

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券
投资基金
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银中证 800ETF
场内简称	工银 800、工银中证 800ETF
基金主代码	515830
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 1 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,153,108.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 7 月 17 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	工银瑞信基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95561
传真	010-66583158	021-62159217
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	福建省福州市湖东路 154 号

办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	100033	200120
法定代表人	赵桂才	高建平

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,104,346.57
本期利润	1,592,822.14
加权平均基金份额本期利润	0.3411
本期加权平均净值利润率	6.20%
本期基金份额净值增长率	3.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,426,944.91
期末可供分配基金份额利润	0.5844
期末基金资产净值	23,209,205.30
期末基金份额净值	5.5884
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.68%

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

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 1 日。

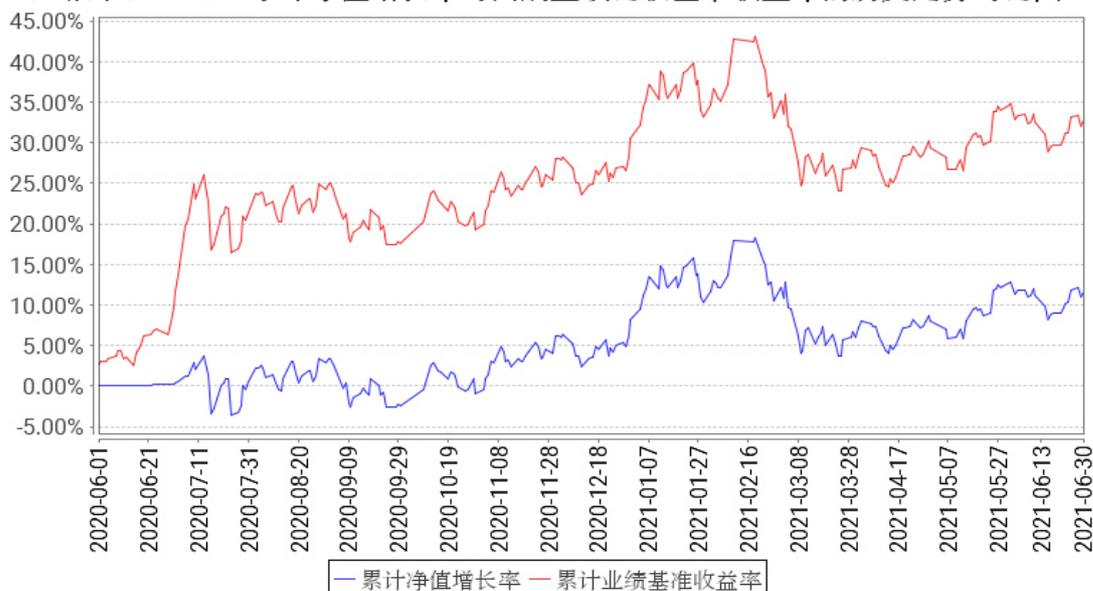
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.83%	0.76%	-1.30%	0.77%	0.47%	-0.01%
过去三个月	5.39%	0.85%	4.68%	0.88%	0.71%	-0.03%
过去六个月	3.29%	1.15%	1.72%	1.21%	1.57%	-0.06%
过去一年	11.45%	1.17%	23.10%	1.28%	-11.65%	-0.11%
自基金合同生效起至今	11.68%	1.12%	32.80%	1.26%	-21.12%	-0.14%

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

工银中证800ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 6 月 1 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于

投资范围及投资限制的规定：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 6 个月定期开放混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金、工银瑞信战略远见混合型证券投资基金、工银瑞信中证科技龙头 ETF 基金、工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金等逾 180 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专

业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵栩	指数投资中心投资部副总监，本基金的基金经理	2020年6月1日	-	13年	2008年加入工银瑞信，曾任风险管理部金融工程分析师，现任指数投资中心投资部副总监，2011年10月18日至今担任工银上证央企ETF基金基金经理；2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF基金基金经理；2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF连接基金基金经理；2015年7月9日至2020年7月27日，担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理；2015年7月9日至2020年10月18日，担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理；2017年12月25日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018年3月21日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2018年12月7日至今担任工银瑞信上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018年12月25日至今担任工银瑞信上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2019年10月17日至今，担任工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年12月19日至今，担任工银瑞信深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020年2月18日至今，担任工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年4月24日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金基金经理；2020年5月21日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；2020年6月1日至今，担任工银瑞信中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020年7月24日至今，担任工银瑞信深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年9月28日至今，担任工银瑞信上

					证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 3 月 5 日至今,担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理; 2021 年 6 月 18 日至今,担任工银瑞信深证物联网 50 交易型开放式指数型证券投资基金基金经理。
刘伟琳	本基金的基金经理	2020 年 6 月 1 日	-	11 年	中国人民大学金融工程博士; 2010 年加入工银瑞信, 历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理, 现任指数投资中心产品及营销支持部研究负责人兼指数基金基金经理。2014 年 10 月 17 日至今, 担任工银深证 100 指数分级基金(自 2018 年 4 月 17 日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF))基金经理; 2014 年 10 月 17 日至今, 担任工银沪深 300 指数基金基金经理; 2014 年 10 月 17 日至今, 担任工银中证 500 指数分级基金(自 2020 年 2 月 18 日起变更为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金)基金经理; 2015 年 5 月 21 日至今, 担任工银瑞信中证传媒指数分级基金(自 2020 年 11 月 26 日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金(LOF))基金经理; 2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日, 担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理; 2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日, 担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金经理; 2018 年 6 月 15 日, 担任工银瑞信印度市场证券投资基金(LOF)基金经理; 2019 年 5 月 20 日至今, 担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2019 年 8 月 21 日至今, 担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理; 2019 年 10 月 17 日至今, 担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2019 年 11 月 1 日至今, 担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2019 年 12 月 25 日至今, 担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理; 2020 年 6 月 1 日至今, 担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;

					2021 年 1 月 21 日至今, 担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 1 月 22 日至今, 担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 6 月 11 日至今, 担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析, 采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口, 假设不同组合间价差为零, 进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易, 公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析, 本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内, 本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 次。投资组

合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 3.29%，业绩比较基准收益率为 1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，市场主要宽基指数中，沪深 300 指数、中证 500 指数、上证 50 指数、创业板指涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、-3.90% 及 17.22%。本基金标的指数在本报告期内涨跌幅为 1.72%，表现优于沪深 300 指数。从市场风格来看，报告期内沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数涨幅分别为 0.28% 和 4.78%，成长风格表现相对较强。从估值水平来看，截至报告期末，沪深 300 指数、中证 500 指数、上证 50 指数、创业板指的市盈率分别为 14.77、22.01、12.49 及 63.11 倍，除中证 500 指数外，主要指数估值历史分位数处于较高水平。

在报告期内，A 股市场经历了较大的市场波动，年初出现较快上涨的行情，春节之后，各主要板块及市场指数均出现了较大的波动，进入到 2 季度市场整体有所企稳，同时也出现了一些分化的行情，市场的风险偏好有一定的提升，整体上结构性行情的特征十分明显。部分具有较好景气度的行业在结构化行情中较为突出，基本面的改善和持续提供了良好的行情支撑。市场对于流动性收紧的担忧有所缓解，未来对于基本面的改善是否持续以及持续多久将成为市场关注的焦点，这同样也是结构性行情下投资者需要加以关注的。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合

规部，组长由运作部负责人担任。

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

(2) 专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内（2020 年 12 月 15 日至 2021 年 3 月 8 日、2021 年 3 月 10 日至 2021 年 6 月 1 日）出现连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期

内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	716,179.60	600,537.58
结算备付金		35,407.93	118,192.02
存出保证金		27,044.01	207,264.13
交易性金融资产	6.4.7.2	22,589,459.52	43,167,081.82
其中：股票投资		22,589,459.52	43,167,081.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	202,526.50
应收利息	6.4.7.5	101.18	234.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		23,368,192.24	44,295,836.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,832.59	19,176.53
应付托管费		1,529.52	2,983.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	28,520.20	25,283.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,104.63	135,065.47
负债合计		158,986.94	182,508.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	20,782,260.39	40,798,364.28
未分配利润	6.4.7.10	2,426,944.91	3,314,963.84
所有者权益合计		23,209,205.30	44,113,328.12
负债和所有者权益总计		23,368,192.24	44,295,836.84

