

# 易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基 金

## 2022 年中期报告

### 2022 年 6 月 30 日

基金管理人：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：二〇二二年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| 1 重要提示及目录.....                               | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 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.....                 | 10 |
| 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（基金净值）变动表.....                        | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| 7 投资组合报告.....                                | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 42 |
| 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.....       | 43 |
| 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.....                    | 63 |
| 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.....      | 64 |

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 64 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 64 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 .....                      | 64 |
| 8    | 基金份额持有人信息 .....                     | 65 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 65 |
| 8.2  | 期末上市基金前十名持有人 .....                  | 66 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 66 |
| 8.4  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 67 |
| 9    | 开放式基金份额变动 .....                     | 67 |
| 10   | 重大事件揭示 .....                        | 67 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 67 |
| 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 .....   | 67 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 68 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 68 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 68 |
| 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 .....      | 68 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 68 |
| 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 .....                        | 71 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                        | 71 |
| 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   | 83,908,843.00 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<br>负责人 | 姓名   | 王玉                                | 李申                    |
|             | 联系电话 | 020-85102688                      | 021-60637102          |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn             | lishen.zh@ccb.com     |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088                      | 021-60637111          |
| 传真          |      | 020-38798812                      | 021-60635778          |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区荣粤道<br>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<br>路30号广州银行大厦40-43楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院<br>1号楼 |
| 邮政编码        |      | 510620                            | 100033                |
| 法定代表人       |      | 刘晓艳                               | 田国立                   |

## 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 | <a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼                                  |

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -6,377,512.06                        |
| 本期利润          | -7,666,782.60                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1037                              |
| 本期加权平均净值利润率   | -8.11%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | -9.02%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 27,781,703.75                        |

|                     |                              |
|---------------------|------------------------------|
| 期末可供分配基金份额利润        | 0.3311                       |
| 期末基金资产净值            | 111,690,546.75               |
| 期末基金份额净值            | 1.3311                       |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率         | 33.11%                       |

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      | 9.76%    | 1.04%       | 9.00%      | 1.05%         | 0.76%  | -0.01% |
| 过去三个月      | 6.28%    | 1.48%       | 5.20%      | 1.48%         | 1.08%  | 0.00%  |
| 过去六个月      | -9.02%   | 1.46%       | -9.97%     | 1.46%         | 0.95%  | 0.00%  |
| 过去一年       | -10.09%  | 1.21%       | -12.16%    | 1.22%         | 2.07%  | -0.01% |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 自基金合同生效起至今 | 33.11%   | 1.28%       | 20.50%     | 1.27%         | 12.61% | 0.01%  |

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

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 2022 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 33.11%，同期业绩比较基准收益率为 20.50%。

## 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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明  |
|-----|--|-------------------------|----------|----------------|---|
|     |  | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |   |
| 林伟斌 | 本基金的基金经理，易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证国有企业改革指数 | 2019-10-08              | -        | 14 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 |



|     |  |            |   |      |   |
|-----|--|------------|---|------|---|
|     | (LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达上证科创板 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接的基金经理, 指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员  |            |   |      | 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) 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 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行指数 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF 的基金经理, 易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理助理 | 2019-10-08 | - | 15 年 | 硕士研究生, 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 22 次，其中 14 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，8 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

本基金跟踪的标的指数为中证 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投资策略，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而进行相应调整。

中证 800 指数市值风格偏向于中大盘，行业分布相对均衡，指数表现跟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。报告期内，A 股市场整体走势先抑后扬，波动率维持在较高水平。2022 年初以来，受国内疫情影响，叠加地缘政治风险加剧、大宗商品价格大幅波动等不稳定因素的冲击，企业和居民的生产与消费活动受到影响，经济发展面临一定的下行压力，投资者风险偏好有所回落，A 股市场出现一定幅度的回调。在国内疫情逐步得到控制、企业复工复产有序推进、中央和地方一系列稳增长政策推出、以及流动性环境保持宽松的背景下，我国社会经济活动逐渐回归正轨，市场情绪逐渐好转，A 股市场在 4 月底出现反弹，从趋势上一直延续至本报告期末。在行业结构方面，上半年表现较好的煤炭行业对中证 800 指数的总体收益贡献有限，而指数中的其他行业均有不同程度的下跌，其中电子、计算机、传媒行业的跌幅较大，权重较大的电力设备、

食品饮料、银行行业的跌幅相对较小。本报告期内，中证 800 指数下跌 10%。

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 1.3311 元，本报告期份额净值增长率为-9.02%，同期业绩比较基准收益率为-9.97%，年化跟踪误差 0.45%，各项指标均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

展望下一阶段，国内经济和社会发展仍面临内外部挑战。统筹疫情防控和社会经济发展仍是下一阶段我国社会经济工作的重中之重，以稳增长为导向的货币与财政政策将着力于加快经济复苏的步伐。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

影响指数表现的因素可以归纳为盈利与估值的变化。盈利主要受企业自身的经营活动与宏观经济环境变化的影响，短期内发生较大变化的可能性较低。估值的波动相对较大，容易受到投资者情绪或者风险偏好的影响。长期而言，指数的表现主要取决于其成份股的持续盈利能力。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政策和程序，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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产        | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：       |         |                        |                          |
| 银行存款      | 6.4.7.1 | 3,480,684.52           | 3,888,186.85             |
| 结算备付金     |         | 1,366,260.04           | 1,712,677.72             |
| 存出保证金     |         | 725,859.93             | 820,614.95               |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 106,254,533.63         | 94,560,913.24            |
| 其中：股票投资   |         | 106,238,832.33         | 94,346,914.59            |
| 基金投资      |         | -                      | -                        |
| 债券投资      |         | 15,701.30              | 213,998.65               |
| 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     |         | 28,026.15              | 73,609.73                |
| 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              | 1,136.22                 |
| 资产总计      |         | 111,930,980.51         | 101,057,138.71           |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
| 负债：       |         |                        |                          |
| 短期借款      |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债   |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |         | -                      | -                        |
| 应付清算款     |         | 4,245.46               | 20.00                    |
| 应付赎回款     |         | -                      | -                        |
| 应付管理人报酬   |         | 12,534.98              | 13,277.13                |
| 应付托管费     |         | 4,178.32               | 4,425.73                 |
| 应付销售服务费   |         | -                      | -                        |
| 应付投资顾问费   |         | -                      | -                        |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应交税费        |         | 0.10           | -              |
| 应付利润        |         | -              | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 219,474.90     | 218,354.33     |
| 负债合计        |         | 240,433.76     | 236,077.19     |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 83,908,843.00  | 68,908,843.00  |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 27,781,703.75  | 31,912,218.52  |
| 净资产合计       |         | 111,690,546.75 | 100,821,061.52 |
| 负债和净资产总计    |         | 111,930,980.51 | 101,057,138.71 |

注：1.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3311 元，基金份额总额 83,908,843.00 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | -7,346,568.14                            | 3,079,216.20                                  |
| 1.利息收入           |          | 15,693.97                                | 18,871.55                                     |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 15,693.97                                | 18,826.61                                     |
| 债券利息收入           |          | -  | 44.94   |
| 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） |          | -5,901,388.90                            | 6,850,768.04                                  |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | -6,398,428.96                            | 5,640,377.35                                  |
| 基金投资收益           |          | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.11 | 61,652.32                                | 25,646.33                                     |
| 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 | -551,588.10          | 531,475.73          |
| 股利收益                       | 6.4.7.14 | 986,975.84           | 653,268.63          |
| 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 | -1,289,270.54        | -3,751,411.57       |
| 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 | -171,602.67          | -39,011.82          |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>320,214.46</b>    | <b>370,622.95</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 70,230.23            | 72,842.57           |
| 2. 托管费                     |          | 23,410.03            | 24,280.79           |
| 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                   |          | 0.01                 | 1,913.35            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18 | 226,574.19           | 271,586.24          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-7,666,782.60</b> | <b>2,708,593.25</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-7,666,782.60</b> | <b>2,708,593.25</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>             | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>-7,666,782.60</b> | <b>2,708,593.25</b> |

