.24	24,100	1,017,9

1223 0000 1563				6			84.00
2020 1223 0000 1617	002044	美年健康	2020-12-23	2021-01-06	11.33	242,600	2,748,658.00
2020 1223 0000 1673	002050	三花智控	2020-12-23	2021-01-06	24.65	66,000	1,626,900.00
2020 1223 0000 1751	002202	金风科技	2020-12-23	2021-01-06	14.25	106,900	1,523,325.00
2020 1223 0000 1782	002241	歌尔股份	2020-12-23	2021-01-06	37.32	10,000	373,200.00
2020 1223 0000 1808	002271	东方雨虹	2020-12-23	2021-01-06	38.8	59,900	2,324,120.00
2020 1223 0000 1906	002415	海康威视	2020-12-23	2021-01-06	48.51	660,000	32,016,600.00
2020 1223 0000 2026	002594	比 亚 迪	2020-12-23	2021-01-06	194.3	10,000	1,943,000.00
2020 1223 0000 2030	002594	比 亚 迪	2020-12-23	2021-01-06	194.3	27,100	5,265,530.00
2020 1223 0000 2031	002600	领益智造	2020-12-23	2021-01-06	11.99	386,700	4,636,533.00
2020 1223 0000 2106	002714	牧原股份	2020-12-23	2021-01-06	77.1	140,200	10,809,420.00
2020 1223	600958	东方证券	2020-12-23	2021-01-06	11.63	125,800	1,463,054.00



0000 2145							
2020 1223 0000 2168	600161	天坛生物	2020-12-23	2021-01-0 6	41.7	41,800	1,743,0 60.00
2020 1223 0000 2210	601727	上海电气	2020-12-23	2021-01-0 6	5.4	27,500	148,500 .00
2020 1223 0000 2234	601328	交通银行	2020-12-23	2021-01-0 6	4.48	180,000	806,400 .00
2020 1223 0000 2240	601328	交通银行	2020-12-23	2021-01-0 6	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1223 0000 2243	601628	中国人寿	2020-12-23	2021-01-0 6	38.39	35,200	1,351,3 28.00
2020 1223 0000 2346	601933	永辉超市	2020-12-23	2021-01-0 6	7.18	180,000	1,292,4 00.00
2020 1223 0000 2377	601225	陕西煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	9.34	148,800	1,389,7 92.00
2020 1223 0000 2403	601021	春秋航空	2020-12-23	2021-01-0 6	55.43	13,400	742,762 .00
2020 1223 0000 2557	600383	金地集团	2020-12-23	2021-01-0 6	13.5	100,100	1,351,3 50.00
2020 1223 0000 2576	601919	中远海控	2020-12-23	2021-01-0 6	12.21	138,400	1,689,8 64.00
2020 1223 0000	600763	通策医疗	2020-12-23	2021-01-0 6	276.52	10,000	2,765,2 00.00

2594							
2020 1223 0000 2614	600104	上汽集团	2020-12-23	2021-01-06	24.44	57,500	1,405,300.00
2020 1223 0000 2720	601838	成都银行	2020-12-23	2021-01-06	10.67	131,100	1,398,837.00
2020 1223 0000 2754	600585	海螺水泥	2020-12-23	2021-01-06	51.62	100,000	5,162,000.00
2020 1223 0000 2863	601066	中信建投	2020-12-23	2021-01-06	42	17,200	722,400.00
2020 1223 0000 2886	601878	浙商证券	2020-12-23	2021-01-06	15.3	42,500	650,250.00
2020 1223 0000 2902	600487	亨通光电	2020-12-23	2021-01-06	13.99	39,300	549,807.00
2020 1223 0000 2947	600999	招商证券	2020-12-23	2021-01-06	23.34	61,900	1,444,746.00
2020 1223 0000 2995	600109	国金证券	2020-12-23	2021-01-06	16.27	24,300	395,361.00
2020 1223 0000 3012	600297	广汇汽车	2020-12-23	2021-01-06	2.86	41,000	117,260.00
2020 1223 0000 3031	603259	药明康德	2020-12-23	2021-01-06	134.72	160,000	21,555,200.00
2020 1223 0000 3123	603369	今世缘	2020-12-23	2021-01-06	57.38	15,000	860,700.00

2020 1223 0000 3211	603369	今世缘	2020-12-23	2021-01-0 6	57.38	24,200	1,388,5 96.00
2020 1223 0000 3231	600111	北方稀土	2020-12-23	2021-01-0 6	13.09	109,200	1,429,4 28.00
2020 1223 0000 3246	601216	君正集团	2020-12-23	2021-01-0 6	4.95	16,400	81,180. 00
2020 1223 0000 3254	601162	天风证券	2020-12-23	2021-01-0 6	6.1	14,800	90,280. 00
2020 1223 0000 3261	601872	招商轮船	2020-12-23	2021-01-0 6	5.65	146,700	828,855 .00
2020 1223 0000 3265	600030	中信证券	2020-12-23	2021-01-0 6	29.4	47,900	1,408,2 60.00
2020 1230 0000 3483	600918	中泰证券	2020-12-30	2021-01-0 6	18.5	78,500	1,452,2 50.00
2020 1224 0000 1625	000066	中国长城	2020-12-24	2021-01-0 7	18.99	21,300	404,487 .00
2020 1224 0000 1669	000066	中国长城	2020-12-24	2021-01-0 7	18.99	30,300	575,397 .00
2020 1224 0000 1987	000661	长春高新	2020-12-24	2021-01-0 7	448.91	23,500	10,549, 385.00
2020 1224 0000 1989	000671	阳光城	2020-12-24	2021-01-0 7	6.52	70,800	461,616 .00
2020	000728	国元证券	2020-12-24	2021-01-0	8.96	100,000	896,000

1224 0000 2081				7			.00
2020 1224 0000 2180	000768	中航西飞	2020-12-24	2021-01-0 7	36.68	23,800	872,984 .00
2020 1224 0000 2792	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-0 7	25.5	20,600	525,300 .00
2020 1224 0000 2794	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-0 7	25.5	10,000	255,000 .00
2020 1224 0000 2796	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-0 7	25.5	50,000	1,275,0 00.00
2020 1224 0000 2819	002120	韵达股份	2020-12-24	2021-01-0 7	15.7	10,000	157,000 .00
2020 1224 0000 2844	002146	荣盛发展	2020-12-24	2021-01-0 7	6.53	16,300	106,439 .00
2020 1224 0000 2845	002153	石基信息	2020-12-24	2021-01-0 7	31.09	10,000	310,900 .00
2020 1224 0000 3024	002241	歌尔股份	2020-12-24	2021-01-0 7	37.32	23,200	865,824 .00
2020 1224 0000 3026	002236	大华股份	2020-12-24	2021-01-0 7	19.89	10,000	198,900 .00
2020 1224 0000 3169	002311	海大集团	2020-12-24	2021-01-0 7	65.5	10,000	655,000 .00
2020 1224	002384	东山精密	2020-12-24	2021-01-0 7	26	10,000	260,000 .00

0000 3281							
2020 1224 0000 3339	002414	高德红外	2020-12-24	2021-01-0 7	41.75	10,000	417,500 .00
2020 1224 0000 3349	002415	海康威视	2020-12-24	2021-01-0 7	48.51	10,000	485,100 .00
2020 1224 0000 3359	002415	海康威视	2020-12-24	2021-01-0 7	48.51	130,000	6,306,3 00.00
2020 1224 0000 3538	002508	老板电器	2020-12-24	2021-01-0 7	40.78	47,000	1,916,6 60.00
2020 1224 0000 3565	002555	三七互娱	2020-12-24	2021-01-0 7	31.23	17,800	555,894 .00
2020 1224 0000 3566	002555	三七互娱	2020-12-24	2021-01-0 7	31.23	36,100	1,127,4 03.00
2020 1224 0000 3655	002600	领益智造	2020-12-24	2021-01-0 7	11.99	77,300	926,827 .00
2020 1224 0000 3656	002601	龙鳞佰利	2020-12-24	2021-01-0 7	30.77	10,000	307,700 .00
2020 1224 0000 3784	002714	牧原股份	2020-12-24	2021-01-0 7	77.1	30,000	2,313,0 00.00
2020 1224 0000 3794	002739	万达电影	2020-12-24	2021-01-0 7	18.08	10,000	180,800 .00
2020 1224 0000	002812	恩捷股份	2020-12-24	2021-01-0 7	141.78	10,000	1,417,8 00.00

3818							
2020 1224 0000 3821	002821	凯莱英	2020-12-24	2021-01-0 7	299.14	10,000	2,991,4 00.00
2020 1224 0000 3836	002916	深南电路	2020-12-24	2021-01-0 7	108.06	10,000	1,080,6 00.00
2020 1224 0000 3863	601377	兴业证券	2020-12-24	2021-01-0 7	8.68	50,200	435,736 .00
2020 1224 0000 3878	600018	上港集团	2020-12-24	2021-01-0 7	4.57	58,000	265,060 .00
2020 1224 0000 3912	600346	恒力石化	2020-12-24	2021-01-0 7	27.97	10,000	279,700 .00
2020 1224 0000 3999	601229	上海银行	2020-12-24	2021-01-0 7	7.84	43,000	337,120 .00
2020 1224 0000 4024	600161	天坛生物	2020-12-24	2021-01-0 7	41.7	10,000	417,000 .00
2020 1224 0000 4076	600588	用友网络	2020-12-24	2021-01-0 7	43.87	62,000	2,719,9 40.00
2020 1224 0000 4100	600332	白云山	2020-12-24	2021-01-0 7	29.25	10,000	292,500 .00
2020 1224 0000 4114	600369	西南证券	2020-12-24	2021-01-0 7	5.38	37,200	200,136 .00
2020 1224 0000 4129	601628	中国人寿	2020-12-24	2021-01-0 7	38.39	10,000	383,900 .00

2020 1224 0000 4143	600118	中国卫星	2020-12-24	2021-01-0 7	32.18	10,000	321,800 .00
2020 1224 0000 4263	601108	财通证券	2020-12-24	2021-01-0 7	12.65	10,000	126,500 .00
2020 1224 0000 4340	601698	中国卫通	2020-12-24	2021-01-0 7	18.14	10,000	181,400 .00
2020 1224 0000 4398	600690	海尔智家	2020-12-24	2021-01-0 7	29.21	10,000	292,100 .00
2020 1224 0000 4426	601236	红塔证券	2020-12-24	2021-01-0 7	18.59	19,500	362,505 .00
2020 1224 0000 4450	601236	红塔证券	2020-12-24	2021-01-0 7	18.59	10,000	185,900 .00
2020 1224 0000 4582	600436	片仔癀	2020-12-24	2021-01-0 7	267.51	10,000	2,675,1 00.00
2020 1224 0000 4615	601990	南京证券	2020-12-24	2021-01-0 7	12.27	18,100	222,087 .00
2020 1224 0000 4628	601990	南京证券	2020-12-24	2021-01-0 7	12.27	10,000	122,700 .00
2020 1224 0000 4638	600352	浙江龙盛	2020-12-24	2021-01-0 7	13.62	19,800	269,676 .00
2020 1224 0000 4690	601319	中国人保	2020-12-24	2021-01-0 7	6.57	13,000	85,410. 00
2020	600893	航发动力	2020-12-24	2021-01-0	59.35	10,000	593,500

1224 0000 4748				7			.00
2020 1224 0000 4861	601998	中信银行	2020-12-24	2021-01-07	5.11	52,000	265,720.00
2020 1224 0000 5008	601919	中远海控	2020-12-24	2021-01-07	12.21	196,000	2,393,160.00
2020 1224 0000 5023	603658	安图生物	2020-12-24	2021-01-07	145.18	10,000	1,451,800.00
2020 1224 0000 5074	600482	中国动力	2020-12-24	2021-01-07	17.92	11,800	211,456.00
2020 1224 0000 5086	600763	通策医疗	2020-12-24	2021-01-07	276.52	10,000	2,765,200.00
2020 1224 0000 5107	601899	紫金矿业	2020-12-24	2021-01-07	9.29	30,000	278,700.00
2020 1224 0000 5121	601899	紫金矿业	2020-12-24	2021-01-07	9.29	80,000	743,200.00
2020 1224 0000 5128	600438	通威股份	2020-12-24	2021-01-07	38.44	21,000	807,240.00
2020 1224 0000 5136	600438	通威股份	2020-12-24	2021-01-07	38.44	24,100	926,404.00
2020 1224 0000 5142	600438	通威股份	2020-12-24	2021-01-07	38.44	10,000	384,400.00
2020 1224	600104	上汽集团	2020-12-24	2021-01-07	24.44	346,200	8,461,128.00



0000 5203							
2020 1224 0000 5209	600522	中天科技	2020-12-24	2021-01-0 7	10.84	26,200	284,008 .00
2020 1224 0000 5264	600745	闻泰科技	2020-12-24	2021-01-0 7	99	19,700	1,950,3 00.00
2020 1224 0000 5283	601800	中国交建	2020-12-24	2021-01-0 7	7.26	24,000	174,240 .00
2020 1224 0000 5399	601766	中国中车	2020-12-24	2021-01-0 7	5.31	52,100	276,651 .00
2020 1224 0000 5419	601169	北京银行	2020-12-24	2021-01-0 7	4.84	51,600	249,744 .00
2020 1224 0000 5453	600271	航天信息	2020-12-24	2021-01-0 7	12.6	10,000	126,000 .00
2020 1224 0000 5473	603899	晨光文具	2020-12-24	2021-01-0 7	88.56	10,000	885,600 .00
2020 1224 0000 5482	600585	海螺水泥	2020-12-24	2021-01-0 7	51.62	10,000	516,200 .00
2020 1224 0000 5541	600009	上海机场	2020-12-24	2021-01-0 7	75.66	10,000	756,600 .00
2020 1224 0000 5558	600340	华夏幸福	2020-12-24	2021-01-0 7	12.93	10,000	129,300 .00
2020 1224 0000	600340	华夏幸福	2020-12-24	2021-01-0 7	12.93	20,400	263,772 .00

5577							
2020 1224 0000 5671	601877	正泰电器	2020-12-24	2021-01-0 7	39.16	10,000	391,600 .00
2020 1224 0000 5776	600115	东方航空	2020-12-24	2021-01-0 7	4.68	43,800	204,984 .00
2020 1224 0000 5869	601878	浙商证券	2020-12-24	2021-01-0 7	15.3	10,000	153,000 .00
2020 1224 0000 5891	601012	隆基股份	2020-12-24	2021-01-0 7	92.2	150,000	13,830, 000.00
2020 1224 0000 5923	601012	隆基股份	2020-12-24	2021-01-0 7	92.2	433,900	40,005, 580.00
2020 1224 0000 5967	600390	五矿资本	2020-12-24	2021-01-0 7	6.98	11,400	79,572. 00
2020 1224 0000 6038	600233	圆通速递	2020-12-24	2021-01-0 7	11.5	10,300	118,450 .00
2020 1224 0000 6160	601808	中海油服	2020-12-24	2021-01-0 7	12.77	13,300	169,841 .00
2020 1224 0000 6251	600016	民生银行	2020-12-24	2021-01-0 7	5.2	52,600	273,520 .00
2020 1224 0000 6265	600297	广汇汽车	2020-12-24	2021-01-0 7	2.86	14,500	41,470. 00
2020 1224 0000 6384	601288	农业银行	2020-12-24	2021-01-0 7	3.14	676,600	2,124,5 24.00

2020 1224 0000 6398	601669	中国电建	2020-12-24	2021-01-0 7	3.88	17,500	67,900. 00
2020 1224 0000 6409	603369	今世缘	2020-12-24	2021-01-0 7	57.38	15,000	860,700 .00
2020 1224 0000 6421	601111	中国国航	2020-12-24	2021-01-0 7	7.49	25,300	189,497 .00
2020 1224 0000 6432	600926	杭州银行	2020-12-24	2021-01-0 7	14.92	10,000	149,200 .00
2020 1224 0000 6440	600637	东方明珠	2020-12-24	2021-01-0 7	8.94	25,600	228,864 .00
2020 1224 0000 6449	601186	中国铁建	2020-12-24	2021-01-0 7	7.9	41,900	331,010 .00
2020 1224 0000 6532	600030	中信证券	2020-12-24	2021-01-0 7	29.4	10,000	294,000 .00
2020 1224 0000 6554	600547	山东黄金	2020-12-24	2021-01-0 7	23.62	14,200	335,404 .00
2020 1224 0000 6606	600547	山东黄金	2020-12-24	2021-01-0 7	23.62	10,000	236,200 .00
2020 1224 0000 6739	600498	烽火通信	2020-12-24	2021-01-0 7	24.08	10,000	240,800 .00
2020 1224 0000 6756	600703	三安光电	2020-12-24	2021-01-0 7	27.01	10,000	270,100 .00
2020	600660	福耀玻璃	2020-12-24	2021-01-0	48.05	30,000	1,441,5

1224 0000 6763				7			00.00
2020 1224 0000 6766	600660	福耀玻璃	2020-12-24	2021-01-0 7	48.05	10,000	480,500 .00
2020 1225 0000 1261	000768	中航西飞	2020-12-25	2021-01-0 8	36.68	28,100	1,030,7 08.00
2020 1225 0000 1484	002044	美年健康	2020-12-25	2021-01-0 8	11.33	56,900	644,677 .00
2020 1225 0000 1898	002463	沪电股份	2020-12-25	2021-01-0 8	18.79	10,000	187,900 .00
2020 1225 0000 2081	002939	长城证券	2020-12-25	2021-01-0 8	12.87	23,700	305,019 .00
2020 1225 0000 2217	600161	天坛生物	2020-12-25	2021-01-0 8	41.7	10,000	417,000 .00
2020 1225 0000 2613	601919	中远海控	2020-12-25	2021-01-0 8	12.21	200,000	2,442,0 00.00
2020 1225 0000 2762	601838	成都银行	2020-12-25	2021-01-0 8	10.67	80,000	853,600 .00
2020 1225 0000 2821	600585	海螺水泥	2020-12-25	2021-01-0 8	51.62	194,600	10,045, 252.00
2020 1225 0000 2959	601788	光大证券	2020-12-25	2021-01-0 8	18.52	56,400	1,044,5 28.00
2020 1225	600795	国电电力	2020-12-25	2021-01-0 8	2.25	479,800	1,079,5 50.00

0000 2984							
2020 1225 0000 3006	600487	亨通光电	2020-12-25	2021-01-0 8	13.99	12,000	167,880 .00
2020 1225 0000 3234	601881	中国银河	2020-12-25	2021-01-0 8	12.51	178,700	2,235,5 37.00
2020 1225 0000 3366	600498	烽火通信	2020-12-25	2021-01-0 8	24.08	14,200	341,936 .00
2020 1225 0000 3376	600660	福耀玻璃	2020-12-25	2021-01-0 8	48.05	20,000	961,000 .00
2020 1214 0000 0762	000001	平安银行	2020-12-14	2021-01-1 1	19.34	1,000,00 0	19,340, 000.00
2020 1214 0000 0764	000002	万科 A	2020-12-14	2021-01-1 1	28.7	1,000,00 0	28,700, 000.00
2020 1214 0000 0766	000001	平安银行	2020-12-14	2021-01-1 1	19.34	472,000	9,128,4 80.00
2020 1214 0000 0768	000001	平安银行	2020-12-14	2021-01-1 1	19.34	1,000,00 0	19,340, 000.00
2020 1214 0000 0773	000002	万科 A	2020-12-14	2021-01-1 1	28.7	571,200	16,393, 440.00
2020 1214 0000 0811	000063	中兴通讯	2020-12-14	2021-01-1 1	33.65	93,000	3,129,4 50.00
2020 1214 0000	000066	中国长城	2020-12-14	2021-01-1 1	18.99	136,000	2,582,6 40.00

0814							
2020 1214 0000 0837	000100	TCL 科技	2020-12-14	2021-01-1 1	7.08	1,000,000	7,080,000.00
2020 1214 0000 0841	000066	中国长城	2020-12-14	2021-01-1 1	18.99	212,000	4,025,880.00
2020 1214 0000 0845	000100	TCL 科技	2020-12-14	2021-01-1 1	7.08	446,000	3,157,680.00
2020 1214 0000 0856	000166	申万宏源	2020-12-14	2021-01-1 1	5.28	589,000	3,109,920.00
2020 1214 0000 0868	000333	美的集团	2020-12-14	2021-01-1 1	98.44	928,900	91,440,916.00
2020 1214 0000 0869	000333	美的集团	2020-12-14	2021-01-1 1	98.44	200,000	19,688,000.00
2020 1214 0000 0900	000425	徐工机械	2020-12-14	2021-01-1 1	5.37	541,000	2,905,170.00
2020 1214 0000 0940	000568	泸州老窖	2020-12-14	2021-01-1 1	226.16	26,000	5,880,160.00
2020 1214 0000 0955	000625	长安汽车	2020-12-14	2021-01-1 1	21.88	150,000	3,282,000.00
2020 1214 0000 0969	000625	长安汽车	2020-12-14	2021-01-1 1	21.88	150,000	3,282,000.00
2020 1214 0000 0970	000627	天茂集团	2020-12-14	2021-01-1 1	4.87	531,400	2,587,918.00