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 1 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 5.5884 元，基金份额总额为 4,153,108.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,846,692.71	1,018,182.40
1. 利息收入		3,169.74	452,583.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,169.74	452,583.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,095,148.12	65,510.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,931,007.53	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	164,140.59	65,510.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,511,524.43	401,281.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	259,899.28	98,807.69
减：二、费用		253,870.57	197,320.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	57,396.33	139,594.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,928.32	21,714.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	109,200.69	9,037.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	78,345.23	26,974.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,592,822.14	820,861.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,592,822.14	820,861.78

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 1 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	40,798,364.28	3,314,963.84	44,113,328.12

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,592,822.14	1,592,822.14
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）	-20,016,103.89	-2,480,841.07	-22,496,944.96
其中：1. 基金申购款	60,048,311.91	4,642,829.15	64,691,141.06
2. 基金赎回款	-80,064,415.80	-7,123,670.22	-87,188,086.02
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）	20,782,260.39	2,426,944.91	23,209,205.30
项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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）	391,080,183.00	-	391,080,183.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	820,861.78	820,861.78
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	391,080,183.00	820,861.78	391,901,044.78

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 6 月 1 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1959 号《关于准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于 2020 年 3 月 27 日至 2020 年 5 月 22 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2020）验字第 60802052_A08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 6 月 1 日正式生效，设立时募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币 391,080,183.00 元（含募集股票），折合 391,080,183.00 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 98,807.59 元，归入基金财产；以上收到的实收基金共计人民币 391,080,183.00 元，折合 391,080,183.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

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

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

(4) 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	716,179.60
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	716,179.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,092,275.00	22,589,459.52	497,184.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,092,275.00	22,589,459.52	497,184.52

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	74.22
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	14.76
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.20
合计	101.18

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	28,520.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	28,520.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	59,835.79
指数使用费	3,826.47
预提信息披露费	29,752.78
IOPV 服务费	24,795.19
可退替代款	894.40
合计	119,104.63

注：1、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额；

2、应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,153,108.00	40,798,364.28
本期申购	12,000,000.00	60,048,311.91
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-80,064,415.80
- 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	4,153,108.00	20,782,260.39

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

6.4.7.10 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	1,935,540.70	1,379,423.14	3,314,963.84

本期利润	4,104,346.57	-2,511,524.43	1,592,822.14
本期基金份额交易产生的变动数	-2,016,955.19	-463,885.88	-2,480,841.07
其中：基金申购款	9,198,618.74	-4,555,789.59	4,642,829.15
基金赎回款	-11,215,573.93	4,091,903.71	-7,123,670.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,022,932.08	-1,595,987.17	2,426,944.91

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		1,822.00
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		839.45
其他		508.29
合计		3,169.74

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		2,082,889.40
股票投资收益——赎回差价收入		1,848,118.13
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		3,931,007.53

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		44,878,953.39
减：卖出股票成本总额		42,796,063.99
买卖股票差价收入		2,082,889.40

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	87,188,086.02
减：现金支付赎回款总额	38,989,576.02
减：赎回股票成本总额	46,350,391.87
赎回差价收入	1,848,118.13

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	164,140.59
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	164,140.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,511,524.43

股票投资	-2,511,524.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,511,524.43

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	259,899.28
合计	259,899.28

注：替代损益指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	109,200.69
银行间市场交易费用	-
合计	109,200.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	29,752.78
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	24,795.19
银行费用	135.00
指数使用费	3,826.47
合计	78,345.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
兴业银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	57,396.33	139,594.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,903.32	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,928.32	21,714.74

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.07% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

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

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年6月1日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	716,179.60	1,822.00	116,164,933.14	113,892.89

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 28,300.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 148,504.95 元，估值总额为人民币 146,311.00 元，占基金资产净值的比例为 0.63%。

于本报告期末，本基金持有 11,753.00 股兴业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 251,119.26 元，估值总额为人民币 241,524.15 元，占基金资产净值的比例为 1.04%。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	600	24,094.65	33,810.00	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	3,000	22,689.20	16,770.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项	3.05	2021年7月14日	3.36	2,400	8,330.61	7,320.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

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

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量

在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	716,179.60	-	-	-	-	-	716,179.60
结算备付金	35,407.93	-	-	-	-	-	35,407.93
存出保证金	27,044.01	-	-	-	-	-	27,044.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	22,589,459.52	22,589,459.52
应收利息	-	-	-	-	-	101.18	101.18
资产总计	778,631.54	-	-	-	-	22,589,560.70	23,368,192.24
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,832.59	9,832.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,529.52	1,529.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	28,520.20	28,520.20
其他负债	-	-	-	-	-	119,104.63	119,104.63
负债总计	-	-	-	-	-	158,986.94	158,986.94
利率敏感度缺口	778,631.54	-	-	-	-	22,430,573.76	23,209,205.30
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	600,537.58	-	-	-	-	-	600,537.58
结算备付金	118,192.02	-	-	-	-	-	118,192.02
存出保证金	207,264.13	-	-	-	-	-	207,264.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	43,167,081.82	43,167,081.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	202,526.50	202,526.50
应收利息	-	-	-	-	-	234.79	234.79
资产总计	925,993.73	-	-	-	-	43,369,843.11	44,295,836.84
负债							
应付管理人报	-	-	-	-	-	19,176.53	19,176.53

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	2,983.01	2,983.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,283.71	25,283.71
其他负债	-	-	-	-	-	135,065.47	135,065.47
负债总计	-	-	-	-	-	182,508.72	182,508.72
利率敏感度缺口	925,993.73	-	-	-	-	43,187,334.39	44,113,328.12

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,589,459.52	97.33	43,167,081.82	97.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	-	-
— 贵金属投资				
衍生金融资产— 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,589,459.52	97.33	43,167,081.82	97.85

注：1、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	1,104,308.92	1,694,833.62
	业绩比较基准减少	-1,104,308.92	-1,694,833.62

	5%		
--	----	--	--

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	22,589,459.52	96.67
	其中：股票	22,589,459.52	96.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	751,587.53	3.22
8	其他各项资产	27,145.19	0.12
9	合计	23,368,192.24	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	227,236.80	0.98
B	采矿业	539,335.90	2.32
C	制造业	12,954,451.45	55.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	420,093.50	1.81
E	建筑业	299,293.00	1.29

F	批发和零售业	288,929.32	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	633,768.96	2.73
H	住宿和餐饮业	26,629.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	959,163.30	4.13
J	金融业	4,374,340.99	18.85
K	房地产业	515,575.60	2.22
L	租赁和商务服务业	368,715.60	1.59
M	科学研究和技术服务业	346,670.68	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	43,601.90	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	32,880.60	0.14
Q	卫生和社会工作	395,422.92	1.70
R	文化、体育和娱乐业	121,422.00	0.52
S	综合	41,928.00	0.18
	合计	22,589,459.52	97.33

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	600	1,234,020.00	5.32
2	601318	中国平安	8,800	565,664.00	2.44
3	600036	招商银行	10,000	541,900.00	2.33
4	000858	五粮液	1,600	476,624.00	2.05
5	601012	隆基股份	3,500	310,940.00	1.34
6	000333	美的集团	4,000	285,480.00	1.23
7	600276	恒瑞医药	3,640	247,410.80	1.07

