

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 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
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63

7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 800ETF
场内简称	ZZ800ETF、中证 800ETF
基金主代码	515810
交易代码	515810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 8 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	185,908,843.00 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	2019 年 10 月 25 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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103

负责人	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码		510620；519031	100033
法定代表人		吴欣荣	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	9,995,379.35
本期利润	7,451,373.12
加权平均基金份额本期利润	0.0342
本期加权平均净值利润率	2.67%
本期基金份额净值增长率	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	61,153,997.18
期末可供分配基金份额利润	0.3289
期末基金资产净值	247,062,840.18
期末基金份额净值	1.3289
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	32.89%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

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	3.97%	0.62%	2.96%	0.62%	1.01%	0.00%
过去三个月	2.71%	1.20%	1.18%	1.18%	1.53%	0.02%
过去六个月	3.10%	1.09%	0.87%	1.09%	2.23%	0.00%
过去一年	21.35%	1.45%	15.20%	1.45%	6.15%	0.00%
过去三年	-0.17%	1.13%	-11.35%	1.13%	11.18%	0.00%
自基金合同生效起至今	32.89%	1.20%	6.82%	1.20%	26.07%	0.00%

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

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019 年 10 月 8 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 32.89%，同期业绩比较基准收益率为

6.82%。

§ 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
林伟斌	本基金的基金经理，易方达中证 800ETF 联接（自 2019 年 10 月 21 日至 2025 年 05 月 09 日）、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接、易方达上证科创板 50ETF、易方达上证科创 50ETF 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达纳斯达克 100ETF（QDII）、易方达中证 2000ETF（自 2023 年 09 月 13 日至 2025 年 05 月 09 日）、易方达 MSCI 美国 50ETF（QDII）、易方达中证红利低波动 ETF（自 2023 年 12 月 06 日至 2025 年 05 月 09 日）、易方达中证 A50ETF、易方达中证 A50ETF 联接发起式的基金经理，指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员	2019-10-08	2025-05-10	17 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）、易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达上证 50 指数（LOF）、易方达中证 500 质量成长 ETF 的基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数（LOF）、易方达中证万得并购	2019-10-08	-	18 年	硕士，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员，易方达深证成指 ETF 联接、易方

重组指数 (LOF)、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达香港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF 联接、易方达中证国企一带一路 ETF 联接、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行 ETF 联接 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF (自 2021 年 11 月 26 日至 2025 年 04 月 02 日)、易方达中证 1000ETF、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接发起式、易方达中证长江保护主题 ETF 联接发起式 (自 2023 年 04 月 11 日至 2025 年 04 月 02 日)、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理, 易方达中证港股通消费主题 ETF (自 2022 年 03 月 25 日至 2025 年 04 月 10 日)、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达创业板中盘 200ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达创业板成长 ETF、易方达创业板中盘 200ETF 联接、易方达创业板成长 ETF 联接发起式、易方达中证国资央企 50ETF 的基金经理助理				达深证成指 ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证浙江新动能 ETF 联接(QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF(QDII)的基金经理。
---	--	--	--	---

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的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% 的交易共 38 次，其中 31 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本基金跟踪中证 800 指数，该指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场中大市值公司的股票价格表现。报告期内，本基金主要采取完全复制法，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。

2025 年上半年，国内经济运行总体平稳，国内生产总值（GDP）同比增长 5.3%。一季度，在宏观调控政策持续作用下，工业生产保持较快增长，装备制造业、高技术制造业增速高于工业整体水平；消费与投资结构延续优化趋势，新质生产力培育进程加速，数字经济活力持续释放，传统产业转型升级节奏加快。二季度，面对国际关税调整等外部环境变化及国内结构性调整压力，国务院及相关部门强化政策协同，通过动态优化进口商品关税、扩大内需、推进现代化产业体系建设等系列措施有效应对复杂局面，工业增加值保持稳步增长，服务类消费回暖推动社会消费品零售总额环比回升，高技术产业投资保持较快增长。

股票市场方面，上半年 A 股市场呈现结构性分化特征。一季度，尽管受海外因素扰动出现短期波动，但在经济基本面改善与政策支持共同作用下，科技成长板块交易活跃度相对较高，市场整体韧性有所显现；二季度，国际贸易政策调整及地缘政治因素对市场情绪仍产生阶段性影响，但中国人民银行通过实施下调金融机构存款准备金率、引导融资成本下行等货币政策操作，保持了市场流动性合理充裕水平，中国证券监督管理委员会等部门同步推进交易机制优化、提升外资投资便利性等改革举措。在此背景下，投资者交易意愿有所回升，市场整体运行平稳。2025 年上半年，中证 800

指数上涨 0.87%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3289 元，本报告期份额净值增长率为 3.10%，同期业绩比较基准收益率为 0.87%。年化跟踪误差 0.55%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，国内经济有望在稳中求进的工作总基调下，延续平稳运行与结构优化的态势。随着宏观政策效应的进一步显现，工业生产，特别是装备制造业和高技术产业的持续增长，预计将继续发挥支撑作用。消费和投资结构有望继续改善，内需潜力在政策引导和居民收入增长的带动下逐步释放。面对外部环境的不确定性，预计宏观政策将继续保持灵活性和针对性，财政政策适度加力，货币政策保持松紧适度，为经济运行营造适宜的金融环境。同时，深化供给侧结构性改革、推动科技创新和传统产业转型升级，仍将是推动经济高质量发展的关键动力。

资本市场方面，市场运行的稳定性有望在政策支持和经济基本面改善的共同作用下继续提升。中国人民银行或将继续通过灵活适度的货币政策操作维持流动性合理充裕，中国证券监督管理委员会等监管机构也可能持续推进制度优化，提升市场运行效率和投资者信心。在此背景下，市场可能继续呈现板块轮动的特征。同时，外部政策变化、地缘政治等因素仍可能带来阶段性波动，需持续关注相关风险因素对市场情绪的影响。总体来看，资本市场将更多反映经济结构转型方向，市场参与者需更加注重结构性机会与风险控制的平衡。中证 800 指数作为覆盖了大部分 A 股市值的代表性宽基指数，市值风格偏向于中大盘，行业分布相对均衡，指数表现与中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，指

导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,900,111.70	6,123,999.85
结算备付金		2,510,103.86	2,452,183.08
存出保证金		1,147,097.54	1,145,057.38
交易性金融资产	6.4.7.2	237,578,083.72	306,760,471.58
其中：股票投资		237,578,083.72	306,760,471.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,622,528.37	21,166,503.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	-
资产总计		248,833,541.43	337,648,215.00
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		869,495.54	13,538,149.17
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,560.37	36,733.64
应付托管费		10,186.80	12,244.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	860,458.54	3,252,635.67
负债合计		1,770,701.25	16,839,763.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	185,908,843.00	248,908,843.00
未分配利润	6.4.7.8	61,153,997.18	71,899,608.98
净资产合计		247,062,840.18	320,808,451.98
负债和净资产总计		248,833,541.43	337,648,215.00

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3289 元，基金份额总额 185,908,843.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,921,664.25	1,182,580.29
1.利息收入		26,209.61	26,093.02
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,209.61	26,093.02
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,664,738.43	-3,337,891.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,722,774.97	-5,312,146.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	17,295.05	3,022.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	819,446.54	-234,759.20
股利收益	6.4.7.14	3,105,221.87	2,205,992.17
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-2,544,006.23	4,384,446.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-225,277.56	109,932.32
减：二、营业总支出		470,291.13	434,520.54
1. 管理人报酬		208,858.74	151,190.29

2. 托管费		69,619.62	50,396.73
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		3,149.96	-
8. 其他费用	6.4.7.18	188,662.81	232,933.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,451,373.12	748,059.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,451,373.12	748,059.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,451,373.12	748,059.75

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	248,908,843.00	71,899,608.98	320,808,451.98
二、本期期初净资产	248,908,843.00	71,899,608.98	320,808,451.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-63,000,000.00	-10,745,611.80	-73,745,611.80
（一）、综合收益总额	-	7,451,373.12	7,451,373.12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-63,000,000.00	-18,196,984.92	-81,196,984.92
其中：1.基金申购款	45,000,000.00	12,943,496.40	57,943,496.40
2.基金赎回款	-108,000,000.00	-31,140,481.32	-139,140,481.32
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	185,908,843.00	61,153,997.18	247,062,840.18
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	176,908,843.00	17,341,037.34	194,249,880.34
二、本期期初净资产	176,908,843.00	17,341,037.34	194,249,880.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,000,000.00	-230,645.75	2,769,354.25
（一）、综合收益总额	-	748,059.75	748,059.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,000,000.00	-978,705.50	2,021,294.50
其中：1.基金申购款	93,000,000.00	8,988,710.78	101,988,710.78
2.基金赎回款	-90,000,000.00	-9,967,416.28	-99,967,416.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	179,908,843.00	17,110,391.59	197,019,234.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据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]1400 号《关于准予易方达中证 800 交易型开放式指数证