2020 1214 0000 0973	000651	格力电器	2020-12-14	2021-01-1 1	61.94	345,000	21,369, 300.00
2020 1214 0000 0977	000651	格力电器	2020-12-14	2021-01-1 1	61.94	345,000	21,369, 300.00
2020 1214 0000 0981	000651	格力电器	2020-12-14	2021-01-1 1	61.94	345,000	21,369, 300.00
2020 1214 0000 0991	000656	金科股份	2020-12-14	2021-01-1 1	7.09	404,000	2,864,3 60.00
2020 1214 0000 0999	000671	阳光城	2020-12-14	2021-01-1 1	6.52	434,700	2,834,2 44.00
2020 1214 0000 1016	000703	恒逸石化	2020-12-14	2021-01-1 1	12.8	399,000	5,107,2 00.00
2020 1214 0000 1021	000708	中信特钢	2020-12-14	2021-01-1 1	21.79	125,200	2,728,1 08.00
2020 1214 0000 1041	000723	美锦能源	2020-12-14	2021-01-1 1	6.68	52,500	350,700 .00
2020 1214 0000 1066	000725	京东方 A	2020-12-14	2021-01-1 1	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00
2020 1214 0000 1070	000728	国元证券	2020-12-14	2021-01-1 1	8.96	220,000	1,971,2 00.00
2020 1214 0000 1073	000728	国元证券	2020-12-14	2021-01-1 1	8.96	344,800	3,089,4 08.00
2020	000768	中航西飞	2020-12-14	2021-01-1	36.68	65,000	2,384,2

1214 0000 1096				1			00.00
2020 1214 0000 1100	000768	中航西飞	2020-12-14	2021-01-1 1	36.68	66,000	2,420,8 80.00
2020 1214 0000 1111	000768	中航西飞	2020-12-14	2021-01-1 1	36.68	165,200	6,059,5 36.00
2020 1214 0000 1113	000776	广发证券	2020-12-14	2021-01-1 1	16.28	185,700	3,023,1 96.00
2020 1214 0000 1120	000783	长江证券	2020-12-14	2021-01-1 1	8.4	607,500	5,103,0 00.00
2020 1214 0000 1135	000858	五 粮 液	2020-12-14	2021-01-1 1	291.85	200,000	58,370, 000.00
2020 1214 0000 1140	000858	五 粮 液	2020-12-14	2021-01-1 1	291.85	122,900	35,868, 365.00
2020 1214 0000 1145	000876	新 希 望	2020-12-14	2021-01-1 1	22.4	405,200	9,076,4 80.00
2020 1214 0000 1148	000876	新 希 望	2020-12-14	2021-01-1 1	22.4	128,000	2,867,2 00.00
2020 1214 0000 1161	000858	五 粮 液	2020-12-14	2021-01-1 1	291.85	121,800	35,547, 330.00
2020 1214 0000 1165	000860	顺鑫农业	2020-12-14	2021-01-1 1	72.54	80,000	5,803,2 00.00
2020 1214	000895	双汇发展	2020-12-14	2021-01-1 1	46.94	65,000	3,051,1 00.00



0000 1185							
2020 1214 0000 1195	000938	紫光股份	2020-12-14	2021-01-1 1	20.45	146,000	2,985,7 00.00
2020 1214 0000 1198	000938	紫光股份	2020-12-14	2021-01-1 1	20.45	91,000	1,860,9 50.00
2020 1214 0000 1215	000977	浪潮信息	2020-12-14	2021-01-1 1	26.88	108,000	2,903,0 40.00
2020 1214 0000 1228	000977	浪潮信息	2020-12-14	2021-01-1 1	26.88	126,000	3,386,8 80.00
2020 1214 0000 1252	002001	新和成	2020-12-14	2021-01-1 1	33.68	152,000	5,119,3 60.00
2020 1214 0000 1262	002008	大族激光	2020-12-14	2021-01-1 1	42.75	123,500	5,279,6 25.00
2020 1214 0000 1269	002007	华兰生物	2020-12-14	2021-01-1 1	42.24	120,000	5,068,8 00.00
2020 1214 0000 1307	002050	三花智控	2020-12-14	2021-01-1 1	24.65	136,000	3,352,4 00.00
2020 1214 0000 1340	002008	大族激光	2020-12-14	2021-01-1 1	42.75	81,000	3,462,7 50.00
2020 1214 0000 1343	002050	三花智控	2020-12-14	2021-01-1 1	24.65	276,900	6,825,5 85.00
2020 1214 0000	002024	苏宁易购	2020-12-14	2021-01-1 1	7.71	366,000	2,821,8 60.00

1346							
2020 1214 0000 1361	002129	中环股份	2020-12-14	2021-01-1 1	25.5	349,000	8,899,5 00.00
2020 1214 0000 1382	002142	宁波银行	2020-12-14	2021-01-1 1	35.34	733,700	25,928, 958.00
2020 1214 0000 1390	002146	荣盛发展	2020-12-14	2021-01-1 1	6.53	468,200	3,057,3 46.00
2020 1214 0000 1398	002153	石基信息	2020-12-14	2021-01-1 1	31.09	86,100	2,676,8 49.00
2020 1214 0000 1401	002157	正邦科技	2020-12-14	2021-01-1 1	17.04	85,900	1,463,7 36.00
2020 1214 0000 1405	002157	正邦科技	2020-12-14	2021-01-1 1	17.04	200,000	3,408,0 00.00
2020 1214 0000 1408	002179	中航光电	2020-12-14	2021-01-1 1	78.29	31,000	2,426,9 90.00
2020 1214 0000 1418	002179	中航光电	2020-12-14	2021-01-1 1	78.29	47,000	3,679,6 30.00
2020 1214 0000 1423	002202	金风科技	2020-12-14	2021-01-1 1	14.25	256,000	3,648,0 00.00
2020 1214 0000 1450	002230	科大讯飞	2020-12-14	2021-01-1 1	40.87	78,000	3,187,8 60.00
2020 1214 0000 1477	002241	歌尔股份	2020-12-14	2021-01-1 1	37.32	212,000	7,911,8 40.00

2020 1214 0000 1503	002252	上海莱士	2020-12-14	2021-01-1 1	7.4	370,000	2,738,0 00.00
2020 1214 0000 1516	002271	东方雨虹	2020-12-14	2021-01-1 1	38.8	372,600	14,456, 880.00
2020 1214 0000 1536	002304	洋河股份	2020-12-14	2021-01-1 1	235.99	137,600	32,472, 224.00
2020 1214 0000 1542	002311	海大集团	2020-12-14	2021-01-1 1	65.5	50,000	3,275,0 00.00
2020 1214 0000 1550	002352	顺丰控股	2020-12-14	2021-01-1 1	88.23	53,700	4,737,9 51.00
2020 1214 0000 1553	002352	顺丰控股	2020-12-14	2021-01-1 1	88.23	190,000	16,763, 700.00
2020 1214 0000 1556	002352	顺丰控股	2020-12-14	2021-01-1 1	88.23	190,000	16,763, 700.00
2020 1214 0000 1566	002371	北方华创	2020-12-14	2021-01-1 1	180.74	12,000	2,168,8 80.00
2020 1214 0000 1571	002371	北方华创	2020-12-14	2021-01-1 1	180.74	30,000	5,422,2 00.00
2020 1214 0000 1610	002415	海康威视	2020-12-14	2021-01-1 1	48.51	44,000	2,134,4 40.00
2020 1214 0000 1622	002422	科伦药业	2020-12-14	2021-01-1 1	19.44	112,500	2,187,0 00.00
2020	002422	科伦药业	2020-12-14	2021-01-1	19.44	130,000	2,527,2

1214 0000 1624				1			00.00
2020 1214 0000 1640	002456	欧菲光	2020-12-14	2021-01-1 1	13.18	279,800	3,687,7 64.00
2020 1214 0000 1644	002456	欧菲光	2020-12-14	2021-01-1 1	13.18	242,000	3,189,5 60.00
2020 1214 0000 1651	002460	赣锋锂业	2020-12-14	2021-01-1 1	101.2	77,100	7,802,5 20.00
2020 1214 0000 1653	002460	赣锋锂业	2020-12-14	2021-01-1 1	101.2	102,000	10,322, 400.00
2020 1214 0000 1657	002463	沪电股份	2020-12-14	2021-01-1 1	18.79	149,000	2,799,7 10.00
2020 1214 0000 1661	002463	沪电股份	2020-12-14	2021-01-1 1	18.79	150,000	2,818,5 00.00
2020 1214 0000 1712	002555	三七互娱	2020-12-14	2021-01-1 1	31.23	300,000	9,369,0 00.00
2020 1214 0000 1721	002558	巨人网络	2020-12-14	2021-01-1 1	17.43	173,400	3,022,3 62.00
2020 1214 0000 1749	002607	中公教育	2020-12-14	2021-01-1 1	35.13	51,000	1,791,6 30.00
2020 1214 0000 1751	002601	龙蟠佰利	2020-12-14	2021-01-1 1	30.77	94,000	2,892,3 80.00
2020 1214	002594	比亚迪	2020-12-14	2021-01-1 1	194.3	80,000	15,544, 000.00

0000 1753							
2020 1214 0000 1781	002673	西部证券	2020-12-14	2021-01-1 1	10.14	200,000	2,028,0 00.00
2020 1214 0000 1784	002673	西部证券	2020-12-14	2021-01-1 1	10.14	200,000	2,028,0 00.00
2020 1214 0000 1811	002736	国信证券	2020-12-14	2021-01-1 1	13.64	382,000	5,210,4 80.00
2020 1214 0000 1825	002773	康弘药业	2020-12-14	2021-01-1 1	48.15	47,000	2,263,0 50.00
2020 1214 0000 1842	002916	深南电路	2020-12-14	2021-01-1 1	108.06	28,000	3,025,6 80.00
2020 1214 0000 1848	002939	长城证券	2020-12-14	2021-01-1 1	12.87	250,800	3,227,7 96.00
2020 1214 0000 1852	002958	青农商行	2020-12-14	2021-01-1 1	5.09	493,900	2,513,9 51.00
2020 1214 0000 1854	002958	青农商行	2020-12-14	2021-01-1 1	5.09	186,000	946,740 .00
2020 1214 0000 1867	601985	中国核电	2020-12-14	2021-01-1 1	4.92	1,000,00 0	4,920,0 00.00
2020 1214 0000 1888	601658	邮储银行	2020-12-14	2021-01-1 1	4.78	412,000	1,969,3 60.00
2020 1214 0000	603993	洛阳钼业	2020-12-14	2021-01-1 1	6.25	696,000	4,350,0 00.00

1890							
2020 1214 0000 1899	600118	中国卫星	2020-12-14	2021-01-1 1	32.18	158,300	5,094,0 94.00
2020 1214 0000 1907	600011	华能国际	2020-12-14	2021-01-1 1	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1214 0000 1912	600196	复星医药	2020-12-14	2021-01-1 1	53.99	36,000	1,943,6 40.00
2020 1214 0000 1922	601236	红塔证券	2020-12-14	2021-01-1 1	18.59	91,000	1,691,6 90.00
2020 1214 0000 1935	603986	兆易创新	2020-12-14	2021-01-1 1	197.5	25,000	4,937,5 00.00
2020 1214 0000 1936	601628	中国人寿	2020-12-14	2021-01-1 1	38.39	126,000	4,837,1 40.00
2020 1214 0000 1949	600196	复星医药	2020-12-14	2021-01-1 1	53.99	124,000	6,694,7 60.00
2020 1214 0000 1952	600745	闻泰科技	2020-12-14	2021-01-1 1	99	30,000	2,970,0 00.00
2020 1214 0000 1962	601236	红塔证券	2020-12-14	2021-01-1 1	18.59	52,000	966,680 .00
2020 1214 0000 1963	601006	大秦铁路	2020-12-14	2021-01-1 1	6.46	443,000	2,861,7 80.00
2020 1214 0000 1968	600795	国电电力	2020-12-14	2021-01-1 1	2.25	1,000,00 0	2,250,0 00.00

2020 1214 0000 1971	601066	中信建投	2020-12-14	2021-01-1 1	42	73,000	3,066,0 00.00
2020 1214 0000 1993	600588	用友网络	2020-12-14	2021-01-1 1	43.87	69,000	3,027,0 30.00
2020 1214 0000 2001	601698	中国卫通	2020-12-14	2021-01-1 1	18.14	50,000	907,000 .00
2020 1214 0000 2003	601899	紫金矿业	2020-12-14	2021-01-1 1	9.29	356,000	3,307,2 40.00
2020 1214 0000 2012	600570	恒生电子	2020-12-14	2021-01-1 1	104.9	30,000	3,147,0 00.00
2020 1214 0000 2037	600745	闻泰科技	2020-12-14	2021-01-1 1	99	19,000	1,881,0 00.00
2020 1214 0000 2039	600362	江西铜业	2020-12-14	2021-01-1 1	19.95	110,700	2,208,4 65.00
2020 1214 0000 2044	600196	复星医药	2020-12-14	2021-01-1 1	53.99	88,000	4,751,1 20.00
2020 1214 0000 2058	600745	闻泰科技	2020-12-14	2021-01-1 1	99	46,000	4,554,0 00.00
2020 1214 0000 2064	600362	江西铜业	2020-12-14	2021-01-1 1	19.95	128,000	2,553,6 00.00
2020 1214 0000 2073	601698	中国卫通	2020-12-14	2021-01-1 1	18.14	52,000	943,280 .00
2020	600050	中国联通	2020-12-14	2021-01-1	4.46	1,000,00	4,460,0

1214 0000 2081				1		0	00.00
2020 1214 0000 2097	601162	天风证券	2020-12-14	2021-01-1 1	6.1	385,100	2,349,1 10.00
2020 1214 0000 2102	600004	白云机场	2020-12-14	2021-01-1 1	14.13	212,000	2,995,5 60.00
2020 1214 0000 2114	601988	中国银行	2020-12-14	2021-01-1 1	3.18	1,000,00 0	3,180,0 00.00
2020 1214 0000 2120	600115	东方航空	2020-12-14	2021-01-1 1	4.68	1,000,00 0	4,680,0 00.00
2020 1214 0000 2124	603501	韦尔股份	2020-12-14	2021-01-1 1	231.1	21,000	4,853,1 00.00
2020 1214 0000 2143	600406	国电南瑞	2020-12-14	2021-01-1 1	26.57	134,000	3,560,3 80.00
2020 1214 0000 2144	601162	天风证券	2020-12-14	2021-01-1 1	6.1	384,000	2,342,4 00.00
2020 1214 0000 2158	600177	雅戈尔	2020-12-14	2021-01-1 1	7.19	694,000	4,989,8 60.00
2020 1214 0000 2164	601688	华泰证券	2020-12-14	2021-01-1 1	18.01	164,000	2,953,6 40.00
2020 1214 0000 2167	601800	中国交建	2020-12-14	2021-01-1 1	7.26	402,000	2,918,5 20.00
2020 1214	600031	三一重工	2020-12-14	2021-01-1 1	34.98	1,000,00 0	34,980, 000.00



0000 2179							
2020 1214 0000 2182	601229	上海银行	2020-12-14	2021-01-1 1	7.84	380,000	2,979,200.00
2020 1214 0000 2195	603288	海天味业	2020-12-14	2021-01-1 1	200.54	16,000	3,208,640.00
2020 1214 0000 2201	601398	工商银行	2020-12-14	2021-01-1 1	4.99	1,000,000	4,990,000.00
2020 1214 0000 2220	600352	浙江龙盛	2020-12-14	2021-01-1 1	13.62	214,000	2,914,680.00
2020 1214 0000 2230	600299	安迪苏	2020-12-14	2021-01-1 1	11.51	66,500	765,415.00
2020 1214 0000 2240	600487	亨通光电	2020-12-14	2021-01-1 1	13.99	154,800	2,165,652.00
2020 1214 0000 2249	600487	亨通光电	2020-12-14	2021-01-1 1	13.99	154,000	2,154,460.00
2020 1214 0000 2251	600741	华域汽车	2020-12-14	2021-01-1 1	28.82	102,000	2,939,640.00
2020 1214 0000 2255	600660	福耀玻璃	2020-12-14	2021-01-1 1	48.05	132,000	6,342,600.00
2020 1214 0000 2262	600018	上港集团	2020-12-14	2021-01-1 1	4.57	934,500	4,270,665.00
2020 1214 0000	601600	中国铝业	2020-12-14	2021-01-1 1	3.63	732,000	2,657,160.00

2265							
2020 1214 0000 2268	601600	中国铝业	2020-12-14	2021-01-1 1	3.63	84,600	307,098 .00
2020 1214 0000 2282	601155	新城控股	2020-12-14	2021-01-1 1	34.83	85,000	2,960,5 50.00
2020 1214 0000 2284	601600	中国铝业	2020-12-14	2021-01-1 1	3.63	732,000	2,657,1 60.00
2020 1214 0000 2293	601100	恒立液压	2020-12-14	2021-01-1 1	113	30,000	3,390,0 00.00
2020 1214 0000 2317	601668	中国建筑	2020-12-14	2021-01-1 1	4.97	588,000	2,922,3 60.00
2020 1214 0000 2338	600019	宝钢股份	2020-12-14	2021-01-1 1	5.95	491,000	2,921,4 50.00
2020 1214 0000 2353	601138	工业富联	2020-12-14	2021-01-1 1	13.69	223,000	3,052,8 70.00
2020 1214 0000 2363	603799	华友钴业	2020-12-14	2021-01-1 1	79.3	65,000	5,154,5 00.00
2020 1214 0000 2373	603799	华友钴业	2020-12-14	2021-01-1 1	79.3	32,900	2,608,9 70.00
2020 1214 0000 2382	603799	华友钴业	2020-12-14	2021-01-1 1	79.3	65,000	5,154,5 00.00
2020 1214 0000 2402	600489	中金黄金	2020-12-14	2021-01-1 1	8.81	521,300	4,592,6 53.00

2020 1214 0000 2416	601919	中远海控	2020-12-14	2021-01-1 1	12.21	563,000	6,874,2 30.00
2020 1214 0000 2461	601998	中信银行	2020-12-14	2021-01-1 1	5.11	823,800	4,209,6 18.00
2020 1214 0000 2481	601989	中国重工	2020-12-14	2021-01-1 1	4.19	1,000,00 0	4,190,0 00.00
2020 1214 0000 2486	601989	中国重工	2020-12-14	2021-01-1 1	4.19	1,000,00 0	4,190,0 00.00
2020 1214 0000 2488	600010	包钢股份	2020-12-14	2021-01-1 1	1.17	1,000,00 0	1,170,0 00.00
2020 1214 0000 2491	600271	航天信息	2020-12-14	2021-01-1 1	12.6	118,700	1,495,6 20.00
2020 1214 0000 2500	600271	航天信息	2020-12-14	2021-01-1 1	12.6	130,000	1,638,0 00.00
2020 1214 0000 2501	601878	浙商证券	2020-12-14	2021-01-1 1	15.3	200,000	3,060,0 00.00
2020 1214 0000 2507	601878	浙商证券	2020-12-14	2021-01-1 1	15.3	46,700	714,510 .00
2020 1214 0000 2508	601108	财通证券	2020-12-14	2021-01-1 1	12.65	307,500	3,889,8 75.00
2020 1214 0000 2509	600332	白云山	2020-12-14	2021-01-1 1	29.25	151,700	4,437,2 25.00
2020	601878	浙商证券	2020-12-14	2021-01-1	15.3	200,000	3,060,0

1214 0000 2513				1			00.00
2020 1214 0000 2516	601231	环旭电子	2020-12-14	2021-01-1 1	19.34	81,000	1,566,5 40.00
2020 1214 0000 2517	601108	财通证券	2020-12-14	2021-01-1 1	12.65	306,000	3,870,9 00.00
2020 1214 0000 2521	601231	环旭电子	2020-12-14	2021-01-1 1	19.34	80,200	1,551,0 68.00
2020 1214 0000 2525	601618	中国中冶	2020-12-14	2021-01-1 1	2.73	896,000	2,446,0 80.00
2020 1214 0000 2529	601618	中国中冶	2020-12-14	2021-01-1 1	2.73	769,600	2,101,0 08.00
2020 1214 0000 2532	601577	长沙银行	2020-12-14	2021-01-1 1	9.52	275,500	2,622,7 60.00
2020 1214 0000 2537	600309	万华化学	2020-12-14	2021-01-1 1	91.04	37,000	3,368,4 80.00
2020 1214 0000 2590	600482	中国动力	2020-12-14	2021-01-1 1	17.92	173,800	3,114,4 96.00
2020 1214 0000 2610	600085	同仁堂	2020-12-14	2021-01-1 1	23.9	148,100	3,539,5 90.00
2020 1214 0000 2614	600703	三安光电	2020-12-14	2021-01-1 1	27.01	70,000	1,890,7 00.00
2020 1214	600703	三安光电	2020-12-14	2021-01-1 1	27.01	291,000	7,859,9 10.00

0000 2619							
2020 1214 0000 2622	601336	新华保险	2020-12-14	2021-01-1 1	57.97	85,000	4,927,4 50.00
2020 1214 0000 2650	601088	中国神华	2020-12-14	2021-01-1 1	18.01	161,000	2,899,6 10.00
2020 1214 0000 2690	600111	北方稀土	2020-12-14	2021-01-1 1	13.09	383,000	5,013,4 70.00
2020 1214 0000 2693	601021	春秋航空	2020-12-14	2021-01-1 1	55.43	98,500	5,459,8 55.00
2020 1214 0000 2699	600655	豫园股份	2020-12-14	2021-01-1 1	8.89	417,600	3,712,4 64.00
2020 1214 0000 2711	601696	中银证券	2020-12-14	2021-01-1 1	27.68	39,000	1,079,5 20.00
2020 1214 0000 2713	603019	中科曙光	2020-12-14	2021-01-1 1	34.23	94,000	3,217,6 20.00
2020 1214 0000 2716	603019	中科曙光	2020-12-14	2021-01-1 1	34.23	133,100	4,556,0 13.00
2020 1214 0000 2730	600015	华夏银行	2020-12-14	2021-01-1 1	6.25	792,000	4,950,0 00.00
2020 1214 0000 2745	601009	南京银行	2020-12-14	2021-01-1 1	8.08	373,000	3,013,8 40.00
2020 1214 0000	601319	中国人保	2020-12-14	2021-01-1 1	6.57	573,200	3,765,9 24.00