8	002415	海康威视	3,800	245,100.00	1.06
9	601166	兴业银行	11,753	241,524.15	1.04
10	603259	药明康德	1,520	238,016.80	1.03
11	601888	中国中免	756	226,875.60	0.98
12	300059	东方财富	6,680	219,037.20	0.94
13	000651	格力电器	3,900	203,190.00	0.88
14	600900	长江电力	9,100	187,824.00	0.81
15	002475	立讯精密	4,000	184,000.00	0.79
16	600887	伊利股份	4,900	180,467.00	0.78
17	000001	平安银行	7,800	176,436.00	0.76
18	002594	比亚迪	700	175,700.00	0.76
19	600030	中信证券	6,900	172,086.00	0.74
20	000725	京东方 A	27,400	170,976.00	0.74
21	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.69
22	300015	爱尔眼科	2,204	156,439.92	0.67
23	601919	中远海控	4,900	149,646.00	0.64
24	601398	工商银行	28,300	146,311.00	0.63
25	000568	泸州老窖	600	141,564.00	0.61
26	600309	万华化学	1,300	141,466.00	0.61
27	600031	三一重工	4,800	139,536.00	0.60
28	600809	山西汾酒	300	134,400.00	0.58
29	603288	海天味业	1,018	131,271.10	0.57
30	000002	万科 A	5,500	130,955.00	0.56
31	002714	牧原股份	2,140	130,154.80	0.56
32	000661	长春高新	300	116,100.00	0.50
33	300122	智飞生物	600	112,038.00	0.48
34	002142	宁波银行	2,846	110,908.62	0.48
35	601328	交通银行	22,200	108,780.00	0.47
36	601899	紫金矿业	11,200	108,528.00	0.47
37	601816	京沪高铁	19,800	104,742.00	0.45
38	002304	洋河股份	500	103,600.00	0.45
39	002352	顺丰控股	1,500	101,550.00	0.44
40	300124	汇川技术	1,300	96,538.00	0.42
41	600438	通威股份	2,200	95,194.00	0.41
42	600000	浦发银行	9,500	95,000.00	0.41
43	002230	科大讯飞	1,400	94,612.00	0.41
44	002812	恩捷股份	400	93,640.00	0.40
45	300014	亿纬锂能	900	93,537.00	0.40
46	300274	阳光电源	800	92,048.00	0.40
47	600837	海通证券	7,800	89,700.00	0.39
48	600436	片仔癀	200	89,660.00	0.39
49	000100	TCL 科技	11,300	86,445.00	0.37

50	002460	赣锋锂业	700	84,763.00	0.37
51	002371	北方华创	300	83,214.00	0.36
52	600763	通策医疗	200	82,200.00	0.35
53	002241	歌尔股份	1,900	81,206.00	0.35
54	601601	中国太保	2,800	81,116.00	0.35
55	600690	海尔智家	3,100	80,321.00	0.35
56	300142	沃森生物	1,300	80,210.00	0.35
57	000063	中兴通讯	2,400	79,752.00	0.34
58	603986	兆易创新	420	78,918.00	0.34
59	601668	中国建筑	16,900	78,585.00	0.34
60	002027	分众传媒	8,300	78,103.00	0.34
61	003035	南网能源	7,852	78,048.88	0.34
62	600585	海螺水泥	1,900	77,995.00	0.34
63	002271	东方雨虹	1,400	77,448.00	0.33
64	300347	泰格医药	400	77,320.00	0.33
65	600016	民生银行	17,200	75,852.00	0.33
66	600196	复星医药	1,000	72,130.00	0.31
67	600703	三安光电	2,200	70,510.00	0.30
68	601288	农业银行	23,200	70,296.00	0.30
69	600048	保利地产	5,800	69,832.00	0.30
70	603799	华友钴业	600	68,520.00	0.30
71	600919	江苏银行	9,570	67,947.00	0.29
72	000338	潍柴动力	3,800	67,906.00	0.29
73	002129	中环股份	1,700	65,620.00	0.28
74	601229	上海银行	8,000	65,600.00	0.28
75	600570	恒生电子	700	65,275.00	0.28
76	600050	中国联通	15,100	65,232.00	0.28
77	601688	华泰证券	4,118	65,064.40	0.28
78	688029	南微医学	200	62,338.00	0.27
79	601211	国泰君安	3,600	61,704.00	0.27
80	600104	上汽集团	2,800	61,516.00	0.27
81	600660	福耀玻璃	1,100	61,435.00	0.26
82	601766	中国中车	9,800	59,584.00	0.26
83	601169	北京银行	12,000	58,440.00	0.25
84	600745	闻泰科技	600	58,140.00	0.25
85	600999	招商证券	3,040	57,820.80	0.25
86	600019	宝钢股份	7,200	55,008.00	0.24
87	002410	广联达	800	54,560.00	0.24
88	002709	天赐材料	510	54,355.80	0.23
89	600406	国电南瑞	2,280	52,987.20	0.23
90	601088	中国神华	2,700	52,704.00	0.23
91	601988	中国银行	17,100	52,668.00	0.23

92	300498	温氏股份	3,600	51,732.00	0.22
93	601818	光大银行	13,400	50,652.00	0.22
94	002311	海大集团	600	48,960.00	0.21
95	300450	先导智能	800	48,112.00	0.21
96	603882	金城医学	300	47,931.00	0.21
97	600893	航发动力	900	47,871.00	0.21
98	000625	长安汽车	1,800	47,304.00	0.20
99	600028	中国石化	10,800	47,088.00	0.20
100	000538	云南白药	400	46,288.00	0.20
101	002049	紫光国微	300	46,257.00	0.20
102	603486	科沃斯	200	45,616.00	0.20
103	300601	康泰生物	300	44,700.00	0.19
104	600346	恒力石化	1,700	44,608.00	0.19
105	601658	邮储银行	8,800	44,176.00	0.19
106	601628	中国人寿	1,300	44,057.00	0.19
107	601633	长城汽车	1,000	43,590.00	0.19
108	601390	中国中铁	8,300	43,492.00	0.19
109	300558	贝达药业	400	43,296.00	0.19
110	600588	用友网络	1,300	43,238.00	0.19
111	601100	恒立液压	496	42,616.32	0.18
112	603444	吉比特	80	42,400.00	0.18
113	002493	荣盛石化	2,450	42,311.50	0.18
114	601009	南京银行	4,000	42,080.00	0.18
115	601857	中国石油	7,900	41,791.00	0.18
116	601377	兴业证券	4,300	41,538.00	0.18
117	600584	长电科技	1,100	41,448.00	0.18
118	300413	芒果超媒	600	41,160.00	0.18
119	600132	重庆啤酒	200	39,590.00	0.17
120	600089	特变电工	3,000	38,550.00	0.17
121	300408	三环集团	900	38,178.00	0.16
122	002601	龙蟠佰利	1,100	38,038.00	0.16
123	601225	陕西煤业	3,200	37,920.00	0.16
124	002841	视源股份	300	37,287.00	0.16
125	002821	凯莱英	100	37,260.00	0.16
125	600111	北方稀土	1,800	37,260.00	0.16
126	600426	华鲁恒升	1,200	37,140.00	0.16
127	000009	中国宝安	2,000	36,540.00	0.16
128	002340	格林美	3,900	36,465.00	0.16
129	000776	广发证券	2,400	36,336.00	0.16
130	002050	三花智控	1,500	35,970.00	0.15
131	601939	建设银行	5,400	35,910.00	0.15
132	002001	新和成	1,240	35,563.20	0.15

133	600926	杭州银行	2,400	35,400.00	0.15
134	300433	蓝思科技	1,200	35,292.00	0.15
135	000895	双汇发展	1,100	34,980.00	0.15
136	002074	国轩高科	800	34,848.00	0.15
137	600600	青岛啤酒	300	34,695.00	0.15
138	000166	申万宏源	7,300	34,164.00	0.15
139	600741	华域汽车	1,300	34,151.00	0.15
140	600958	东方证券	3,400	33,966.00	0.15
141	600460	士兰微	600	33,810.00	0.15
142	601127	小康股份	500	33,335.00	0.14
143	688012	中微公司	200	33,184.00	0.14
144	300595	欧普康视	320	33,136.00	0.14
145	002007	华兰生物	900	33,012.00	0.14
146	000963	华东医药	700	32,207.00	0.14
147	601336	新华保险	700	32,137.00	0.14
148	300003	乐普医疗	1,000	32,120.00	0.14
149	603290	斯达半导	100	32,000.00	0.14
150	002236	大华股份	1,500	31,650.00	0.14
151	002179	中航光电	400	31,608.00	0.14
152	601006	大秦铁路	4,800	31,584.00	0.14
153	000157	中联重科	3,400	31,416.00	0.14
154	000786	北新建材	800	31,400.00	0.14
155	601233	桐昆股份	1,300	31,317.00	0.13
156	600143	金发科技	1,500	31,290.00	0.13
157	601138	工业富联	2,500	31,025.00	0.13
158	600015	华夏银行	5,000	30,950.00	0.13
159	601901	方正证券	3,300	30,888.00	0.13
160	601989	中国重工	7,400	30,488.00	0.13
161	600176	中国巨石	1,957	30,353.07	0.13
162	601877	正泰电器	900	30,042.00	0.13
163	300037	新宙邦	300	30,030.00	0.13
164	688002	睿创微纳	300	29,949.00	0.13
165	603993	洛阳钼业	5,700	29,412.00	0.13
166	300207	欣旺达	900	29,304.00	0.13
167	300285	国瓷材料	600	29,250.00	0.13
168	002607	中公教育	1,400	29,246.00	0.13
169	601155	新城控股	700	29,120.00	0.13
170	000768	中航西飞	1,100	28,908.00	0.12
171	600009	上海机场	600	28,878.00	0.12
172	600352	浙江龙盛	2,100	28,854.00	0.12
173	600010	包钢股份	18,500	28,675.00	0.12
174	601788	光大证券	1,600	28,624.00	0.12