注：上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|-----------------|---------------------------------------|--------|---------------|----------------|
|                 | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 68,908,843.00                         | -      | 31,912,218.52 | 100,821,061.52 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 68,908,843.00                         | -      | 31,912,218.52 | 100,821,061.52 |

|  |  |        |                |                |
|--|--|--------|----------------|----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 15,000,000.00                              | -      | -4,130,514.77  | 10,869,485.23  |
| （一）、综合收益总额                               | -  | -      | -7,666,782.60  | -7,666,782.60  |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 15,000,000.00                              | -      | 3,536,267.83   | 18,536,267.83  |
| 其中：1.基金申购款                               | 78,000,000.00                              | -      | 21,299,904.29  | 99,299,904.29  |
| 2.基金赎回款                                  | -63,000,000.00                             | -      | -17,763,636.46 | -80,763,636.46 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -      | -              | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 83,908,843.00                              | -      | 27,781,703.75  | 111,690,546.75 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |        |                |                |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 71,908,843.00                              | -      | 31,294,078.39  | 103,202,921.39 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 71,908,843.00                              | -      | 31,294,078.39  | 103,202,921.39 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -9,000,000.00                              | -      | -1,069,890.05  | -10,069,890.05 |
| （一）、综合收益总额                               | -  | -      | 2,708,593.25   | 2,708,593.25   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -9,000,000.00                              | -      | -3,778,483.30  | -12,778,483.30 |
| 其中：1.基金申购款                               | 12,000,000.00                              | -      | 5,562,533.53   | 17,562,533.53  |
| 2.基金赎回款                                  | -21,000,000.00                             | -      | -9,341,016.83  | -30,341,016.83 |
| （三）、本期向基                                 | -  | -      | -              | -              |



|                                  |               |   |               |               |
|----------------------------------|---------------|---|---------------|---------------|
| 金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） |               |   |               |               |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                  | 62,908,843.00 | - | 30,224,188.34 | 93,133,031.34 |

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：刘晓艳，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、应用指南、解释以及其他相关规定（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基金净值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

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

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信

用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

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

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额

的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

（5）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（6）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（7）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于

以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,888,186.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 374.66 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,888,561.51 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,712,677.72 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 743.69 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,713,421.41 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 820,614.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 12.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 820,627.85 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,136.22 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 374.66 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 743.69 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 12.90 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 4.97 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 94,560,913.24 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4.97 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 94,560,918.21 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 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。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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费附加。

### （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 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 3,480,684.52           |
| 等于：本金  | 3,480,356.88           |
| 加：应计利息 | 327.64                 |
| 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             | 3,480,684.52 |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |      |                |            |
|---------------|-------|------------------------|------|----------------|------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票            |       | 105,843,583.74         | -    | 106,238,832.33 | 395,248.59 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -    | -              | -          |
| 债券            | 交易所市场 | 15,699.94              | 1.36 | 15,701.30      | -          |
|               | 银行间市场 | -                      | -    | -              | -          |
|               | 合计    | 15,699.94              | 1.36 | 15,701.30      | -          |
| 资产支持证券        |       | -                      | -    | -              | -          |
| 基金            |       | -                      | -    | -              | -          |
| 其他            |       | -                      | -    | -              | -          |
| 合计            |       | 105,859,283.68         | 1.36 | 106,254,533.63 | 395,248.59 |

## 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<br>2022 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|--------|------------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义<br>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 | 4,997,280.00           | -    | -  | -  |
| IC2209 | 3,751,920.00           | -    | -  | -  |



|        |              |   |   |   |
|--------|--------------|---|---|---|
| IF2209 | 1,245,360.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | -            | - | - | - |
| 合计     | 4,997,280.00 | - | - | - |

#### 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     |
|------------|--------|----------|--------------|------------|
| IC2209     | IC2209 | 3        | 3,818,400.00 | 66,480.00  |
| IF2209     | IF2209 | 1        | 1,334,160.00 | 88,800.00  |
| 合计         | -      | -        | -            | 155,280.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | -      | -        | -            | 155,280.00 |
| 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | -                      |
| 其他应收款 | -                      |
| 待摊费用  | 75,616.24              |
| 合计    | 75,616.24              |

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 8,634.24               |
| 其中：交易所市场    | 8,634.24               |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |

|       |            |
|-------|------------|
| 预提费用  | 101,424.66 |
| 可退替代款 | 4,416.00   |
| 其他应付款 | 105,000.00 |
| 合计    | 219,474.90 |

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 68,908,843.00                         | 68,908,843.00  |
| 本期申购          | 78,000,000.00                         | 78,000,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -63,000,000.00                        | -63,000,000.00 |
| 本期末           | 83,908,843.00                         | 83,908,843.00  |

## 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           | 40,705,507.18  | -8,793,288.66  | 31,912,218.52  |
| 本期利润           | -6,377,512.06  | -1,289,270.54  | -7,666,782.60  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,039,348.22   | -4,503,080.39  | 3,536,267.83   |
| 其中：基金申购款       | 42,358,247.03  | -21,058,342.74 | 21,299,904.29  |
| 基金赎回款          | -34,318,898.81 | 16,555,262.35  | -17,763,636.46 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 42,367,343.34  | -14,585,639.59 | 27,781,703.75  |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           |                                       |
| 活期存款利息收入  | 6,626.90                              |
| 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 | 8,731.99                              |
| 其他        | 335.08                                |
| 合计        | 15,693.97                             |

## 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
|                  |                                       |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -3,950,401.39                         |

|                  |               |
|------------------|---------------|
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -2,448,027.57 |
| 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               | -6,398,428.96 |

## 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 43,060,475.46                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 46,947,113.60                         |
| 减：交易费用     | 63,763.25                             |
| 买卖股票差价收入   | -3,950,401.39                         |

## 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 80,763,636.46                         |
| 减：现金支付赎回款总额 | 34,634,648.46                         |
| 减：赎回股票成本总额  | 48,577,015.57                         |
| 减：交易费用      | -                                     |
| 赎回差价收入      | -2,448,027.57                         |

## 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 32.99                      |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 61,619.33                  |
| 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                           | 61,652.32                  |

## 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|--------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交 | 472,055.91                 |

|                        |            |
|------------------------|------------|
| 总额                     |            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 410,398.16 |
| 减：应计利息总额               | 37.24      |
| 减：交易费用                 | 1.18       |
| 买卖债券差价收入               | 61,619.33  |

**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**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 股指期货投资收益 | -551,588.10                |

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 986,975.84                 |
| 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            | 986,975.84                 |

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -1,258,430.54              |
| ——股票投资                 | -1,258,430.54              |
| ——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                 | -30,840.00                 |
| ——权证投资                 | -                          |
| ——期货投资                 | -30,840.00                 |
| 3.其他                   | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                          |
| 合计                     | -1,289,270.54              |

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                          |
| 基金申购费收入 | -                          |
| 其他      | -                          |
| 替代损益收入  | -171,602.67                |
| 合计      | -171,602.67                |

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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 12,000.30                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行汇划费   | 765.00                     |
| 指数使用费   | 70,000.00                  |
| 存托服务费   | 0.77                       |
| 其他      | 84,300.75                  |
| 合计      | 226,574.19                 |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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  | 9,848,612.52               | 10.40%       | 8,933,807.04                    | 20.05%       |

##### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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  | 18,766.44                  | 3.98%        | 99,482.47                       | 27.67%       |

##### 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<br>2022年1月1日至2022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  | 4,247.70                   | 33.17%     | 3,620.00 | 41.93%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间                    |            |          |              |

|      | 2021年1月1日至2021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 | 3,853.35             | 51.16%     | 3,384.81 | 68.45%       |

注：上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 70,230.23                      | 72,842.57                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,148.82                       | 286.44                              |

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<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 23,410.03                      | 24,280.79                           |

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 2022 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2021 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 | 37,912,279.00       | 45.1827%         | 29,566,279.00         | 42.9064%         |
| 广发证券股份有限公司                      | 3,443,866.00        | 4.1043%          | 3,554,366.00          | 5.1581%          |

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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           |
|-------------|----------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|             | 期末余额                       | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国建设银行-活期存款 | 3,480,684.52               | 6,626.90 | 4,477,434.99                    | 10,391.30 |

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<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |        |      |        |            |           |
|---------------------------------|--------|------|--------|------------|-----------|
| 关联方名称                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式   | 基金在承销期内买入  |           |
|                                 |        |      |        | 数量（单位：股/张） | 总金额       |
| 广发证券                            | 600958 | 东方证券 | 配股     | 4,088      | 34,584.48 |
| 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |      |        |            |           |
| 关联方名称                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式   | 基金在承销期内买入  |           |
|                                 |        |      |        | 数量（单位：股/张） | 总金额       |
| 广发证券                            | 605090 | 九丰能源 | 新股网下发行 | 1,090      | 37,681.30 |

#### 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股票广发证券和托管行发行的股票建设银行。于2022年6月30日，本基金持有广发证券的A股11,600股(2021年12月31日：9,900股)，占本基金资产净值的比例为0.19%(2021年12月31日：0.24%)；持有建设银行的A股26,600股(2021年12月31日：22,400股)，占本基金资产净值的比例为0.14%(2021年12月31日：0.13%)。