券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达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《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 887,908,843.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融

业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(3) 企业所得税

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

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	5,900,111.70
等于：本金	5,899,597.69
加：应计利息	514.01
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	5,900,111.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	228,523,699.98	-	237,578,083.72	9,054,383.74
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		228,523,699.98	-	237,578,083.72	9,054,383.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	9,070,780.00	-	-	-
IC2509	1,137,360.00	-	-	-
IC2512	1,088,200.00	-	-	-
IF2509	3,458,700.00	-	-	-
IF2512	3,386,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,070,780.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2509	IC2509	1	1,155,160.00	17,800.00
IC2512	IC2512	1	1,131,120.00	42,920.00
IF2509	IF2509	3	3,498,300.00	39,600.00
IF2512	IF2512	3	3,470,940.00	84,420.00
合计	-	-	-	184,740.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	184,740.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,886.02
其中：交易所市场	4,886.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	92,731.73
应付替代款	762,840.79
合计	860,458.54

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	248,908,843.00	248,908,843.00
本期申购	45,000,000.00	45,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-108,000,000.00	-108,000,000.00
本期末	185,908,843.00	185,908,843.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	113,238,197.74	-41,338,588.76	71,899,608.98
本期期初	113,238,197.74	-41,338,588.76	71,899,608.98
本期利润	9,995,379.35	-2,544,006.23	7,451,373.12
本期基金份额交易产生的变动数	-29,974,629.50	11,777,644.58	-18,196,984.92
其中：基金申购款	21,321,646.05	-8,378,149.65	12,943,496.40
基金赎回款	-51,296,275.55	20,155,794.23	-31,140,481.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,258,947.59	-32,104,950.41	61,153,997.18

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,520.53
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	15,621.04
其他	68.04
合计	26,209.61

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,551,502.30
股票投资收益——赎回差价收入	2,171,272.67
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	6,722,774.97

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	92,048,748.61
减：卖出股票成本总额	87,426,484.45
减：交易费用	70,761.86
买卖股票差价收入	4,551,502.30

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	139,140,481.32
减：现金支付赎回款总额	54,761,828.32
减：赎回股票成本总额	82,207,380.33
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,171,272.67

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	5.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,289.73
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	17,295.05

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	559,566.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	541,810.59
减：应计利息总额	443.67
减：交易费用	22.03
买卖债券差价收入	17,289.73

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	819,446.54

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,105,221.87
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	3,105,221.87

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	-1,901,126.23
——股票投资	-1,901,126.23
——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	-642,880.00
——权证投资	-
——期货投资	-642,880.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-2,544,006.23

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-225,277.56
合计	-225,277.56

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	23,307.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	25.25
指数使用费	20,662.86
银行汇划费	859.21
其他	84,300.75
合计	188,662.81

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的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

本报告期内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
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	35,062.00	0.02%	23,001,674.68	21.16%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	-	-	5,898.60	38.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	3.50	0.02%	1.85	0.04%
关联方名称	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	2,300.16	21.15%	1,983.65	41.38%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.2024 年 7 月 1 日前，本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，本基金佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究

服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	208,858.74	151,190.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,552.87	991.88
应支付基金管理人的净管理费	205,305.87	150,198.41

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,619.62	50,396.73

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	86,002,156.00	46.2604%	154,307,655.00	61.9936%
广发证券股份有限公司	1,764,820.00	0.9493%	1,168,385.00	0.4694%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	5,900,111.70	10,520.53	6,129,458.41	10,333.80

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
万联证券股份有限公司	837023	芭薇股份	新股发行	200	1,154.00

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，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，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券和托管人建设银行发行的 A 股建设银行。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 24,800 股（2024 年 12 月 31 日:33,200 股），占本基金净值比例为 0.17%(2024 年 12 月 31 日:0.17%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 71,400 股（2024 年 12 月 31 日:73,200 股），占本基金净值比例为 0.27%(2024 年 12 月 31 日:0.20%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月以内	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	335	9,212.50	18,823.65	-
301458	钧威电子	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	305	8,383.20	13,792.10	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-

301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	61	5,465.60	8,508.28	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	134	3,551.00	4,379.12	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	46	4,301.00	4,170.36	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-

				受限						
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	212	10,021.24	26,321.92	-

注：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，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

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。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。于 2025 年 6 月 30 日，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，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,900,111.70	-	-	-	5,900,111.70
结算备付金	2,510,103.86	-	-	-	2,510,103.86
存出保证金	1,147,097.54	-	-	-	1,147,097.54
交易性金融资产	-	-	-	237,578,083.72	237,578,083.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,622,528.37	1,622,528.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	9,557,313.10	-	-	239,276,228.33	248,833,541.43

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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	869,495.54	869,495.54
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	30,560.37	30,560.37
应付托管费	-	-	-	10,186.80	10,186.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	860,458.54	860,458.54
负债总计	-	-	-	1,770,701.25	1,770,701.25
利率敏感度缺口	9,557,313.10	-	-	237,505,527.08	247,062,840.18
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,123,999.85	-	-	-	6,123,999.85
结算备付金	2,452,183.08	-	-	-	2,452,183.08
存出保证金	1,145,057.38	-	-	-	1,145,057.38
交易性金融资产	-	-	-	306,760,471.58	306,760,471.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	21,166,503.11	21,166,503.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,721,240.31	-	-	327,926,974.69	337,648,215.00

					0
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	13,538,149.17	13,538,149.17
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	36,733.64	36,733.64
应付托管费	-	-	-	12,244.54	12,244.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,252,635.67	3,252,635.67
负债总计	-	-	-	16,839,763.02	16,839,763.02
利率敏感度缺口	9,721,240.31	-	-	311,087,211.67	320,808,451.98

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	237,578,083.72	96.16	306,760,471.58	95.62
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	237,578,083.72	96.16	306,760,471.58	95.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	11,863,768.82	15,330,037.54
	2.业绩比较基准下降 5%	-11,863,768.82	-15,330,037.54

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
---------------	-----

	2025 年 6 月 30 日
第一层次	237,178,330.46
第二层次	15,385.54
第三层次	384,367.72
合计	237,578,083.72

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	237,578,083.72	95.48
	其中：股票	237,578,083.72	95.48
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	8,410,215.56	3.38
8	其他各项资产	2,845,242.15	1.14
9	合计	248,833,541.43	100.00

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	1,880,518.20	0.76
B	采矿业	10,942,691.15	4.43
C	制造业	127,469,956.39	51.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,312,149.30	3.36
E	建筑业	3,824,413.60	1.55
F	批发和零售业	1,772,295.58	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	7,180,781.40	2.91
H	住宿和餐饮业	164,400.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,145,888.11	5.73
J	金融业	53,220,377.72	21.54
K	房地产业	2,059,553.33	0.83
L	租赁和商务服务业	2,130,176.40	0.86
M	科学研究和技术服务业	2,293,765.42	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	259,187.64	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	126,990.00	0.05
Q	卫生和社会工作	778,582.48	0.32
R	文化、体育和娱乐业	868,656.00	0.35
S	综合	147,701.00	0.06
	合计	237,578,083.72	96.16

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,300	7,470,456.00	3.02
2	300750	宁德时代	22,140	5,584,150.80	2.26
3	601318	中国平安	90,300	5,009,844.00	2.03
4	600036	招商银行	103,747	4,767,174.65	1.93
5	601166	兴业银行	139,400	3,253,596.00	1.32
6	600900	长江电力	102,700	3,095,378.00	1.25
7	000333	美的集团	41,300	2,981,860.00	1.21
8	601899	紫金矿业	138,100	2,692,950.00	1.09
9	002594	比亚迪	7,700	2,555,707.00	1.03
10	300059	东方财富	106,028	2,452,427.64	0.99
11	600030	中信证券	81,760	2,258,211.20	0.91
12	601398	工商银行	293,900	2,230,701.00	0.90
13	600276	恒瑞医药	37,390	1,940,541.00	0.79
14	000858	五粮液	16,300	1,938,070.00	0.78
15	601211	国泰海通	94,820	1,816,751.20	0.74
16	601328	交通银行	223,800	1,790,400.00	0.72
17	000651	格力电器	37,500	1,684,500.00	0.68
18	601288	农业银行	267,800	1,574,664.00	0.64
19	600887	伊利股份	52,935	1,475,827.80	0.60
20	002475	立讯精密	42,499	1,474,290.31	0.60
21	600919	江苏银行	123,200	1,471,008.00	0.60
22	688981	中芯国际	16,586	1,462,387.62	0.59
23	603259	药明康德	20,940	1,456,377.00	0.59
24	601816	京沪高铁	246,300	1,416,225.00	0.57
25	600000	浦发银行	98,400	1,365,792.00	0.55
26	000725	京东方 A	308,100	1,229,319.00	0.50
27	002371	北方华创	2,700	1,193,967.00	0.48
28	300760	迈瑞医疗	5,100	1,146,225.00	0.46
29	601088	中国神华	27,700	1,122,958.00	0.45
30	688256	寒武纪	1,834	1,103,151.00	0.45
31	300308	中际旭创	7,520	1,096,867.20	0.44
32	688041	海光信息	7,761	1,096,551.69	0.44
33	601601	中国太保	28,700	1,076,537.00	0.44
34	300502	新易盛	8,300	1,054,266.00	0.43
35	300124	汇川技术	15,750	1,016,977.50	0.41
36	601728	中国电信	130,300	1,009,825.00	0.41
37	601668	中国建筑	173,300	999,941.00	0.40
38	600016	民生银行	208,300	989,425.00	0.40
39	000001	平安银行	81,300	981,291.00	0.40
40	002352	顺丰控股	20,100	980,076.00	0.40