175	001979	招商蛇口	2,600	28,470.00	0.12
176	002008	大族激光	700	28,273.00	0.12
177	601600	中国铝业	5,300	28,090.00	0.12
178	002185	华天科技	1,800	27,702.00	0.12
179	601186	中国铁建	3,700	27,491.00	0.12
180	603806	福斯特	260	27,333.80	0.12
181	600547	山东黄金	1,420	27,292.40	0.12
182	603369	今世缘	500	27,080.00	0.12
183	002202	金风科技	2,200	26,752.00	0.12
184	601916	浙商银行	6,700	26,599.00	0.11
185	000876	新希望	1,800	26,406.00	0.11
186	601636	旗滨集团	1,400	25,984.00	0.11
187	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.11
188	300529	健帆生物	300	25,908.00	0.11
189	000799	酒鬼酒	100	25,560.00	0.11
190	603833	欧派家居	180	25,552.80	0.11
191	000938	紫光股份	1,160	25,380.80	0.11
192	603899	晨光文具	300	25,368.00	0.11
193	003816	中国广核	9,500	25,365.00	0.11
194	600760	中航沈飞	420	25,326.00	0.11
195	603517	绝味食品	300	25,287.00	0.11
196	600779	水井坊	200	25,270.00	0.11
197	300316	晶盛机电	500	25,250.00	0.11
198	601066	中信建投	800	25,144.00	0.11
199	300628	亿联网络	300	25,140.00	0.11
200	600885	宏发股份	400	25,080.00	0.11
201	688008	澜起科技	401	25,014.38	0.11
202	002384	东山精密	1,200	25,008.00	0.11
203	002736	国信证券	2,300	24,725.00	0.11
204	300136	信维通信	800	24,704.00	0.11
205	600989	宝丰能源	1,800	24,624.00	0.11
206	000069	华侨城 A	3,300	24,552.00	0.11
207	000425	徐工机械	3,800	24,206.00	0.10
208	600109	国金证券	1,900	24,111.00	0.10
209	002555	三七互娱	1,000	24,020.00	0.10
210	601669	中国电建	6,200	23,994.00	0.10
211	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.10
212	300676	华大基因	200	23,720.00	0.10
213	600795	国电电力	9,600	23,328.00	0.10
214	601238	广汽集团	1,800	23,310.00	0.10
215	300482	万孚生物	360	23,288.40	0.10
216	600150	中国船舶	1,400	23,114.00	0.10

217	300146	汤臣倍健	700	23,030.00	0.10
218	600733	北汽蓝谷	1,700	22,916.00	0.10
219	002625	光启技术	1,100	22,891.00	0.10
220	300699	光威复材	300	22,785.00	0.10
221	601838	成都银行	1,800	22,752.00	0.10
222	002624	完美世界	950	22,714.50	0.10
223	000783	长江证券	3,100	22,692.00	0.10
224	601799	星宇股份	100	22,572.00	0.10
225	300033	同花顺	200	22,556.00	0.10
226	000977	浪潮信息	800	22,504.00	0.10
227	688099	晶晨股份	200	22,440.00	0.10
228	600079	人福医药	793	22,418.11	0.10
229	600486	扬农化工	200	22,354.00	0.10
230	002353	杰瑞股份	500	22,350.00	0.10
231	002916	深南电路	200	22,226.00	0.10
232	603019	中科曙光	800	22,088.00	0.10
233	002414	高德红外	800	22,064.00	0.10
234	601360	三六零	1,800	21,978.00	0.09
235	002648	卫星石化	560	21,946.40	0.09
236	300144	宋城演艺	1,300	21,840.00	0.09
237	600029	南方航空	3,600	21,672.00	0.09
238	002938	鹏鼎控股	600	21,528.00	0.09
239	601985	中国核电	4,200	21,252.00	0.09
240	300253	卫宁健康	1,300	21,151.00	0.09
241	600886	国投电力	2,200	21,142.00	0.09
242	002600	领益智造	2,300	21,137.00	0.09
243	600183	生益科技	900	21,069.00	0.09
244	601108	财通证券	2,000	20,980.00	0.09
245	002252	上海莱士	2,800	20,972.00	0.09
246	688036	传音控股	100	20,950.00	0.09
247	601555	东吴证券	2,500	20,850.00	0.09
248	600884	杉杉股份	890	20,754.80	0.09
249	600161	天坛生物	600	20,550.00	0.09
250	600219	南山铝业	5,700	20,520.00	0.09
251	002444	巨星科技	600	20,448.00	0.09
252	000066	中国长城	1,400	20,440.00	0.09
253	600085	同仁堂	500	20,425.00	0.09
254	600845	宝信软件	400	20,360.00	0.09
255	000703	恒逸石化	1,700	20,315.00	0.09
256	002439	启明星辰	700	20,307.00	0.09
256	603589	口子窖	300	20,307.00	0.09
257	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.09

258	300223	北京君正	200	20,184.00	0.09
259	000728	国元证券	2,530	20,164.10	0.09
260	002044	美年健康	2,200	20,042.00	0.09
261	600522	中天科技	2,000	20,000.00	0.09
262	601077	渝农商行	5,000	19,950.00	0.09
263	002212	天融信	1,000	19,770.00	0.09
264	002602	世纪华通	3,040	19,516.80	0.08
265	002138	顺络电子	500	19,385.00	0.08
266	002180	纳思达	600	19,320.00	0.08
267	002797	第一创业	2,700	19,278.00	0.08
268	002223	鱼跃医疗	500	19,065.00	0.08
269	000807	云铝股份	1,600	19,040.00	0.08
270	601607	上海医药	900	19,017.00	0.08
271	600704	物产中大	2,400	18,888.00	0.08
272	000547	航天发展	1,000	18,870.00	0.08
273	300630	普利制药	360	18,864.00	0.08
274	000988	华工科技	800	18,816.00	0.08
275	601800	中国交建	2,900	18,792.00	0.08
276	600739	辽宁成大	900	18,729.00	0.08
277	601689	拓普集团	500	18,715.00	0.08
278	601111	中国国航	2,400	18,672.00	0.08
279	601099	太平洋	5,500	18,645.00	0.08
280	002508	老板电器	400	18,600.00	0.08
281	600862	中航高科	600	18,468.00	0.08
282	601995	中金公司	300	18,450.00	0.08
283	600383	金地集团	1,800	18,432.00	0.08
284	002385	大北农	2,700	18,360.00	0.08
285	600115	中国东航	3,600	18,288.00	0.08
286	000636	风华高科	600	18,132.00	0.08
287	600061	国投资本	2,128	18,066.72	0.08
288	600315	上海家化	300	18,042.00	0.08
289	002422	科伦药业	900	17,955.00	0.08
290	600362	江西铜业	800	17,904.00	0.08
291	601168	西部矿业	1,500	17,895.00	0.08
292	600699	均胜电子	700	17,864.00	0.08
293	601117	中国化学	2,000	17,520.00	0.08
294	601727	上海电气	4,100	17,384.00	0.07
295	600392	盛和资源	1,000	17,360.00	0.07
296	002078	太阳纸业	1,300	17,355.00	0.07
297	002030	达安基因	816	17,331.84	0.07
298	600754	锦江酒店	300	17,085.00	0.07
299	600536	中国软件	300	17,079.00	0.07