#### 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（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

**6.4.12.1.1 受限证券类别：债券**

| 证券代码   | 证券名称    | 成功认购日      | 受限期       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|---------|------------|-----------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 113060 | 浙 22 转债 | 2022-06-15 | 1 个月内(含)  | 新发流通受限 | 100.00 | 100.01 | 140      | 14,000.00 | 14,000.98 | -  |
| 127064 | 杭氧转债    | 2022-05-19 | 1-6 个月(含) | 新发流通受限 | 100.00 | 100.02 | 17       | 1,700.00  | 1,700.32  | -  |

**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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 002670 | 国盛金控 | 2022-06-01 | 重大事项停牌 | 9.60   | 2022-07-14 | 9.99   | 4,100 | 37,922.10 | 39,360.00 | -  |

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2022 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 2022 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。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券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 2022 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 0.01%(2021 年 12 月 31 日：0.21%)。

##### 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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短期融资券。

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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 14,000.98         | 211,003.30          |
| AAA 以下 | 1,700.32          | 3,000.32            |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 15,701.30         | 214,003.62          |

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、政策性金融债和央票。

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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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 2022 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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额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，期末除本报告“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<br>2022 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
|                        |       |       |       |     |    |

|                          |              |       |           |                |                |
|--------------------------|--------------|-------|-----------|----------------|----------------|
| 资产                       |              |       |           |                |                |
| 银行存款                     | 3,480,684.52 | -     | -         | -              | 3,480,684.52   |
| 结算备付金                    | 1,366,260.04 | -     | -         | -              | 1,366,260.04   |
| 存出保证金                    | 725,859.93   | -     | -         | -              | 725,859.93     |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | 15,701.30 | 106,238,832.33 | 106,254,533.63 |
| 衍生金融资产                   | -            | -     | -         | -              | -              |
| 买入返售金融资产                 | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应收清算款                    | -            | -     | -         | 28,026.15      | 28,026.15      |
| 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                     | 5,572,804.49 | -     | 15,701.30 | 106,342,474.72 | 111,930,980.51 |
| 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                    | -            | -     | -         | 4,245.46       | 4,245.46       |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -         | 12,534.98      | 12,534.98      |
| 应付托管费                    | -            | -     | -         | 4,178.32       | 4,178.32       |
| 应付销售服务费                  | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应付投资顾问费                  | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应交税费                     | -            | -     | -         | 0.10           | 0.10           |
| 应付利润                     | -            | -     | -         | -              | -              |
| 递延所得税负债                  | -            | -     | -         | -              | -              |
| 其他负债                     | -            | -     | -         | 219,474.90     | 219,474.90     |
| 负债总计                     | -            | -     | -         | 240,433.76     | 240,433.76     |
| 利率敏感度缺口                  | 5,572,804.49 | -     | 15,701.30 | 106,102,040.96 | 111,690,546.75 |
| 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上     | 不计息            | 合计             |

| 资产        |              |   |            |               |                |
|-----------|--------------|---|------------|---------------|----------------|
| 银行存款      | 3,888,186.85 | - | -          | -             | 3,888,186.85   |
| 结算备付金     | 1,712,677.72 | - | -          | -             | 1,712,677.72   |
| 存出保证金     | 820,614.95   | - | -          | -             | 820,614.95     |
| 交易性金融资产   | -            | - | 213,998.65 | 94,346,914.59 | 94,560,913.24  |
| 衍生金融资产    | -            | - | -          | -             | -              |
| 买入返售金融资产  | -            | - | -          | -             | -              |
| 应收证券清算款   | -            | - | -          | 73,609.73     | 73,609.73      |
| 应收利息      | -            | - | -          | 1,136.22      | 1,136.22       |
| 应收股利      | -            | - | -          | -             | -              |
| 应收申购款     | -            | - | -          | -             | -              |
| 递延所得税资产   | -            | - | -          | -             | -              |
| 其他资产      | -            | - | -          | -             | -              |
| 资产总计      | 6,421,479.52 | - | 213,998.65 | 94,421,660.54 | 101,057,138.71 |
| 负债        |              |   |            |               |                |
| 短期借款      | -            | - | -          | -             | -              |
| 交易性金融负债   | -            | - | -          | -             | -              |
| 衍生金融负债    | -            | - | -          | -             | -              |
| 卖出回购金融资产款 | -            | - | -          | -             | -              |
| 应付证券清算款   | -            | - | -          | 20.00         | 20.00          |
| 应付赎回款     | -            | - | -          | -             | -              |
| 应付管理人报酬   | -            | - | -          | 13,277.13     | 13,277.13      |
| 应付托管费     | -            | - | -          | 4,425.73      | 4,425.73       |
| 应付销售服务费   | -            | - | -          | -             | -              |
| 应付交易费用    | -            | - | -          | 16,744.73     | 16,744.73      |
| 应交税费      | -            | - | -          | -             | -              |
| 应付利息      | -            | - | -          | -             | -              |
| 应付利润      | -            | - | -          | -             | -              |
| 递延所得税负债   | -            | - | -          | -             | -              |
| 其他负债      | -            | - | -          | 201,609.60    | 201,609.60     |
| 负债总计      | -            | - | -          | 236,077.19    | 236,077.19     |
| 利率敏感度缺口   | 6,421,479.52 | - | 213,998.65 | 94,185,583.35 | 100,821,061.52 |

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<br>2022 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                          |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 106,238,832.33         | 95.12                    | 94,346,914.59            | 93.58                    |
| 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            | 106,238,832.33         | 95.12                    | 94,346,914.59            | 93.58                    |

#### 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 5,322,582.81                    | 4,794,907.87             |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -5,322,582.81                   | -4,794,907.87            |

#### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 106,199,472.33         |
| 第二层次          | 55,061.30              |
| 第三层次          | -                      |
| 合计            | 106,254,533.63         |

**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**

本基金本报告期末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              | 106,238,832.33 | 94.91         |
|    | 其中：股票             | 106,238,832.33 | 94.91         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 15,701.30      | 0.01          |
|    | 其中：债券             | 15,701.30      | 0.01          |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 4,846,944.56   | 4.33          |
| 8  | 其他各项资产            | 829,502.32     | 0.74          |
| 9  | 合计                | 111,930,980.51 | 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         | 1,222,028.00  | 1.09          |
| B  | 采矿业              | 3,340,129.80  | 2.99          |
| C  | 制造业              | 63,361,465.63 | 56.73         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,786,423.60  | 2.49          |
| E  | 建筑业              | 1,916,116.20  | 1.72          |
| F  | 批发和零售业           | 1,112,518.36  | 1.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,793,390.12  | 2.50          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 47,120.00     | 0.04          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,195,355.31  | 3.76          |
| J  | 金融业              | 18,833,238.56 | 16.86         |
| K  | 房地产业             | 2,073,697.66  | 1.86          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 1,461,541.20   | 1.31  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 1,591,745.60   | 1.43  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 166,695.70     | 0.15  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 773,087.59     | 0.69  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 399,718.00     | 0.36  |
| S | 综合            | 164,561.00     | 0.15  |
|   | 合计            | 106,238,832.33 | 95.12 |

### 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<br>比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 2,500   | 5,112,500.00 | 4.58             |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 5,600   | 2,990,400.00 | 2.68             |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 49,215  | 2,076,873.00 | 1.86             |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 43,100  | 2,012,339.00 | 1.80             |
| 5  | 601012 | 隆基绿能 | 24,112  | 1,606,582.56 | 1.44             |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 7,800   | 1,575,054.00 | 1.41             |
| 7  | 002594 | 比亚迪  | 3,700   | 1,233,913.00 | 1.10             |
| 8  | 000333 | 美的集团 | 19,500  | 1,177,605.00 | 1.05             |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 57,800  | 1,150,220.00 | 1.03             |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 42,057  | 1,068,247.80 | 0.96             |
| 11 | 600900 | 长江电力 | 45,200  | 1,045,024.00 | 0.94             |
| 12 | 601888 | 中国中免 | 3,900   | 908,427.00   | 0.81             |
| 13 | 603259 | 药明康德 | 8,240   | 856,877.60   | 0.77             |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 38,860  | 841,707.60   | 0.75             |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 20,435  | 795,943.25   | 0.71             |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 3,000   | 739,620.00   | 0.66             |
| 17 | 002415 | 海康威视 | 18,800  | 680,560.00   | 0.61             |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 19,699  | 665,629.21   | 0.60             |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 139,300 | 664,461.00   | 0.59             |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药 | 17,820  | 660,943.80   | 0.59             |
| 21 | 600438 | 通威股份 | 10,800  | 646,488.00   | 0.58             |
| 22 | 600809 | 山西汾酒 | 1,980   | 643,104.00   | 0.58             |
| 23 | 000651 | 格力电器 | 18,800  | 633,936.00   | 0.57             |
| 24 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,000   | 626,400.00   | 0.56             |