41	002714	牧原股份	22,940	963,709.40	0.39
42	002230	科大讯飞	19,500	933,660.00	0.38
43	601127	赛力斯	6,900	926,808.00	0.38
44	603501	豪威集团	7,235	923,547.75	0.37
45	600031	三一重工	49,700	892,115.00	0.36
46	601229	上海银行	83,400	884,874.00	0.36
47	000063	中兴通讯	27,000	877,230.00	0.36
48	603019	中科曙光	12,320	867,328.00	0.35
49	600309	万华化学	15,800	857,308.00	0.35
50	002415	海康威视	30,900	856,857.00	0.35
51	600941	中国移动	7,600	855,380.00	0.35
52	601169	北京银行	124,200	848,286.00	0.34
53	300274	阳光电源	12,220	828,149.40	0.34
54	601857	中国石油	95,100	813,105.00	0.33
55	601919	中远海控	52,790	793,961.60	0.32
56	688008	澜起科技	9,539	782,198.00	0.32
57	600690	海尔智家	31,400	778,092.00	0.31
58	600660	福耀玻璃	13,500	769,635.00	0.31
59	601012	隆基绿能	50,912	764,698.24	0.31
60	601688	华泰证券	42,900	764,049.00	0.31
61	300498	温氏股份	44,660	762,792.80	0.31
62	002142	宁波银行	27,640	756,230.40	0.31
63	600406	国电南瑞	33,662	754,365.42	0.31
64	600809	山西汾酒	4,080	719,671.20	0.29
65	601766	中国中车	102,100	718,784.00	0.29
66	601138	工业富联	33,300	711,954.00	0.29
67	603986	兆易创新	5,596	708,061.88	0.29
68	000568	泸州老窖	6,200	703,080.00	0.28
69	000338	潍柴动力	45,500	699,790.00	0.28
70	600050	中国联通	131,000	699,540.00	0.28
71	600028	中国石化	122,300	689,772.00	0.28
72	688012	中微公司	3,771	687,453.30	0.28
73	000100	TCL 科技	157,530	682,104.90	0.28
74	601988	中国银行	120,000	674,400.00	0.27
75	601939	建设银行	71,400	674,016.00	0.27
76	300476	胜宏科技	5,000	671,900.00	0.27
77	601006	大秦铁路	101,400	669,240.00	0.27
78	600926	杭州银行	38,500	647,570.00	0.26
79	601818	光大银行	155,700	646,155.00	0.26
80	601985	中国核电	69,100	644,012.00	0.26
81	601225	陕西煤业	32,535	625,973.40	0.25
82	600104	上汽集团	38,803	622,788.15	0.25
83	002027	分众传媒	84,800	619,040.00	0.25

84	600150	中国船舶	18,800	611,752.00	0.25
85	688111	金山办公	2,055	575,502.75	0.23
86	601009	南京银行	49,317	573,063.54	0.23
87	601628	中国人寿	13,900	572,541.00	0.23
88	605499	东鹏饮料	1,800	565,290.00	0.23
89	688271	联影医疗	4,283	547,110.42	0.22
90	600999	招商证券	31,040	545,993.60	0.22
91	603288	海天味业	13,912	541,315.92	0.22
92	000425	徐工机械	69,100	536,907.00	0.22
93	600760	中航沈飞	9,144	536,021.28	0.22
94	000625	长安汽车	41,732	532,500.32	0.22
95	000792	盐湖股份	31,000	529,480.00	0.21
96	600111	北方稀土	21,200	527,880.00	0.21
97	600938	中国海油	20,000	522,200.00	0.21
98	600436	片仔癀	2,600	520,026.00	0.21
99	600905	三峡能源	119,900	510,774.00	0.21
100	601888	中国中免	8,300	506,051.00	0.20
101	601658	邮储银行	92,400	505,428.00	0.20
102	600089	特变电工	42,340	505,116.20	0.20
103	002050	三花智控	18,900	498,582.00	0.20
104	603993	洛阳钼业	58,900	495,938.00	0.20
105	300033	同花顺	1,800	491,418.00	0.20
106	300015	爱尔眼科	39,150	488,592.00	0.20
107	600048	保利发展	60,200	487,620.00	0.20
108	600019	宝钢股份	73,500	484,365.00	0.20
109	601390	中国中铁	86,200	483,582.00	0.20
110	600547	山东黄金	15,100	482,143.00	0.20
111	002463	沪电股份	11,300	481,154.00	0.19
112	002241	歌尔股份	20,400	475,728.00	0.19
113	600415	小商品城	23,000	475,640.00	0.19
114	300014	亿纬锂能	10,303	471,980.43	0.19
115	601825	沪农商行	48,500	470,450.00	0.19
116	601600	中国铝业	66,500	468,160.00	0.19
117	601989	中国重工	95,700	444,048.00	0.18
118	000977	浪潮信息	8,600	437,568.00	0.18
119	600585	海螺水泥	20,100	431,547.00	0.17
120	002179	中航光电	10,660	430,237.60	0.17
121	600893	航发动力	11,160	430,106.40	0.17
122	601916	浙商银行	126,400	428,496.00	0.17
123	600570	恒生电子	12,769	428,272.26	0.17
124	601838	成都银行	21,300	428,130.00	0.17
125	600958	东方证券	43,788	423,867.84	0.17
126	603799	华友钴业	11,440	423,508.80	0.17

127	600015	华夏银行	53,300	421,603.00	0.17
128	000538	云南白药	7,520	419,540.80	0.17
129	000776	广发证券	24,800	416,888.00	0.17
130	002311	海大集团	7,000	410,130.00	0.17
131	601336	新华保险	7,000	409,500.00	0.17
132	600584	长电科技	12,000	404,280.00	0.16
133	000938	紫光股份	16,780	402,552.20	0.16
134	000988	华工科技	8,300	390,183.00	0.16
135	600438	通威股份	22,700	380,225.00	0.15
136	002028	思源电气	5,200	379,132.00	0.15
137	000166	申万宏源	75,500	379,010.00	0.15
138	300408	三环集团	11,300	377,420.00	0.15
139	601998	中信银行	44,400	377,400.00	0.15
140	002049	紫光国微	5,680	374,084.80	0.15
141	300433	蓝思科技	16,700	372,410.00	0.15
142	601077	渝农商行	52,000	371,280.00	0.15
143	000002	万科 A	57,100	366,582.00	0.15
144	600795	国电电力	74,900	362,516.00	0.15
145	601377	兴业证券	58,000	359,020.00	0.15
146	600489	中金黄金	24,500	358,435.00	0.15
147	601669	中国电建	72,200	351,614.00	0.14
148	601689	拓普集团	7,355	347,523.75	0.14
149	601995	中金公司	9,800	346,528.00	0.14
150	600988	赤峰黄金	13,900	345,832.00	0.14
151	300339	润和软件	6,700	340,561.00	0.14
152	600010	宝钢股份	190,000	340,100.00	0.14
153	002422	科伦药业	9,300	334,056.00	0.14
154	600009	上海机场	10,400	330,408.00	0.13
155	002966	苏州银行	37,460	328,898.80	0.13
156	600160	巨化股份	11,300	324,084.00	0.13
157	601100	恒立液压	4,496	323,712.00	0.13
158	002304	洋河股份	5,000	322,750.00	0.13
159	000768	中航西飞	11,700	319,878.00	0.13
160	688036	传音控股	3,981	317,285.70	0.13
161	002460	赣锋锂业	9,380	316,762.60	0.13
162	601881	中国银河	18,300	313,845.00	0.13
163	601186	中国铁建	38,600	309,186.00	0.13
164	300394	天孚通信	3,860	308,182.40	0.12
165	600183	生益科技	10,200	307,530.00	0.12
166	002252	上海莱士	44,500	305,715.00	0.12
167	000157	中联重科	41,800	302,214.00	0.12
168	600839	四川长虹	30,900	300,348.00	0.12
169	601360	三六零	29,400	299,880.00	0.12