300	601021	春秋航空	300	17,070.00	0.07
301	601878	浙商证券	1,300	17,004.00	0.07
302	601618	中国中冶	5,700	16,986.00	0.07
303	600332	白云山	500	16,925.00	0.07
304	000860	顺鑫农业	400	16,872.00	0.07
305	000830	鲁西化工	900	16,857.00	0.07
306	603939	益丰药房	300	16,827.00	0.07
307	600872	中炬高新	400	16,808.00	0.07
308	002024	苏宁易购	3,000	16,770.00	0.07
309	002690	美亚光电	300	16,728.00	0.07
310	000708	中信特钢	800	16,672.00	0.07
311	600705	中航资本	4,300	16,641.00	0.07
312	601162	天风证券	3,400	16,524.00	0.07
313	300088	长信科技	2,000	16,520.00	0.07
314	600068	葛洲坝	2,200	16,478.00	0.07
315	000039	中集集团	900	16,362.00	0.07
316	000630	铜陵有色	6,000	16,320.00	0.07
317	002013	中航机电	1,600	16,112.00	0.07
318	600563	法拉电子	100	15,836.00	0.07
319	600606	绿地控股	2,900	15,805.00	0.07
320	601990	南京证券	1,500	15,780.00	0.07
321	600201	生物股份	900	15,705.00	0.07
322	000656	金科股份	2,700	15,633.00	0.07
323	002157	正邦科技	1,300	15,535.00	0.07
324	002463	沪电股份	1,000	15,470.00	0.07
325	300308	中际旭创	400	15,408.00	0.07
326	002028	思源电气	500	15,395.00	0.07
327	000021	深科技	800	15,312.00	0.07
328	002075	沙钢股份	1,400	15,274.00	0.07
329	600171	上海贝岭	500	15,215.00	0.07
330	600011	华能国际	3,600	15,192.00	0.07
331	002456	欧菲光	1,700	15,096.00	0.07
332	600655	豫园股份	1,300	15,067.00	0.06
333	002507	涪陵榨菜	400	15,064.00	0.06
334	300001	特锐德	500	15,055.00	0.06
335	601997	贵阳银行	2,100	15,036.00	0.06
336	000513	丽珠集团	300	15,006.00	0.06
337	600988	赤峰黄金	1,000	14,990.00	0.06
338	000739	普洛药业	500	14,700.00	0.06
339	002273	水晶光电	1,000	14,690.00	0.06
340	601933	永辉超市	3,100	14,663.00	0.06
341	002127	南极电商	1,500	14,655.00	0.06

342	600118	中国卫星	500	14,630.00	0.06
343	600521	华海药业	700	14,616.00	0.06
344	600549	厦门钨业	700	14,581.00	0.06
345	002603	以岭药业	500	14,580.00	0.06
346	600177	雅戈尔	2,200	14,498.00	0.06
347	601005	重庆钢铁	5,400	14,418.00	0.06
348	002092	中泰化学	1,400	14,378.00	0.06
349	600848	上海临港	800	14,320.00	0.06
350	300009	安科生物	960	14,304.00	0.06
351	002465	海格通信	1,500	14,190.00	0.06
352	603737	三棵树	80	14,080.00	0.06
353	002250	联化科技	500	13,950.00	0.06
354	603893	瑞芯微	100	13,946.00	0.06
355	600637	东方明珠	1,700	13,923.00	0.06
356	000983	山西焦煤	1,670	13,877.70	0.06
357	600489	中金黄金	1,600	13,792.00	0.06
358	002511	中顺洁柔	500	13,775.00	0.06
359	601216	君正集团	2,700	13,743.00	0.06
360	600066	宇通客车	1,100	13,739.00	0.06
361	600487	亨通光电	1,200	13,680.00	0.06
362	600418	江淮汽车	1,100	13,673.00	0.06
363	603659	璞泰来	100	13,660.00	0.06
364	601128	常熟银行	2,200	13,640.00	0.06
365	600529	山东药玻	400	13,580.00	0.06
366	600879	航天电子	1,800	13,536.00	0.06
367	000825	太钢不锈	1,800	13,482.00	0.06
368	600516	方大炭素	1,800	13,392.00	0.06
369	002373	千方科技	800	13,360.00	0.06
370	600018	上港集团	2,800	13,356.00	0.06
371	300070	碧水源	1,800	13,158.00	0.06
372	600369	西南证券	2,700	13,149.00	0.06
373	000750	国海证券	3,100	13,144.00	0.06
374	300168	万达信息	900	13,140.00	0.06
375	600867	通化东宝	1,100	13,134.00	0.06
376	000975	银泰黄金	1,380	13,123.80	0.06
377	002080	中材科技	500	13,085.00	0.06
378	002152	广电运通	1,000	13,030.00	0.06
379	601615	明阳智能	800	12,952.00	0.06
380	603927	中科软	300	12,885.00	0.06
381	002131	利欧股份	5,500	12,870.00	0.06
382	000723	美锦能源	1,700	12,852.00	0.06
383	000998	隆平高科	800	12,832.00	0.06

384	000960	锡业股份	800	12,824.00	0.06
384	300357	我武生物	200	12,824.00	0.06
385	300115	长盈精密	620	12,772.00	0.06
386	600166	福田汽车	3,700	12,765.00	0.05
387	000050	深天马 A	900	12,762.00	0.05
388	601998	中信银行	2,500	12,750.00	0.05
389	600909	华安证券	2,270	12,643.90	0.05
390	300463	迈克生物	300	12,627.00	0.05
391	000932	华菱钢铁	1,900	12,540.00	0.05
392	603707	健友股份	300	12,525.00	0.05
393	002926	华西证券	1,300	12,519.00	0.05
394	300296	利亚德	1,600	12,512.00	0.05
395	300677	英科医疗	100	12,480.00	0.05
396	000623	吉林敖东	800	12,392.00	0.05
397	600380	健康元	900	12,357.00	0.05
398	601696	中银证券	600	12,354.00	0.05
399	600998	九州通	800	12,296.00	0.05
400	600642	申能股份	2,000	12,280.00	0.05
401	601872	招商轮船	2,640	12,196.80	0.05
402	002120	韵达股份	900	12,177.00	0.05
403	002572	索菲亚	500	12,100.00	0.05
404	600827	百联股份	600	12,090.00	0.05
405	601198	东兴证券	1,100	12,023.00	0.05
406	002156	通富微电	500	12,020.00	0.05
407	601866	中远海发	3,200	12,000.00	0.05
408	002558	巨人网络	900	11,970.00	0.05
409	002299	圣农发展	500	11,940.00	0.05
410	002065	东华软件	1,500	11,895.00	0.05
411	601699	潞安环能	1,000	11,810.00	0.05
412	600271	航天信息	900	11,727.00	0.05
413	605358	立昂微	100	11,558.00	0.05
414	002673	西部证券	1,400	11,550.00	0.05
414	300271	华宇软件	600	11,550.00	0.05
415	600316	洪都航空	300	11,544.00	0.05
416	300383	光环新网	800	11,512.00	0.05
417	300244	迪安诊断	300	11,490.00	0.05
418	300418	昆仑万维	700	11,466.00	0.05
419	603156	养元饮品	400	11,432.00	0.05
420	002500	山西证券	1,700	11,407.00	0.05
421	688009	中国通号	2,000	11,380.00	0.05
422	600415	小商品城	2,200	11,330.00	0.05
423	600765	中航重机	500	11,325.00	0.05