|    |        |        |         |            |      |
|----|--------|--------|---------|------------|------|
| 25 | 600309 | 万华化学   | 6,300   | 611,037.00 | 0.55 |
| 26 | 000725 | 京东方 A  | 149,400 | 588,636.00 | 0.53 |
| 27 | 002714 | 牧原股份   | 10,640  | 588,072.80 | 0.53 |
| 28 | 000001 | 平安银行   | 38,600  | 578,228.00 | 0.52 |
| 29 | 002142 | 宁波银行   | 15,740  | 563,649.40 | 0.50 |
| 30 | 000002 | 万科 A   | 27,000  | 553,500.00 | 0.50 |
| 31 | 002812 | 恩捷股份   | 2,200   | 550,990.00 | 0.49 |
| 32 | 601328 | 交通银行   | 109,300 | 544,314.00 | 0.49 |
| 33 | 601899 | 紫金矿业   | 57,300  | 534,609.00 | 0.48 |
| 34 | 000792 | 盐湖股份   | 17,500  | 524,300.00 | 0.47 |
| 35 | 002466 | 天齐锂业   | 4,200   | 524,160.00 | 0.47 |
| 36 | 002129 | TCL 中环 | 8,900   | 524,121.00 | 0.47 |
| 37 | 600048 | 保利发展   | 28,600  | 499,356.00 | 0.45 |
| 38 | 603288 | 海天味业   | 5,510   | 497,883.60 | 0.45 |
| 39 | 300124 | 汇川技术   | 7,350   | 484,144.50 | 0.43 |
| 40 | 603799 | 华友钴业   | 5,040   | 481,924.80 | 0.43 |
| 41 | 300015 | 爱尔眼科   | 10,667  | 477,561.59 | 0.43 |
| 42 | 002460 | 赣锋锂业   | 3,200   | 475,840.00 | 0.43 |
| 43 | 600031 | 三一重工   | 23,600  | 449,816.00 | 0.40 |
| 44 | 601668 | 中国建筑   | 83,200  | 442,624.00 | 0.40 |
| 45 | 002304 | 洋河股份   | 2,400   | 439,560.00 | 0.39 |
| 46 | 300014 | 亿纬锂能   | 4,503   | 439,042.50 | 0.39 |
| 47 | 601088 | 中国神华   | 13,100  | 436,230.00 | 0.39 |
| 48 | 002352 | 顺丰控股   | 7,700   | 429,737.00 | 0.38 |
| 49 | 300498 | 温氏股份   | 20,160  | 429,206.40 | 0.38 |
| 50 | 600436 | 片仔癀    | 1,200   | 428,076.00 | 0.38 |
| 51 | 600089 | 特变电工   | 15,400  | 421,806.00 | 0.38 |
| 52 | 002271 | 东方雨虹   | 8,100   | 416,907.00 | 0.37 |
| 53 | 600690 | 海尔智家   | 15,100  | 414,646.00 | 0.37 |
| 54 | 300274 | 阳光电源   | 4,200   | 412,650.00 | 0.37 |
| 55 | 601816 | 京沪高铁   | 78,000  | 391,560.00 | 0.35 |
| 56 | 603986 | 兆易创新   | 2,696   | 383,398.16 | 0.34 |
| 57 | 601288 | 农业银行   | 126,500 | 382,030.00 | 0.34 |
| 58 | 603501 | 韦尔股份   | 2,200   | 380,666.00 | 0.34 |
| 59 | 600837 | 海通证券   | 38,200  | 374,742.00 | 0.34 |
| 60 | 600000 | 浦发银行   | 46,500  | 372,465.00 | 0.33 |
| 61 | 600016 | 民生银行   | 98,500  | 366,420.00 | 0.33 |
| 62 | 600406 | 国电南瑞   | 13,268  | 358,236.00 | 0.32 |
| 63 | 688981 | 中芯国际   | 7,725   | 348,938.25 | 0.31 |
| 64 | 601919 | 中远海控   | 24,990  | 347,361.00 | 0.31 |
| 65 | 300122 | 智飞生物   | 3,100   | 344,131.00 | 0.31 |
| 66 | 000625 | 长安汽车   | 19,732  | 341,758.24 | 0.31 |
| 67 | 002049 | 紫光国微   | 1,800   | 341,496.00 | 0.31 |
| 68 | 600585 | 海螺水泥   | 9,600   | 338,688.00 | 0.30 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 69  | 002709 | 天赐材料   | 5,440  | 337,606.40 | 0.30 |
| 70  | 601688 | 华泰证券   | 23,500 | 333,700.00 | 0.30 |
| 71  | 600919 | 江苏银行   | 46,800 | 333,216.00 | 0.30 |
| 72  | 600104 | 上汽集团   | 18,503 | 329,538.43 | 0.30 |
| 73  | 601225 | 陕西煤业   | 15,435 | 326,913.30 | 0.29 |
| 74  | 000661 | 长春高新   | 1,400  | 326,788.00 | 0.29 |
| 75  | 000063 | 中兴通讯   | 12,700 | 324,231.00 | 0.29 |
| 76  | 002241 | 歌尔股份   | 9,500  | 319,200.00 | 0.29 |
| 77  | 601601 | 中国太保   | 13,500 | 317,655.00 | 0.28 |
| 78  | 002230 | 科大讯飞   | 7,400  | 305,028.00 | 0.27 |
| 79  | 600111 | 北方稀土   | 8,600  | 302,376.00 | 0.27 |
| 80  | 300142 | 沃森生物   | 6,200  | 300,018.00 | 0.27 |
| 81  | 688599 | 天合光能   | 4,402  | 287,230.50 | 0.26 |
| 82  | 002459 | 晶澳科技   | 3,640  | 287,196.00 | 0.26 |
| 83  | 300450 | 先导智能   | 4,400  | 277,992.00 | 0.25 |
| 84  | 002371 | 北方华创   | 1,000  | 277,120.00 | 0.25 |
| 85  | 601988 | 中国银行   | 83,600 | 272,536.00 | 0.24 |
| 86  | 601211 | 国泰君安   | 17,900 | 272,080.00 | 0.24 |
| 87  | 002027 | 分众传媒   | 40,100 | 269,873.00 | 0.24 |
| 88  | 000338 | 潍柴动力   | 21,600 | 269,352.00 | 0.24 |
| 89  | 600660 | 福耀玻璃   | 6,400  | 267,584.00 | 0.24 |
| 90  | 601169 | 北京银行   | 58,800 | 266,952.00 | 0.24 |
| 91  | 000100 | TCL 科技 | 55,700 | 266,803.00 | 0.24 |
| 92  | 601229 | 上海银行   | 39,500 | 258,725.00 | 0.23 |
| 93  | 601985 | 中国核电   | 37,400 | 256,564.00 | 0.23 |
| 94  | 600050 | 中国联通   | 73,700 | 255,002.00 | 0.23 |
| 95  | 601766 | 中国中车   | 48,300 | 251,160.00 | 0.22 |
| 96  | 601390 | 中国中铁   | 40,700 | 249,898.00 | 0.22 |
| 97  | 600745 | 闻泰科技   | 2,905  | 247,244.55 | 0.22 |
| 98  | 300347 | 泰格医药   | 2,100  | 240,345.00 | 0.22 |
| 99  | 600893 | 航发动力   | 5,260  | 239,382.60 | 0.21 |
| 100 | 601669 | 中国电建   | 30,300 | 238,461.00 | 0.21 |
| 101 | 601658 | 邮储银行   | 43,100 | 232,309.00 | 0.21 |
| 102 | 603659 | 璞泰来    | 2,700  | 227,880.00 | 0.20 |
| 103 | 000776 | 广发证券   | 11,600 | 216,920.00 | 0.19 |
| 104 | 600028 | 中国石化   | 53,100 | 216,648.00 | 0.19 |
| 105 | 600522 | 中天科技   | 9,300  | 214,830.00 | 0.19 |
| 106 | 600905 | 三峡能源   | 34,100 | 214,489.00 | 0.19 |
| 107 | 601009 | 南京银行   | 20,500 | 213,610.00 | 0.19 |
| 108 | 600019 | 宝钢股份   | 35,300 | 212,506.00 | 0.19 |
| 109 | 600010 | 包钢股份   | 90,400 | 212,440.00 | 0.19 |
| 110 | 600958 | 东方证券   | 20,788 | 212,245.48 | 0.19 |
| 111 | 600196 | 复星医药   | 4,800  | 211,632.00 | 0.19 |
| 112 | 600999 | 招商证券   | 14,640 | 210,962.40 | 0.19 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 113 | 600009 | 上海机场 | 3,700  | 209,790.00 | 0.19 |
| 114 | 300759 | 康龙化成 | 2,200  | 209,484.00 | 0.19 |
| 115 | 300769 | 德方纳米 | 500    | 204,340.00 | 0.18 |
| 116 | 601857 | 中国石油 | 38,500 | 204,050.00 | 0.18 |
| 117 | 002179 | 中航光电 | 3,200  | 202,624.00 | 0.18 |
| 118 | 000895 | 双汇发展 | 6,900  | 202,170.00 | 0.18 |
| 119 | 601628 | 中国人寿 | 6,500  | 202,020.00 | 0.18 |
| 120 | 002410 | 广联达  | 3,700  | 201,428.00 | 0.18 |
| 121 | 600570 | 恒生电子 | 4,622  | 201,241.88 | 0.18 |
| 122 | 002050 | 三花智控 | 7,200  | 197,856.00 | 0.18 |
| 123 | 601818 | 光大银行 | 65,600 | 197,456.00 | 0.18 |
| 124 | 601615 | 明阳智能 | 5,800  | 196,040.00 | 0.18 |
| 125 | 300496 | 中科创达 | 1,500  | 195,720.00 | 0.18 |
| 126 | 002311 | 海大集团 | 3,200  | 192,032.00 | 0.17 |
| 127 | 300661 | 圣邦股份 | 1,050  | 191,121.00 | 0.17 |
| 128 | 600760 | 中航沈飞 | 3,160  | 191,022.00 | 0.17 |
| 129 | 600346 | 恒力石化 | 8,300  | 184,592.00 | 0.17 |
| 130 | 002493 | 荣盛石化 | 11,900 | 183,141.00 | 0.16 |
| 131 | 002074 | 国轩高科 | 4,000  | 182,400.00 | 0.16 |
| 132 | 601633 | 长城汽车 | 4,900  | 181,496.00 | 0.16 |