2820							
2020 1214 0000 2832	600498	烽火通信	2020-12-14	2021-01-1 1	24.08	77,400	1,863,7 92.00
2020 1214 0000 2836	600498	烽火通信	2020-12-14	2021-01-1 1	24.08	80,000	1,926,4 00.00
2020 1214 0000 2839	600705	中航资本	2020-12-14	2021-01-1 1	4.38	703,000	3,079,1 40.00
2020 1214 0000 2841	601901	方正证券	2020-12-14	2021-01-1 1	10.37	571,000	5,921,2 70.00
2020 1214 0000 2843	601933	永辉超市	2020-12-14	2021-01-1 1	7.18	702,000	5,040,3 60.00
2020 1214 0000 2905	601225	陕西煤业	2020-12-14	2021-01-1 1	9.34	295,000	2,755,3 00.00
2020 1214 0000 2916	601012	隆基股份	2020-12-14	2021-01-1 1	92.2	69,000	6,361,8 00.00
2020 1214 0000 2926	600522	中天科技	2020-12-14	2021-01-1 1	10.84	285,000	3,089,4 00.00
2020 1214 0000 2947	601669	中国电建	2020-12-14	2021-01-1 1	3.88	1,000,00 0	3,880,0 00.00
2020 1214 0000 2951	600208	新潮中宝	2020-12-14	2021-01-1 1	3.1	932,000	2,889,2 00.00
2020 1214 0000 2953	603658	安图生物	2020-12-14	2021-01-1 1	145.18	20,000	2,903,6 00.00

2020 1214 0000 2963	600519	贵州茅台	2020-12-14	2021-01-1 1	1998	30,000	59,940, 000.00
2020 1214 0000 2964	600585	海螺水泥	2020-12-14	2021-01-1 1	51.62	57,000	2,942,3 40.00
2020 1214 0000 2986	600150	中国船舶	2020-12-14	2021-01-1 1	17.69	178,100	3,150,5 89.00
2020 1214 0000 3000	601216	君正集团	2020-12-14	2021-01-1 1	4.95	350,000	1,732,5 00.00
2020 1214 0000 3005	601238	广汽集团	2020-12-14	2021-01-1 1	13.29	110,000	1,461,9 00.00
2020 1214 0000 3015	601216	君正集团	2020-12-14	2021-01-1 1	4.95	149,500	740,025 .00
2020 1214 0000 3023	601238	广汽集团	2020-12-14	2021-01-1 1	13.29	115,600	1,536,3 24.00
2020 1214 0000 3029	600893	航发动力	2020-12-14	2021-01-1 1	59.35	20,000	1,187,0 00.00
2020 1214 0000 3053	600104	上汽集团	2020-12-14	2021-01-1 1	24.44	126,000	3,079,4 40.00
2020 1214 0000 3055	601198	东兴证券	2020-12-14	2021-01-1 1	13.32	371,400	4,947,0 48.00
2020 1214 0000 3061	600637	东方明珠	2020-12-14	2021-01-1 1	8.94	334,000	2,985,9 60.00
2020	601211	国泰君安	2020-12-14	2021-01-1	17.53	169,000	2,962,5

1214 0000 3070				1			70.00
2020 1214 0000 3080	601111	中国国航	2020-12-14	2021-01-1 1	7.49	387,000	2,898,6 30.00
2020 1214 0000 3083	601818	光大银行	2020-12-14	2021-01-1 1	3.99	1,000,00 0	3,990,0 00.00
2020 1214 0000 3087	600958	东方证券	2020-12-14	2021-01-1 1	11.63	272,000	3,163,3 60.00
2020 1214 0000 3097	600369	西南证券	2020-12-14	2021-01-1 1	5.38	588,000	3,163,4 40.00
2020 1214 0000 3101	600036	招商银行	2020-12-14	2021-01-1 1	43.95	1,000,00 0	43,950, 000.00
2020 1214 0000 3123	601788	光大证券	2020-12-14	2021-01-1 1	18.52	275,000	5,093,0 00.00
2020 1214 0000 3136	600760	中航沈飞	2020-12-14	2021-01-1 1	78.18	48,400	3,783,9 12.00
2020 1214 0000 3143	601555	东吴证券	2020-12-14	2021-01-1 1	9.86	533,000	5,255,3 80.00
2020 1214 0000 3144	600760	中航沈飞	2020-12-14	2021-01-1 1	78.18	49,200	3,846,4 56.00
2020 1214 0000 3148	600438	通威股份	2020-12-14	2021-01-1 1	38.44	171,000	6,573,2 40.00
2020 1214	601169	北京银行	2020-12-14	2021-01-1 1	4.84	1,000,00 0	4,840,0 00.00



0000 3159							
2020 1214 0000 3174	600025	华能水电	2020-12-14	2021-01-1 1	4.46	483,500	2,156,4 10.00
2020 1214 0000 3198	601633	长城汽车	2020-12-14	2021-01-1 1	37.81	150,000	5,671,5 00.00
2020 1214 0000 3204	600887	伊利股份	2020-12-14	2021-01-1 1	44.37	1,000,00 0	44,370, 000.00
2020 1214 0000 3207	600436	片仔癀	2020-12-14	2021-01-1 1	267.51	21,000	5,617,7 10.00
2020 1214 0000 3214	601633	长城汽车	2020-12-14	2021-01-1 1	37.81	10,000	378,100 .00
2020 1214 0000 3224	601727	上海电气	2020-12-14	2021-01-1 1	5.4	861,200	4,650,4 80.00
2020 1214 0000 3227	601633	长城汽车	2020-12-14	2021-01-1 1	37.81	150,000	5,671,5 00.00
2020 1214 0000 3244	600183	生益科技	2020-12-14	2021-01-1 1	28.16	71,000	1,999,3 60.00
2020 1214 0000 3258	600183	生益科技	2020-12-14	2021-01-1 1	28.16	50,000	1,408,0 00.00
2020 1214 0000 3266	600183	生益科技	2020-12-14	2021-01-1 1	28.16	110,000	3,097,6 00.00
2020 1228 0000	000063	中兴通讯	2020-12-28	2021-01-1 1	33.65	322,200	10,842, 030.00

0697							
2020 1228 0000 0723	000425	徐工机械	2020-12-28	2021-01-1 1	5.37	98,600	529,482 .00
2020 1228 0000 0729	000538	云南白药	2020-12-28	2021-01-1 1	113.6	23,600	2,680,9 60.00
2020 1228 0000 0745	000596	古井贡酒	2020-12-28	2021-01-1 1	272	10,000	2,720,0 00.00
2020 1228 0000 0753	000627	天茂集团	2020-12-28	2021-01-1 1	4.87	70,000	340,900 .00
2020 1228 0000 0767	000656	金科股份	2020-12-28	2021-01-1 1	7.09	60,000	425,400 .00
2020 1228 0000 0770	000708	中信特钢	2020-12-28	2021-01-1 1	21.79	33,800	736,502 .00
2020 1228 0000 0786	000728	国元证券	2020-12-28	2021-01-1 1	8.96	10,000	89,600. 00
2020 1228 0000 0812	000786	北新建材	2020-12-28	2021-01-1 1	40.05	10,000	400,500 .00
2020 1228 0000 0874	000938	紫光股份	2020-12-28	2021-01-1 1	20.45	17,000	347,650 .00
2020 1228 0000 0881	000961	中南建设	2020-12-28	2021-01-1 1	8.83	32,600	287,858 .00
2020 1228 0000 0908	002001	新和成	2020-12-28	2021-01-1 1	33.68	10,000	336,800 .00

2020 1228 0000 0919	002008	大族激光	2020-12-28	2021-01-1 1	42.75	10,000	427,500 .00
2020 1228 0000 0938	002024	苏宁易购	2020-12-28	2021-01-1 1	7.71	43,600	336,156 .00
2020 1228 0000 0940	002032	苏泊尔	2020-12-28	2021-01-1 1	77.99	10,000	779,900 .00
2020 1228 0000 0943	002044	美年健康	2020-12-28	2021-01-1 1	11.33	29,000	328,570 .00
2020 1228 0000 0946	002049	紫光国微	2020-12-28	2021-01-1 1	133.81	10,000	1,338,1 00.00
2020 1228 0000 0984	002120	韵达股份	2020-12-28	2021-01-1 1	15.7	25,400	398,780 .00
2020 1228 0000 1005	002157	正邦科技	2020-12-28	2021-01-1 1	17.04	17,100	291,384 .00
2020 1228 0000 1037	002236	大华股份	2020-12-28	2021-01-1 1	19.89	10,000	198,900 .00
2020 1228 0000 1052	002252	上海莱士	2020-12-28	2021-01-1 1	7.4	49,600	367,040 .00
2020 1228 0000 1085	002384	东山精密	2020-12-28	2021-01-1 1	26	12,000	312,000 .00
2020 1228 0000 1108	002415	海康威视	2020-12-28	2021-01-1 1	48.51	111,600	5,413,7 16.00
2020	002414	高德红外	2020-12-28	2021-01-1	41.75	13,600	567,800

1228 0000 1111				1			.00
2020 1228 0000 1122	002422	科伦药业	2020-12-28	2021-01-1 1	19.44	10,000	194,400 .00
2020 1228 0000 1131	002456	欧菲光	2020-12-28	2021-01-1 1	13.18	39,800	524,564 .00
2020 1228 0000 1147	002463	沪电股份	2020-12-28	2021-01-1 1	18.79	17,200	323,188 .00
2020 1228 0000 1170	002508	老板电器	2020-12-28	2021-01-1 1	40.78	10,000	407,800 .00
2020 1228 0000 1182	002558	巨人网络	2020-12-28	2021-01-1 1	17.43	14,500	252,735 .00
2020 1228 0000 1194	002594	比亚迪	2020-12-28	2021-01-1 1	194.3	10,000	1,943,0 00.00
2020 1228 0000 1198	002601	龙麟佰利	2020-12-28	2021-01-1 1	30.77	10,300	316,931 .00
2020 1228 0000 1199	002602	世纪华通	2020-12-28	2021-01-1 1	7.11	43,900	312,129 .00
2020 1228 0000 1202	002600	领益智造	2020-12-28	2021-01-1 1	11.99	22,700	272,173 .00
2020 1228 0000 1208	002624	完美世界	2020-12-28	2021-01-1 1	29.5	10,000	295,000 .00
2020 1228	002607	中公教育	2020-12-28	2021-01-1 1	35.13	10,000	351,300 .00

0000 1210							
2020 1228 0000 1233	002739	万达电影	2020-12-28	2021-01-1 1	18.08	17,900	323,632 .00
2020 1228 0000 1244	002812	恩捷股份	2020-12-28	2021-01-1 1	141.78	10,000	1,417,8 00.00
2020 1228 0000 1246	002773	康弘药业	2020-12-28	2021-01-1 1	48.15	10,000	481,500 .00
2020 1228 0000 1247	002821	凯莱英	2020-12-28	2021-01-1 1	299.14	10,000	2,991,4 00.00
2020 1228 0000 1252	002841	视源股份	2020-12-28	2021-01-1 1	115.03	10,000	1,150,3 00.00
2020 1228 0000 1267	600018	上港集团	2020-12-28	2021-01-1 1	4.57	65,300	298,421 .00
2020 1228 0000 1282	600998	九州通	2020-12-28	2021-01-1 1	18.16	29,800	541,168 .00
2020 1228 0000 1303	600183	生益科技	2020-12-28	2021-01-1 1	28.16	10,000	281,600 .00
2020 1228 0000 1313	601229	上海银行	2020-12-28	2021-01-1 1	7.84	89,000	697,760 .00
2020 1228 0000 1329	601988	中国银行	2020-12-28	2021-01-1 1	3.18	57,500	182,850 .00
2020 1228 0000	600161	天坛生物	2020-12-28	2021-01-1 1	41.7	16,700	696,390 .00

1331							
2020 1228 0000 1341	601328	交通银行	2020-12-28	2021-01-1 1	4.48	47,400	212,352 .00
2020 1228 0000 1352	601988	中国银行	2020-12-28	2021-01-1 1	3.18	683,500	2,173,5 30.00
2020 1228 0000 1357	600845	宝信软件	2020-12-28	2021-01-1 1	68.98	10,000	689,800 .00
2020 1228 0000 1366	601328	交通银行	2020-12-28	2021-01-1 1	4.48	16,900	75,712. 00
2020 1228 0000 1372	601155	新城控股	2020-12-28	2021-01-1 1	34.83	10,000	348,300 .00
2020 1228 0000 1374	600369	西南证券	2020-12-28	2021-01-1 1	5.38	160,500	863,490 .00
2020 1228 0000 1378	600118	中国卫星	2020-12-28	2021-01-1 1	32.18	10,500	337,890 .00
2020 1228 0000 1387	600655	豫园股份	2020-12-28	2021-01-1 1	8.89	55,100	489,839 .00
2020 1228 0000 1389	600028	中国石化	2020-12-28	2021-01-1 1	4.03	10,100	40,703. 00
2020 1228 0000 1401	601577	长沙银行	2020-12-28	2021-01-1 1	9.52	36,800	350,336 .00
2020 1228 0000 1417	601108	财通证券	2020-12-28	2021-01-1 1	12.65	36,400	460,460 .00

2020 1228 0000 1430	601108	财通证券	2020-12-28	2021-01-1 1	12.65	42,200	533,830 .00
2020 1228 0000 1435	600068	葛洲坝	2020-12-28	2021-01-1 1	6.58	90,600	596,148 .00
2020 1228 0000 1438	600036	招商银行	2020-12-28	2021-01-1 1	43.95	28,600	1,256,9 70.00
2020 1228 0000 1442	600848	上海临港	2020-12-28	2021-01-1 1	20.02	25,600	512,512 .00
2020 1228 0000 1446	600050	中国联通	2020-12-28	2021-01-1 1	4.46	24,800	110,608 .00
2020 1228 0000 1470	600299	安迪苏	2020-12-28	2021-01-1 1	11.51	10,700	123,157 .00
2020 1228 0000 1478	601933	永辉超市	2020-12-28	2021-01-1 1	7.18	27,100	194,578 .00
2020 1228 0000 1483	601225	陕西煤业	2020-12-28	2021-01-1 1	9.34	20,400	190,536 .00
2020 1228 0000 1487	600061	国投资本	2020-12-28	2021-01-1 1	13.83	69,000	954,270 .00
2020 1228 0000 1499	600872	中炬高新	2020-12-28	2021-01-1 1	66.65	10,000	666,500 .00
2020 1228 0000 1506	601555	东吴证券	2020-12-28	2021-01-1 1	9.86	67,300	663,578 .00
2020	601990	南京证券	2020-12-28	2021-01-1	12.27	82,100	1,007,3

1228 0000 1510				1			67.00
2020 1228 0000 1516	601555	东吴证券	2020-12-28	2021-01-1 1	9.86	239,100	2,357,5 26.00
2020 1228 0000 1517	603833	欧派家居	2020-12-28	2021-01-1 1	134.5	10,000	1,345,0 00.00
2020 1228 0000 1537	601857	中国石油	2020-12-28	2021-01-1 1	4.15	17,500	72,625. 00
2020 1228 0000 1539	600352	浙江龙盛	2020-12-28	2021-01-1 1	13.62	16,100	219,282 .00
2020 1228 0000 1543	600763	通策医疗	2020-12-28	2021-01-1 1	276.52	10,000	2,765,2 00.00
2020 1228 0000 1556	600011	华能国际	2020-12-28	2021-01-1 1	4.48	37,700	168,896 .00
2020 1228 0000 1571	601100	恒立液压	2020-12-28	2021-01-1 1	113	10,000	1,130,0 00.00
2020 1228 0000 1575	601319	中国人保	2020-12-28	2021-01-1 1	6.57	49,000	321,930 .00
2020 1228 0000 1583	601998	中信银行	2020-12-28	2021-01-1 1	5.11	56,800	290,248 .00
2020 1228 0000 1588	601198	东兴证券	2020-12-28	2021-01-1 1	13.32	31,700	422,244 .00
2020 1228	600025	华能水电	2020-12-28	2021-01-1 1	4.46	41,100	183,306 .00



0000 1596							
2020 1228 0000 1605	600600	青岛啤酒	2020-12-28	2021-01-1 1	99.4	10,000	994,000 .00
2020 1228 0000 1616	601398	工商银行	2020-12-28	2021-01-1 1	4.99	101,700	507,483 .00
2020 1228 0000 1624	600893	航发动力	2020-12-28	2021-01-1 1	59.35	58,000	3,442,3 00.00
2020 1228 0000 1629	601899	紫金矿业	2020-12-28	2021-01-1 1	9.29	200,000	1,858,0 00.00
2020 1228 0000 1639	600383	金地集团	2020-12-28	2021-01-1 1	13.5	12,300	166,050 .00
2020 1228 0000 1644	603160	汇顶科技	2020-12-28	2021-01-1 1	155.55	10,000	1,555,5 00.00
2020 1228 0000 1647	600000	浦发银行	2020-12-28	2021-01-1 1	9.68	43,800	423,984 .00
2020 1228 0000 1651	600383	金地集团	2020-12-28	2021-01-1 1	13.5	16,200	218,700 .00
2020 1228 0000 1667	601919	中远海控	2020-12-28	2021-01-1 1	12.21	148,600	1,814,4 06.00
2020 1228 0000 1669	601800	中国交建	2020-12-28	2021-01-1 1	7.26	76,700	556,842 .00
2020 1228 0000	600522	中天科技	2020-12-28	2021-01-1 1	10.84	44,900	486,716 .00

1675							
2020 1228 0000 1681	600015	华夏银行	2020-12-28	2021-01-1 1	6.25	92,200	576,250 .00
2020 1228 0000 1683	600482	中国动力	2020-12-28	2021-01-1 1	17.92	11,600	207,872 .00
2020 1228 0000 1692	600176	中国巨石	2020-12-28	2021-01-1 1	19.96	50,000	998,000 .00
2020 1228 0000 1695	601169	北京银行	2020-12-28	2021-01-1 1	4.84	95,600	462,704 .00
2020 1228 0000 1698	600763	通策医疗	2020-12-28	2021-01-1 1	276.52	10,000	2,765,2 00.00
2020 1228 0000 1706	600271	航天信息	2020-12-28	2021-01-1 1	12.6	29,400	370,440 .00
2020 1228 0000 1713	601009	南京银行	2020-12-28	2021-01-1 1	8.08	108,400	875,872 .00
2020 1228 0000 1717	601838	成都银行	2020-12-28	2021-01-1 1	10.67	44,000	469,480 .00
2020 1228 0000 1720	603899	晨光文具	2020-12-28	2021-01-1 1	88.56	10,000	885,600 .00
2020 1228 0000 1730	601816	京沪高铁	2020-12-28	2021-01-1 1	5.66	42,800	242,248 .00
2020 1228 0000 1744	600340	华夏幸福	2020-12-28	2021-01-1 1	12.93	55,500	717,615 .00

2020 1228 0000 1749	601877	正泰电器	2020-12-28	2021-01-1 1	39.16	10,000	391,600 .00
2020 1228 0000 1754	603195	公牛集团	2020-12-28	2021-01-1 1	205.29	10,000	2,052,9 00.00
2020 1228 0000 1783	601166	兴业银行	2020-12-28	2021-01-1 1	20.87	10,000	208,700 .00
2020 1228 0000 1790	601166	兴业银行	2020-12-28	2021-01-1 1	20.87	700,000	14,609, 000.00
2020 1228 0000 1796	600177	雅戈尔	2020-12-28	2021-01-1 1	7.19	23,500	168,965 .00
2020 1228 0000 1799	600029	南方航空	2020-12-28	2021-01-1 1	5.96	52,100	310,516 .00
2020 1228 0000 1802	600115	东方航空	2020-12-28	2021-01-1 1	4.68	63,400	296,712 .00
2020 1228 0000 1829	600233	圆通速递	2020-12-28	2021-01-1 1	11.5	39,200	450,800 .00
2020 1228 0000 1842	600919	江苏银行	2020-12-28	2021-01-1 1	5.46	91,600	500,136 .00
2020 1228 0000 1844	600109	国金证券	2020-12-28	2021-01-1 1	16.27	59,400	966,438 .00
2020 1228 0000 1851	601808	中海油服	2020-12-28	2021-01-1 1	12.77	50,800	648,716 .00
2020	601231	环旭电子	2020-12-28	2021-01-1	19.34	16,400	317,176

1228 0000 1854				1			.00
2020 1228 0000 1858	600705	中航资本	2020-12-28	2021-01-1 1	4.38	71,400	312,732 .00
2020 1228 0000 1871	600606	绿地控股	2020-12-28	2021-01-1 1	5.83	16,500	96,195. 00
2020 1228 0000 1890	600016	民生银行	2020-12-28	2021-01-1 1	5.2	126,100	655,720 .00
2020 1228 0000 1898	601878	浙商证券	2020-12-28	2021-01-1 1	15.3	12,000	183,600 .00
2020 1228 0000 1905	600297	广汇汽车	2020-12-28	2021-01-1 1	2.86	215,500	616,330 .00
2020 1228 0000 1910	601818	光大银行	2020-12-28	2021-01-1 1	3.99	40,600	161,994 .00
2020 1228 0000 1914	601288	农业银行	2020-12-28	2021-01-1 1	3.14	82,100	257,794 .00
2020 1228 0000 1921	600390	五矿资本	2020-12-28	2021-01-1 1	6.98	27,200	189,856 .00
2020 1228 0000 1940	600489	中金黄金	2020-12-28	2021-01-1 1	8.81	37,000	325,970 .00
2020 1228 0000 1941	601881	中国银河	2020-12-28	2021-01-1 1	12.51	10,000	125,100 .00
2020 1228	601111	中国国航	2020-12-28	2021-01-1 1	7.49	88,000	659,120 .00