170	000963	华东医药	7,400	298,664.00	0.12
171	600989	宝丰能源	18,500	298,590.00	0.12
172	600886	国投电力	20,100	296,274.00	0.12
173	601788	光大证券	16,400	294,872.00	0.12
174	689009	九号公司	4,971	294,134.07	0.12
175	601162	天风证券	59,510	293,384.30	0.12
176	002074	国轩高科	9,000	292,140.00	0.12
177	601555	东吴证券	33,368	291,970.00	0.12
178	601058	赛轮轮胎	22,100	289,952.00	0.12
179	600115	中国东航	71,800	289,354.00	0.12
180	300442	润泽科技	5,800	287,274.00	0.12
181	688521	芯原股份	2,974	286,991.00	0.12
182	000408	藏格矿业	6,600	281,622.00	0.11
183	002736	国信证券	24,300	279,936.00	0.11
184	000807	云铝股份	17,500	279,650.00	0.11
185	000661	长春高新	2,800	277,704.00	0.11
186	002517	恺英网络	14,300	276,133.00	0.11
187	002001	新和成	12,976	275,999.52	0.11
188	600066	宇通客车	11,100	275,946.00	0.11
189	002466	天齐锂业	8,600	275,544.00	0.11
190	601901	方正证券	34,600	273,686.00	0.11
191	603893	瑞芯微	1,800	273,348.00	0.11
192	002340	格林美	42,900	272,415.00	0.11
193	688169	石头科技	1,737	271,927.35	0.11
194	600426	华鲁恒升	12,540	271,741.80	0.11
195	002558	巨人网络	11,400	268,470.00	0.11
196	002195	岩山科技	47,600	267,988.00	0.11
197	001979	招商蛇口	30,500	267,485.00	0.11
198	600029	南方航空	45,200	266,680.00	0.11
199	600196	复星医药	10,600	265,954.00	0.11
200	601800	中国交建	29,900	265,811.00	0.11
201	002236	大华股份	16,600	263,608.00	0.11
202	000975	山金国际	13,900	263,266.00	0.11
203	600011	华能国际	36,810	262,823.40	0.11
204	301236	软通动力	4,800	262,272.00	0.11
205	601066	中信建投	10,900	262,145.00	0.11
206	300661	圣邦股份	3,602	262,117.54	0.11
207	600674	川投能源	16,300	261,452.00	0.11
208	688126	沪硅产业	13,852	259,309.44	0.10
209	002156	通富微电	10,100	258,762.00	0.10
210	002261	拓维信息	8,300	256,885.00	0.10
211	688608	恒玄科技	728	253,329.44	0.10
212	600487	亨通光电	16,500	252,450.00	0.10

213	600346	恒力石化	17,700	252,402.00	0.10
214	601878	浙商证券	23,000	250,930.00	0.10
215	002797	第一创业	35,300	249,924.00	0.10
216	600157	永泰能源	186,400	249,776.00	0.10
217	300251	光线传媒	12,300	249,321.00	0.10
218	300418	昆仑万维	7,400	248,862.00	0.10
219	300207	欣旺达	12,400	248,744.00	0.10
220	601111	中国国航	31,400	247,746.00	0.10
221	002916	深南电路	2,288	246,669.28	0.10
222	603369	今世缘	6,300	245,259.00	0.10
223	002920	德赛西威	2,400	245,112.00	0.10
224	688777	中控技术	5,438	244,220.58	0.10
225	002648	卫星化学	14,080	244,006.40	0.10
226	600372	中航机载	20,200	243,612.00	0.10
227	601868	中国能建	108,720	242,445.60	0.10
228	688120	华海清科	1,435	242,084.50	0.10
229	600460	士兰微	9,700	240,754.00	0.10
230	003816	中国广核	66,000	240,240.00	0.10
231	688617	惠泰医疗	808	239,976.00	0.10
232	000066	中国长城	16,200	239,760.00	0.10
233	688213	思特威	2,333	238,479.26	0.10
234	301269	华大九天	1,900	235,372.00	0.10
235	600096	云天化	10,700	235,079.00	0.10
236	600741	华域汽车	13,300	234,745.00	0.10
237	601117	中国化学	30,600	234,702.00	0.09
238	002273	水晶光电	11,700	233,649.00	0.09
239	601319	中国人保	26,800	233,428.00	0.09
240	688235	百济神州	997	232,939.08	0.09
241	002465	海格通信	16,700	232,798.00	0.09
242	300803	指南针	2,880	232,300.80	0.09
243	600879	航天电子	22,100	231,387.00	0.09
244	688506	百利天恒	781	231,269.72	0.09
245	601168	西部矿业	13,900	231,157.00	0.09
246	600536	中国软件	4,940	231,043.80	0.09
247	600588	用友网络	17,191	229,843.67	0.09
248	300347	泰格医药	4,300	229,276.00	0.09
249	600176	中国巨石	20,101	229,151.40	0.09
250	302132	中航成飞	2,600	228,644.00	0.09
251	601021	春秋航空	4,100	228,165.00	0.09
252	000831	中国稀土	6,300	227,556.00	0.09
253	300450	先导智能	9,100	226,135.00	0.09
254	002601	龙佰集团	13,900	225,319.00	0.09
255	601099	太平洋	57,200	224,796.00	0.09

256	601633	长城汽车	10,400	223,392.00	0.09
257	600219	南山铝业	58,300	223,289.00	0.09
258	000786	北新建材	8,400	222,432.00	0.09
259	600352	浙江龙盛	21,800	221,488.00	0.09
260	000933	神火股份	13,300	221,312.00	0.09
261	300782	卓胜微	3,100	221,247.00	0.09
262	688396	华润微	4,675	220,473.00	0.09
263	300896	爱美客	1,260	220,260.60	0.09
264	300017	网宿科技	20,500	219,760.00	0.09
265	600885	宏发股份	9,792	218,459.52	0.09
266	002294	信立泰	4,600	217,718.00	0.09
267	002185	华天科技	21,500	217,150.00	0.09
268	600482	中国动力	9,400	216,858.00	0.09
269	600039	四川路桥	21,880	216,612.00	0.09
270	601108	财通证券	27,220	215,310.20	0.09
271	000630	铜陵有色	64,300	214,762.00	0.09
272	688002	睿创微纳	3,055	212,994.60	0.09
273	002493	荣盛石化	25,400	210,312.00	0.09
274	000895	双汇发展	8,600	209,926.00	0.08
275	603296	华勤技术	2,600	209,768.00	0.08
276	600085	同仁堂	5,800	209,148.00	0.08
277	002129	TCL 中环	27,075	207,936.00	0.08
278	300454	深信服	2,200	207,196.00	0.08
279	688122	西部超导	3,980	206,482.40	0.08
280	001965	招商公路	17,200	206,400.00	0.08
281	601128	常熟银行	27,791	204,819.67	0.08
282	002709	天赐材料	11,240	203,668.80	0.08
283	002600	领益智造	23,600	202,724.00	0.08
284	601877	正泰电器	8,900	201,763.00	0.08
285	600362	江西铜业	8,600	201,498.00	0.08
286	600600	青岛啤酒	2,900	201,434.00	0.08
287	688099	晶晨股份	2,832	201,100.32	0.08
288	601577	长沙银行	20,200	200,788.00	0.08
289	300474	景嘉微	2,750	200,750.00	0.08
290	002130	沃尔核材	8,400	200,088.00	0.08
291	600079	人福医药	9,500	199,310.00	0.08
292	688469	芯联集成	41,664	198,737.28	0.08
293	002085	万丰奥威	12,500	198,625.00	0.08
294	000997	新大陆	6,100	197,518.00	0.08
295	002281	光迅科技	4,000	197,280.00	0.08
296	002738	中矿资源	6,100	196,176.00	0.08
297	002595	豪迈科技	3,300	195,426.00	0.08
298	002532	天山铝业	23,500	195,285.00	0.08