| 133 | 300896 | 爱美客  | 300    | 180,003.00 | 0.16 |
| 134 | 600460 | 士兰微  | 3,400  | 176,800.00 | 0.16 |
| 135 | 600926 | 杭州银行 | 11,700 | 175,266.00 | 0.16 |
| 136 | 000596 | 古井贡酒 | 700    | 174,762.00 | 0.16 |
| 137 | 002821 | 凯莱英  | 600    | 173,400.00 | 0.16 |
| 138 | 300782 | 卓胜微  | 1,280  | 172,800.00 | 0.15 |
| 139 | 600426 | 华鲁恒升 | 5,840  | 170,528.00 | 0.15 |
| 140 | 000538 | 云南白药 | 2,820  | 170,299.80 | 0.15 |
| 141 | 001979 | 招商蛇口 | 12,600 | 169,218.00 | 0.15 |
| 142 | 300316 | 晶盛机电 | 2,500  | 168,975.00 | 0.15 |
| 143 | 002001 | 新和成  | 7,376  | 168,246.56 | 0.15 |
| 144 | 601989 | 中国重工 | 45,300 | 168,063.00 | 0.15 |
| 145 | 600176 | 中国巨石 | 9,601  | 167,153.41 | 0.15 |
| 146 | 600096 | 云天化  | 5,300  | 166,844.00 | 0.15 |
| 147 | 600256 | 广汇能源 | 15,700 | 165,478.00 | 0.15 |
| 148 | 000768 | 中航西飞 | 5,400  | 163,566.00 | 0.15 |
| 149 | 002920 | 德赛西威 | 1,100  | 162,800.00 | 0.15 |
| 150 | 002202 | 金风科技 | 10,900 | 161,320.00 | 0.14 |
| 151 | 601939 | 建设银行 | 26,600 | 161,196.00 | 0.14 |
| 152 | 603993 | 洛阳钼业 | 27,900 | 159,867.00 | 0.14 |
| 153 | 688012 | 中微公司 | 1,368  | 159,714.00 | 0.14 |
| 154 | 300207 | 欣旺达  | 5,000  | 158,000.00 | 0.14 |
| 155 | 300390 | 天华超净 | 1,800  | 157,320.00 | 0.14 |
| 156 | 600763 | 通策医疗 | 900    | 156,996.00 | 0.14 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 157 | 002497 | 雅化集团 | 4,800  | 156,720.00 | 0.14 |
| 158 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,500  | 155,880.00 | 0.14 |
| 159 | 601006 | 大秦铁路 | 23,600 | 155,524.00 | 0.14 |
| 160 | 601138 | 工业富联 | 15,800 | 155,472.00 | 0.14 |
| 161 | 600584 | 长电科技 | 5,700  | 153,900.00 | 0.14 |
| 162 | 601877 | 正泰电器 | 4,300  | 153,854.00 | 0.14 |
| 163 | 000963 | 华东医药 | 3,400  | 153,544.00 | 0.14 |
| 164 | 000166 | 申万宏源 | 35,500 | 152,295.00 | 0.14 |
| 165 | 002240 | 盛新锂能 | 2,500  | 150,900.00 | 0.14 |
| 166 | 600588 | 用友网络 | 6,891  | 149,603.61 | 0.13 |
| 167 | 601377 | 兴业证券 | 21,200 | 149,460.00 | 0.13 |
| 168 | 601600 | 中国铝业 | 31,200 | 148,200.00 | 0.13 |
| 169 | 601066 | 中信建投 | 5,100  | 147,441.00 | 0.13 |
| 170 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,000  | 146,600.00 | 0.13 |
| 171 | 600029 | 南方航空 | 20,000 | 146,200.00 | 0.13 |
| 172 | 600383 | 金地集团 | 10,800 | 145,152.00 | 0.13 |
| 173 | 601186 | 中国铁建 | 18,300 | 144,570.00 | 0.13 |
| 174 | 300073 | 当升科技 | 1,600  | 144,544.00 | 0.13 |
| 175 | 600085 | 同仁堂  | 2,700  | 142,776.00 | 0.13 |
| 176 | 600188 | 兖矿能源 | 3,600  | 142,128.00 | 0.13 |
| 177 | 601838 | 成都银行 | 8,500  | 140,930.00 | 0.13 |
| 178 | 600741 | 华域汽车 | 6,100  | 140,300.00 | 0.13 |
| 179 | 300408 | 三环集团 | 4,600  | 138,460.00 | 0.12 |
| 180 | 600795 | 国电电力 | 35,300 | 138,023.00 | 0.12 |
| 181 | 603806 | 福斯特  | 2,099  | 137,526.48 | 0.12 |
| 182 | 300012 | 华测检测 | 5,900  | 136,939.00 | 0.12 |
| 183 | 601111 | 中国国航 | 11,700 | 135,837.00 | 0.12 |
| 184 | 300999 | 金龙鱼  | 2,500  | 135,050.00 | 0.12 |
| 185 | 000786 | 北新建材 | 3,900  | 135,018.00 | 0.12 |
| 186 | 600150 | 中国船舶 | 7,100  | 134,758.00 | 0.12 |
| 187 | 688005 | 容百科技 | 1,041  | 134,747.04 | 0.12 |
| 188 | 000876 | 新希望  | 8,800  | 134,640.00 | 0.12 |
| 189 | 603019 | 中科曙光 | 4,620  | 134,072.40 | 0.12 |
| 190 | 600547 | 山东黄金 | 7,200  | 133,632.00 | 0.12 |
| 191 | 601117 | 中国化学 | 14,100 | 132,681.00 | 0.12 |
| 192 | 601238 | 广汽集团 | 8,700  | 132,588.00 | 0.12 |
| 193 | 002407 | 多氟多  | 2,700  | 132,057.00 | 0.12 |
| 194 | 003816 | 中国广核 | 46,700 | 130,760.00 | 0.12 |
| 195 | 601100 | 恒立液压 | 2,096  | 129,365.12 | 0.12 |
| 196 | 002648 | 卫星化学 | 5,000  | 129,250.00 | 0.12 |
| 197 | 601800 | 中国交建 | 13,900 | 128,992.00 | 0.12 |
| 198 | 600885 | 宏发股份 | 3,080  | 128,898.00 | 0.12 |
| 199 | 603369 | 今世缘  | 2,500  | 127,500.00 | 0.11 |
| 200 | 600015 | 华夏银行 | 24,400 | 127,124.00 | 0.11 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 201 | 600989 | 宝丰能源 | 8,600  | 125,990.00 | 0.11 |
| 202 | 603185 | 上机数控 | 800    | 124,792.00 | 0.11 |
| 203 | 688169 | 石头科技 | 200    | 123,340.00 | 0.11 |
| 204 | 600886 | 国投电力 | 11,700 | 122,850.00 | 0.11 |
| 205 | 601868 | 中国能建 | 51,420 | 121,865.40 | 0.11 |
| 206 | 600011 | 华能国际 | 17,300 | 121,792.00 | 0.11 |
| 207 | 002756 | 永兴材料 | 800    | 121,768.00 | 0.11 |
| 208 | 002180 | 纳思达  | 2,400  | 121,488.00 | 0.11 |
| 209 | 601788 | 光大证券 | 7,700  | 121,352.00 | 0.11 |
| 210 | 000157 | 中联重科 | 19,600 | 120,736.00 | 0.11 |
| 211 | 600157 | 永泰能源 | 75,900 | 120,681.00 | 0.11 |
| 212 | 300601 | 康泰生物 | 2,660  | 120,178.80 | 0.11 |
| 213 | 000301 | 东方盛虹 | 7,100  | 120,061.00 | 0.11 |
| 214 | 600115 | 中国东航 | 21,700 | 119,133.00 | 0.11 |
| 215 | 000009 | 中国宝安 | 8,800  | 118,712.00 | 0.11 |
| 216 | 002236 | 大华股份 | 7,200  | 118,224.00 | 0.11 |
| 217 | 688111 | 金山办公 | 596    | 117,483.52 | 0.11 |
| 218 | 300763 | 锦浪科技 | 550    | 117,150.00 | 0.10 |
| 219 | 000425 | 徐工机械 | 21,700 | 116,963.00 | 0.10 |
| 220 | 603290 | 斯达半导 | 300    | 115,770.00 | 0.10 |
| 221 | 688396 | 华润微  | 1,959  | 115,718.13 | 0.10 |
| 222 | 600941 | 中国移动 | 1,900  | 114,950.00 | 0.10 |
| 223 | 300595 | 欧普康视 | 2,000  | 114,380.00 | 0.10 |
| 224 | 600141 | 兴发集团 | 2,600  | 114,374.00 | 0.10 |
| 225 | 002601 | 龙佰集团 | 5,700  | 114,285.00 | 0.10 |
| 226 | 300628 | 亿联网络 | 1,500  | 114,225.00 | 0.10 |
| 227 | 603613 | 国联股份 | 1,288  | 114,116.80 | 0.10 |
| 228 | 601058 | 赛轮轮胎 | 10,000 | 112,700.00 | 0.10 |
| 229 | 600499 | 科达制造 | 5,400  | 111,456.00 | 0.10 |
| 230 | 002555 | 三七互娱 | 5,200  | 110,396.00 | 0.10 |
| 231 | 601916 | 浙商银行 | 33,100 | 109,892.00 | 0.10 |
| 232 | 603486 | 科沃斯  | 900    | 109,701.00 | 0.10 |
| 233 | 601901 | 方正证券 | 16,300 | 109,373.00 | 0.10 |
| 234 | 002008 | 大族激光 | 3,300  | 109,329.00 | 0.10 |
| 235 | 002736 | 国信证券 | 11,400 | 109,098.00 | 0.10 |
| 236 | 603833 | 欧派家居 | 722    | 108,790.96 | 0.10 |
| 237 | 000938 | 紫光股份 | 5,580  | 108,252.00 | 0.10 |
| 238 | 603392 | 万泰生物 | 696    | 108,088.80 | 0.10 |
| 239 | 300751 | 迈为股份 | 220    | 107,998.00 | 0.10 |
| 240 | 600219 | 南山铝业 | 29,100 | 107,379.00 | 0.10 |
| 241 | 600845 | 宝信软件 | 1,960  | 107,016.00 | 0.10 |
| 242 | 601995 | 中金公司 | 2,400  | 106,776.00 | 0.10 |
| 243 | 600418 | 江淮汽车 | 6,200  | 106,392.00 | 0.10 |
| 244 | 600392 | 盛和资源 | 4,700  | 106,220.00 | 0.10 |