0000 1959							
2020 1228 0000 1971	600208	新湖中宝	2020-12-28	2021-01-1 1	3.1	208,500	646,350 .00
2020 1228 0000 1972	601872	招商轮船	2020-12-28	2021-01-1 1	5.65	156,000	881,400 .00
2020 1228 0000 1980	600637	东方明珠	2020-12-28	2021-01-1 1	8.94	107,300	959,262 .00
2020 1228 0000 1986	600027	华电国际	2020-12-28	2021-01-1 1	3.4	151,300	514,420 .00
2020 1228 0000 1996	601658	邮储银行	2020-12-28	2021-01-1 1	4.78	81,200	388,136 .00
2020 1228 0000 2006	601669	中国电建	2020-12-28	2021-01-1 1	3.88	58,400	226,592 .00
2020 1228 0000 2012	600004	白云机场	2020-12-28	2021-01-1 1	14.13	42,200	596,286 .00
2020 1228 0000 2015	601618	中国中冶	2020-12-28	2021-01-1 1	2.73	55,500	151,515 .00
2020 1228 0000 2021	603369	今世缘	2020-12-28	2021-01-1 1	57.38	10,000	573,800 .00
2020 1228 0000 2028	601318	中国平安	2020-12-28	2021-01-1 1	86.98	35,200	3,061,6 96.00
2020 1228 0000	600926	杭州银行	2020-12-28	2021-01-1 1	14.92	76,800	1,145,8 56.00

2034							
2020 1228 0000 2038	603993	洛阳钼业	2020-12-28	2021-01-1 1	6.25	124,800	780,000 .00
2020 1228 0000 2045	601186	中国铁建	2020-12-28	2021-01-1 1	7.9	30,600	241,740 .00
2020 1228 0000 2047	603993	洛阳钼业	2020-12-28	2021-01-1 1	6.25	555,000	3,468,7 50.00
2020 1228 0000 2052	601138	工业富联	2020-12-28	2021-01-1 1	13.69	10,000	136,900 .00
2020 1228 0000 2055	601162	天风证券	2020-12-28	2021-01-1 1	6.1	102,700	626,470 .00
2020 1228 0000 3535	600584	长电科技	2020-12-28	2021-01-1 1	42.57	20,000	851,400 .00
2020 1228 0000 3603	600066	宇通客车	2020-12-28	2021-01-1 1	16.92	49,400	835,848 .00
2020 1228 0000 3605	600061	国投资本	2020-12-28	2021-01-1 1	13.83	61,300	847,779 .00
2020 1228 0000 3607	002422	科伦药业	2020-12-28	2021-01-1 1	19.44	27,700	538,488 .00
2020 1228 0000 3609	002415	海康威视	2020-12-28	2021-01-1 1	48.51	147,900	7,174,6 29.00
2020 1228 0000 3611	002410	广联达	2020-12-28	2021-01-1 1	78.74	35,000	2,755,9 00.00

2020 1228 0000 3613	002463	沪电股份	2020-12-28	2021-01-1 1	18.79	22,100	415,259 .00
2020 1228 0000 3615	002456	欧菲光	2020-12-28	2021-01-1 1	13.18	56,700	747,306 .00
2020 1228 0000 3617	002371	北方华创	2020-12-28	2021-01-1 1	180.74	10,000	1,807,4 00.00
2020 1228 0000 3619	002271	东方雨虹	2020-12-28	2021-01-1 1	38.8	70,800	2,747,0 40.00
2020 1228 0000 3621	002460	赣锋锂业	2020-12-28	2021-01-1 1	101.2	26,500	2,681,8 00.00
2020 1228 0000 3623	002252	上海莱士	2020-12-28	2021-01-1 1	7.4	87,800	649,720 .00
2020 1228 0000 3625	002241	歌尔股份	2020-12-28	2021-01-1 1	37.32	67,300	2,511,6 36.00
2020 1228 0000 3627	002352	顺丰控股	2020-12-28	2021-01-1 1	88.23	54,300	4,790,8 89.00
2020 1228 0000 3629	002311	海大集团	2020-12-28	2021-01-1 1	65.5	21,900	1,434,4 50.00
2020 1228 0000 3631	002304	洋河股份	2020-12-28	2021-01-1 1	235.99	23,900	5,640,1 61.00
2020 1228 0000 3633	002475	立讯精密	2020-12-28	2021-01-1 1	56.12	163,000	9,147,5 60.00
2020	002673	西部证券	2020-12-28	2021-01-1	10.14	71,300	722,982

1228 0000 3635				1			.00
2020 1228 0000 3637	002607	中公教育	2020-12-28	2021-01-1 1	35.13	27,700	973,101 .00
2020 1228 0000 3639	002739	万达电影	2020-12-28	2021-01-1 1	18.08	31,500	569,520 .00
2020 1228 0000 3641	002736	国信证券	2020-12-28	2021-01-1 1	13.64	119,000	1,623,1 60.00
2020 1228 0000 3643	002624	完美世界	2020-12-28	2021-01-1 1	29.5	39,100	1,153,4 50.00
2020 1228 0000 3645	002714	牧原股份	2020-12-28	2021-01-1 1	77.1	84,200	6,491,8 20.00
2020 1228 0000 3647	002602	世纪华通	2020-12-28	2021-01-1 1	7.11	125,500	892,305 .00
2020 1228 0000 3649	002555	三七互娱	2020-12-28	2021-01-1 1	31.23	34,800	1,086,8 04.00
2020 1228 0000 3651	002508	老板电器	2020-12-28	2021-01-1 1	40.78	19,400	791,132 .00
2020 1228 0000 3653	002493	荣盛石化	2020-12-28	2021-01-1 1	27.61	70,700	1,952,0 27.00
2020 1228 0000 3655	002601	龙蟠佰利	2020-12-28	2021-01-1 1	30.77	37,900	1,166,1 83.00
2020 1228	002594	比亚迪	2020-12-28	2021-01-1 1	194.3	27,500	5,343,2 50.00



0000 3657							
2020 1228 0000 3659	002558	巨人网络	2020-12-28	2021-01-1 1	17.43	26,700	465,381 .00
2020 1228 0000 7363	600893	航发动力	2020-12-28	2021-01-1 1	59.35	39,800	2,362,1 30.00
2020 1228 0000 7365	600887	伊利股份	2020-12-28	2021-01-1 1	44.37	74,000	3,283,3 80.00
2020 1228 0000 7367	600848	上海临港	2020-12-28	2021-01-1 1	20.02	29,000	580,580 .00
2020 1228 0000 7369	600998	九州通	2020-12-28	2021-01-1 1	18.16	26,300	477,608 .00
2020 1228 0000 7371	600958	东方证券	2020-12-28	2021-01-1 1	11.63	129,200	1,502,5 96.00
2020 1228 0000 7373	600926	杭州银行	2020-12-28	2021-01-1 1	14.92	58,500	872,820 .00
2020 1228 0000 7375	600809	山西汾酒	2020-12-28	2021-01-1 1	375.29	10,000	3,752,9 00.00
2020 1228 0000 7377	600705	中航资本	2020-12-28	2021-01-1 1	4.38	206,400	904,032 .00
2020 1228 0000 7379	600703	三安光电	2020-12-28	2021-01-1 1	27.01	21,700	586,117 .00
2020 1228 0000	600795	国电电力	2020-12-28	2021-01-1 1	2.25	362,400	815,400 .00

7381							
2020 1228 0000 7383	600741	华域汽车	2020-12-28	2021-01-1 1	28.82	55,100	1,587,9 82.00
2020 1228 0000 7385	600760	中航沈飞	2020-12-28	2021-01-1 1	78.18	15,400	1,203,9 72.00
2020 1228 0000 7387	600745	闻泰科技	2020-12-28	2021-01-1 1	99	10,000	990,000 .00
2020 1228 0000 7389	601006	大秦铁路	2020-12-28	2021-01-1 1	6.46	210,100	1,357,2 46.00
2020 1228 0000 7391	601162	天风证券	2020-12-28	2021-01-1 1	6.1	127,700	778,970 .00
2020 1228 0000 7393	601155	新城控股	2020-12-28	2021-01-1 1	34.83	35,400	1,232,9 82.00
2020 1228 0000 7395	601138	工业富联	2020-12-28	2021-01-1 1	13.69	38,900	532,541 .00
2020 1228 0000 7397	601211	国泰君安	2020-12-28	2021-01-1 1	17.53	65,800	1,153,4 74.00
2020 1228 0000 7399	601186	中国铁建	2020-12-28	2021-01-1 1	7.9	49,300	389,470 .00
2020 1228 0000 7401	601169	北京银行	2020-12-28	2021-01-1 1	4.84	359,200	1,738,5 28.00
2020 1228 0000 7403	601117	中国化学	2020-12-28	2021-01-1 1	5.87	81,400	477,818 .00

2020 1228 0000 7405	601088	中国神华	2020-12-28	2021-01-1 1	18.01	40,700	733,007 .00
2020 1228 0000 7407	601012	隆基股份	2020-12-28	2021-01-1 1	92.2	25,000	2,305,0 00.00
2020 1228 0000 7409	601009	南京银行	2020-12-28	2021-01-1 1	8.08	146,400	1,182,9 12.00
2020 1228 0000 7411	601111	中国国航	2020-12-28	2021-01-1 1	7.49	91,500	685,335 .00
2020 1228 0000 7413	601108	财通证券	2020-12-28	2021-01-1 1	12.65	62,500	790,625 .00
2020 1228 0000 7415	601100	恒立液压	2020-12-28	2021-01-1 1	113	14,900	1,683,7 00.00
2020 1228 0000 7417	600362	江西铜业	2020-12-28	2021-01-1 1	19.95	39,800	794,010 .00
2020 1228 0000 7419	600352	浙江龙盛	2020-12-28	2021-01-1 1	13.62	145,900	1,987,1 58.00
2020 1228 0000 7421	600383	金地集团	2020-12-28	2021-01-1 1	13.5	82,100	1,108,3 50.00
2020 1228 0000 7423	600346	恒力石化	2020-12-28	2021-01-1 1	27.97	82,700	2,313,1 19.00
2020 1228 0000 7425	600390	五矿资本	2020-12-28	2021-01-1 1	6.98	85,800	598,884 .00
2020	600369	西南证券	2020-12-28	2021-01-1	5.38	132,400	712,312

1228 0000 7427				1			.00
2020 1228 0000 7429	600340	华夏幸福	2020-12-28	2021-01-1 1	12.93	66,000	853,380 .00
2020 1228 0000 7431	600276	恒瑞医药	2020-12-28	2021-01-1 1	111.46	63,900	7,122,2 94.00
2020 1228 0000 7433	600271	航天信息	2020-12-28	2021-01-1 1	12.6	51,000	642,600 .00
2020 1228 0000 7435	600233	圆通速递	2020-12-28	2021-01-1 1	11.5	54,900	631,350 .00
2020 1228 0000 7437	600309	万华化学	2020-12-28	2021-01-1 1	91.04	14,900	1,356,4 96.00
2020 1228 0000 7439	600299	安迪苏	2020-12-28	2021-01-1 1	11.51	12,500	143,875 .00
2020 1228 0000 7441	600297	广汇汽车	2020-12-28	2021-01-1 1	2.86	110,100	314,886 .00
2020 1228 0000 7443	600406	国电南瑞	2020-12-28	2021-01-1 1	26.57	95,500	2,537,4 35.00
2020 1228 0000 7445	600606	绿地控股	2020-12-28	2021-01-1 1	5.83	139,400	812,702 .00
2020 1228 0000 7447	600588	用友网络	2020-12-28	2021-01-1 1	43.87	30,500	1,338,0 35.00
2020 1228	600585	海螺水泥	2020-12-28	2021-01-1 1	51.62	40,100	2,069,9 62.00

0000 7449							
2020 1228 0000 7451	600690	海尔智家	2020-12-28	2021-01-1 1	29.21	48,000	1,402,0 80.00
2020 1228 0000 7453	600637	东方明珠	2020-12-28	2021-01-1 1	8.94	87,800	784,932 .00
2020 1228 0000 7455	600660	福耀玻璃	2020-12-28	2021-01-1 1	48.05	37,100	1,782,6 55.00
2020 1228 0000 7457	600570	恒生电子	2020-12-28	2021-01-1 1	104.9	36,900	3,870,8 10.00
2020 1228 0000 7459	600487	亨通光电	2020-12-28	2021-01-1 1	13.99	59,300	829,607 .00
2020 1228 0000 7461	600438	通威股份	2020-12-28	2021-01-1 1	38.44	78,300	3,009,8 52.00
2020 1228 0000 7463	600436	片仔癀	2020-12-28	2021-01-1 1	267.51	12,300	3,290,3 73.00
2020 1228 0000 7465	600547	山东黄金	2020-12-28	2021-01-1 1	23.62	30,500	720,410 .00
2020 1228 0000 7467	600522	中天科技	2020-12-28	2021-01-1 1	10.84	105,200	1,140,3 68.00
2020 1228 0000 7469	600498	烽火通信	2020-12-28	2021-01-1 1	24.08	31,100	748,888 .00
2020 1228 0000	601989	中国重工	2020-12-28	2021-01-1 1	4.19	171,600	719,004 .00

7471							
2020 1228 0000 7473	601985	中国核电	2020-12-28	2021-01-1 1	4.92	243,800	1,199,496.00
2020 1228 0000 7475	601939	建设银行	2020-12-28	2021-01-1 1	6.28	161,500	1,014,220.00
2020 1228 0000 7477	603160	汇顶科技	2020-12-28	2021-01-1 1	155.55	10,000	1,555,500.00
2020 1228 0000 7479	603156	养元饮品	2020-12-28	2021-01-1 1	25.84	20,200	521,968.00
2020 1228 0000 7481	603019	中科曙光	2020-12-28	2021-01-1 1	34.23	45,400	1,554,042.00
2020 1228 0000 7483	601933	永辉超市	2020-12-28	2021-01-1 1	7.18	166,100	1,192,598.00
2020 1228 0000 7485	601888	中国中免	2020-12-28	2021-01-1 1	282.45	10,000	2,824,500.00
2020 1228 0000 7487	601881	中国银河	2020-12-28	2021-01-1 1	12.51	40,300	504,153.00
2020 1228 0000 7489	601878	浙商证券	2020-12-28	2021-01-1 1	15.3	38,700	592,110.00
2020 1228 0000 7491	601919	中远海控	2020-12-28	2021-01-1 1	12.21	103,000	1,257,630.00
2020 1228 0000 7493	601901	方正证券	2020-12-28	2021-01-1 1	10.37	179,200	1,858,304.00

2020 1228 0000 7495	601899	紫金矿业	2020-12-28	2021-01-1 1	9.29	491,300	4,564,1 77.00
2020 1228 0000 7497	603833	欧派家居	2020-12-28	2021-01-1 1	134.5	10,000	1,345,0 00.00
2020 1228 0000 7499	603799	华友钴业	2020-12-28	2021-01-1 1	79.3	20,900	1,657,3 70.00
2020 1228 0000 7501	603658	安图生物	2020-12-28	2021-01-1 1	145.18	10,000	1,451,8 00.00
2020 1228 0000 7503	603993	洛阳钼业	2020-12-28	2021-01-1 1	6.25	108,300	676,875 .00
2020 1228 0000 7505	603986	兆易创新	2020-12-28	2021-01-1 1	197.5	10,100	1,994,7 50.00
2020 1228 0000 7507	603899	晨光文具	2020-12-28	2021-01-1 1	88.56	14,900	1,319,5 44.00
2020 1228 0000 7509	603501	韦尔股份	2020-12-28	2021-01-1 1	231.1	10,000	2,311,0 00.00
2020 1228 0000 7511	603369	今世缘	2020-12-28	2021-01-1 1	57.38	16,100	923,818 .00
2020 1228 0000 7513	603288	海天味业	2020-12-28	2021-01-1 1	200.54	44,400	8,903,9 76.00
2020 1228 0000 7515	603259	药明康德	2020-12-28	2021-01-1 1	134.72	15,000	2,020,8 00.00
2020	601555	东吴证券	2020-12-28	2021-01-1	9.86	105,300	1,038,2

1228 0000 7517				1			58.00
2020 1228 0000 7519	601390	中国中铁	2020-12-28	2021-01-1 1	5.27	278,900	1,469,8 03.00
2020 1228 0000 7521	601360	三六零	2020-12-28	2021-01-1 1	15.71	44,400	697,524 .00
2020 1228 0000 7523	601618	中国中冶	2020-12-28	2021-01-1 1	2.73	254,800	695,604 .00
2020 1228 0000 7525	601607	上海医药	2020-12-28	2021-01-1 1	19.2	43,800	840,960 .00
2020 1228 0000 7527	601600	中国铝业	2020-12-28	2021-01-1 1	3.63	210,600	764,478 .00
2020 1228 0000 7529	601336	新华保险	2020-12-28	2021-01-1 1	57.97	12,800	742,016 .00
2020 1228 0000 7531	601229	上海银行	2020-12-28	2021-01-1 1	7.84	240,200	1,883,1 68.00
2020 1228 0000 7533	601225	陕西煤业	2020-12-28	2021-01-1 1	9.34	124,500	1,162,8 30.00
2020 1228 0000 7535	601216	君正集团	2020-12-28	2021-01-1 1	4.95	57,600	285,120 .00
2020 1228 0000 7537	601236	红塔证券	2020-12-28	2021-01-1 1	18.59	10,000	185,900 .00
2020 1228	601238	广汽集团	2020-12-28	2021-01-1 1	13.29	24,400	324,276 .00



0000 7539							
2020 1228 0000 7541	601231	环旭电子	2020-12-28	2021-01-1 1	19.34	24,100	466,094 .00
2020 1228 0000 7543	601628	中国人寿	2020-12-28	2021-01-1 1	38.39	23,800	913,682 .00
2020 1228 0000 7545	601808	中海油服	2020-12-28	2021-01-1 1	12.77	26,000	332,020 .00
2020 1228 0000 7547	601800	中国交建	2020-12-28	2021-01-1 1	7.26	128,900	935,814 .00
2020 1228 0000 7549	601788	光大证券	2020-12-28	2021-01-1 1	18.52	64,600	1,196,3 92.00
2020 1228 0000 7551	601877	正泰电器	2020-12-28	2021-01-1 1	39.16	46,600	1,824,8 56.00
2020 1228 0000 7553	601838	成都银行	2020-12-28	2021-01-1 1	10.67	52,000	554,840 .00
2020 1228 0000 7555	601816	京沪高铁	2020-12-28	2021-01-1 1	5.66	58,400	330,544 .00
2020 1228 0000 7557	601766	中国中车	2020-12-28	2021-01-1 1	5.31	517,700	2,748,9 87.00
2020 1228 0000 7559	601669	中国电建	2020-12-28	2021-01-1 1	3.88	269,500	1,045,6 60.00
2020 1228 0000	601668	中国建筑	2020-12-28	2021-01-1 1	4.97	268,800	1,335,9 36.00

7561							
2020 1228 0000 7563	601633	长城汽车	2020-12-28	2021-01-1 1	37.81	16,900	638,989 .00
2020 1228 0000 7565	601727	上海电气	2020-12-28	2021-01-1 1	5.4	121,900	658,260 .00
2020 1228 0000 7567	601688	华泰证券	2020-12-28	2021-01-1 1	18.01	88,800	1,599,2 88.00
2020 1228 0000 7569	601698	中国卫通	2020-12-28	2021-01-1 1	18.14	16,200	293,868 .00
2020 1228 0000 7571	000977	浪潮信息	2020-12-28	2021-01-1 1	26.88	39,100	1,051,0 08.00
2020 1228 0000 7573	000963	华东医药	2020-12-28	2021-01-1 1	26.56	34,300	911,008 .00
2020 1228 0000 7575	000961	中南建设	2020-12-28	2021-01-1 1	8.83	72,200	637,526 .00
2020 1228 0000 7577	002007	华兰生物	2020-12-28	2021-01-1 1	42.24	30,000	1,267,2 00.00
2020 1228 0000 7579	002001	新和成	2020-12-28	2021-01-1 1	33.68	57,100	1,923,1 28.00
2020 1228 0000 7581	001979	招商蛇口	2020-12-28	2021-01-1 1	13.29	163,100	2,167,5 99.00
2020 1228 0000 7583	000938	紫光股份	2020-12-28	2021-01-1 1	20.45	57,300	1,171,7 85.00

2020 1228 0000 7585	000858	五 粮 液	2020-12-28	2021-01-1 1	291.85	77,100	22,501, 635.00
2020 1228 0000 7587	000786	北新建材	2020-12-28	2021-01-1 1	40.05	25,900	1,037,2 95.00
2020 1228 0000 7589	000783	长江证券	2020-12-28	2021-01-1 1	8.4	192,800	1,619,5 20.00
2020 1228 0000 7591	000895	双汇发展	2020-12-28	2021-01-1 1	46.94	42,900	2,013,7 26.00
2020 1228 0000 7593	000876	新 希 望	2020-12-28	2021-01-1 1	22.4	72,100	1,615,0 40.00
2020 1228 0000 7595	000860	顺鑫农业	2020-12-28	2021-01-1 1	72.54	22,200	1,610,3 88.00
2020 1228 0000 7597	002008	大族激光	2020-12-28	2021-01-1 1	42.75	25,200	1,077,3 00.00
2020 1228 0000 7599	002179	中航光电	2020-12-28	2021-01-1 1	78.29	19,700	1,542,3 13.00
2020 1228 0000 7601	002157	正邦科技	2020-12-28	2021-01-1 1	17.04	53,000	903,120 .00
2020 1228 0000 7603	002142	宁波银行	2020-12-28	2021-01-1 1	35.34	73,600	2,601,0 24.00
2020 1228 0000 7605	002236	大华股份	2020-12-28	2021-01-1 1	19.89	70,600	1,404,2 34.00
2020	002202	金风科技	2020-12-28	2021-01-1	14.25	100,200	1,427,8