299	300058	蓝色光标	29,740	195,094.40	0.08
300	300122	智飞生物	9,950	194,920.50	0.08
301	603129	春风动力	900	194,850.00	0.08
302	300002	神州泰岳	16,500	194,700.00	0.08
303	000423	东阿阿胶	3,700	193,510.00	0.08
304	000783	长江证券	27,800	192,654.00	0.08
305	002138	顺络电子	6,800	191,216.00	0.08
306	600109	国金证券	21,800	191,186.00	0.08
307	002472	双环传动	5,700	190,893.00	0.08
308	600161	天坛生物	9,929	190,537.51	0.08
309	300458	全志科技	4,800	190,512.00	0.08
310	002180	纳思达	8,300	190,402.00	0.08
311	603392	万泰生物	3,100	189,100.00	0.08
312	688525	佰维存储	2,797	188,517.80	0.08
313	002078	太阳纸业	14,000	188,440.00	0.08
314	002410	广联达	13,940	186,935.40	0.08
315	300223	北京君正	2,700	186,840.00	0.08
316	002436	兴森科技	14,100	186,684.00	0.08
317	000596	古井贡酒	1,400	186,410.00	0.08
318	601933	永辉超市	38,000	186,200.00	0.08
319	688578	艾力斯	1,999	185,986.96	0.08
320	002938	鹏鼎控股	5,800	185,774.00	0.08
321	600233	圆通速递	14,400	185,616.00	0.08
322	600862	中航高科	7,100	185,168.00	0.07
323	000301	东方盛虹	22,200	184,926.00	0.07
324	300759	康龙化成	7,500	184,050.00	0.07
325	300136	信维通信	8,200	183,680.00	0.07
326	300346	南大光电	5,800	183,512.00	0.07
327	600143	金发科技	17,712	182,610.72	0.07
328	688047	龙芯中科	1,368	182,477.52	0.07
329	601198	东兴证券	16,300	181,745.00	0.07
330	600188	兖矿能源	14,925	181,637.25	0.07
331	300832	新产业	3,200	181,504.00	0.07
332	002065	东华软件	18,900	181,440.00	0.07
333	603596	伯特利	3,440	181,253.60	0.07
334	002850	科达利	1,600	181,072.00	0.07
335	300765	新诺威	3,500	180,915.00	0.07
336	300857	协创数据	2,100	180,726.00	0.07
337	300054	鼎龙股份	6,300	180,684.00	0.07
338	002851	麦格米特	3,600	180,504.00	0.07
339	300024	机器人	10,500	180,390.00	0.07
340	600873	梅花生物	16,800	179,592.00	0.07
341	600580	卧龙电驱	9,080	179,511.60	0.07

342	600298	安琪酵母	5,100	179,367.00	0.07
343	000876	新希望	19,100	179,158.00	0.07
344	600023	浙能电力	33,800	179,140.00	0.07
345	002353	杰瑞股份	5,100	178,500.00	0.07
346	002202	金风科技	17,400	178,350.00	0.07
347	601618	中国中冶	59,800	178,204.00	0.07
348	688072	拓荆科技	1,159	178,149.89	0.07
349	002223	鱼跃医疗	5,000	178,000.00	0.07
350	002673	西部证券	22,500	177,300.00	0.07
351	000034	神州数码	4,700	176,908.00	0.07
352	603606	东方电缆	3,400	175,814.00	0.07
353	600363	联创光电	3,000	174,990.00	0.07
354	000999	华润三九	5,585	174,698.80	0.07
355	688223	晶科能源	33,652	174,653.88	0.07
356	601615	明阳智能	15,200	174,648.00	0.07
357	603605	珀莱雅	2,100	173,859.00	0.07
358	300395	菲利华	3,400	173,740.00	0.07
359	000728	国元证券	21,940	173,106.60	0.07
360	300383	光环新网	12,100	173,030.00	0.07
361	002008	大族激光	7,100	173,027.00	0.07
362	002624	完美世界	11,350	172,179.50	0.07
363	300496	中科创达	3,000	171,660.00	0.07
364	600845	宝信软件	7,263	171,552.06	0.07
365	300115	长盈精密	8,000	171,200.00	0.07
366	600875	东方电气	10,200	170,748.00	0.07
367	000021	深科技	9,100	170,534.00	0.07
368	603160	汇顶科技	2,400	170,472.00	0.07
369	688220	翱捷科技	2,174	170,224.20	0.07
370	601872	招商轮船	27,080	169,520.80	0.07
371	600549	厦门钨业	8,100	169,452.00	0.07
372	600515	海南机场	47,800	169,212.00	0.07
373	601898	中煤能源	15,300	167,382.00	0.07
374	600895	张江高科	6,500	167,050.00	0.07
375	603659	璞泰来	8,865	166,484.70	0.07
376	002459	晶澳科技	16,656	166,226.88	0.07
377	000426	兴业银锡	10,400	164,320.00	0.07
378	300012	华测检测	14,000	163,660.00	0.07
379	688361	中科飞测	1,940	163,328.60	0.07
380	002155	湖南黄金	9,090	162,256.50	0.07
381	300604	长川科技	3,600	161,676.00	0.07
382	688180	君实生物	4,752	161,472.96	0.07
383	600171	上海贝岭	4,700	160,975.00	0.07
384	600061	国投资本	21,404	160,958.08	0.07

385	000733	振华科技	3,200	160,160.00	0.06
386	300627	华测导航	4,560	159,600.00	0.06
387	603087	甘李药业	2,900	158,862.00	0.06
388	688599	天合光能	10,927	158,769.31	0.06
389	605589	圣泉集团	5,700	158,175.00	0.06
390	601216	君正集团	28,300	156,216.00	0.06
391	605117	德业股份	2,964	156,084.24	0.06
392	600027	华电国际	28,500	155,895.00	0.06
393	600332	白云山	5,900	155,524.00	0.06
394	000519	中兵红箭	7,100	155,419.00	0.06
395	600392	盛和资源	11,800	155,406.00	0.06
396	300699	光威复材	4,900	155,183.00	0.06
397	601665	齐鲁银行	24,500	154,840.00	0.06
398	000617	中油资本	21,200	154,760.00	0.06
399	000750	国海证券	37,480	154,417.60	0.06
400	002821	凯莱英	1,740	153,555.00	0.06
401	601997	贵阳银行	24,600	153,504.00	0.06
402	000932	华菱钢铁	34,800	153,120.00	0.06
403	002444	巨星科技	6,000	153,060.00	0.06
404	000983	山西焦煤	23,900	152,960.00	0.06
405	000729	燕京啤酒	11,800	152,574.00	0.06
406	300037	新宙邦	4,320	152,064.00	0.06
407	600060	海信视像	6,600	151,932.00	0.06
408	300003	乐普医疗	11,000	151,580.00	0.06
409	688052	纳芯微	865	150,933.85	0.06
410	600918	中泰证券	23,400	150,462.00	0.06
411	600153	建发股份	14,500	150,365.00	0.06
412	601990	南京证券	18,600	150,288.00	0.06
413	000878	云南铜业	11,800	150,096.00	0.06
414	601799	星宇股份	1,200	150,000.00	0.06
415	601717	郑煤机	9,000	149,580.00	0.06
416	300316	晶盛机电	5,500	149,325.00	0.06
417	600803	新奥股份	7,900	149,310.00	0.06
418	300001	特锐德	6,200	148,614.00	0.06
419	601696	中银证券	13,900	148,591.00	0.06
420	300142	沃森生物	13,500	148,500.00	0.06
421	601233	桐昆股份	14,000	148,400.00	0.06
422	600673	东阳光	12,700	147,701.00	0.06
423	300999	金龙鱼	5,000	147,650.00	0.06
424	688027	国盾量子	535	147,130.35	0.06
425	300628	亿联网络	4,220	146,687.20	0.06
426	600699	均胜电子	8,400	146,496.00	0.06
427	002414	高德红外	14,237	145,929.25	0.06

428	002837	英维克	4,900	145,579.00	0.06
429	601698	中国卫通	7,100	145,337.00	0.06
430	300373	扬杰科技	2,800	145,320.00	0.06
431	600369	西南证券	33,400	145,290.00	0.06
432	688065	凯赛生物	3,075	144,832.50	0.06
433	300073	当升科技	3,300	144,771.00	0.06
434	603345	安井食品	1,800	144,756.00	0.06
435	603979	金诚信	3,100	143,964.00	0.06
436	600521	华海药业	7,700	143,451.00	0.06
437	600025	华能水电	15,000	143,250.00	0.06
438	002007	华兰生物	9,080	142,283.60	0.06
439	600177	雅戈尔	19,468	142,116.40	0.06
440	601059	信达证券	8,300	141,930.00	0.06
441	688188	柏楚电子	1,064	140,086.24	0.06
442	600118	中国卫星	4,900	139,993.00	0.06
443	600398	海澜之家	20,100	139,896.00	0.06
444	002152	广电运通	10,400	139,776.00	0.06
445	601238	广汽集团	18,600	139,314.00	0.06
446	000738	航发控制	6,700	139,025.00	0.06
447	000893	亚钾国际	4,600	138,644.00	0.06
448	600909	华安证券	23,640	137,821.20	0.06
449	600704	物产中大	26,100	137,547.00	0.06
450	300413	芒果超媒	6,300	137,466.00	0.06
451	603260	合盛硅业	2,900	137,460.00	0.06
452	000623	吉林敖东	8,100	137,295.00	0.06
453	600435	北方导航	8,800	137,192.00	0.06
454	002409	雅克科技	2,500	136,725.00	0.06
455	300748	金力永磁	5,720	136,364.80	0.06
456	600765	中航重机	8,040	135,715.20	0.05
457	300757	罗博特科	900	134,973.00	0.05
458	600497	驰宏锌锗	25,500	134,895.00	0.05
459	002044	美年健康	26,200	134,668.00	0.05
460	002958	青农商行	37,200	134,292.00	0.05
461	600018	上港集团	23,500	134,185.00	0.05
462	000009	中国宝安	15,100	134,088.00	0.05
463	688249	晶合集成	6,607	133,923.89	0.05
464	600141	兴发集团	6,500	133,445.00	0.05
465	002318	久立特材	5,700	133,323.00	0.05
466	688385	复旦微电	2,704	133,226.08	0.05
467	600038	中直股份	3,400	131,954.00	0.05
468	600316	洪都航空	3,500	131,950.00	0.05
469	603179	新泉股份	2,800	131,516.00	0.05
470	600563	法拉电子	1,200	130,908.00	0.05