|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 245 | 000977 | 浪潮信息  | 4,000  | 105,920.00 | 0.09 |
| 246 | 002384 | 东山精密  | 4,600  | 105,478.00 | 0.09 |
| 247 | 002841 | 视源股份  | 1,400  | 105,448.00 | 0.09 |
| 248 | 000069 | 华侨城 A | 16,200 | 105,138.00 | 0.09 |
| 249 | 600352 | 浙江龙盛  | 10,300 | 104,854.00 | 0.09 |
| 250 | 300454 | 深信服   | 1,000  | 103,780.00 | 0.09 |
| 251 | 688008 | 澜起科技  | 1,702  | 103,107.16 | 0.09 |
| 252 | 601336 | 新华保险  | 3,200  | 103,008.00 | 0.09 |
| 253 | 601108 | 财通证券  | 12,920 | 101,680.40 | 0.09 |
| 254 | 688126 | 沪硅产业  | 4,419  | 101,548.62 | 0.09 |
| 255 | 300363 | 博腾股份  | 1,300  | 101,387.00 | 0.09 |
| 256 | 603345 | 安井食品  | 600    | 100,722.00 | 0.09 |
| 257 | 002007 | 华兰生物  | 4,380  | 99,864.00  | 0.09 |
| 258 | 601618 | 中国中冶  | 28,300 | 99,050.00  | 0.09 |
| 259 | 002120 | 韵达股份  | 5,800  | 98,948.00  | 0.09 |
| 260 | 688180 | 君实生物  | 1,294  | 97,489.96  | 0.09 |
| 261 | 300285 | 国瓷材料  | 2,700  | 96,984.00  | 0.09 |
| 262 | 300413 | 芒果超媒  | 2,900  | 96,744.00  | 0.09 |
| 263 | 300529 | 健帆生物  | 1,900  | 96,691.00  | 0.09 |
| 264 | 601360 | 三六零   | 11,300 | 96,276.00  | 0.09 |
| 265 | 688122 | 西部超导  | 1,042  | 96,072.40  | 0.09 |
| 266 | 300037 | 新宙邦   | 1,820  | 95,659.20  | 0.09 |
| 267 | 002252 | 上海莱士  | 16,000 | 94,880.00  | 0.08 |
| 268 | 600399 | 抚顺特钢  | 5,300  | 94,870.00  | 0.08 |
| 269 | 601555 | 东吴证券  | 13,668 | 94,719.24  | 0.08 |
| 270 | 600765 | 中航重机  | 2,940  | 94,609.20  | 0.08 |
| 271 | 603260 | 合盛硅业  | 800    | 94,368.00  | 0.08 |
| 272 | 600233 | 圆通速递  | 4,600  | 93,794.00  | 0.08 |
| 273 | 000983 | 山西焦煤  | 6,990  | 93,596.10  | 0.08 |
| 274 | 600487 | 亨通光电  | 6,400  | 93,056.00  | 0.08 |
| 275 | 300003 | 乐普医疗  | 5,000  | 92,850.00  | 0.08 |
| 276 | 002625 | 光启技术  | 5,300  | 91,531.00  | 0.08 |
| 277 | 000783 | 长江证券  | 15,400 | 91,322.00  | 0.08 |
| 278 | 000703 | 恒逸石化  | 8,590  | 90,280.90  | 0.08 |
| 279 | 603077 | 和邦生物  | 21,000 | 89,460.00  | 0.08 |
| 280 | 600732 | 爱旭股份  | 2,700  | 89,154.00  | 0.08 |
| 281 | 601155 | 新城控股  | 3,498  | 88,954.14  | 0.08 |
| 282 | 601878 | 浙商证券  | 7,800  | 88,764.00  | 0.08 |
| 283 | 002385 | 大北农   | 11,300 | 88,253.00  | 0.08 |
| 284 | 601162 | 天风证券  | 27,710 | 88,117.80  | 0.08 |
| 285 | 603456 | 九洲药业  | 1,700  | 87,890.00  | 0.08 |
| 286 | 688390 | 固德威   | 280    | 87,642.80  | 0.08 |
| 287 | 601021 | 春秋航空  | 1,500  | 87,525.00  | 0.08 |
| 288 | 300433 | 蓝思科技  | 7,900  | 87,453.00  | 0.08 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 289 | 603026 | 石大胜华 | 600    | 87,210.00 | 0.08 |
| 290 | 300957 | 贝泰妮  | 400    | 87,012.00 | 0.08 |
| 291 | 300919 | 中伟股份 | 700    | 86,730.00 | 0.08 |
| 291 | 603517 | 绝味食品 | 1,500  | 86,730.00 | 0.08 |
| 293 | 002268 | 卫士通  | 2,000  | 85,820.00 | 0.08 |
| 294 | 002602 | 世纪华通 | 17,760 | 85,603.20 | 0.08 |
| 295 | 601799 | 星宇股份 | 500    | 85,500.00 | 0.08 |
| 296 | 600332 | 白云山  | 2,700  | 85,293.00 | 0.08 |
| 297 | 600489 | 中金黄金 | 11,400 | 84,246.00 | 0.08 |
| 298 | 600918 | 中泰证券 | 11,000 | 84,150.00 | 0.08 |
| 299 | 603899 | 晨光股份 | 1,500  | 84,120.00 | 0.08 |
| 300 | 300144 | 宋城演艺 | 5,480  | 84,118.00 | 0.08 |
| 301 | 605117 | 德业股份 | 300    | 83,967.00 | 0.08 |
| 302 | 000066 | 中国长城 | 7,700  | 83,314.00 | 0.07 |
| 303 | 600298 | 安琪酵母 | 1,700  | 82,875.00 | 0.07 |
| 304 | 603882 | 金域医学 | 1,000  | 82,550.00 | 0.07 |
| 305 | 002326 | 永太科技 | 2,500  | 82,325.00 | 0.07 |
| 306 | 000630 | 铜陵有色 | 25,200 | 82,152.00 | 0.07 |
| 307 | 600563 | 法拉电子 | 400    | 82,064.00 | 0.07 |
| 308 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,700  | 81,567.00 | 0.07 |
| 309 | 688777 | 中控技术 | 1,116  | 81,200.16 | 0.07 |
| 310 | 601728 | 中国电信 | 21,700 | 80,941.00 | 0.07 |
| 311 | 300146 | 汤臣倍健 | 3,700  | 80,105.00 | 0.07 |
| 312 | 601607 | 上海医药 | 4,400  | 79,552.00 | 0.07 |
| 313 | 603939 | 益丰药房 | 1,500  | 79,245.00 | 0.07 |
| 314 | 600862 | 中航高科 | 2,800  | 78,680.00 | 0.07 |
| 315 | 000708 | 中信特钢 | 3,900  | 78,585.00 | 0.07 |
| 316 | 002624 | 完美世界 | 5,450  | 78,316.50 | 0.07 |
| 317 | 600183 | 生益科技 | 4,600  | 78,154.00 | 0.07 |
| 318 | 000831 | 五矿稀土 | 2,500  | 78,125.00 | 0.07 |