1228 0000 7607				1			50.00
2020 1228 0000 7609	002230	科大讯飞	2020-12-28	2021-01-1 1	40.87	26,500	1,083,0 55.00
2020 1228 0000 7611	002129	中环股份	2020-12-28	2021-01-1 1	25.5	48,300	1,231,6 50.00
2020 1228 0000 7613	002027	分众传媒	2020-12-28	2021-01-1 1	9.87	317,200	3,130,7 64.00
2020 1228 0000 7615	002032	苏泊尔	2020-12-28	2021-01-1 1	77.99	10,000	779,900 .00
2020 1228 0000 7617	002024	苏宁易购	2020-12-28	2021-01-1 1	7.71	150,100	1,157,2 71.00
2020 1228 0000 7619	002120	韵达股份	2020-12-28	2021-01-1 1	15.7	50,500	792,850 .00
2020 1228 0000 7621	002050	三花智控	2020-12-28	2021-01-1 1	24.65	69,500	1,713,1 75.00
2020 1228 0000 7623	002044	美年健康	2020-12-28	2021-01-1 1	11.33	99,400	1,126,2 02.00
2020 1228 0000 7625	000166	申万宏源	2020-12-28	2021-01-1 1	5.28	379,500	2,003,7 60.00
2020 1228 0000 7627	000157	中联重科	2020-12-28	2021-01-1 1	9.9	116,800	1,156,3 20.00
2020 1228	000100	TCL 科技	2020-12-28	2021-01-1 1	7.08	535,700	3,792,7 56.00

0000 7629							
2020 1228 0000 7631	000425	徐工机械	2020-12-28	2021-01-1 1	5.37	199,000	1,068,6 30.00
2020 1228 0000 7633	000338	潍柴动力	2020-12-28	2021-01-1 1	15.79	197,100	3,112,2 09.00
2020 1228 0000 7635	601989	中国重工	2020-12-28	2021-01-1 1	4.19	281,200	1,178,2 28.00
2020 1228 0000 7637	000001	平安银行	2020-12-28	2021-01-1 1	19.34	137,900	2,666,9 86.00
2020 1228 0000 7639	000069	华侨城 A	2020-12-28	2021-01-1 1	7.09	146,800	1,040,8 12.00
2020 1228 0000 7641	000333	美的集团	2020-12-28	2021-01-1 1	98.44	193,400	19,038, 296.00
2020 1228 0000 7643	000066	中国长城	2020-12-28	2021-01-1 1	18.99	66,700	1,266,6 33.00
2020 1228 0000 7645	000063	中兴通讯	2020-12-28	2021-01-1 1	33.65	54,300	1,827,1 95.00
2020 1228 0000 7647	000002	万科 A	2020-12-28	2021-01-1 1	28.7	259,400	7,444,7 80.00
2020 1228 0000 7649	000538	云南白药	2020-12-28	2021-01-1 1	113.6	19,400	2,203,8 40.00
2020 1228 0000	000725	京东方 A	2020-12-28	2021-01-1 1	6	932,500	5,595,0 00.00

7651							
2020 1228 0000 7653	000723	美锦能源	2020-12-28	2021-01-1 1	6.68	38,300	255,844 .00
2020 1228 0000 7655	000708	中信特钢	2020-12-28	2021-01-1 1	21.79	14,600	318,134 .00
2020 1228 0000 7657	000776	广发证券	2020-12-28	2021-01-1 1	16.28	149,700	2,437,1 16.00
2020 1228 0000 7659	000768	中航西飞	2020-12-28	2021-01-1 1	36.68	41,200	1,511,2 16.00
2020 1228 0000 7661	000728	国元证券	2020-12-28	2021-01-1 1	8.96	97,600	874,496 .00
2020 1228 0000 7663	000703	恒逸石化	2020-12-28	2021-01-1 1	12.8	64,400	824,320 .00
2020 1228 0000 7665	000596	古井贡酒	2020-12-28	2021-01-1 1	272	10,000	2,720,0 00.00
2020 1228 0000 7667	000568	泸州老窖	2020-12-28	2021-01-1 1	226.16	24,600	5,563,5 36.00
2020 1228 0000 7669	000625	长安汽车	2020-12-28	2021-01-1 1	21.88	75,300	1,647,5 64.00
2020 1228 0000 7671	000656	金科股份	2020-12-28	2021-01-1 1	7.09	59,300	420,437 .00
2020 1228 0000 7673	000661	长春高新	2020-12-28	2021-01-1 1	448.91	11,500	5,162,4 65.00

2020 1228 0000 7675	000651	格力电器	2020-12-28	2021-01-1 1	61.94	186,300	11,539, 422.00
2020 1228 0000 7677	600019	宝钢股份	2020-12-28	2021-01-1 1	5.95	279,100	1,660,6 45.00
2020 1228 0000 7679	600011	华能国际	2020-12-28	2021-01-1 1	4.48	155,500	696,640 .00
2020 1228 0000 7681	600029	南方航空	2020-12-28	2021-01-1 1	5.96	177,300	1,056,7 08.00
2020 1228 0000 7683	600015	华夏银行	2020-12-28	2021-01-1 1	6.25	149,600	935,000 .00
2020 1228 0000 7685	600028	中国石化	2020-12-28	2021-01-1 1	4.03	94,600	381,238 .00
2020 1228 0000 7687	600027	华电国际	2020-12-28	2021-01-1 1	3.4	114,700	389,980 .00
2020 1228 0000 7689	600010	包钢股份	2020-12-28	2021-01-1 1	1.17	770,500	901,485 .00
2020 1228 0000 7691	002916	深南电路	2020-12-28	2021-01-1 1	108.06	10,000	1,080,6 00.00
2020 1228 0000 7693	002841	视源股份	2020-12-28	2021-01-1 1	115.03	10,300	1,184,8 09.00
2020 1228 0000 7695	002773	康弘药业	2020-12-28	2021-01-1 1	48.15	12,300	592,245 .00
2020	600009	上海机场	2020-12-28	2021-01-1	75.66	18,600	1,407,2

1228 0000 7697				1			76.00
2020 1228 0000 7699	600004	白云机场	2020-12-28	2021-01-1 1	14.13	45,700	645,741 .00
2020 1228 0000 7701	002958	青农商行	2020-12-28	2021-01-1 1	5.09	67,100	341,539 .00
2020 1228 0000 7703	600030	中信证券	2020-12-28	2021-01-1 1	29.4	99,700	2,931,1 80.00
2020 1228 0000 7705	600177	雅戈尔	2020-12-28	2021-01-1 1	7.19	52,900	380,351 .00
2020 1228 0000 7707	600115	东方航空	2020-12-28	2021-01-1 1	4.68	163,500	765,180 .00
2020 1228 0000 7709	600111	北方稀土	2020-12-28	2021-01-1 1	13.09	39,000	510,510 .00
2020 1228 0000 7711	600208	新湖中宝	2020-12-28	2021-01-1 1	3.1	168,000	520,800 .00
2020 1228 0000 7713	600183	生益科技	2020-12-28	2021-01-1 1	28.16	37,200	1,047,5 52.00
2020 1228 0000 7715	600104	上汽集团	2020-12-28	2021-01-1 1	24.44	28,100	686,764 .00
2020 1228 0000 7717	600196	复星医药	2020-12-28	2021-01-1 1	53.99	21,000	1,133,7 90.00
2020 1228	600050	中国联通	2020-12-28	2021-01-1 1	4.46	134,000	597,640 .00



0000 7719							
2020 1228 0000 7721	600048	保利地产	2020-12-28	2021-01-1 1	15.82	108,600	1,718,0 52.00
2020 1228 0000 7723	600031	三一重工	2020-12-28	2021-01-1 1	34.98	60,900	2,130,2 82.00
2020 1228 0000 7725	600068	葛洲坝	2020-12-28	2021-01-1 1	6.58	94,200	619,836 .00
2020 1228 0000 7731	002241	歌尔股份	2020-12-28	2021-01-1 1	37.32	270,000	10,076, 400.00
2020 1228 0000 7739	601216	君正集团	2020-12-28	2021-01-1 1	4.95	350,000	1,732,5 00.00
2020 1215 0000 0972	000063	中兴通讯	2020-12-15	2021-01-1 2	33.65	30,000	1,009,5 00.00
2020 1215 0000 1019	000338	潍柴动力	2020-12-15	2021-01-1 2	15.79	1,000,00 0	15,790, 000.00
2020 1215 0000 1020	000338	潍柴动力	2020-12-15	2021-01-1 2	15.79	81,600	1,288,4 64.00
2020 1215 0000 1113	000708	中信特钢	2020-12-15	2021-01-1 2	21.79	65,000	1,416,3 50.00
2020 1215 0000 1128	000725	京东方 A	2020-12-15	2021-01-1 2	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00
2020 1215 0000	000725	京东方 A	2020-12-15	2021-01-1 2	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00

1129							
2020 1215 0000 1130	000725	京东方 A	2020-12-15	2021-01-1 2	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00
2020 1215 0000 1131	000725	京东方 A	2020-12-15	2021-01-1 2	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00
2020 1215 0000 1132	000725	京东方 A	2020-12-15	2021-01-1 2	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00
2020 1215 0000 1158	000768	中航西飞	2020-12-15	2021-01-1 2	36.68	30,000	1,100,4 00.00
2020 1215 0000 1161	000776	广发证券	2020-12-15	2021-01-1 2	16.28	454,100	7,392,7 48.00
2020 1215 0000 1216	000895	双汇发展	2020-12-15	2021-01-1 2	46.94	35,000	1,642,9 00.00
2020 1215 0000 1279	002049	紫光国微	2020-12-15	2021-01-1 2	133.81	27,000	3,612,8 70.00
2020 1215 0000 1290	001979	招商蛇口	2020-12-15	2021-01-1 2	13.29	74,800	994,092 .00
2020 1215 0000 1380	002202	金风科技	2020-12-15	2021-01-1 2	14.25	70,000	997,500 .00
2020 1215 0000 1389	002202	金风科技	2020-12-15	2021-01-1 2	14.25	110,000	1,567,5 00.00
2020 1215 0000 1479	002371	北方华创	2020-12-15	2021-01-1 2	180.74	13,600	2,458,0 64.00

2020 1215 0000 1621	002594	比 亚 迪	2020-12-15	2021-01-1 2	194.3	40,000	7,772,0 00.00
2020 1215 0000 1658	002812	恩捷股份	2020-12-15	2021-01-1 2	141.78	20,000	2,835,6 00.00
2020 1215 0000 1682	601985	中国核电	2020-12-15	2021-01-1 2	4.92	416,900	2,051,1 48.00
2020 1215 0000 1720	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-1 2	42.57	229,000	9,748,5 30.00
2020 1215 0000 1738	601988	中国银行	2020-12-15	2021-01-1 2	3.18	1,000,00 0	3,180,0 00.00
2020 1215 0000 1741	601236	红塔证券	2020-12-15	2021-01-1 2	18.59	40,500	752,895 .00
2020 1215 0000 1761	601988	中国银行	2020-12-15	2021-01-1 2	3.18	1,000,00 0	3,180,0 00.00
2020 1215 0000 1788	601988	中国银行	2020-12-15	2021-01-1 2	3.18	622,300	1,978,9 14.00
2020 1215 0000 1796	600918	中泰证券	2020-12-15	2021-01-1 2	18.5	134,300	2,484,5 50.00
2020 1215 0000 1810	601988	中国银行	2020-12-15	2021-01-1 2	3.18	1,000,00 0	3,180,0 00.00
2020 1215 0000 1820	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020	601988	中国银行	2020-12-15	2021-01-1	3.18	1,000,00	3,180,0

1215 0000 1821				2		0	00.00
2020 1215 0000 1827	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1215 0000 1828	600570	恒生电子	2020-12-15	2021-01-1 2	104.9	19,000	1,993,1 00.00
2020 1215 0000 1832	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1215 0000 1838	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1215 0000 1845	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	348,900	1,741,0 11.00
2020 1215 0000 1852	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1215 0000 1856	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1215 0000 1865	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1215 0000 1879	600660	福耀玻璃	2020-12-15	2021-01-1 2	48.05	10,000	480,500 .00
2020 1215 0000 1884	601838	成都银行	2020-12-15	2021-01-1 2	10.67	63,800	680,746 .00
2020 1215	601398	工商银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00

0000 1898							
2020 1215 0000 1983	600161	天坛生物	2020-12-15	2021-01-1 2	41.7	65,600	2,735,5 20.00
2020 1215 0000 2016	600010	包钢股份	2020-12-15	2021-01-1 2	1.17	1,000,00 0	1,170,0 00.00
2020 1215 0000 2085	601336	新华保险	2020-12-15	2021-01-1 2	57.97	20,000	1,159,4 00.00
2020 1215 0000 2119	600111	北方稀土	2020-12-15	2021-01-1 2	13.09	50,000	654,500 .00
2020 1215 0000 2260	600585	海螺水泥	2020-12-15	2021-01-1 2	51.62	68,400	3,530,8 08.00
2020 1215 0000 2282	601990	南京证券	2020-12-15	2021-01-1 2	12.27	154,000	1,889,5 80.00
2020 1215 0000 2325	603156	养元饮品	2020-12-15	2021-01-1 2	25.84	115,000	2,971,6 00.00
2020 1215 0000 2396	600297	广汇汽车	2020-12-15	2021-01-1 2	2.86	626,000	1,790,3 60.00
2020 1215 0000 2429	601328	交通银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1215 0000 2443	601328	交通银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.48	500,000	2,240,0 00.00
2020 1215 0000	601328	交通银行	2020-12-15	2021-01-1 2	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00

2450							
2020 1215 0000 2455	601877	正泰电器	2020-12-15	2021-01-1 2	39.16	30,800	1,206,1 28.00
2020 1229 0000 0734	000425	徐工机械	2020-12-29	2021-01-1 2	5.37	10,000	53,700. 00
2020 1229 0000 0763	000625	长安汽车	2020-12-29	2021-01-1 2	21.88	211,600	4,629,8 08.00
2020 1229 0000 0780	000656	金科股份	2020-12-29	2021-01-1 2	7.09	25,600	181,504 .00
2020 1229 0000 0797	000723	美锦能源	2020-12-29	2021-01-1 2	6.68	190,000	1,269,2 00.00
2020 1229 0000 0798	000723	美锦能源	2020-12-29	2021-01-1 2	6.68	251,900	1,682,6 92.00
2020 1229 0000 0854	000876	新希望	2020-12-29	2021-01-1 2	22.4	45,000	1,008,0 00.00
2020 1229 0000 0855	000876	新希望	2020-12-29	2021-01-1 2	22.4	32,000	716,800 .00
2020 1229 0000 0868	000938	紫光股份	2020-12-29	2021-01-1 2	20.45	10,000	204,500 .00
2020 1229 0000 0890	002007	华兰生物	2020-12-29	2021-01-1 2	42.24	10,000	422,400 .00
2020 1229 0000 0899	002024	苏宁易购	2020-12-29	2021-01-1 2	7.71	56,900	438,699 .00

2020 1229 0000 0908	002044	美年健康	2020-12-29	2021-01-1 2	11.33	17,600	199,408 .00
2020 1229 0000 0942	000961	中南建设	2020-12-29	2021-01-1 2	8.83	27,100	239,293 .00
2020 1229 0000 0943	002001	新和成	2020-12-29	2021-01-1 2	33.68	12,800	431,104 .00
2020 1229 0000 0955	002120	韵达股份	2020-12-29	2021-01-1 2	15.7	11,200	175,840 .00
2020 1229 0000 0973	002120	韵达股份	2020-12-29	2021-01-1 2	15.7	10,000	157,000 .00
2020 1229 0000 0995	002157	正邦科技	2020-12-29	2021-01-1 2	17.04	10,000	170,400 .00
2020 1229 0000 1019	002236	大华股份	2020-12-29	2021-01-1 2	19.89	15,000	298,350 .00
2020 1229 0000 1075	002422	科伦药业	2020-12-29	2021-01-1 2	19.44	10,000	194,400 .00
2020 1229 0000 1087	002456	欧菲光	2020-12-29	2021-01-1 2	13.18	17,400	229,332 .00
2020 1229 0000 1092	002463	沪电股份	2020-12-29	2021-01-1 2	18.79	19,500	366,405 .00
2020 1229 0000 1112	002508	老板电器	2020-12-29	2021-01-1 2	40.78	10,000	407,800 .00
2020	002558	巨人网络	2020-12-29	2021-01-1	17.43	10,000	174,300

1229 0000 1120				2			.00
2020 1229 0000 1127	002600	领益智造	2020-12-29	2021-01-1 2	11.99	363,300	4,355,9 67.00
2020 1229 0000 1136	002601	龙蟠佰利	2020-12-29	2021-01-1 2	30.77	10,000	307,700 .00
2020 1229 0000 1144	002602	世纪华通	2020-12-29	2021-01-1 2	7.11	41,400	294,354 .00
2020 1229 0000 1145	002624	完美世界	2020-12-29	2021-01-1 2	29.5	21,500	634,250 .00
2020 1229 0000 1169	002739	万达电影	2020-12-29	2021-01-1 2	18.08	11,200	202,496 .00
2020 1229 0000 1175	002773	康弘药业	2020-12-29	2021-01-1 2	48.15	10,000	481,500 .00
2020 1229 0000 1188	002841	视源股份	2020-12-29	2021-01-1 2	115.03	10,000	1,150,3 00.00
2020 1229 0000 1224	600998	九州通	2020-12-29	2021-01-1 2	18.16	10,000	181,600 .00
2020 1229 0000 1238	600183	生益科技	2020-12-29	2021-01-1 2	28.16	10,000	281,600 .00
2020 1229 0000 1243	600346	恒力石化	2020-12-29	2021-01-1 2	27.97	10,000	279,700 .00
2020 1229	601155	新城控股	2020-12-29	2021-01-1 2	34.83	10,000	348,300 .00



0000 1260							
2020 1229 0000 1266	601988	中国银行	2020-12-29	2021-01-1 2	3.18	20,500	65,190. 00
2020 1229 0000 1298	600845	宝信软件	2020-12-29	2021-01-1 2	68.98	10,000	689,800 .00
2020 1229 0000 1317	600369	西南证券	2020-12-29	2021-01-1 2	5.38	30,900	166,242 .00
2020 1229 0000 1367	601328	交通银行	2020-12-29	2021-01-1 2	4.48	26,900	120,512 .00
2020 1229 0000 1447	600028	中国石化	2020-12-29	2021-01-1 2	4.03	32,000	128,960 .00
2020 1229 0000 1518	600741	华域汽车	2020-12-29	2021-01-1 2	28.82	35,200	1,014,4 64.00
2020 1229 0000 1570	600036	招商银行	2020-12-29	2021-01-1 2	43.95	230,000	10,108, 500.00
2020 1229 0000 1588	600848	上海临港	2020-12-29	2021-01-1 2	20.02	12,000	240,240 .00
2020 1229 0000 1599	600050	中国联通	2020-12-29	2021-01-1 2	4.46	124,200	553,932 .00
2020 1229 0000 1630	600061	国投资本	2020-12-29	2021-01-1 2	13.83	10,000	138,300 .00
2020 1229 0000	600061	国投资本	2020-12-29	2021-01-1 2	13.83	20,600	284,898 .00

1641							
2020 1229 0000 1670	601857	中国石油	2020-12-29	2021-01-1 2	4.15	69,600	288,840 .00
2020 1229 0000 1745	600872	中炬高新	2020-12-29	2021-01-1 2	66.65	16,600	1,106,3 90.00
2020 1229 0000 1788	600352	浙江龙盛	2020-12-29	2021-01-1 2	13.62	19,700	268,314 .00
2020 1229 0000 1804	600352	浙江龙盛	2020-12-29	2021-01-1 2	13.62	49,200	670,104 .00
2020 1229 0000 1909	600011	华能国际	2020-12-29	2021-01-1 2	4.48	45,700	204,736 .00
2020 1229 0000 1969	601398	工商银行	2020-12-29	2021-01-1 2	4.99	1,000,00 0	4,990,0 00.00
2020 1229 0000 1986	601398	工商银行	2020-12-29	2021-01-1 2	4.99	217,200	1,083,8 28.00
2020 1229 0000 2011	600383	金地集团	2020-12-29	2021-01-1 2	13.5	29,000	391,500 .00
2020 1229 0000 2052	600763	通策医疗	2020-12-29	2021-01-1 2	276.52	10,000	2,765,2 00.00
2020 1229 0000 2074	600522	中天科技	2020-12-29	2021-01-1 2	10.84	43,100	467,204 .00
2020 1229 0000 2100	601800	中国交建	2020-12-29	2021-01-1 2	7.26	19,400	140,844 .00