424	600707	彩虹股份	1,200	11,292.00	0.05
425	601319	中国人保	1,900	11,267.00	0.05
426	000012	南玻A	1,100	11,264.00	0.05
427	603858	步长制药	500	11,245.00	0.05
428	688088	虹软科技	200	11,150.00	0.05
429	002683	宏大爆破	400	11,108.00	0.05
430	002739	万达电影	700	11,053.00	0.05
431	600256	广汇能源	3,300	10,989.00	0.05
432	600895	张江高科	600	10,962.00	0.05
433	600667	太极实业	1,200	10,920.00	0.05
434	603712	七一二	300	10,830.00	0.05
435	601881	中国银河	1,000	10,780.00	0.05
436	603225	新凤鸣	531	10,779.30	0.05
437	600497	驰宏锌锗	2,500	10,775.00	0.05
438	600390	五矿资本	1,800	10,764.00	0.05
439	600188	兖州煤业	700	10,752.00	0.05
440	600155	华创阳安	1,000	10,700.00	0.05
441	600008	首创环保	3,550	10,685.50	0.05
442	300024	机器人	1,000	10,670.00	0.05
443	603087	甘李药业	100	10,658.00	0.05
444	600208	新湖中宝	3,500	10,640.00	0.05
445	600038	中直股份	200	10,548.00	0.05
446	600153	建发股份	1,300	10,530.00	0.05
447	601717	郑煤机	900	10,467.00	0.05
448	002382	蓝帆医疗	500	10,425.00	0.04
449	000738	航发控制	500	10,415.00	0.04
450	603392	万泰生物	40	10,367.20	0.04
451	600535	天士力	700	10,367.00	0.04
452	002019	亿帆医药	600	10,350.00	0.04
453	002372	伟星新材	500	10,335.00	0.04
454	000878	云南铜业	800	10,264.00	0.04
455	002670	国盛金控	900	10,251.00	0.04
456	002146	荣盛发展	1,800	10,152.00	0.04
457	600060	海信视像	600	10,140.00	0.04
458	600409	三友化工	1,000	10,110.00	0.04
459	000027	深圳能源	1,100	10,087.00	0.04
460	600233	圆通速递	1,000	10,010.00	0.04
461	000997	新大陆	600	9,954.00	0.04
462	000718	苏宁环球	1,200	9,948.00	0.04
463	002408	齐翔腾达	800	9,936.00	0.04
463	600170	上海建工	3,600	9,936.00	0.04
464	600372	中航电子	600	9,930.00	0.04

465	600511	国药股份	300	9,918.00	0.04
466	000401	冀东水泥	800	9,880.00	0.04
467	002153	石基信息	420	9,874.20	0.04
468	600875	东方电气	900	9,873.00	0.04
469	002294	信立泰	300	9,870.00	0.04
470	002221	东华能源	900	9,855.00	0.04
471	603658	安图生物	130	9,850.10	0.04
472	002958	青农商行	2,300	9,844.00	0.04
473	600160	巨化股份	1,110	9,812.40	0.04
474	300474	景嘉微	100	9,792.00	0.04
475	002506	协鑫集成	2,800	9,744.00	0.04
476	002268	卫士通	500	9,740.00	0.04
477	300251	光线传媒	900	9,729.00	0.04
478	300058	蓝色光标	1,600	9,680.00	0.04
479	002191	劲嘉股份	900	9,576.00	0.04
480	002966	苏州银行	1,300	9,555.00	0.04
481	600258	首旅酒店	400	9,544.00	0.04
482	600325	华发股份	1,400	9,436.00	0.04
483	002390	信邦制药	900	9,432.00	0.04
484	603638	艾迪精密	220	9,431.40	0.04
485	600141	兴发集团	500	9,415.00	0.04
486	002745	木林森	700	9,380.00	0.04
487	300017	网宿科技	1,600	9,360.00	0.04
488	300315	掌趣科技	2,200	9,350.00	0.04
488	601016	节能风电	2,500	9,350.00	0.04
489	002195	二三四五	4,600	9,338.00	0.04
490	600663	陆家嘴	700	9,324.00	0.04
491	600498	烽火通信	500	9,315.00	0.04
492	000686	东北证券	1,100	9,295.00	0.04
493	000540	中天金融	3,400	9,282.00	0.04
494	688321	微芯生物	200	9,238.00	0.04
495	000158	常山北明	800	9,192.00	0.04
496	603883	老百姓	174	9,166.32	0.04
497	300212	易华录	340	9,149.40	0.04
498	601992	金隅集团	3,400	9,146.00	0.04
499	688396	华润微	100	9,102.00	0.04
500	002056	横店东磁	700	9,100.00	0.04
501	000060	中金岭南	2,000	9,040.00	0.04
502	600737	中粮糖业	900	9,009.00	0.04
503	600598	北大荒	600	8,976.00	0.04
504	600567	山鹰国际	2,600	8,970.00	0.04
505	600027	华电国际	2,600	8,944.00	0.04

506	601577	长沙银行	1,000	8,940.00	0.04
507	600528	中铁工业	1,100	8,910.00	0.04
508	002831	裕同科技	300	8,907.00	0.04
509	002939	长城证券	800	8,904.00	0.04
510	600282	南钢股份	2,500	8,900.00	0.04
511	000961	中南建设	1,500	8,880.00	0.04
512	603198	迎驾贡酒	200	8,860.00	0.04
513	000671	阳光城	1,700	8,840.00	0.04
514	600801	华新水泥	500	8,785.00	0.04
515	603077	和邦生物	4,200	8,736.00	0.04
515	603866	桃李面包	280	8,736.00	0.04
516	002081	金螳螂	1,100	8,712.00	0.04
517	600482	中国动力	500	8,710.00	0.04
518	600025	华能水电	1,500	8,685.00	0.04
519	600859	王府井	300	8,664.00	0.04
520	000800	一汽解放	800	8,656.00	0.04
521	600500	中化国际	1,100	8,646.00	0.04
522	002557	洽洽食品	200	8,620.00	0.04
523	002174	游族网络	500	8,585.00	0.04
524	600808	马钢股份	2,000	8,580.00	0.04
525	002124	天邦股份	1,220	8,552.20	0.04
526	002396	星网锐捷	400	8,540.00	0.04
527	002203	海亮股份	800	8,512.00	0.04
528	002429	兆驰股份	1,400	8,498.00	0.04
529	300182	捷成股份	1,700	8,483.00	0.04
530	000898	鞍钢股份	1,900	8,455.00	0.04
531	601231	环旭电子	500	8,405.00	0.04
532	600340	华夏幸福	1,600	8,384.00	0.04
533	002563	森马服饰	700	8,365.00	0.04
534	000709	河钢股份	3,400	8,364.00	0.04
535	600732	爱旭股份	600	8,352.00	0.04
536	000581	威孚高科	400	8,332.00	0.04
537	600728	佳都科技	1,100	8,151.00	0.04
538	000488	晨鸣纸业	1,000	8,140.00	0.04
539	601236	红塔证券	600	8,136.00	0.04
540	000930	中粮科技	900	8,109.00	0.03
541	002004	华邦健康	1,300	8,073.00	0.03
542	000999	华润三九	300	8,025.00	0.03
543	002595	豪迈科技	300	8,010.00	0.03
544	600216	浙江医药	500	8,005.00	0.03
545	600580	卧龙电驱	600	7,980.00	0.03
546	000729	燕京啤酒	1,100	7,964.00	0.03