| 319 | 601077 | 渝农商行 | 21,100 | 78,070.00 | 0.07 |
| 320 | 601696 | 中银证券 | 5,800  | 77,140.00 | 0.07 |
| 321 | 601168 | 西部矿业 | 6,500  | 76,895.00 | 0.07 |
| 322 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,900  | 76,570.00 | 0.07 |
| 323 | 300699 | 光威复材 | 1,300  | 76,531.00 | 0.07 |
| 324 | 000988 | 华工科技 | 3,300  | 76,461.00 | 0.07 |
| 325 | 601865 | 福莱特  | 2,000  | 76,200.00 | 0.07 |
| 326 | 603589 | 口子窖  | 1,300  | 76,193.00 | 0.07 |
| 327 | 002507 | 涪陵榨菜 | 2,200  | 75,944.00 | 0.07 |
| 328 | 601898 | 中煤能源 | 7,300  | 75,774.00 | 0.07 |
| 329 | 600018 | 上港集团 | 12,900 | 75,207.00 | 0.07 |
| 330 | 002028 | 思源电气 | 2,100  | 74,886.00 | 0.07 |
| 330 | 600362 | 江西铜业 | 4,200  | 74,886.00 | 0.07 |
| 332 | 002557 | 洽洽食品 | 1,300  | 74,009.00 | 0.07 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 333 | 600039 | 四川路桥 | 7,000  | 73,710.00 | 0.07 |
| 334 | 002797 | 第一创业 | 11,400 | 73,074.00 | 0.07 |
| 335 | 002056 | 横店东磁 | 2,700  | 71,874.00 | 0.06 |
| 336 | 600988 | 赤峰黄金 | 4,500  | 71,775.00 | 0.06 |
| 337 | 000932 | 华菱钢铁 | 14,100 | 71,769.00 | 0.06 |
| 338 | 300724 | 捷佳伟创 | 800    | 71,480.00 | 0.06 |
| 339 | 002185 | 华天科技 | 7,600  | 71,288.00 | 0.06 |
| 340 | 601128 | 常熟银行 | 9,300  | 71,052.00 | 0.06 |
| 341 | 600109 | 国金证券 | 7,800  | 70,200.00 | 0.06 |
| 342 | 000830 | 鲁西化工 | 4,000  | 69,160.00 | 0.06 |
| 343 | 601636 | 旗滨集团 | 5,400  | 68,850.00 | 0.06 |
| 344 | 600143 | 金发科技 | 7,200  | 68,544.00 | 0.06 |
| 345 | 600521 | 华海药业 | 3,000  | 68,100.00 | 0.06 |
| 346 | 300357 | 我武生物 | 1,300  | 67,639.00 | 0.06 |
| 347 | 002603 | 以岭药业 | 2,780  | 67,554.00 | 0.06 |
| 348 | 300033 | 同花顺  | 700    | 67,305.00 | 0.06 |
| 349 | 002414 | 高德红外 | 5,190  | 66,795.30 | 0.06 |
| 350 | 600486 | 扬农化工 | 500    | 66,640.00 | 0.06 |
| 351 | 002078 | 太阳纸业 | 5,400  | 66,474.00 | 0.06 |
| 352 | 600161 | 天坛生物 | 2,720  | 66,041.60 | 0.06 |
| 353 | 000408 | 藏格矿业 | 2,000  | 65,880.00 | 0.06 |
| 354 | 002422 | 科伦药业 | 3,500  | 65,450.00 | 0.06 |
| 355 | 601216 | 君正集团 | 13,400 | 65,392.00 | 0.06 |
| 356 | 600061 | 国投资本 | 10,204 | 64,897.44 | 0.06 |
| 357 | 601319 | 中国人保 | 12,800 | 64,768.00 | 0.06 |
| 358 | 300676 | 华大基因 | 900    | 64,530.00 | 0.06 |
| 359 | 601990 | 南京证券 | 7,700  | 64,218.00 | 0.06 |
| 360 | 600153 | 建发股份 | 4,900  | 64,043.00 | 0.06 |
| 361 | 601872 | 招商轮船 | 11,080 | 63,820.80 | 0.06 |
| 362 | 300223 | 北京君正 | 600    | 63,750.00 | 0.06 |
| 363 | 600348 | 华阳股份 | 4,100  | 63,386.00 | 0.06 |
| 364 | 600705 | 中航产融 | 18,300 | 63,318.00 | 0.06 |
| 365 | 300832 | 新产业  | 1,400  | 63,154.00 | 0.06 |
| 366 | 000999 | 华润三九 | 1,400  | 63,000.00 | 0.06 |
| 367 | 688561 | 奇安信  | 1,126  | 62,830.80 | 0.06 |
| 368 | 600497 | 驰宏锌锗 | 12,100 | 62,799.00 | 0.06 |
| 369 | 600177 | 雅戈尔  | 9,468  | 62,772.84 | 0.06 |
| 370 | 600875 | 东方电气 | 3,800  | 62,510.00 | 0.06 |
| 371 | 688036 | 传音控股 | 699    | 62,371.77 | 0.06 |
| 372 | 600859 | 王府井  | 2,400  | 62,352.00 | 0.06 |
| 373 | 300088 | 长信科技 | 8,400  | 62,328.00 | 0.06 |
| 374 | 600546 | 山煤国际 | 3,200  | 62,272.00 | 0.06 |
| 375 | 002568 | 百润股份 | 2,060  | 61,882.40 | 0.06 |
| 376 | 002916 | 深南电路 | 660    | 61,848.60 | 0.06 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 377 | 000738 | 航发控制 | 2,200  | 61,820.00 | 0.06 |
| 378 | 688363 | 华熙生物 | 433    | 61,563.94 | 0.06 |
| 379 | 688099 | 晶晨股份 | 600    | 60,600.00 | 0.05 |
| 380 | 002273 | 水晶光电 | 5,000  | 60,550.00 | 0.05 |
| 381 | 600549 | 厦门钨业 | 2,800  | 60,536.00 | 0.05 |
| 382 | 600606 | 绿地控股 | 15,280 | 60,508.80 | 0.05 |
| 383 | 600160 | 巨化股份 | 4,600  | 60,490.00 | 0.05 |
| 384 | 000998 | 隆平高科 | 3,600  | 59,976.00 | 0.05 |
| 385 | 002138 | 顺络电子 | 2,200  | 59,950.00 | 0.05 |
| 386 | 601699 | 潞安环能 | 4,100  | 59,942.00 | 0.05 |
| 387 | 000970 | 中科三环 | 3,175  | 59,626.50 | 0.05 |
| 388 | 689009 | 九号公司 | 1,338  | 59,541.00 | 0.05 |
| 389 | 002673 | 西部证券 | 9,100  | 59,514.00 | 0.05 |
| 390 | 603605 | 珀莱雅  | 360    | 59,464.80 | 0.05 |
| 391 | 000807 | 云铝股份 | 6,000  | 59,280.00 | 0.05 |
| 392 | 601997 | 贵阳银行 | 10,200 | 59,262.00 | 0.05 |
| 393 | 002294 | 信立泰  | 2,100  | 59,010.00 | 0.05 |
| 394 | 601577 | 长沙银行 | 7,400  | 58,682.00 | 0.05 |