2020 1229 0000 2120	601800	中国交建	2020-12-29	2021-01-1 2	7.26	46,600	338,316 .00
2020 1229 0000 2132	601800	中国交建	2020-12-29	2021-01-1 2	7.26	10,000	72,600. 00
2020 1229 0000 2236	601766	中国中车	2020-12-29	2021-01-1 2	5.31	12,600	66,906. 00
2020 1229 0000 2249	603899	晨光文具	2020-12-29	2021-01-1 2	88.56	10,000	885,600 .00
2020 1229 0000 2285	601816	京沪高铁	2020-12-29	2021-01-1 2	5.66	58,400	330,544 .00
2020 1229 0000 2293	600340	华夏幸福	2020-12-29	2021-01-1 2	12.93	22,600	292,218 .00
2020 1229 0000 2294	600340	华夏幸福	2020-12-29	2021-01-1 2	12.93	10,000	129,300 .00
2020 1229 0000 2343	601877	正泰电器	2020-12-29	2021-01-1 2	39.16	11,900	466,004 .00
2020 1229 0000 2365	601360	三六零	2020-12-29	2021-01-1 2	15.71	75,100	1,179,8 21.00
2020 1229 0000 2427	600029	南方航空	2020-12-29	2021-01-1 2	5.96	54,700	326,012 .00
2020 1229 0000 2481	600115	东方航空	2020-12-29	2021-01-1 2	4.68	10,000	46,800. 00
2020	600115	东方航空	2020-12-29	2021-01-1	4.68	46,800	219,024

1229 0000 2487				2			.00
2020 1229 0000 2507	600196	复星医药	2020-12-29	2021-01-1 2	53.99	17,000	917,830 .00
2020 1229 0000 2518	600196	复星医药	2020-12-29	2021-01-1 2	53.99	23,100	1,247,1 69.00
2020 1229 0000 2524	600705	中航资本	2020-12-29	2021-01-1 2	4.38	61,300	268,494 .00
2020 1229 0000 2549	600606	绿地控股	2020-12-29	2021-01-1 2	5.83	35,100	204,633 .00
2020 1229 0000 2562	601818	光大银行	2020-12-29	2021-01-1 2	3.99	820,000	3,271,8 00.00
2020 1229 0000 2596	600390	五矿资本	2020-12-29	2021-01-1 2	6.98	21,600	150,768 .00
2020 1229 0000 2685	601808	中海油服	2020-12-29	2021-01-1 2	12.77	10,000	127,700 .00
2020 1229 0000 2845	600489	中金黄金	2020-12-29	2021-01-1 2	8.81	33,800	297,778 .00
2020 1229 0000 2857	601111	中国国航	2020-12-29	2021-01-1 2	7.49	49,700	372,253 .00
2020 1229 0000 2870	600637	东方明珠	2020-12-29	2021-01-1 2	8.94	32,000	286,080 .00
2020 1229	603369	今世缘	2020-12-29	2021-01-1 2	57.38	10,000	573,800 .00

0000 2913							
2020 1229 0000 2941	601186	中国铁建	2020-12-29	2021-01-1 2	7.9	10,000	79,000. 00
2020 1229 0000 2971	601138	工业富联	2020-12-29	2021-01-1 2	13.69	26,800	366,892 .00
2020 1229 0000 3006	601618	中国中冶	2020-12-29	2021-01-1 2	2.73	81,200	221,676 .00
2020 1229 0000 5693	601360	三六零	2020-12-29	2021-01-1 2	15.71	500,000	7,855,0 00.00
2020 1229 0000 6043	601888	中国中免	2020-12-29	2021-01-1 2	282.45	10,000	2,824,5 00.00
2020 1229 0000 6351	601877	正泰电器	2020-12-29	2021-01-1 2	39.16	10,000	391,600 .00
2020 1229 0000 6357	601933	永辉超市	2020-12-29	2021-01-1 2	7.18	42,800	307,304 .00
2020 1229 0000 6361	002812	恩捷股份	2020-12-29	2021-01-1 2	141.78	20,000	2,835,6 00.00
2020 1229 0000 6603	000066	中国长城	2020-12-29	2021-01-1 2	18.99	22,200	421,578 .00
2020 1229 0000 6609	000703	恒逸石化	2020-12-29	2021-01-1 2	12.8	24,600	314,880 .00
2020 1229 0000	600745	闻泰科技	2020-12-29	2021-01-1 2	99	27,900	2,762,1 00.00

6625							
2020 1229 0000 7097	600584	长电科技	2020-12-29	2021-01-1 2	42.57	40,000	1,702,8 00.00
2020 1229 0000 7099	600438	通威股份	2020-12-29	2021-01-1 2	38.44	10,000	384,400 .00
2020 1229 0000 7101	002202	金风科技	2020-12-29	2021-01-1 2	14.25	200,000	2,850,0 00.00
2020 1229 0000 7103	601288	农业银行	2020-12-29	2021-01-1 2	3.14	586,400	1,841,2 96.00
2020 1216 0000 1213	000661	长春高新	2020-12-16	2021-01-1 3	448.91	10,000	4,489,1 00.00
2020 1216 0000 1249	000728	国元证券	2020-12-16	2021-01-1 3	8.96	24,400	218,624 .00
2020 1216 0000 1452	001979	招商蛇口	2020-12-16	2021-01-1 3	13.29	148,000	1,966,9 20.00
2020 1216 0000 1453	001979	招商蛇口	2020-12-16	2021-01-1 3	13.29	100,000	1,329,0 00.00
2020 1216 0000 1874	002601	龙蟠佰利	2020-12-16	2021-01-1 3	30.77	65,000	2,000,0 50.00
2020 1216 0000 1931	002739	万达电影	2020-12-16	2021-01-1 3	18.08	36,400	658,112 .00
2020 1216 0000 1945	002821	凯莱英	2020-12-16	2021-01-1 3	299.14	10,000	2,991,4 00.00

2020 1216 0000 2047	601939	建设银行	2020-12-16	2021-01-1 3	6.28	1,000,000	6,280,000.00
2020 1216 0000 2055	601939	建设银行	2020-12-16	2021-01-1 3	6.28	600,200	3,769,256.00
2020 1216 0000 2160	600031	三一重工	2020-12-16	2021-01-1 3	34.98	63,000	2,203,740.00
2020 1216 0000 2376	600161	天坛生物	2020-12-16	2021-01-1 3	41.7	35,000	1,459,500.00
2020 1216 0000 2637	601696	中银证券	2020-12-16	2021-01-1 3	27.68	41,100	1,137,648.00
2020 1216 0000 2881	600104	上汽集团	2020-12-16	2021-01-1 3	24.44	176,200	4,306,328.00
2020 1230 0000 1206	000063	中兴通讯	2020-12-30	2021-01-1 3	33.65	299,500	10,078,175.00
2020 1230 0000 1207	000063	中兴通讯	2020-12-30	2021-01-1 3	33.65	20,000	673,000.00
2020 1230 0000 1222	000069	华侨城 A	2020-12-30	2021-01-1 3	7.09	48,700	345,283.00
2020 1230 0000 1272	000166	申万宏源	2020-12-30	2021-01-1 3	5.28	529,700	2,796,816.00
2020 1230 0000 1481	000661	长春高新	2020-12-30	2021-01-1 3	448.91	10,000	4,489,100.00
2020	002007	华兰生物	2020-12-30	2021-01-1	42.24	10,000	422,400

1230 0000 1892				3			.00
2020 1230 0000 2228	002230	科大讯飞	2020-12-30	2021-01-1 3	40.87	200,000	8,174,0 00.00
2020 1230 0000 2417	002384	东山精密	2020-12-30	2021-01-1 3	26	10,000	260,000 .00
2020 1230 0000 2680	002594	比 亚 迪	2020-12-30	2021-01-1 3	194.3	23,100	4,488,3 30.00
2020 1230 0000 2791	002736	国信证券	2020-12-30	2021-01-1 3	13.64	384,800	5,248,6 72.00
2020 1230 0000 2799	002714	牧原股份	2020-12-30	2021-01-1 3	77.1	100,000	7,710,0 00.00
2020 1230 0000 2827	002812	恩捷股份	2020-12-30	2021-01-1 3	141.78	31,900	4,522,7 82.00
2020 1230 0000 2838	002812	恩捷股份	2020-12-30	2021-01-1 3	141.78	20,000	2,835,6 00.00
2020 1230 0000 2971	600050	中国联通	2020-12-30	2021-01-1 3	4.46	34,200	152,532 .00
2020 1230 0000 3017	601225	陕西煤业	2020-12-30	2021-01-1 3	9.34	33,800	315,692 .00
2020 1230 0000 3061	600872	中炬高新	2020-12-30	2021-01-1 3	66.65	29,300	1,952,8 45.00
2020 1230	601990	南京证券	2020-12-30	2021-01-1 3	12.27	172,000	2,110,4 40.00



0000 3076							
2020 1230 0000 3085	601990	南京证券	2020-12-30	2021-01-1 3	12.27	10,000	122,700 .00
2020 1230 0000 3111	601398	工商银行	2020-12-30	2021-01-1 3	4.99	66,200	330,338 .00
2020 1230 0000 3154	601888	中国中免	2020-12-30	2021-01-1 3	282.45	10,000	2,824,5 00.00
2020 1230 0000 3279	601166	兴业银行	2020-12-30	2021-01-1 3	20.87	92,300	1,926,3 01.00
2020 1230 0000 3328	600048	保利地产	2020-12-30	2021-01-1 3	15.82	372,700	5,896,1 14.00
2020 1230 0000 3341	600196	复星医药	2020-12-30	2021-01-1 3	53.99	10,000	539,900 .00
2020 1230 0000 3348	600196	复星医药	2020-12-30	2021-01-1 3	53.99	16,500	890,835 .00
2020 1230 0000 3353	600705	中航资本	2020-12-30	2021-01-1 3	4.38	73,700	322,806 .00
2020 1230 0000 3423	601066	中信建投	2020-12-30	2021-01-1 3	42	50,000	2,100,0 00.00
2020 1230 0000 3424	600837	海通证券	2020-12-30	2021-01-1 3	12.86	452,900	5,824,2 94.00
2020 1230 0000	600109	国金证券	2020-12-30	2021-01-1 3	16.27	57,000	927,390 .00

3435							
2020 1230 0000 3508	601186	中国铁建	2020-12-30	2021-01-1 3	7.9	80,000	632,000 .00
2020 1230 0000 3541	601881	中国银河	2020-12-30	2021-01-1 3	12.51	30,000	375,300 .00
2020 1230 0000 3554	600208	新湖中宝	2020-12-30	2021-01-1 3	3.1	12,300	38,130. 00
2020 1230 0000 3562	600547	山东黄金	2020-12-30	2021-01-1 3	23.62	25,600	604,672 .00
2020 1230 0000 3619	603993	洛阳钼业	2020-12-30	2021-01-1 3	6.25	20,600	128,750 .00
2020 1230 0000 6451	002607	中公教育	2020-12-30	2021-01-1 3	35.13	10,000	351,300 .00
2020 1230 0000 8701	002129	中环股份	2020-12-30	2021-01-1 3	25.5	10,000	255,000 .00
2020 1217 0000 1840	000596	古井贡酒	2020-12-17	2021-01-1 4	272	10,000	2,720,0 00.00
2020 1217 0000 1902	000651	格力电器	2020-12-17	2021-01-1 4	61.94	13,100	811,414 .00
2020 1217 0000 1915	000661	长春高新	2020-12-17	2021-01-1 4	448.91	18,000	8,080,3 80.00
2020 1217 0000 1985	000725	京东方 A	2020-12-17	2021-01-1 4	6	26,400	158,400 .00

2020 1217 0000 2905	002475	立讯精密	2020-12-17	2021-01-1 4	56.12	114,000	6,397,6 80.00
2020 1217 0000 2907	002475	立讯精密	2020-12-17	2021-01-1 4	56.12	200,000	11,224, 000.00
2020 1217 0000 3149	002916	深南电路	2020-12-17	2021-01-1 4	108.06	10,000	1,080,6 00.00
2020 1217 0000 3177	600066	宇通客车	2020-12-17	2021-01-1 4	16.92	278,800	4,717,2 96.00
2020 1217 0000 3207	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	1,000,00 0	3,140,0 00.00
2020 1217 0000 3215	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	1,000,00 0	3,140,0 00.00
2020 1217 0000 3223	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	794,100	2,493,4 74.00
2020 1217 0000 3232	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	1,000,00 0	3,140,0 00.00
2020 1217 0000 3239	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	1,000,00 0	3,140,0 00.00
2020 1217 0000 3245	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	1,000,00 0	3,140,0 00.00
2020 1217 0000 3252	601288	农业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	3.14	1,000,00 0	3,140,0 00.00
2020	601318	中国平安	2020-12-17	2021-01-1	86.98	410,000	35,661,

1217 0000 3531				4			800.00
2020 1217 0000 3669	601100	恒立液压	2020-12-17	2021-01-1 4	113	10,000	1,130,0 00.00
2020 1217 0000 3881	600048	保利地产	2020-12-17	2021-01-1 4	15.82	300,000	4,746,0 00.00
2020 1217 0000 3888	600048	保利地产	2020-12-17	2021-01-1 4	15.82	1,000,00 0	15,820, 000.00
2020 1217 0000 4050	601166	兴业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	20.87	740,000	15,443, 800.00
2020 1217 0000 4066	601166	兴业银行	2020-12-17	2021-01-1 4	20.87	1,000,00 0	20,870, 000.00
2020 1217 0000 4406	600176	中国巨石	2020-12-17	2021-01-1 4	19.96	124,000	2,475,0 40.00
2020 1217 0000 4833	603369	今世缘	2020-12-17	2021-01-1 4	57.38	15,000	860,700 .00
2020 1217 0000 4852	600036	招商银行	2020-12-17	2021-01-1 4	43.95	400,000	17,580, 000.00
2020 1217 0000 4871	601788	光大证券	2020-12-17	2021-01-1 4	18.52	160,900	2,979,8 68.00
2020 1217 0000 4958	600887	伊利股份	2020-12-17	2021-01-1 4	44.37	150,000	6,655,5 00.00
2020 1217	601328	交通银行	2020-12-17	2021-01-1 4	4.48	557,700	2,498,4 96.00

0000 5017							
2020 1217 0000 5026	601328	交通银行	2020-12-17	2021-01-1 4	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1217 0000 5033	601328	交通银行	2020-12-17	2021-01-1 4	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1217 0000 5040	601328	交通银行	2020-12-17	2021-01-1 4	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1217 0000 5045	601328	交通银行	2020-12-17	2021-01-1 4	4.48	1,000,00 0	4,480,0 00.00
2020 1231 0000 0316	000069	华侨城 A	2020-12-31	2021-01-1 4	7.09	10,000	70,900. 00
2020 1231 0000 0332	000425	徐工机械	2020-12-31	2021-01-1 4	5.37	16,900	90,753. 00
2020 1231 0000 0368	000625	长安汽车	2020-12-31	2021-01-1 4	21.88	11,300	247,244 .00
2020 1231 0000 0369	000723	美锦能源	2020-12-31	2021-01-1 4	6.68	10,300	68,804. 00
2020 1231 0000 0410	002001	新和成	2020-12-31	2021-01-1 4	33.68	10,000	336,800 .00
2020 1231 0000 0417	002001	新和成	2020-12-31	2021-01-1 4	33.68	10,000	336,800 .00
2020 1231 0000	002032	苏泊尔	2020-12-31	2021-01-1 4	77.99	10,000	779,900 .00

0430							
2020 1231 0000 0442	002129	中环股份	2020-12-31	2021-01-1 4	25.5	76,800	1,958,4 00.00
2020 1231 0000 0486	002493	荣盛石化	2020-12-31	2021-01-1 4	27.61	182,700	5,044,3 47.00
2020 1231 0000 0488	002493	荣盛石化	2020-12-31	2021-01-1 4	27.61	10,000	276,100 .00
2020 1231 0000 0492	002558	巨人网络	2020-12-31	2021-01-1 4	17.43	26,700	465,381 .00
2020 1231 0000 0542	002594	比 亚 迪	2020-12-31	2021-01-1 4	194.3	20,000	3,886,0 00.00
2020 1231 0000 0553	002939	长城证券	2020-12-31	2021-01-1 4	12.87	12,700	163,449 .00
2020 1231 0000 0602	601727	上海电气	2020-12-31	2021-01-1 4	5.4	18,200	98,280. 00
2020 1231 0000 0610	600061	国投资本	2020-12-31	2021-01-1 4	13.83	10,000	138,300 .00
2020 1231 0000 0638	600436	片仔癀	2020-12-31	2021-01-1 4	267.51	10,000	2,675,1 00.00
2020 1231 0000 0660	601901	方正证券	2020-12-31	2021-01-1 4	10.37	100,000	1,037,0 00.00
2020 1231 0000 0666	601633	长城汽车	2020-12-31	2021-01-1 4	37.81	12,400	468,844 .00

2020 1231 0000 0679	600438	通威股份	2020-12-31	2021-01-1 4	38.44	45,400	1,745,1 76.00
2020 1231 0000 0698	601901	方正证券	2020-12-31	2021-01-1 4	10.37	49,800	516,426 .00
2020 1231 0000 0704	600585	海螺水泥	2020-12-31	2021-01-1 4	51.62	170,000	8,775,4 00.00
2020 1231 0000 0725	601901	方正证券	2020-12-31	2021-01-1 4	10.37	200,000	2,074,0 00.00
2020 1231 0000 0731	600309	万华化学	2020-12-31	2021-01-1 4	91.04	20,600	1,875,4 24.00
2020 1231 0000 0741	601012	隆基股份	2020-12-31	2021-01-1 4	92.2	11,400	1,051,0 80.00
2020 1231 0000 0811	601216	君正集团	2020-12-31	2021-01-1 4	4.95	16,800	83,160. 00
2020 1231 0000 0827	601872	招商轮船	2020-12-31	2021-01-1 4	5.65	64,800	366,120 .00
2020 1231 0000 0856	600809	山西汾酒	2020-12-31	2021-01-1 4	375.29	10,000	3,752,9 00.00
2020 1231 0000 0882	603993	洛阳钼业	2020-12-31	2021-01-1 4	6.25	111,000	693,750 .00
2020 1231 0000 0887	603993	洛阳钼业	2020-12-31	2021-01-1 4	6.25	191,300	1,195,6 25.00
2020	600010	包钢股份	2020-12-31	2021-01-1	1.17	400,000	468,000

1231 0000 0890				4			.00
2020 1231 0000 4938	000538	云南白药	2020-12-31	2021-01-1 4	113.6	12,400	1,408,6 40.00
2020 1218 0000 1199	000938	紫光股份	2020-12-18	2021-01-1 5	20.45	70,700	1,445,8 15.00
2020 1218 0000 1526	002311	海大集团	2020-12-18	2021-01-1 5	65.5	118,500	7,761,7 50.00
2020 1218 0000 1594	002410	广联达	2020-12-18	2021-01-1 5	78.74	28,000	2,204,7 20.00
2020 1218 0000 1713	002594	比亚迪	2020-12-18	2021-01-1 5	194.3	27,500	5,343,2 50.00
2020 1218 0000 2002	600109	国金证券	2020-12-18	2021-01-1 5	16.27	78,000	1,269,0 60.00
2020 1218 0000 2109	600031	三一重工	2020-12-18	2021-01-1 5	34.98	310,000	10,843, 800.00
2020 1218 0000 2320	600048	保利地产	2020-12-18	2021-01-1 5	15.82	424,500	6,715,5 90.00
2020 1218 0000 2721	600176	中国巨石	2020-12-18	2021-01-1 5	19.96	63,000	1,257,4 80.00
2020 1218 0000 2888	600519	贵州茅台	2020-12-18	2021-01-1 5	1998	10,900	21,778, 200.00
2020 1218	600522	中天科技	2020-12-18	2021-01-1 5	10.84	139,200	1,508,9 28.00



0000 2972							
2020 1221 0000 0808	000166	申万宏源	2020-12-21	2021-01-1 8	5.28	271,000	1,430,8 80.00
2020 1221 0000 0810	000166	申万宏源	2020-12-21	2021-01-1 8	5.28	1,000,00 0	5,280,0 00.00
2020 1221 0000 0867	000568	泸州老窖	2020-12-21	2021-01-1 8	226.16	97,700	22,095, 832.00
2020 1221 0000 1292	002475	立讯精密	2020-12-21	2021-01-1 8	56.12	200,000	11,224, 000.00
2020 1221 0000 1470	601872	招商轮船	2020-12-21	2021-01-1 8	5.65	240,600	1,359,3 90.00
2020 1221 0000 1773	600309	万华化学	2020-12-21	2021-01-1 8	91.04	63,500	5,781,0 40.00
2020 1221 0000 1913	600176	中国巨石	2020-12-21	2021-01-1 8	19.96	48,000	958,080 .00
2020 1221 0000 2062	600893	航发动力	2020-12-21	2021-01-1 8	59.35	45,000	2,670,7 50.00
2020 1221 0000 2090	600837	海通证券	2020-12-21	2021-01-1 8	12.86	149,700	1,925,1 42.00
2020 1221 0000 2103	600837	海通证券	2020-12-21	2021-01-1 8	12.86	1,000,00 0	12,860, 000.00
2020 1221 0000	600036	招商银行	2020-12-21	2021-01-1 8	43.95	29,600	1,300,9 20.00