547	600820	隧道股份	1,500	7,935.00	0.03
548	300618	寒锐钴业	100	7,884.00	0.03
549	002705	新宝股份	300	7,875.00	0.03
550	603228	景旺电子	300	7,860.00	0.03
551	002048	宁波华翔	400	7,800.00	0.03
552	000629	攀钢钒钛	3,400	7,786.00	0.03
553	300002	神州泰岳	1,600	7,760.00	0.03
554	002010	传化智联	1,000	7,710.00	0.03
555	601456	国联证券	500	7,700.00	0.03
556	603260	合盛硅业	100	7,691.00	0.03
557	600037	歌华有线	800	7,688.00	0.03
558	603885	吉祥航空	500	7,630.00	0.03
559	600022	山东钢铁	4,400	7,568.00	0.03
560	603786	科博达	100	7,550.00	0.03
561	603568	伟明环保	330	7,533.90	0.03
562	600039	四川路桥	1,200	7,524.00	0.03
563	002002	鸿达兴业	1,900	7,467.00	0.03
564	600348	华阳股份	1,000	7,420.00	0.03
565	300166	东方国信	600	7,416.00	0.03
566	600881	亚泰集团	2,600	7,410.00	0.03
567	600755	厦门国贸	900	7,389.00	0.03
568	002281	光迅科技	300	7,380.00	0.03
569	002249	大洋电机	1,400	7,350.00	0.03
570	000883	湖北能源	1,600	7,344.00	0.03
571	600970	中材国际	800	7,336.00	0.03
572	600985	淮北矿业	600	7,326.00	0.03
573	600811	东方集团	2,400	7,320.00	0.03
574	002387	维信诺	700	7,301.00	0.03
575	000598	兴蓉环境	1,400	7,294.00	0.03
576	002901	大博医疗	100	7,289.00	0.03
577	002085	万丰奥威	1,300	7,280.00	0.03
578	600782	新钢股份	1,300	7,254.00	0.03
579	000887	中鼎股份	600	7,248.00	0.03
580	600398	海澜之家	1,000	7,240.00	0.03
581	600446	金证股份	500	7,220.00	0.03
582	600597	光明乳业	500	7,205.00	0.03
583	601200	上海环境	600	7,182.00	0.03
583	601880	辽港股份	4,200	7,182.00	0.03
584	601808	中海油服	500	7,180.00	0.03
585	000690	宝新能源	1,400	7,154.00	0.03
586	601106	中国一重	2,100	7,119.00	0.03
587	600260	凯乐科技	800	7,104.00	0.03

588	600967	内蒙一机	700	7,084.00	0.03
589	000778	新兴铸管	1,900	7,068.00	0.03
590	603338	浙江鼎力	120	7,042.80	0.03
591	600410	华胜天成	900	6,984.00	0.03
592	000528	柳工	851	6,978.20	0.03
593	600908	无锡银行	1,200	6,960.00	0.03
594	002773	康弘药业	300	6,939.00	0.03
595	300072	三聚环保	1,200	6,888.00	0.03
596	600645	中源协和	300	6,885.00	0.03
597	002183	怡亚通	1,200	6,876.00	0.03
597	603000	人民网	400	6,876.00	0.03
598	600718	东软集团	700	6,846.00	0.03
599	002985	北摩高科	70	6,825.00	0.03
600	600026	中远海能	1,100	6,776.00	0.03
601	000402	金融街	1,000	6,750.00	0.03
602	002110	三钢闽光	1,000	6,740.00	0.03
603	600839	四川长虹	2,300	6,693.00	0.03
604	000970	中科三环	700	6,685.00	0.03
605	002701	奥瑞金	1,300	6,682.00	0.03
606	600126	杭钢股份	1,300	6,669.00	0.03
607	600572	康恩贝	1,500	6,660.00	0.03
608	601118	海南橡胶	1,300	6,617.00	0.03
609	002925	盈趣科技	170	6,614.70	0.03
610	600803	新奥股份	400	6,604.00	0.03
611	601179	中国西电	1,600	6,592.00	0.03
612	601598	中国外运	1,300	6,565.00	0.03
613	000877	天山股份	500	6,515.00	0.03
614	600064	南京高科	700	6,503.00	0.03
615	002242	九阳股份	200	6,498.00	0.03
616	600918	中泰证券	600	6,492.00	0.03
617	002266	浙富控股	1,300	6,487.00	0.03
618	601698	中国卫通	400	6,476.00	0.03
619	000519	中兵红箭	600	6,432.00	0.03
620	002368	太极股份	320	6,419.20	0.03
621	002032	苏泊尔	100	6,379.00	0.03
622	000990	诚志股份	500	6,365.00	0.03
623	000400	许继电气	500	6,330.00	0.03
624	600167	联美控股	700	6,251.00	0.03
625	002128	露天煤业	600	6,246.00	0.03
626	603355	莱克电气	100	6,223.00	0.03
627	000089	深圳机场	800	6,216.00	0.03
628	601718	际华集团	2,200	6,204.00	0.03

629	002233	塔牌集团	600	6,168.00	0.03
630	600517	国网英大	900	6,129.00	0.03
631	600120	浙江东方	1,430	6,120.40	0.03
632	600507	方大特钢	900	6,102.00	0.03
633	600307	酒钢宏兴	2,600	6,032.00	0.03
634	601975	招商南油	2,800	5,992.00	0.03
635	300026	红日药业	1,400	5,950.00	0.03
636	002867	周大生	300	5,931.00	0.03
637	600095	湘财股份	500	5,855.00	0.03
638	600804	鹏博士	1,200	5,808.00	0.03
639	601000	唐山港	2,400	5,784.00	0.02
640	601333	广深铁路	2,700	5,724.00	0.02
641	000685	中山公用	700	5,712.00	0.02
642	600158	中体产业	500	5,705.00	0.02
643	600195	中牧股份	477	5,704.92	0.02
644	300376	易事特	700	5,628.00	0.02
645	000959	首钢股份	1,000	5,620.00	0.02
646	600329	中新药业	200	5,618.00	0.02
647	002505	鹏都农牧	2,500	5,600.00	0.02
647	600376	首开股份	1,000	5,600.00	0.02
648	600435	北方导航	700	5,558.00	0.02
649	000090	天健集团	1,000	5,530.00	0.02
650	000967	盈峰环境	800	5,496.00	0.02
651	600729	重庆百货	200	5,490.00	0.02
652	601860	紫金银行	1,500	5,445.00	0.02
653	002839	张家港行	1,000	5,440.00	0.02
654	002155	湖南黄金	700	5,425.00	0.02
655	600266	城建发展	1,140	5,403.60	0.02
656	600673	东阳光	1,200	5,388.00	0.02
657	600566	济川药业	300	5,370.00	0.02
658	300133	华策影视	900	5,328.00	0.02
659	000559	万向钱潮	1,000	5,310.00	0.02
659	002440	闰土股份	600	5,310.00	0.02
660	601098	中南传媒	600	5,292.00	0.02
661	600556	天下秀	500	5,280.00	0.02
661	601991	大唐发电	2,000	5,280.00	0.02
662	002038	双鹭药业	500	5,265.00	0.02
663	601608	中信重工	1,400	5,236.00	0.02
664	000758	中色股份	1,100	5,225.00	0.02
665	603983	丸美股份	100	5,211.00	0.02
666	600901	江苏租赁	1,000	5,200.00	0.02
667	601958	金钼股份	800	5,184.00	0.02

668	002936	郑州银行	1,410	5,174.70	0.02
669	001914	招商积余	300	5,154.00	0.02
670	000563	陕国投 A	1,600	5,152.00	0.02
671	600928	西安银行	1,100	5,126.00	0.02
672	600388	龙净环保	600	5,112.00	0.02
673	603233	大参林	100	5,111.00	0.02
674	000062	深圳华强	300	5,073.00	0.02
675	300741	华宝股份	100	5,072.00	0.02
676	002416	爱施德	500	5,015.00	0.02
677	002458	益生股份	500	4,985.00	0.02
678	600776	东方通信	400	4,960.00	0.02
679	600373	中文传媒	500	4,930.00	0.02
680	600094	大名城	1,300	4,901.00	0.02
681	600643	爱建集团	700	4,886.00	0.02
682	600959	江苏有线	1,600	4,880.00	0.02
683	600835	上海机电	300	4,875.00	0.02
684	600056	中国医药	400	4,860.00	0.02
685	000415	渤海租赁	2,000	4,840.00	0.02
686	603650	彤程新材	100	4,810.00	0.02
687	600299	安迪苏	400	4,784.00	0.02
688	002399	海普瑞	300	4,779.00	0.02
689	600062	华润双鹤	400	4,764.00	0.02
690	600649	城投控股	1,000	4,760.00	0.02
691	603605	珀莱雅	24	4,721.04	0.02
692	000501	鄂武商 A	400	4,680.00	0.02
692	601828	美凯龙	390	4,680.00	0.02
693	000717	韶钢松山	1,000	4,590.00	0.02
694	603719	良品铺子	100	4,500.00	0.02
695	300180	华峰超纤	900	4,455.00	0.02
696	600863	内蒙华电	1,900	4,427.00	0.02
697	600717	天津港	1,128	4,421.76	0.02
698	002424	贵州百灵	600	4,416.00	0.02
699	600623	华谊集团	500	4,405.00	0.02
700	603317	天味食品	149	4,385.07	0.02
701	600006	东风汽车	600	4,380.00	0.02
702	601611	中国核建	600	4,332.00	0.02
703	300257	开山股份	300	4,311.00	0.02
704	600546	山煤国际	600	4,308.00	0.02
704	600633	浙数文化	600	4,308.00	0.02
705	002317	众生药业	500	4,305.00	0.02
706	601928	凤凰传媒	600	4,284.00	0.02
707	000078	海王生物	1,300	4,238.00	0.02