471	000528	柳工	13,600	130,696.00	0.05
472	000400	许继电气	6,000	130,620.00	0.05
473	300724	捷佳伟创	2,400	130,320.00	0.05
474	001696	宗申动力	5,800	130,210.00	0.05
475	600155	华创云信	18,700	130,152.00	0.05
476	600562	国睿科技	4,100	129,109.00	0.05
477	002683	广东宏大	3,800	128,972.00	0.05
478	300919	中伟股份	3,920	128,889.60	0.05
479	688017	绿的谐波	1,030	128,636.70	0.05
480	000960	锡业股份	8,400	128,520.00	0.05
481	300558	贝达药业	2,200	127,490.00	0.05
482	002607	中公教育	41,500	126,990.00	0.05
483	601607	上海医药	7,100	126,948.00	0.05
484	688568	中科星图	3,506	126,251.06	0.05
485	600637	东方明珠	16,900	126,243.00	0.05
486	600498	烽火通信	6,000	126,180.00	0.05
487	600884	杉杉股份	13,300	125,818.00	0.05
488	603228	景旺电子	3,000	125,520.00	0.05
489	600529	山东药玻	5,600	123,984.00	0.05
490	603939	益丰药房	5,060	123,818.20	0.05
491	600486	扬农化工	2,130	123,540.00	0.05
492	002025	航天电器	2,400	123,384.00	0.05
493	300623	捷捷微电	4,100	122,180.00	0.05
494	002739	万达电影	10,600	121,158.00	0.05
495	000039	中集集团	15,400	121,044.00	0.05
496	600026	中远海能	11,700	120,861.00	0.05
497	000415	渤海租赁	36,200	120,546.00	0.05
498	300763	锦浪科技	2,076	119,141.64	0.05
499	688114	华大智造	1,835	118,963.05	0.05
500	002926	华西证券	13,300	118,902.00	0.05
501	600901	江苏金租	19,580	118,654.80	0.05
502	300679	电连技术	2,600	117,988.00	0.05
503	000887	中鼎股份	6,700	117,853.00	0.05
504	688303	大全能源	5,526	117,814.32	0.05
505	002841	视源股份	3,400	117,640.00	0.05
506	002385	大北农	28,900	116,756.00	0.05
507	688582	芯动联科	1,736	116,659.20	0.05
508	603486	科沃斯	2,000	116,460.00	0.05
509	300285	国瓷材料	6,700	116,245.00	0.05
510	600132	重庆啤酒	2,100	115,710.00	0.05
511	301358	湖南裕能	3,700	115,403.00	0.05
512	002653	海思科	2,700	113,994.00	0.05
513	002939	长城证券	13,600	113,968.00	0.05

514	300144	宋城演艺	13,280	113,544.00	0.05
515	688472	阿特斯	12,402	113,478.30	0.05
516	600763	通策医疗	2,741	113,148.48	0.05
517	600820	隧道股份	18,500	112,850.00	0.05
518	600863	内蒙华电	27,400	112,614.00	0.05
519	603806	福斯特	8,639	111,961.44	0.05
520	002568	百润股份	4,360	111,659.60	0.05
521	603195	公牛集团	2,314	111,650.50	0.05
522	000723	美锦能源	25,800	111,456.00	0.05
523	600008	首创环保	36,850	111,287.00	0.05
524	688009	中国通号	21,616	111,106.24	0.04
525	688183	生益电子	2,162	110,694.40	0.04
526	300487	蓝晓科技	2,200	110,660.00	0.04
527	600390	五矿资本	18,900	110,187.00	0.04
528	600516	方大炭素	23,660	109,782.40	0.04
529	002064	华峰化学	16,600	109,726.00	0.04
530	300676	华大基因	2,200	109,494.00	0.04
531	603568	伟明环保	5,733	109,385.64	0.04
532	002080	中材科技	5,600	109,200.00	0.04
533	688538	和辉光电	46,527	108,873.18	0.04
534	000703	恒逸石化	18,490	108,721.20	0.04
535	600998	九州通	21,087	108,387.18	0.04
536	600166	福田汽车	39,900	108,129.00	0.04
537	000513	丽珠集团	3,000	108,120.00	0.04
538	002312	川发龙蟒	9,400	107,912.00	0.04
539	600170	上海建工	44,700	106,833.00	0.04
540	600312	平高电气	6,900	106,191.00	0.04
541	002262	恩华药业	5,100	105,978.00	0.04
542	600208	衢州发展	35,800	105,968.00	0.04
543	002432	九安医疗	2,900	105,647.00	0.04
544	002500	山西证券	18,090	105,645.60	0.04
545	601179	中国西电	17,200	105,608.00	0.04
546	601699	潞安环能	10,000	105,500.00	0.04
547	601155	新城控股	7,698	105,308.64	0.04
548	605358	立昂微	4,500	104,850.00	0.04
549	603816	顾家家居	4,100	104,632.00	0.04
550	000683	博源化工	21,800	104,422.00	0.04
551	603338	浙江鼎力	2,200	104,280.00	0.04
552	600021	上海电力	11,800	103,722.00	0.04
553	002203	海亮股份	10,000	103,200.00	0.04
554	300567	精测电子	1,700	103,037.00	0.04
555	600985	淮北矿业	9,000	102,060.00	0.04
556	600126	杭钢股份	11,300	101,700.00	0.04

557	600583	海油工程	18,600	101,556.00	0.04
558	002244	滨江集团	10,400	101,400.00	0.04
559	601000	唐山港	24,900	101,094.00	0.04
560	603379	三美股份	2,100	101,052.00	0.04
561	000591	太阳能	23,000	100,970.00	0.04
562	601236	红塔证券	11,920	100,962.40	0.04
563	603589	口子窖	2,900	100,920.00	0.04
564	600348	华阳股份	15,100	100,566.00	0.04
565	000403	派林生物	5,540	100,440.20	0.04
566	600380	健康元	9,100	100,373.00	0.04
567	000060	中金岭南	21,900	100,302.00	0.04
568	688278	特宝生物	1,390	100,232.90	0.04
569	002603	以岭药业	7,100	100,110.00	0.04
570	688187	时代电气	2,342	99,886.30	0.04
571	000629	钒钛股份	39,000	99,840.00	0.04
572	603885	吉祥航空	7,400	99,678.00	0.04
573	000830	鲁西化工	9,600	98,880.00	0.04
574	600872	中炬高新	5,200	98,800.00	0.04
575	000708	中信特钢	8,400	98,784.00	0.04
576	600535	天士力	6,300	98,595.00	0.04
577	601991	大唐发电	31,100	98,587.00	0.04
578	688728	格科微	6,358	97,913.20	0.04
579	601880	辽港股份	65,200	97,800.00	0.04
580	000921	海信家电	3,800	97,660.00	0.04
581	002056	横店东磁	6,900	97,635.00	0.04
582	002439	启明星辰	6,100	97,539.00	0.04
583	002984	森麒麟	5,200	97,500.00	0.04
584	600816	建元信托	33,000	97,350.00	0.04
585	601865	福莱特	6,400	97,344.00	0.04
586	301308	江波龙	1,100	96,239.00	0.04
587	300146	汤臣倍健	8,500	95,540.00	0.04
588	603737	三棵树	2,592	95,515.20	0.04
589	002423	中粮资本	7,800	95,394.00	0.04
590	600095	湘财股份	9,500	95,285.00	0.04
591	600970	中材国际	11,100	95,238.00	0.04
592	688297	中无人机	1,778	94,945.20	0.04
593	603927	中科软	4,880	94,379.20	0.04
594	601016	节能风电	32,590	94,185.10	0.04
595	600499	科达制造	9,600	94,080.00	0.04
596	000636	风华高科	6,800	93,432.00	0.04
597	688082	盛美上海	818	93,202.92	0.04
598	000958	电投产融	13,600	93,024.00	0.04
599	603000	人民网	4,600	92,966.00	0.04