2111							
2020 1221 0000 2136	600438	通威股份	2020-12-21	2021-01-1 8	38.44	100,000	3,844,0 00.00
2020 1221 0000 2151	600297	广汇汽车	2020-12-21	2021-01-1 8	2.86	158,800	454,168 .00
2020 1221 0000 2171	600887	伊利股份	2020-12-21	2021-01-1 8	44.37	31,100	1,379,9 07.00
2020 1222 0000 1100	000002	万 科 A	2020-12-22	2021-01-1 9	28.7	145,000	4,161,5 00.00
2020 1222 0000 1101	000001	平安银行	2020-12-22	2021-01-1 9	19.34	200,000	3,868,0 00.00
2020 1222 0000 1113	000001	平安银行	2020-12-22	2021-01-1 9	19.34	205,800	3,980,1 72.00
2020 1222 0000 1119	000002	万 科 A	2020-12-22	2021-01-1 9	28.7	140,000	4,018,0 00.00
2020 1222 0000 1225	000100	TCL 科技	2020-12-22	2021-01-1 9	7.08	282,000	1,996,5 60.00
2020 1222 0000 1266	000333	美的集团	2020-12-22	2021-01-1 9	98.44	205,600	20,239, 264.00
2020 1222 0000 1268	000338	潍柴动力	2020-12-22	2021-01-1 9	15.79	210,900	3,330,1 11.00
2020 1222 0000 1406	000568	泸州老窖	2020-12-22	2021-01-1 9	226.16	79,300	17,934, 488.00

2020 1222 0000 1463	000651	格力电器	2020-12-22	2021-01-1 9	61.94	130,000	8,052,2 00.00
2020 1222 0000 1465	000651	格力电器	2020-12-22	2021-01-1 9	61.94	130,800	8,101,7 52.00
2020 1222 0000 1526	000725	京东方 A	2020-12-22	2021-01-1 9	6	457,500	2,745,0 00.00
2020 1222 0000 1529	000725	京东方 A	2020-12-22	2021-01-1 9	6	1,000,00 0	6,000,0 00.00
2020 1222 0000 1639	000858	五 粮 液	2020-12-22	2021-01-1 9	291.85	41,300	12,053, 405.00
2020 1222 0000 1641	000858	五 粮 液	2020-12-22	2021-01-1 9	291.85	40,000	11,674, 000.00
2020 1222 0000 1685	000895	双汇发展	2020-12-22	2021-01-1 9	46.94	180,100	8,453,8 94.00
2020 1222 0000 1991	002142	宁波银行	2020-12-22	2021-01-1 9	35.34	126,500	4,470,5 10.00
2020 1222 0000 2117	002241	歌尔股份	2020-12-22	2021-01-1 9	37.32	10,000	373,200 .00
2020 1222 0000 2198	002304	洋河股份	2020-12-22	2021-01-1 9	235.99	15,800	3,728,6 42.00
2020 1222 0000 2214	002352	顺丰控股	2020-12-22	2021-01-1 9	88.23	39,200	3,458,6 16.00
2020	002352	顺丰控股	2020-12-22	2021-01-1	88.23	39,300	3,467,4

1222 0000 2220				9			39.00
2020 1222 0000 2362	002460	赣锋锂业	2020-12-22	2021-01-1 9	101.2	32,100	3,248,5 20.00
2020 1222 0000 2383	002475	立讯精密	2020-12-22	2021-01-1 9	56.12	234,800	13,176, 976.00
2020 1222 0000 2384	002475	立讯精密	2020-12-22	2021-01-1 9	56.12	380,000	21,325, 600.00
2020 1222 0000 2532	002673	西部证券	2020-12-22	2021-01-1 9	10.14	72,900	739,206 .00
2020 1222 0000 2605	002958	青农商行	2020-12-22	2021-01-1 9	5.09	25,500	129,795 .00
2020 1222 0000 2617	601985	中国核电	2020-12-22	2021-01-1 9	4.92	274,800	1,352,0 16.00
2020 1222 0000 2638	600362	江西铜业	2020-12-22	2021-01-1 9	19.95	14,700	293,265 .00
2020 1222 0000 2650	600362	江西铜业	2020-12-22	2021-01-1 9	19.95	14,700	293,265 .00
2020 1222 0000 2665	603993	洛阳钼业	2020-12-22	2021-01-1 9	6.25	386,000	2,412,5 00.00
2020 1222 0000 2670	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-1 9	42.57	49,700	2,115,7 29.00
2020 1222	601899	紫金矿业	2020-12-22	2021-01-1 9	9.29	200,000	1,858,0 00.00

0000 2722							
2020 1222 0000 2754	601939	建设银行	2020-12-22	2021-01-1 9	6.28	314,000	1,971,9 20.00
2020 1222 0000 2793	601066	中信建投	2020-12-22	2021-01-1 9	42	19,600	823,200 .00
2020 1222 0000 2833	600918	中泰证券	2020-12-22	2021-01-1 9	18.5	11,300	209,050 .00
2020 1222 0000 2936	600031	三一重工	2020-12-22	2021-01-1 9	34.98	120,000	4,197,6 00.00
2020 1222 0000 3055	603501	韦尔股份	2020-12-22	2021-01-1 9	231.1	53,300	12,317, 630.00
2020 1222 0000 3121	601600	中国铝业	2020-12-22	2021-01-1 9	3.63	273,600	993,168 .00
2020 1222 0000 3336	601989	中国重工	2020-12-22	2021-01-1 9	4.19	382,500	1,602,6 75.00
2020 1222 0000 3466	600085	同仁堂	2020-12-22	2021-01-1 9	23.9	22,600	540,140 .00
2020 1222 0000 3650	601696	中银证券	2020-12-22	2021-01-1 9	27.68	14,800	409,664 .00
2020 1222 0000 3717	603019	中科曙光	2020-12-22	2021-01-1 9	34.23	43,400	1,485,5 82.00
2020 1222 0000	600150	中国船舶	2020-12-22	2021-01-1 9	17.69	30,400	537,776 .00

4083							
2020 1222 0000 4098	603156	养元饮品	2020-12-22	2021-01-1 9	25.84	22,100	571,064 .00
2020 1222 0000 4173	600522	中天科技	2020-12-22	2021-01-1 9	10.84	100,000	1,084,0 00.00
2020 1222 0000 4281	600760	中航沈飞	2020-12-22	2021-01-1 9	78.18	17,600	1,375,9 68.00
2020 1222 0000 4362	601633	长城汽车	2020-12-22	2021-01-1 9	37.81	12,600	476,406 .00
2020 1224 0000 2561	002027	分众传媒	2020-12-24	2021-01-2 1	9.87	600,000	5,922,0 00.00
2020 1225 0000 2000	002600	领益智造	2020-12-25	2021-01-2 2	11.99	10,000	119,900 .00
2020 1225 0000 2183	600588	用友网络	2020-12-25	2021-01-2 2	43.87	20,000	877,400 .00
2020 1225 0000 3131	601169	北京银行	2020-12-25	2021-01-2 2	4.84	280,000	1,355,2 00.00
2020 1225 0000 3184	601169	北京银行	2020-12-25	2021-01-2 2	4.84	1,000,00 0	4,840,0 00.00
2020 1229 0000 1206	600795	国电电力	2020-12-29	2021-01-2 6	2.25	26,800	60,300. 00
2020 1229 0000 2470	601901	方正证券	2020-12-29	2021-01-2 6	10.37	176,900	1,834,4 53.00

2020 1230 0000 2713	002624	完美世界	2020-12-30	2021-01-2 7	29.5	10,000	295,000 .00
2020 1230 0000 3025	600487	亨通光电	2020-12-30	2021-01-2 7	13.99	15,900	222,441 .00
2020 1231 0000 0361	000166	申万宏源	2020-12-31	2021-01-2 8	5.28	28,400	149,952 .00
2020 1231 0000 0459	002157	正邦科技	2020-12-31	2021-01-2 8	17.04	24,800	422,592 .00
2020 1231 0000 0460	002202	金风科技	2020-12-31	2021-01-2 8	14.25	13,800	196,650 .00
2020 1231 0000 0554	002958	青农商行	2020-12-31	2021-01-2 8	5.09	14,300	72,787. 00
2020 1231 0000 0627	600031	三一重工	2020-12-31	2021-01-2 8	34.98	31,200	1,091,3 76.00
2020 1231 0000 0871	601360	三六零	2020-12-31	2021-01-2 8	15.71	10,200	160,242 .00
合计	-	-	-	-	-	187,774, 000	3,359,4 50,551. 00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具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进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。



#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	17,408,000.00	168,000.00
AAA 以下	1,100,000.00	1,745,100.00
未评级	-	-
合计	18,508,000.00	1,913,100.00

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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  
第 153 页 共 186 页

7.4.12 中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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	53,594,418.71	-	-	-	53,594,418.71
结算备付金	49,976,072.26	-	-	-	49,976,072.26
存出保证金	7,513,017.21	-	-	23,117,040.00	30,630,057.21
交易性金融资产	-	-	18,508,000.00	24,860,452,265.54	24,878,960,265.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	187,000,000.00	-	-	-	187,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	170,114,251.96	170,114,251.96
应收利息	-	-	-	1,868,475.92	1,868,475.92
应收股利	-	-	-	18,900.20	18,900.20
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	298,083,508.18	-	18,508,000.00	25,055,570,933.62	25,372,162,441.80
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	261,571,750.61	261,571,750.61
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,318,956.53	10,318,956.53
应付托管费	-	-	-	2,063,791.28	2,063,791.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,274,698.55	2,274,698.55
应付税费	-	-	-	776,074.68	776,074.68
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,116,747.89	2,116,747.89
负债总计	-	-	-	279,122,019.54	279,122,019.54
利率敏感度缺口	298,083,508.18	-	18,508,000.00	24,776,448,914.08	25,093,040,422.26
上年度末 2019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	21,703,693.53	-	-	-	21,703,693.53
结算备付金	26,697,797.36	-	-	-	26,697,797.36
存出保证金	1,203,615.62	-	-	15,316,068.00	16,519,683.62
交易性金融资产	-	-	1,913,100.00	27,005,582,800.25	27,007,495,900.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	134,000,000.00	-	-	-	134,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	21,616,190.17	21,616,190.17
应收利息	-	-	-	61,641.94	61,641.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	183,605,106.51	-	1,913,100.00	27,042,576,700.36	27,228,094,906.87
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	27,591,856.16	27,591,856.16

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,418,555.77	10,418,555.77
应付托管费	-	-	-	2,083,711.14	2,083,711.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,490,274.14	2,490,274.14
应付税费	-	-	-	42,243.71	42,243.71
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,079,066.30	2,079,066.30
负债总计	-	-	-	44,705,707.22	44,705,707.22
利率敏感度缺口	183,605,106.51	-	1,913,100.00	26,997,870,993.14	27,183,389,199.65

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.07%(2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	24,860,452,265.54	99.07	27,005,582,800.25	99.35
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	24,860,452,265.54	99.07	27,005,582,800.25	99.35

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	1,253,281,656.88	1,357,032,026.50
	业绩比较基准下降5%	-1,253,281,656.88	-1,357,032,026.50

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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 24,837,313,021.69 元，属于第二层次的余额为 41,647,243.85 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 26,942,936,640.24 元，第二层次 64,559,260.01 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换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，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为交易性金融资产-股票投资公允价值的变动。于 2020 年 1 月 1 日及 2020 年 12 月 31 日，本基金无第三层次交易性金融资产余额。于 2020 年度，本基金无第三层次交易性金融资产变动（于 2019 年 1 月 1 日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为零元，2019 年度转入第三层次金额为 17,009,888.68 元，转出第三层次金额为 17,009,888.68 元，当期计入损益的利得/损失金额为零元。于 2019 年 12 月 31 日，本基金无第三层次交易性金融资产余额。计入损益的利得/损失计入利润表中的公允价值变动收益项目）。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,860,452,265.54	97.98
	其中：股票	24,860,452,265.54	97.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,508,000.00	0.07
	其中：债券	18,508,000.00	0.07
	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	187,000,000.00	0.74
	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	103,570,490.97	0.41
8	其他各项资产	202,631,685.29	0.80
9	合计	25,372,162,441.80	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 3,359,450,551.00 元，占基金资产净值的比例为 13.39%。

### 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	286,181,467.89	1.14
B	采矿业	545,539,985.14	2.17
C	制造业	13,046,909,615.61	51.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	415,168,176.25	1.65
E	建筑业	382,342,320.18	1.52
F	批发和零售业	177,778,541.42	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	655,646,051.81	2.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	772,171,762.03	3.08
J	金融业	6,590,688,185.29	26.27
K	房地产业	722,935,679.56	2.88
L	租赁和商务服务业	477,641,673.39	1.90

M	科学研究和技术服务业	251,408,282.56	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,255,817.89	0.12
Q	卫生和社会工作	382,318,058.65	1.52
R	文化、体育和娱乐业	121,224,139.72	0.48
S	综合	-	-
	合计	24,858,209,757.39	99.06

### 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	1,281,456.05	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	888,964.56	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,221,823.31	0.01

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。



## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	636,371	1,271,469,258.00	5.07
2	601318	中国平安	13,723,115	1,193,636,542.70	4.76
3	000858	五粮液	2,461,531	718,397,822.35	2.86
4	600036	招商银行	15,680,655	689,164,787.25	2.75
5	000333	美的集团	6,232,111	613,489,006.84	2.44
6	600276	恒瑞医药	4,728,171	527,001,939.66	2.10
7	601166	兴业银行	18,436,332	384,766,248.84	1.53
8	000651	格力电器	6,099,686	377,814,550.84	1.51
9	601888	中国中免	1,235,852	349,066,397.40	1.39
10	600887	伊利股份	7,707,403	341,977,471.11	1.36
11	600030	中信证券	10,790,591	317,243,375.40	1.26
12	601012	隆基股份	3,343,789	308,297,345.80	1.23
13	002475	立讯精密	5,312,249	298,123,413.88	1.19
14	300059	东方财富	8,734,044	270,755,364.00	1.08
15	600031	三一重工	7,515,424	262,889,531.52	1.05
16	000002	万科A	8,628,685	247,643,259.50	0.99
17	603288	海天味业	1,230,602	246,784,925.08	0.98
18	000001	平安银行	12,300,387	237,889,484.58	0.95
19	002415	海康威视	4,739,048	229,891,218.48	0.92
20	002594	比亚迪	1,148,761	223,204,262.30	0.89
21	601398	工商银行	44,434,857	221,729,936.43	0.88
22	600900	长江电力	11,524,446	220,808,385.36	0.88
23	603259	药明康德	1,622,623	218,599,770.56	0.87
24	000568	泸州老窖	929,292	210,168,678.72	0.84
25	000725	京东方A	34,343,925	206,063,550.00	0.82
26	002352	顺丰控股	2,309,444	203,762,244.12	0.81
27	002714	牧原股份	2,374,257	183,055,214.70	0.73
28	600309	万华化学	1,989,312	181,106,964.48	0.72
29	002304	洋河股份	762,873	180,030,399.27	0.72
30	601601	中国太保	4,338,370	166,593,408.00	0.66
31	600809	山西汾酒	442,089	165,911,580.81	0.66
32	601899	紫金矿业	17,429,728	161,922,173.12	0.65
33	000661	长春高新	360,098	161,651,593.18	0.64
34	600585	海螺水泥	3,040,757	156,963,876.34	0.63
35	300015	爱尔眼科	2,090,212	156,535,976.68	0.62
36	601328	交通银行	34,806,826	155,934,580.48	0.62
37	600000	浦发银行	14,884,338	144,080,391.84	0.57

38	600048	保利地产	9,095,894	143,897,043.08	0.57
39	600016	民生银行	26,954,334	140,162,536.80	0.56
40	600690	海尔智家	4,794,955	140,060,635.55	0.56
41	002142	宁波银行	3,807,746	134,565,743.64	0.54
42	601688	华泰证券	7,461,911	134,389,017.11	0.54
43	601668	中国建筑	26,600,232	132,203,153.04	0.53
44	600438	通威股份	3,420,326	131,477,331.44	0.52
45	002027	分众传媒	13,026,877	128,575,275.99	0.51
46	603501	韦尔股份	546,825	126,371,257.50	0.50
47	000100	TCL 科技	17,785,964	125,924,625.12	0.50
48	600837	海通证券	9,783,166	125,811,514.76	0.50
49	300124	汇川技术	1,306,688	121,913,990.40	0.49
50	300122	智飞生物	812,800	120,221,248.00	0.48
51	300014	亿纬锂能	1,437,640	117,167,660.00	0.47
52	000063	中兴通讯	3,419,881	115,078,995.65	0.46
53	601288	农业银行	36,398,397	114,290,966.58	0.46
54	600570	恒生电子	1,058,217	111,006,963.30	0.44
55	600999	招商证券	4,681,690	109,270,644.60	0.44
56	600104	上汽集团	4,442,405	108,572,378.20	0.43
57	002241	歌尔股份	2,878,492	107,425,321.44	0.43
58	300347	泰格医药	664,273	107,353,159.53	0.43
59	300498	温氏股份	5,656,953	103,126,253.19	0.41
60	600436	片仔癀	383,259	102,525,615.09	0.41
61	601211	国泰君安	5,713,767	100,162,335.51	0.40
62	601229	上海银行	12,607,941	98,846,257.44	0.39
63	002460	赣锋锂业	970,217	98,185,960.40	0.39
64	000338	潍柴动力	6,074,584	95,917,681.36	0.38
65	002410	广联达	1,200,661	94,540,047.14	0.38
66	600009	上海机场	1,219,712	92,283,409.92	0.37
67	002230	科大讯飞	2,228,468	91,077,487.16	0.36
68	600588	用友网络	2,073,205	90,951,503.35	0.36
69	601169	北京银行	18,747,649	90,738,621.16	0.36
70	600660	福耀玻璃	1,775,222	85,299,417.10	0.34
71	601988	中国银行	26,698,729	84,901,958.22	0.34
72	600919	江苏银行	15,221,920	83,111,683.20	0.33
73	603986	兆易创新	419,244	82,800,690.00	0.33
74	600196	复星医药	1,529,973	82,603,242.27	0.33
75	601766	中国中车	15,420,596	81,883,364.76	0.33
76	002271	东方雨虹	2,089,790	81,083,852.00	0.32
77	601628	中国人寿	2,110,386	81,017,718.54	0.32
78	601818	光大银行	20,187,809	80,549,357.91	0.32
79	600893	航发动力	1,351,838	80,231,585.30	0.32

80	600763	通策医疗	285,903	79,057,897.56	0.32
81	002812	恩捷股份	555,915	78,817,628.70	0.31
82	600406	国电南瑞	2,928,670	77,814,761.90	0.31
83	600703	三安光电	2,838,311	76,662,780.11	0.31
84	300601	康泰生物	433,575	75,658,837.50	0.30
85	300142	沃森生物	1,957,671	75,487,793.76	0.30
86	601088	中国神华	4,178,527	75,255,271.27	0.30
87	600346	恒力石化	2,676,940	74,874,011.80	0.30
88	601919	中远海控	6,131,748	74,868,643.08	0.30
89	000538	云南白药	647,044	73,504,198.40	0.29
90	002049	紫光国微	538,397	72,042,902.57	0.29
91	002493	荣盛石化	2,567,800	70,896,958.00	0.28
92	603799	华友钴业	869,228	68,929,780.40	0.27
93	600028	中国石化	16,960,170	68,349,485.10	0.27
94	601390	中国中铁	12,897,362	67,969,097.74	0.27
95	600019	宝钢股份	11,291,931	67,186,989.45	0.27
96	002311	海大集团	1,015,413	66,509,551.50	0.27
97	300413	芒果超媒	903,774	65,523,615.00	0.26
98	000768	中航西飞	1,753,993	64,336,463.24	0.26
99	000876	新希望	2,854,472	63,940,172.80	0.25
100	600745	闻泰科技	630,300	62,399,700.00	0.25
101	000625	长安汽车	2,826,975	61,854,213.00	0.25
102	000895	双汇发展	1,316,203	61,782,568.82	0.25
103	600958	东方证券	5,290,987	61,534,178.81	0.25
104	601009	南京银行	7,610,791	61,495,191.28	0.25
105	601336	新华保险	1,056,773	61,261,130.81	0.24
106	000776	广发证券	3,751,878	61,080,573.84	0.24
107	600584	长电科技	1,423,379	60,593,244.03	0.24
108	000166	申万宏源	11,429,388	60,347,168.64	0.24
109	601377	兴业证券	6,787,183	58,912,748.44	0.23
110	002129	中环股份	2,305,965	58,802,107.50	0.23
111	002007	华兰生物	1,388,856	58,665,277.44	0.23
112	601633	长城汽车	1,541,031	58,266,382.11	0.23
113	600741	华域汽车	1,999,134	57,615,041.88	0.23
114	000157	中联重科	5,795,923	57,379,637.70	0.23
115	002371	北方华创	315,113	56,953,523.62	0.23
116	601100	恒立液压	496,659	56,122,467.00	0.22
117	002050	三花智控	2,275,959	56,102,389.35	0.22
118	600926	杭州银行	3,758,750	56,080,550.00	0.22
119	603993	洛阳钼业	8,951,887	55,949,293.75	0.22
120	002001	新和成	1,634,100	55,036,488.00	0.22
121	002821	凯莱英	183,388	54,858,686.32	0.22