708	603888	新华网	200	4,234.00	0.02
709	603868	飞科电器	100	4,206.00	0.02
710	002244	滨江集团	1,000	4,190.00	0.02
711	002945	华林证券	300	4,146.00	0.02
711	600021	上海电力	600	4,146.00	0.02
712	600968	海油发展	1,600	4,144.00	0.02
713	600639	浦东金桥	300	4,095.00	0.02
714	600312	平高电气	700	4,088.00	0.02
715	002434	万里扬	500	4,055.00	0.02
716	600339	中油工程	1,400	3,976.00	0.02
717	600131	国网信通	300	3,972.00	0.02
718	002375	亚厦股份	500	3,960.00	0.02
719	600377	宁沪高速	400	3,904.00	0.02
720	600582	天地科技	1,000	3,900.00	0.02
721	300113	顺网科技	300	3,882.00	0.02
722	000681	视觉中国	300	3,879.00	0.02
723	601778	晶科科技	700	3,822.00	0.02
724	002468	申通快递	500	3,810.00	0.02
725	000028	国药一致	100	3,784.00	0.02
726	000826	启迪环境	700	3,745.00	0.02
727	002815	崇达技术	300	3,744.00	0.02
728	603379	三美股份	200	3,742.00	0.02
729	600787	中储股份	700	3,731.00	0.02
730	000869	张裕 A	100	3,714.00	0.02
731	601298	青岛港	600	3,708.00	0.02
732	600640	号百控股	300	3,657.00	0.02
733	600823	世茂股份	900	3,636.00	0.02
734	603377	东方时尚	340	3,634.60	0.02
735	000031	大悦城	1,000	3,600.00	0.02
736	600466	蓝光发展	1,200	3,540.00	0.02
737	000937	冀中能源	900	3,537.00	0.02
738	002583	海能达	700	3,528.00	0.02
739	601969	海南矿业	300	3,489.00	0.02
740	002948	青岛银行	700	3,479.00	0.01
741	603708	家家悦	200	3,474.00	0.01
742	601568	北元集团	400	3,424.00	0.01
743	300010	豆神教育	600	3,402.00	0.01
744	600259	广晟有色	100	3,381.00	0.01
745	002532	天山铝业	400	3,356.00	0.01
746	601139	深圳燃气	500	3,280.00	0.01
747	601228	广州港	1,000	3,180.00	0.01
748	000813	德展健康	700	3,178.00	0.01

749	002302	西部建设	400	3,160.00	0.01
750	000156	华数传媒	400	3,084.00	0.01
751	600350	山东高速	500	3,075.00	0.01
752	003022	联泓新科	100	3,070.00	0.01
753	000046	泛海控股	1,300	2,990.00	0.01
754	600648	外高桥	200	2,956.00	0.01
755	600871	石化油服	1,500	2,955.00	0.01
756	002635	安洁科技	200	2,926.00	0.01
757	688126	沪硅产业	100	2,918.00	0.01
758	601187	厦门银行	300	2,844.00	0.01
759	600764	中国海防	100	2,830.00	0.01
760	000553	安道麦 A	300	2,781.00	0.01
761	000061	农产品	500	2,760.00	0.01
762	002419	天虹股份	400	2,624.00	0.01
763	000537	广宇发展	500	2,615.00	0.01
764	603515	欧普照明	100	2,567.00	0.01
765	600657	信达地产	700	2,436.00	0.01
765	601869	长飞光纤	100	2,436.00	0.01
766	601003	柳钢股份	400	2,360.00	0.01
766	601801	皖新传媒	500	2,360.00	0.01
767	603056	德邦股份	200	2,198.00	0.01
768	002653	海思科	100	2,152.00	0.01
769	001872	招商港口	120	2,030.40	0.01
770	601512	中新集团	200	1,992.00	0.01
771	600903	贵州燃气	200	1,840.00	0.01
772	000732	泰禾集团	800	1,728.00	0.01
773	600917	重庆燃气	200	1,634.00	0.01
774	002946	新乳业	100	1,515.00	0.01
775	002818	富森美	100	1,206.00	0.01
776	600956	新天绿能	100	1,171.00	0.01
777	603256	宏和科技	100	914.00	0.00
778	002423	中粮资本	100	905.00	0.00
779	601068	中铝国际	200	690.00	0.00

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	1,358,881.00	3.08

2	000333	美的集团	1,112,611.00	2.52
3	000651	格力电器	694,037.00	1.57
4	000661	长春高新	684,228.00	1.55
5	600519	贵州茅台	661,594.00	1.50
6	000568	泸州老窖	629,672.00	1.43
7	002415	海康威视	606,590.00	1.38
8	300059	东方财富	597,914.00	1.36
9	000001	平安银行	587,869.00	1.33
10	002714	牧原股份	580,064.00	1.31
11	000002	万科 A	543,478.00	1.23
12	000725	京东方 A	486,311.00	1.10
13	002594	比亚迪	480,803.00	1.09
14	002475	立讯精密	478,234.00	1.08
15	300015	爱尔眼科	405,561.00	0.92
16	002352	顺丰控股	405,370.00	0.92
17	002460	赣锋锂业	328,030.00	0.74
18	002142	宁波银行	324,590.00	0.74
19	002371	北方华创	319,908.00	0.73
20	000100	TCL 科技	309,867.00	0.70

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	1,922,742.44	4.36
2	000333	美的集团	1,524,652.00	3.46
3	000651	格力电器	963,572.00	2.18
4	300059	东方财富	816,234.20	1.85
5	000568	泸州老窖	790,533.91	1.79
6	002415	海康威视	764,744.00	1.73
7	000001	平安银行	749,829.00	1.70
8	000661	长春高新	741,924.00	1.68
9	002714	牧原股份	717,526.00	1.63
10	000002	万科 A	689,861.00	1.56
11	002594	比亚迪	675,305.00	1.53
12	002475	立讯精密	660,936.01	1.50
13	000725	京东方 A	587,105.00	1.33
14	002352	顺丰控股	567,102.00	1.29
15	300015	爱尔眼科	483,264.00	1.10
16	600519	贵州茅台	432,224.00	0.98

17	002304	洋河股份	414,921.00	0.94
18	002142	宁波银行	407,421.00	0.92
19	000100	TCL 科技	404,479.00	0.92
20	002460	赣锋锂业	397,950.00	0.90

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

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

7.4.3 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	35,638,812.97
卖出股票收入（成交）总额	44,878,953.39

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,044.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	101.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,145.19

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
360	11,536.41	1,543,005.00	37.15	2,610,103.00	62.85

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信证券股份有限公司	1,543,005.00	37.15
2	钱中明	405,767.00	9.77
3	周兰萍	99,923.00	2.41
4	罗光兴	59,923.00	1.44
5	马琳	55,357.00	1.33
6	张威	49,961.00	1.20
7	王祯	39,969.00	0.96
8	周瑾	39,969.00	0.96
9	曹辉	39,969.00	0.96
10	蔡亚东	37,223.00	0.90

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 6 月 1 日) 基 金份额总额	391,080,183.00
本报告期期初基金份额总额	8,153,108.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	4,153,108.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

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

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

2、基金托管人：

本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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	4	80,394,417.47	100.00%	57,185.42	100.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人

的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 16 日

2	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 2 月 6 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 3 月 31 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210309-20210309, 20210602-20210607, 20210622-20210630	1,547,442.00	14,438,799.00	14,443,236.00	1,543,005.00	37.15
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中, 存在基金规模大幅波动的风险, 以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》的规定, 对《基金合同》和《托管协议》进行了修订, 并在投资范围中增加存托凭证, 修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 3 月 31 日起生效, 详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件;

- 2、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日