600	601611	中国核建	10,100	92,819.00	0.04
601	601666	平煤股份	12,500	92,625.00	0.04
602	600685	中船防务	3,400	92,446.00	0.04
603	688520	神州细胞	1,543	92,348.55	0.04
604	300390	天华新能	4,840	92,298.80	0.04
605	603298	杭叉集团	4,400	92,180.00	0.04
606	000563	陕国投 A	25,700	91,749.00	0.04
607	600859	王府井	6,600	91,674.00	0.04
608	603833	欧派家居	1,622	91,561.90	0.04
609	300212	易华录	4,200	91,392.00	0.04
610	000062	深圳华强	3,400	91,324.00	0.04
611	601966	玲珑轮胎	6,200	90,954.00	0.04
612	000598	兴蓉环境	12,600	90,846.00	0.04
613	603077	和邦生物	51,900	90,825.00	0.04
614	600655	豫园股份	16,300	90,465.00	0.04
615	301536	星辰科技	1,500	90,450.00	0.04
616	600511	国药股份	3,100	90,396.00	0.04
617	000155	川能动力	9,200	90,344.00	0.04
618	600325	华发股份	18,500	90,095.00	0.04
619	600004	白云机场	9,900	90,090.00	0.04
620	601456	国联民生	8,700	90,045.00	0.04
621	601958	金钼股份	8,200	89,708.00	0.04
622	600483	福能股份	9,300	89,652.00	0.04
623	601136	首创证券	4,500	89,460.00	0.04
624	002756	永兴材料	2,800	88,900.00	0.04
625	603156	养元饮品	4,200	88,872.00	0.04
626	600131	国网信通	5,000	88,500.00	0.04
627	688301	奕瑞科技	1,009	88,398.49	0.04
628	603290	斯达半导	1,080	87,771.60	0.04
629	000050	深天马 A	10,300	87,756.00	0.04
630	600663	陆家嘴	9,900	87,714.00	0.04
631	300677	英科医疗	3,700	87,616.00	0.04
632	002507	涪陵榨菜	6,840	87,483.60	0.04
633	603899	晨光股份	3,000	86,970.00	0.04
634	002773	康弘药业	3,000	86,910.00	0.04
635	000987	越秀资本	12,660	86,847.60	0.04
636	601001	晋控煤业	7,100	86,762.00	0.04
637	688234	天岳先进	1,480	86,654.00	0.04
638	600378	昊华科技	3,200	86,624.00	0.04
639	600282	南钢股份	20,600	86,520.00	0.04
639	600598	北大荒	6,000	86,520.00	0.04
641	688363	华熙生物	1,683	86,422.05	0.03
642	300529	健帆生物	4,000	86,280.00	0.03

643	603728	鸣志电器	1,500	86,205.00	0.03
644	000951	中国重汽	4,900	86,142.00	0.03
645	300601	康泰生物	5,660	85,975.40	0.03
646	600271	航天信息	9,300	85,932.00	0.03
647	300751	迈为股份	1,232	85,697.92	0.03
648	600754	锦江酒店	3,800	85,272.00	0.03
649	600739	辽宁成大	7,750	85,250.00	0.03
650	003031	中瓷电子	1,600	85,136.00	0.03
651	600764	中国海防	2,500	85,000.00	0.03
652	000559	万向钱潮	11,100	84,915.00	0.03
653	601918	新集能源	13,100	84,626.00	0.03
654	688561	奇安信	2,479	84,236.42	0.03
655	600737	中粮糖业	8,900	84,105.00	0.03
656	300888	稳健医疗	2,040	83,844.00	0.03
657	002429	兆驰股份	19,100	83,658.00	0.03
658	600329	达仁堂	2,500	83,400.00	0.03
659	600582	天地科技	13,900	83,261.00	0.03
660	603688	石英股份	2,350	82,767.00	0.03
661	601333	广深铁路	28,500	82,365.00	0.03
662	300070	碧水源	18,300	82,350.00	0.03
663	002120	韵达股份	12,200	81,740.00	0.03
664	601866	中远海发	33,000	81,510.00	0.03
665	603341	龙旗科技	2,000	81,260.00	0.03
666	688778	厦钨新能	1,444	80,748.48	0.03
667	601231	环旭电子	5,500	80,465.00	0.03
668	600867	通化东宝	9,800	80,360.00	0.03
669	688676	金盘科技	2,387	79,845.15	0.03
670	002430	杭氧股份	4,100	79,622.00	0.03
671	600995	南网储能	8,100	79,218.00	0.03
672	600258	首旅酒店	5,600	79,128.00	0.03
673	600566	济川药业	3,000	78,990.00	0.03
674	601098	中南传媒	6,000	78,720.00	0.03
675	688772	珠海冠宇	5,470	78,166.30	0.03
676	600707	彩虹股份	12,100	78,166.00	0.03
677	601212	白银有色	24,900	77,937.00	0.03
678	300735	光弘科技	3,100	77,810.00	0.03
679	000032	深桑达 A	3,800	76,874.00	0.03
680	300573	兴齐眼药	1,480	76,649.20	0.03
681	301498	乖宝宠物	700	76,559.00	0.03
682	688318	财富趋势	666	76,536.72	0.03
683	000027	深圳能源	11,960	76,304.80	0.03
684	600578	京能电力	16,900	75,881.00	0.03
685	603529	爱玛科技	2,200	75,680.00	0.03

686	000709	河钢股份	34,700	74,952.00	0.03
687	603858	步长制药	4,600	74,704.00	0.03
688	600906	财达证券	10,900	74,338.00	0.03
689	002299	圣农发展	5,200	74,308.00	0.03
690	002508	老板电器	3,900	74,139.00	0.03
691	600848	上海临港	8,167	74,074.69	0.03
692	000967	盈峰环境	10,600	73,670.00	0.03
693	000883	湖北能源	16,300	73,513.00	0.03
694	600546	山煤国际	8,400	73,332.00	0.03
695	600517	国网英大	14,300	72,930.00	0.03
696	601399	国机重装	24,300	72,900.00	0.03
697	002670	国盛金控	4,800	72,240.00	0.03
698	600959	江苏有线	20,900	71,896.00	0.03
699	601928	凤凰传媒	6,400	71,488.00	0.03
700	002831	裕同科技	3,000	70,260.00	0.03
701	600968	海油发展	17,100	69,768.00	0.03
702	601156	东航物流	5,300	69,377.00	0.03
703	600808	马钢股份	20,000	69,000.00	0.03
704	000825	太钢不锈	19,200	68,928.00	0.03
705	300595	欧普康视	4,500	68,715.00	0.03
706	600528	中铁工业	9,300	68,634.00	0.03
707	000739	普洛药业	4,900	68,600.00	0.03
708	300979	华利集团	1,300	68,341.00	0.03
709	603225	新凤鸣	6,400	68,160.00	0.03
710	601636	旗滨集团	13,600	68,136.00	0.03
711	603565	中谷物流	7,100	67,805.00	0.03
712	600977	中国电影	6,300	67,536.00	0.03
713	603650	彤程新材	2,100	67,515.00	0.03
714	601118	海南橡胶	14,300	67,496.00	0.03
715	002266	浙富控股	21,900	67,452.00	0.03
716	301301	川宁生物	5,600	67,424.00	0.03
716	601808	中海油服	4,900	67,424.00	0.03
718	002572	索菲亚	4,800	67,248.00	0.03
719	601608	中信重工	15,300	66,861.00	0.03
720	600871	石化油服	34,100	66,495.00	0.03
721	300957	贝泰妮	1,500	66,330.00	0.03
722	600801	华新水泥	5,600	66,304.00	0.03
723	000543	皖能电力	9,400	65,800.00	0.03
724	601598	中国外运	13,300	65,569.00	0.03
725	000582	北部湾港	7,900	65,175.00	0.03
726	688702	盛科通信	1,065	65,050.20	0.03
727	600056	中国医药	6,280	64,935.20	0.03
728	688387	信科移动	11,419	64,517.35	0.03