122	002179	中航光电	696,851	54,556,464.79	0.22
123	600547	山东黄金	2,304,622	54,435,171.64	0.22
124	601939	建设银行	8,507,179	53,425,084.12	0.21
125	001979	招商蛇口	4,018,702	53,408,549.58	0.21
126	601877	正泰电器	1,362,918	53,371,868.88	0.21
127	600176	中国巨石	2,664,008	53,173,599.68	0.21
128	601901	方正证券	5,080,518	52,684,971.66	0.21
129	600050	中国联通	11,795,222	52,606,690.12	0.21
130	300408	三环集团	1,383,109	51,520,810.25	0.21
131	000786	北新建材	1,283,800	51,416,190.00	0.20
132	601857	中国石油	12,306,706	51,072,829.90	0.20
133	300433	蓝思科技	1,666,838	51,021,911.18	0.20
134	601066	中信建投	1,213,373	50,961,666.00	0.20
135	002555	三七互娱	1,605,330	50,134,455.90	0.20
136	002202	金风科技	3,501,672	49,898,826.00	0.20
137	600109	国金证券	3,065,553	49,876,547.31	0.20
138	002736	国信证券	3,656,218	49,870,813.52	0.20
139	002841	视源股份	424,182	48,793,655.46	0.19
140	600015	华夏银行	7,797,794	48,736,212.50	0.19
141	601006	大秦铁路	7,532,725	48,661,403.50	0.19
142	601989	中国重工	11,563,535	48,451,211.65	0.19
143	000860	顺鑫农业	657,513	47,695,993.02	0.19
144	002601	龙蟠佰利	1,545,929	47,568,235.33	0.19
145	688008	澜起科技	572,296	47,431,892.48	0.19
146	601225	陕西煤业	5,068,296	47,337,884.64	0.19
147	600872	中炬高新	705,984	47,053,833.60	0.19
148	002008	大族激光	1,078,540	46,107,585.00	0.18
149	601186	中国铁建	5,828,944	46,048,657.60	0.18
150	601788	光大证券	2,475,362	45,843,704.24	0.18
151	603369	今世缘	795,908	45,669,201.04	0.18
152	603160	汇顶科技	291,436	45,332,869.80	0.18
153	002236	大华股份	2,278,135	45,312,105.15	0.18
154	600352	浙江龙盛	3,298,848	44,930,309.76	0.18
155	600600	青岛啤酒	450,000	44,730,000.00	0.18
156	603019	中科曙光	1,286,156	44,025,119.88	0.18
157	002938	鹏鼎控股	880,186	43,718,838.62	0.17
158	002624	完美世界	1,476,074	43,544,183.00	0.17
159	300003	乐普医疗	1,601,400	43,526,052.00	0.17
160	002600	领益智造	3,571,800	42,825,882.00	0.17
161	688012	中微公司	269,746	42,509,272.14	0.17
162	000066	中国长城	2,226,700	42,285,033.00	0.17
163	003816	中国广核	14,956,700	42,177,894.00	0.17

164	603899	晨光文具	470,239	41,644,365.84	0.17
165	600760	中航沈飞	532,200	41,607,396.00	0.17
166	000783	长江证券	4,906,281	41,212,760.40	0.16
167	600183	生益科技	1,451,200	40,865,792.00	0.16
168	601360	三六零	2,572,990	40,421,672.90	0.16
169	601108	财通证券	3,185,000	40,290,250.00	0.16
170	601155	新城控股	1,143,400	39,824,622.00	0.16
171	002384	东山精密	1,517,858	39,464,308.00	0.16
172	000596	古井贡酒	145,040	39,450,880.00	0.16
173	002044	美年健康	3,474,936	39,371,024.88	0.16
174	601985	中国核电	7,893,600	38,836,512.00	0.15
175	601555	东吴证券	3,931,537	38,764,954.82	0.15
176	600383	金地集团	2,860,471	38,616,358.50	0.15
177	601669	中国电建	9,696,777	37,623,494.76	0.15
178	000938	紫光股份	1,811,662	37,048,487.90	0.15
179	000069	华侨城 A	5,199,494	36,864,412.46	0.15
180	002024	苏宁易购	4,721,479	36,402,603.09	0.15
181	600111	北方稀土	2,760,848	36,139,500.32	0.14
182	002456	欧菲光	2,732,530	36,014,745.40	0.14
183	300144	宋城演艺	1,989,642	35,256,456.24	0.14
184	300136	信维通信	977,032	35,055,908.16	0.14
185	601878	浙商证券	2,289,910	35,035,623.00	0.14
186	601933	永辉超市	4,825,426	34,646,558.68	0.14
187	000977	浪潮信息	1,288,772	34,642,191.36	0.14
188	601138	工业富联	2,519,800	34,496,062.00	0.14
189	300529	健帆生物	505,760	34,300,643.20	0.14
190	300033	同花顺	274,118	33,985,149.64	0.14
191	600010	包钢股份	28,874,775	33,783,486.75	0.13
192	002414	高德红外	808,700	33,763,225.00	0.13
193	600522	中天科技	3,110,100	33,713,484.00	0.13
194	600795	国电电力	14,946,589	33,629,825.25	0.13
195	002602	世纪华通	4,724,360	33,590,199.60	0.13
196	600029	南方航空	5,602,513	33,390,977.48	0.13
197	600161	天坛生物	796,700	33,222,390.00	0.13
198	300676	华大基因	255,200	32,808,512.00	0.13
199	601800	中国交建	4,463,323	32,403,724.98	0.13
200	000425	徐工机械	5,957,969	31,994,293.53	0.13
201	603833	欧派家居	228,548	30,739,706.00	0.12
202	688036	传音控股	201,731	30,691,354.34	0.12
203	600886	国投电力	3,530,601	30,504,392.64	0.12
204	002607	中公教育	861,253	30,255,817.89	0.12
205	601600	中国铝业	8,284,965	30,074,422.95	0.12

206	000703	恒逸石化	2,332,479	29,855,731.20	0.12
207	000728	国元证券	3,318,524	29,733,975.04	0.12
208	600705	中航资本	6,785,598	29,720,919.24	0.12
209	600061	国投资本	2,141,783	29,620,858.89	0.12
210	000963	华东医药	1,108,821	29,450,285.76	0.12
211	601838	成都银行	2,747,100	29,311,557.00	0.12
212	000656	金科股份	4,062,700	28,804,543.00	0.11
213	002463	沪电股份	1,530,600	28,759,974.00	0.11
214	600066	宇通客车	1,683,510	28,484,989.20	0.11
215	601111	中国国航	3,785,547	28,353,747.03	0.11
216	601607	上海医药	1,463,531	28,099,795.20	0.11
217	000708	中信特钢	1,278,450	27,857,425.50	0.11
218	002157	正邦科技	1,596,600	27,206,064.00	0.11
219	002916	深南电路	249,770	26,990,146.20	0.11
220	600606	绿地控股	4,628,700	26,985,321.00	0.11
221	600115	东方航空	5,681,800	26,590,824.00	0.11
222	600362	江西铜业	1,314,015	26,214,599.25	0.10
223	601021	春秋航空	464,706	25,758,653.58	0.10
224	601162	天风证券	4,222,350	25,756,335.00	0.10
225	600340	华夏幸福	1,985,458	25,671,971.94	0.10
226	600177	雅戈尔	3,519,313	25,303,860.47	0.10
227	002252	上海莱士	3,416,342	25,280,930.80	0.10
228	300628	亿联网络	344,318	25,176,532.16	0.10
229	600487	亨通光电	1,795,640	25,121,003.60	0.10
230	601727	上海电气	4,634,243	25,024,912.20	0.10
231	600011	华能国际	5,578,400	24,991,232.00	0.10
232	002422	科伦药业	1,275,469	24,795,117.36	0.10
233	603658	安图生物	170,500	24,753,190.00	0.10
234	601618	中国中冶	9,046,110	24,695,880.30	0.10
235	601816	京沪高铁	4,357,200	24,661,752.00	0.10
236	002508	老板电器	601,090	24,512,450.20	0.10
237	600118	中国卫星	747,929	24,068,355.22	0.10
238	601198	东兴证券	1,747,301	23,274,049.32	0.09
239	600637	东方明珠	2,595,555	23,204,261.70	0.09
240	002120	韵达股份	1,470,818	23,091,842.60	0.09
241	600068	葛洲坝	3,503,822	23,055,148.76	0.09
242	601990	南京证券	1,870,800	22,954,716.00	0.09
243	600369	西南证券	4,209,236	22,645,689.68	0.09
244	600845	宝信软件	327,472	22,589,018.56	0.09
245	002773	康弘药业	467,683	22,518,936.45	0.09
246	002673	西部证券	2,219,173	22,502,414.22	0.09
247	600489	中金黄金	2,457,212	21,648,037.72	0.09

248	600498	烽火通信	889,421	21,417,257.68	0.09
249	600004	白云机场	1,499,600	21,189,348.00	0.08
250	601216	君正集团	4,278,714	21,179,634.30	0.08
251	000961	中南建设	2,394,350	21,142,110.50	0.08
252	600332	白云山	711,877	20,822,402.25	0.08
253	002739	万达电影	1,130,756	20,444,068.48	0.08
254	601881	中国银河	1,633,000	20,428,830.00	0.08
255	601658	邮储银行	4,254,700	20,337,466.00	0.08
256	600018	上港集团	4,402,650	20,120,110.50	0.08
257	600390	五矿资本	2,850,060	19,893,418.80	0.08
258	601998	中信银行	3,881,511	19,834,521.21	0.08
259	688009	中国通号	3,278,264	19,210,627.04	0.08
260	600233	圆通速递	1,602,304	18,426,496.00	0.07
261	601117	中国化学	3,124,900	18,343,163.00	0.07
262	600918	中泰证券	971,480	17,972,380.00	0.07
263	002958	青农商行	3,522,600	17,930,034.00	0.07
264	002558	巨人网络	1,026,760	17,896,426.80	0.07
265	600271	航天信息	1,412,768	17,800,876.80	0.07
266	601319	中国人保	2,697,800	17,724,546.00	0.07
267	601916	浙商银行	4,238,100	17,291,448.00	0.07
268	000723	美锦能源	2,585,400	17,270,472.00	0.07
269	600998	九州通	950,900	17,268,344.00	0.07
270	600655	豫园股份	1,936,621	17,216,560.69	0.07
271	601236	红塔证券	922,093	17,141,708.87	0.07
272	600208	新湖中宝	5,450,030	16,895,093.00	0.07
273	600085	同仁堂	694,103	16,589,061.70	0.07
274	603156	养元饮品	640,720	16,556,204.80	0.07
275	002032	苏泊尔	209,954	16,374,312.46	0.07
276	601231	环旭电子	841,500	16,274,610.00	0.06
277	601238	广汽集团	1,175,974	15,628,694.46	0.06
278	603195	公牛集团	75,700	15,540,453.00	0.06
279	002939	长城证券	1,179,600	15,181,452.00	0.06
280	600848	上海临港	757,379	15,162,727.58	0.06
281	600150	中国船舶	851,700	15,066,573.00	0.06
282	600482	中国动力	823,156	14,750,955.52	0.06
283	600297	广汇汽车	5,137,900	14,694,394.00	0.06
284	601872	招商轮船	2,564,000	14,486,600.00	0.06
285	002146	荣盛发展	2,204,414	14,394,823.42	0.06
286	600027	华电国际	4,131,375	14,046,675.00	0.06
287	000671	阳光城	2,089,700	13,624,844.00	0.05
288	002153	石基信息	407,940	12,682,854.60	0.05
289	601577	长沙银行	1,299,900	12,375,048.00	0.05

290	000627	天茂集团	2,506,200	12,205,194.00	0.05
291	603392	万泰生物	60,100	12,111,953.00	0.05
292	600989	宝丰能源	929,700	10,877,490.00	0.04
293	601696	中银证券	382,400	10,584,832.00	0.04
294	603087	甘李药业	77,880	10,297,293.60	0.04
295	600025	华能水电	2,281,000	10,173,260.00	0.04
296	601698	中国卫通	557,400	10,111,236.00	0.04
297	601077	渝农商行	2,240,000	10,080,000.00	0.04
298	601808	中海油服	749,400	9,569,838.00	0.04
299	002945	华林证券	343,400	5,175,038.00	0.02
300	600299	安迪苏	374,899	4,315,087.49	0.02

### 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	688095	福昕软件	1,981	453,232.99	0.00
2	688686	奥普特	2,330	397,334.90	0.00
3	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
4	688229	博睿数据	1,643	166,353.75	0.00
5	688589	力合微	3,562	125,845.46	0.00
6	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
7	688551	科威尔	2,211	73,714.74	0.00
8	688590	新致软件	4,171	65,860.09	0.00
9	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
10	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
11	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
12	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
13	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
14	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
15	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
16	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
17	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
18	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
19	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
20	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
21	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
22	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
23	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
24	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
25	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
26	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
27	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00



28	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
29	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
30	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
31	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
32	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
33	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
34	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
35	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
36	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
37	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
38	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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	600519	贵州茅台	497,119,620.84	1.83
2	601318	中国平安	494,691,808.12	1.82
3	600036	招商银行	313,418,635.19	1.15
4	601398	工商银行	200,853,142.50	0.74
5	600276	恒瑞医药	197,711,997.18	0.73
6	603501	韦尔股份	177,802,647.18	0.65
7	601166	兴业银行	175,560,407.29	0.65
8	600030	中信证券	170,026,451.94	0.63
9	603160	汇顶科技	149,220,982.66	0.55
10	600887	伊利股份	127,855,588.82	0.47
11	601888	中国中免	123,533,210.02	0.45
12	600745	闻泰科技	121,760,344.28	0.45
13	000661	长春高新	114,494,314.84	0.42
14	603986	兆易创新	105,346,845.50	0.39
15	600585	海螺水泥	104,617,990.44	0.38
16	603288	海天味业	102,846,100.38	0.38
17	600837	海通证券	102,640,706.50	0.38
18	601688	华泰证券	98,734,058.47	0.36
19	300601	康泰生物	97,723,358.22	0.36
20	600900	长江电力	96,804,486.01	0.36

##### 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	601318	中国平安	2,497,370,234.52	9.19
2	600519	贵州茅台	2,049,331,834.58	7.54
3	600036	招商银行	1,119,255,382.23	4.12

4	600276	恒瑞医药	959,676,791.16	3.53
5	601166	兴业银行	710,732,582.11	2.61
6	600030	中信证券	674,820,313.62	2.48
7	600887	伊利股份	619,518,616.79	2.28
8	601888	中国中免	490,997,279.76	1.81
9	600900	长江电力	475,800,283.50	1.75
10	601398	工商银行	443,624,915.55	1.63
11	603288	海天味业	409,070,204.39	1.50
12	600016	民生银行	408,713,681.54	1.50
13	601328	交通银行	399,615,116.76	1.47
14	601012	隆基股份	394,762,865.56	1.45
15	600031	三一重工	386,696,630.33	1.42
16	600837	海通证券	376,991,516.60	1.39
17	601288	农业银行	373,257,157.13	1.37
18	600000	浦发银行	361,989,123.48	1.33
19	600585	海螺水泥	357,755,868.23	1.32
20	600048	保利地产	334,272,182.80	1.23

#### 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	11,030,218,523.07
卖出股票收入（成交）总额	32,455,968,902.65

注：8.4.1项“买入金额”、8.4.2项“卖出金额”及8.4.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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）	18,508,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,508,000.00	0.07

#### 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	113044	大秦转债	174,080	17,408,000.00	0.07
2	113616	韦尔转债	11,000	1,100,000.00	-

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
无。

**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**  
无。

**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**  
无。

**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(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2103	IF2103	30	46,904,400.00	6,234,120.00	-
IF2106	IF2106	94	145,737,600.00	10,319,040.00	-
公允价值变动总额合计(元)					16,553,160.00
股指期货投资本期收益(元)					39,478,368.93
股指期货投资本期公允价值变动(元)					7,457,160.00

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。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，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

(1) 2020 年 8 月 12 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕58 号），对平安财险总公司（一）未按车辆实际使用性质承保商业车险行为违反了《保险法》第一百三十五条的规定，根据该法第一百七十条，于 2020 年 8 月 6 日作出行政处罚决定，罚款 50 万元；（二）手续费支出未分摊至各分支机构行为违反了《保险法》第八十六条的规定，根据该法第一百七十条，于 2020 年 8 月 6 日作出行政处罚决定，罚款 25 万元。

本基金投资于“中国平安（601318）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，中国平安为标的指数成份股，本基金投资于“中国平安”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,630,057.21
2	应收证券清算款	170,114,251.96
3	应收股利	18,900.20
4	应收利息	1,868,475.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	202,631,685.29

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 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	000858	五 粮 液	176,014,735.00	0.70	转融通出借证 券
2	000333	美的集团	150,406,476.00	0.60	转融通出借证 券
3	000651	格力电器	92,612,688.00	0.37	转融通出借证 券
4	600519	贵州茅台	81,718,200.00	0.33	转融通出借证 券
5	600036	招商银行	74,196,390.00	0.30	转融通出借证 券
6	600887	伊利股份	55,688,787.00	0.22	转融通出借证 券
7	601166	兴业银行	53,057,801.00	0.21	转融通出借证 券
8	601318	中国平安	38,723,496.00	0.15	转融通出借证 券
9	601888	中国中免	11,298,000.00	0.05	转融通出借证 券
10	600276	恒瑞医药	7,122,294.00	0.03	转融通出借证 券

#### 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	688095	福昕软件	453,232.99	0.00	新股锁定
2	688686	奥普特	397,334.90	0.00	新股锁定
3	300896	爱美客	285,389.28	0.00	新股锁定
4	688229	博睿数据	166,353.75	0.00	新股锁定
5	688589	力合微	125,845.46	0.00	新股锁定

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

##### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
27,285	176,808.38	4,406,864,943.00	91.35	417,351,733.00	8.65

### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)	2,810,066,905.00	58.25

### 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	364,539,607.00	7.56
2	创金合信基金—华夏银行—创金合信华睿 2 号集合资产管理计划	137,250,862.00	2.85
3	国泰君安证券股份有限公司	122,041,909.00	2.53
4	中央汇金投资有限责任公司	83,301,065.00	1.73
5	中信证券股份有限公司	79,379,521.00	1.65
6	华夏基金—华夏银行—华夏银行股份有限公司	67,380,917.00	1.40
7	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	58,892,735.00	1.22
8	广发证券股份有限公司	53,846,673.00	1.12
9	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	49,092,428.00	1.02
10	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品 (财富管家) 委托专户	39,200,072.00	0.81
11	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	2,810,066,905.00	58.25

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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（2012年5月7日）基 金份额总额	19,333,307,392.00
本报告期期初基金份额总额	6,536,016,676.00
本报告期基金总申购份额	8,115,300,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,827,100,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,824,216,676.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### （1）基金管理人的重大人事变动情况

2020年4月8日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020年5月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020年6月19日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

##### （2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 170,000.00 元，该审计机构已连续 9 年为本基金提供审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	7	33,859,084,956.76	78.00%	4,652,033.24	42.14%	-
方正证券股份有限公司	5	3,757,195,647.02	8.66%	2,521,764.30	22.84%	-
中航证券有限公司	1	1,807,447,021.86	4.16%	1,141,050.68	10.34%	-
中信建投证券股份有限公司	4	1,167,473,996.12	2.69%	817,242.96	7.40%	-
广发证券股份有限公司	4	733,536,236.75	1.69%	513,478.84	4.65%	-



公司						
兴业证券 股份有限 公司	3	460,918,352.18	1.06%	322,645.35	2.92%	-
中国国际 金融股份 有限公司	5	257,779,808.52	0.59%	162,739.74	1.47%	-
新时代证 券股份有 限公司	2	252,236,764.51	0.58%	170,461.85	1.54%	-
中泰证券 股份有限 公司	5	199,546,103.88	0.46%	139,683.63	1.27%	-
长江证券 股份有限 公司	2	191,355,316.32	0.44%	120,804.34	1.09%	-
海通证券 股份有限 公司	3	144,961,709.84	0.33%	101,474.20	0.92%	-
华泰证券 股份有限 公司	5	143,435,837.18	0.33%	90,551.57	0.82%	-
天风证券 股份有限 公司	2	136,111,416.80	0.31%	85,928.09	0.78%	-
华西证券 股份有限 公司	3	113,935,597.02	0.26%	71,927.23	0.65%	-
华创证券 有限责任	2	62,299,445.48	0.14%	43,609.93	0.40%	-

公司						
招商证券 股份有限 公司	2	37,578,908.96	0.09%	26,305.71	0.24%	-
民生证券 股份有限 公司	2	33,852,794.60	0.08%	23,696.91	0.21%	-
东方证券 股份有限 公司	4	31,453,726.51	0.07%	22,018.16	0.20%	-
安信证券 股份有限 公司	3	16,390,645.98	0.04%	11,473.50	0.10%	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
光大证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限	4	-	-	-	-	-

公司						
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中信证券 华南股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金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等券商的佣金合计。

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 广州证券股份有限公司更名为中信证券华南股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：天源证券经纪有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：海通证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中泰证券股份有限公司新增交易单元 1 个，华西证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	35,144,290.64	42.37%	7,851,000,000.00	25.33%	-	-
方正证券股份有限公司	12,328,662.91	14.86%	11,276,000,000.00	36.38%	-	-
中航证券有限公司	9,936,691.80	11.98%	1,486,000,000.00	4.79%	-	-

中信建投证券股份有限公司	-	-	650,000,000.00	2.10%	-	-
广发证券股份有限公司	10,484,623.91	12.64%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	6,892,133.40	8.31%	1,507,000,000.00	4.86%	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	1,772,000,000.00	5.72%	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	1,586,000,000.00	5.12%	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	1,087,000,000.00	3.51%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3,213,778.57	3.87%	1,268,000,000.00	4.09%	-	-
天风证券股份有限公司	4,946,711.33	5.96%	1,173,000,000.00	3.78%	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	172,000,000.00	0.55%	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	370,000,000.00	1.19%	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限	-	-	801,000,000.00	2.58%	-	-

公司						
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

有限 责任 公司						
华福证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
西部证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
湘财证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
英大证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财 富证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券华 南股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-



## 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	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月22日
2	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年02月28日
3	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年03月16日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年05月18日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年07月16日
6	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第一次收益分配公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年08月29日
7	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年10月09日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2020/01/01 至 2020/12/31	4,491,383,192.00	10,155,975,274.00	11,837,291,561.00	2,810,066,905.00	58.25
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可</p>							

能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

### 13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日