729	601106	中国一重	23,000	64,400.00	0.03
730	600062	华润双鹤	3,400	63,444.00	0.03
731	000785	居然智家	20,800	63,440.00	0.03
732	688563	航材股份	1,119	63,368.97	0.03
733	600377	宁沪高速	4,100	62,894.00	0.03
734	603233	大参林	3,800	61,940.00	0.03
735	600925	苏能股份	11,600	60,668.00	0.02
736	600373	中文传媒	5,900	60,593.00	0.02
737	002153	石基信息	6,940	60,100.40	0.02
738	688281	华秦科技	987	59,723.37	0.02
739	601965	中国汽研	3,300	58,575.00	0.02
740	000537	中绿电	7,000	58,520.00	0.02
741	600606	绿地控股	35,400	57,702.00	0.02
742	000800	一汽解放	8,400	57,624.00	0.02
743	000429	粤高速 A	4,300	57,319.00	0.02
744	603658	安图生物	1,480	55,500.00	0.02
745	600361	创新新材	13,900	55,461.00	0.02
746	601568	北元集团	13,360	55,444.00	0.02
747	002372	伟星新材	5,300	54,908.00	0.02
748	688425	铁建重工	13,435	54,814.80	0.02
749	001286	陕西能源	6,300	54,810.00	0.02
750	688349	三一重能	2,196	54,768.24	0.02
751	600612	老凤祥	1,100	54,725.00	0.02
752	600098	广州发展	8,700	54,375.00	0.02
753	600688	上海石化	18,500	52,725.00	0.02
754	003022	联泓新科	3,300	52,239.00	0.02
755	301165	锐捷网络	840	51,626.40	0.02
756	000937	冀中能源	8,800	50,600.00	0.02
757	601019	山东出版	5,200	49,244.00	0.02
758	001391	国货航	7,200	48,456.00	0.02
759	688100	威胜信息	1,278	47,349.90	0.02
760	002608	江苏国信	6,400	46,912.00	0.02
761	688411	海博思创	560	46,754.40	0.02
762	601139	深圳燃气	7,300	46,428.00	0.02
763	000898	鞍钢股份	19,900	46,168.00	0.02
764	600032	浙江新能	6,100	46,116.00	0.02
765	688248	南网科技	1,456	45,805.76	0.02
766	600339	中油工程	14,000	45,780.00	0.02
767	603707	健友股份	4,060	45,269.00	0.02
768	600720	中交设计	5,800	44,834.00	0.02
769	000959	首钢股份	13,100	44,540.00	0.02
770	600928	西安银行	11,200	43,904.00	0.02
771	003035	南网能源	9,500	43,605.00	0.02

772	603556	海兴电力	1,700	43,299.00	0.02
773	600295	鄂尔多斯	4,900	42,679.00	0.02
774	301267	华夏眼科	2,200	42,174.00	0.02
775	688475	萤石网络	1,338	42,173.76	0.02
776	688172	燕东微	2,143	42,131.38	0.02
777	601228	广州港	12,700	41,021.00	0.02
778	002461	珠江啤酒	3,600	40,644.00	0.02
779	603786	科博达	700	38,787.00	0.02
780	600007	中国国贸	1,800	37,044.00	0.01
781	688375	国博电子	617	37,026.17	0.01
782	600927	永安期货	2,500	37,025.00	0.01
783	688032	禾迈股份	366	36,548.76	0.01
784	002563	森马服饰	6,800	35,768.00	0.01
785	601061	中信金属	4,500	35,595.00	0.01
786	000539	粤电力 A	7,500	34,050.00	0.01
787	603826	坤彩科技	1,700	33,269.00	0.01
788	002945	华林证券	2,300	33,051.00	0.01
789	300140	节能环保	5,200	32,084.00	0.01
790	600299	安迪苏	3,300	31,845.00	0.01
791	688819	天能股份	1,129	31,341.04	0.01
792	001213	中铁特货	7,500	30,450.00	0.01
793	601921	浙版传媒	3,700	29,822.00	0.01
794	601858	中国科传	1,400	27,230.00	0.01
795	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
796	688775	影石创新	212	26,321.92	0.01
797	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
798	601158	重庆水务	4,800	22,272.00	0.01
799	688153	唯捷创芯	688	21,334.88	0.01
800	001289	龙源电力	1,300	21,034.00	0.01
801	600956	新天绿能	2,700	20,844.00	0.01
802	301275	汉朔科技	335	18,823.65	0.01
803	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
804	001389	广合科技	300	17,631.00	0.01
805	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
806	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
807	688295	中复神鹰	767	15,953.60	0.01
808	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
809	603868	飞科电器	400	14,348.00	0.01
810	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
811	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
812	301501	恒鑫生活	305	13,792.10	0.01
813	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
814	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00

815	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
816	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
817	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
818	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
819	301590	优优绿能	61	8,508.28	0.00
820	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
821	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
822	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
823	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
824	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
825	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
826	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
827	603014	威高血净	134	4,379.12	0.00
828	603202	天有为	46	4,170.36	0.00
829	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
830	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
831	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
832	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
833	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
834	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
835	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
836	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,921,516.40	0.60
2	601211	国泰海通	1,442,116.60	0.45
3	600519	贵州茅台	1,039,095.00	0.32
4	000333	美的集团	864,470.00	0.27
5	300059	东方财富	797,087.00	0.25
6	000858	五粮液	776,251.40	0.24
7	002594	比亚迪	742,294.00	0.23
8	601166	兴业银行	637,310.00	0.20
9	002475	立讯精密	607,607.00	0.19
10	000651	格力电器	592,085.00	0.18
11	300760	迈瑞医疗	530,106.00	0.17
12	601825	沪农商行	500,605.00	0.16
13	002230	科大讯飞	496,655.00	0.15
14	688256	寒武纪	477,035.28	0.15
15	601009	南京银行	473,843.45	0.15

16	600157	永泰能源	465,321.00	0.15
17	002371	北方华创	449,323.00	0.14
18	601058	赛轮轮胎	446,716.00	0.14
19	600036	招商银行	434,123.00	0.14
20	000725	京东方 A	434,122.00	0.14

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	3,943,263.00	1.23
2	000333	美的集团	1,849,624.00	0.58
3	002594	比亚迪	1,641,377.00	0.51
4	300059	东方财富	1,639,083.00	0.51
5	000858	五粮液	1,522,925.00	0.47
6	600837	海通证券	1,290,135.60	0.40
7	002475	立讯精密	1,220,430.00	0.38
8	000651	格力电器	1,161,167.00	0.36
9	300760	迈瑞医疗	992,572.00	0.31
10	300124	汇川技术	936,796.00	0.29
11	000725	京东方 A	892,297.00	0.28
12	002625	光启技术	806,163.00	0.25
13	002415	海康威视	713,287.00	0.22
14	002371	北方华创	710,100.00	0.22
15	000063	中兴通讯	697,681.00	0.22
16	600418	江淮汽车	691,109.00	0.22
17	002352	顺丰控股	681,536.00	0.21
18	000001	平安银行	654,747.00	0.20
19	688256	寒武纪	622,039.05	0.19
20	002384	东山精密	602,016.00	0.19

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	67,174,008.15
卖出股票收入（成交）总额	92,048,748.61

注：“买入股票成本”或“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 本基金投资股指期货的投资政策

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。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求。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。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省上杭县住房和城乡建设局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有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	1,147,097.54
2	应收清算款	1,622,528.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	2,845,242.15

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有限公司一易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,240	149,926.4	156,461,375	84.16%	29,447,468.	15.84%	86,002,156.	46.26%

	9	.00		00		00	
--	---	-----	--	----	--	----	--

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	平安资管－中国银行－平安资产夏荷 18 号资产管理产品	17,693,600.00	9.52%
2	东方证券股份有限公司	5,575,475.00	3.00%
3	重庆市叁号职业年金计划－建设银行	5,430,400.00	2.92%
4	招商康欣股票型养老金产品－中国民生银行股份有限公司	4,621,700.00	2.49%
5	张招兴	4,500,000.00	2.42%
6	中欧基金－民生银行－中欧基金民丰 1 号集合资产管理计划	3,996,200.00	2.15%
7	安徽省伍号职业年金计划－交通银行	3,894,700.00	2.09%
8	中信证券股份有限公司	3,682,875.00	1.98%
9	上海申通地铁集团有限公司企业年金计划－上海浦东发展银行股份有限公司	3,365,300.00	1.81%
10	招商基金－农业银行－北京大学教育基金会	2,917,300.00	1.57%
11	中国建设银行股份有限公司－易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	86,002,156.00	46.26%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

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	0.0000%
------------------	------	---------

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 8 日）基金份额总额	887,908,843.00
本报告期期初基金份额总额	248,908,843.00
本报告期基金总申购份额	45,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	108,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	185,908,843.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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。

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	
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	1,539,995.51	1.00%	154.09	1.00%	-
广发证券	3	35,062.00	0.02%	3.50	0.02%	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	28,762,529.42	18.60%	2,876.40	18.60%	-
申万宏源	4	77,267,275.60	49.97%	7,727.41	49.97%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	900,729.51	0.58%	90.10	0.58%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	46,121,198.24	29.83%	4,612.92	29.83%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	64,947.67	11.77%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	486,667.18	88.23%	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-01-21
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-27
3	关于易方达基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同、托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
4	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
9	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证券报	2025-03-31
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-11
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第	中国证券报	2025-04-22

	1 季度报告提示性公告		
13	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-10
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-20

§ 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	2025 年 03 月 11 日 ~2025 年 04 月 01 日	23,037,400.00	24,483,600.00	29,827,400.00	17,693,600.00	9.52%
中国建设银行股份有限公司－易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2025 年 01 月 01 日 ~2025 年 06 月 30 日	154,307,655.00	108,698,700.00	177,004,199.00	86,002,156.00	46.26 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3.《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日