| 395 | 601966 | 玲珑轮胎 | 2,300  | 58,351.00 | 0.05 |
| 396 | 300677 | 英科医疗 | 2,300  | 58,328.00 | 0.05 |
| 397 | 600516 | 方大炭素 | 7,660  | 58,216.00 | 0.05 |
| 398 | 000039 | 中集集团 | 4,200  | 58,170.00 | 0.05 |
| 399 | 600482 | 中国动力 | 3,700  | 58,127.00 | 0.05 |
| 400 | 601998 | 中信银行 | 12,200 | 57,950.00 | 0.05 |
| 401 | 002572 | 索菲亚  | 2,100  | 57,750.00 | 0.05 |
| 402 | 002508 | 老板电器 | 1,600  | 57,648.00 | 0.05 |
| 403 | 600655 | 豫园股份 | 6,100  | 57,584.00 | 0.05 |
| 404 | 002465 | 海格通信 | 6,300  | 57,267.00 | 0.05 |
| 404 | 600170 | 上海建工 | 18,900 | 57,267.00 | 0.05 |
| 406 | 603127 | 昭衍新药 | 500    | 56,900.00 | 0.05 |
| 407 | 600536 | 中国软件 | 1,400  | 56,826.00 | 0.05 |
| 408 | 600079 | 人福医药 | 3,500  | 56,000.00 | 0.05 |
| 409 | 300244 | 迪安诊断 | 1,800  | 55,980.00 | 0.05 |
| 410 | 002092 | 中泰化学 | 7,200  | 55,872.00 | 0.05 |
| 411 | 002600 | 领益智造 | 11,100 | 55,722.00 | 0.05 |
| 412 | 600315 | 上海家化 | 1,300  | 55,575.00 | 0.05 |
| 413 | 300058 | 蓝色光标 | 8,500  | 55,505.00 | 0.05 |
| 414 | 000629 | 攀钢钒钛 | 14,600 | 55,480.00 | 0.05 |
| 415 | 000960 | 锡业股份 | 3,300  | 55,341.00 | 0.05 |
| 416 | 603233 | 大参林  | 1,760  | 55,088.00 | 0.05 |
| 417 | 600704 | 物产中大 | 10,700 | 54,891.00 | 0.05 |
| 418 | 300558 | 贝达药业 | 900    | 54,720.00 | 0.05 |
| 419 | 002030 | 达安基因 | 3,176  | 54,595.44 | 0.05 |
| 420 | 000975 | 银泰黄金 | 5,560  | 54,154.40 | 0.05 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 421 | 300136 | 信维通信 | 3,200  | 53,920.00 | 0.05 |
| 422 | 000728 | 国元证券 | 8,640  | 53,740.80 | 0.05 |
| 423 | 603267 | 鸿远电子 | 400    | 53,732.00 | 0.05 |
| 424 | 600739 | 辽宁成大 | 3,650  | 53,217.00 | 0.05 |
| 425 | 002683 | 广东宏大 | 1,900  | 52,877.00 | 0.05 |
| 426 | 000547 | 航天发展 | 4,400  | 52,536.00 | 0.05 |
| 427 | 600372 | 中航电子 | 2,700  | 52,353.00 | 0.05 |
| 428 | 002791 | 坚朗五金 | 400    | 51,888.00 | 0.05 |
| 429 | 002739 | 万达电影 | 3,800  | 51,870.00 | 0.05 |
| 429 | 600380 | 健康元  | 4,200  | 51,870.00 | 0.05 |
| 431 | 300253 | 卫宁健康 | 5,900  | 51,802.00 | 0.05 |
| 432 | 600415 | 小商品城 | 9,300  | 51,801.00 | 0.05 |
| 433 | 002506 | 协鑫集成 | 13,900 | 51,708.00 | 0.05 |
| 434 | 688185 | 康希诺  | 258    | 51,362.64 | 0.05 |
| 435 | 002223 | 鱼跃医疗 | 2,000  | 51,320.00 | 0.05 |
| 436 | 002372 | 伟星新材 | 2,100  | 50,484.00 | 0.05 |
| 437 | 300296 | 利亚德  | 6,900  | 50,370.00 | 0.05 |
| 438 | 600025 | 华能水电 | 7,200  | 50,328.00 | 0.05 |
| 439 | 002408 | 齐翔腾达 | 6,180  | 50,119.80 | 0.04 |
| 440 | 002065 | 东华软件 | 7,900  | 49,928.00 | 0.04 |
| 441 | 300308 | 中际旭创 | 1,600  | 49,680.00 | 0.04 |
| 442 | 300418 | 昆仑万维 | 3,100  | 49,600.00 | 0.04 |
| 443 | 603160 | 汇顶科技 | 800    | 49,544.00 | 0.04 |
| 444 | 600637 | 东方明珠 | 6,900  | 49,335.00 | 0.04 |
| 445 | 601881 | 中国银河 | 5,100  | 49,317.00 | 0.04 |
| 446 | 000878 | 云南铜业 | 4,300  | 48,977.00 | 0.04 |
| 447 | 002064 | 华峰化学 | 5,800  | 48,952.00 | 0.04 |
| 448 | 600699 | 均胜电子 | 3,100  | 48,701.00 | 0.04 |
| 449 | 600867 | 通化东宝 | 4,700  | 48,598.00 | 0.04 |
| 450 | 600026 | 中远海能 | 4,700  | 48,551.00 | 0.04 |
| 451 | 688256 | 寒武纪  | 750    | 48,525.00 | 0.04 |
| 452 | 601016 | 节能风电 | 10,100 | 48,480.00 | 0.04 |
| 453 | 600236 | 桂冠电力 | 7,900  | 48,111.00 | 0.04 |
| 454 | 601198 | 东兴证券 | 5,400  | 48,060.00 | 0.04 |
| 455 | 000400 | 许继电气 | 2,500  | 48,000.00 | 0.04 |
| 456 | 002299 | 圣农发展 | 2,500  | 47,950.00 | 0.04 |
| 457 | 002156 | 通富微电 | 3,100  | 47,740.00 | 0.04 |
| 457 | 300026 | 红日药业 | 6,200  | 47,740.00 | 0.04 |
| 459 | 600642 | 申能股份 | 8,400  | 47,712.00 | 0.04 |
| 460 | 600171 | 上海贝岭 | 1,900  | 47,557.00 | 0.04 |
| 461 | 000750 | 国海证券 | 13,080 | 47,480.40 | 0.04 |
| 462 | 002936 | 郑州银行 | 17,644 | 47,462.36 | 0.04 |
| 463 | 000887 | 中鼎股份 | 2,600  | 47,424.00 | 0.04 |
| 464 | 600879 | 航天电子 | 7,300  | 47,377.00 | 0.04 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 465 | 600820 | 隧道股份  | 7,700  | 47,124.00 | 0.04 |
| 466 | 600258 | 首旅酒店  | 1,900  | 47,120.00 | 0.04 |
| 467 | 603568 | 伟明环保  | 1,410  | 47,051.70 | 0.04 |
| 468 | 002183 | 怡亚通   | 6,500  | 46,865.00 | 0.04 |
| 469 | 002958 | 青农商行  | 14,100 | 46,812.00 | 0.04 |
| 470 | 688009 | 中国通号  | 10,307 | 46,690.71 | 0.04 |
| 471 | 600985 | 淮北矿业  | 3,200  | 46,592.00 | 0.04 |
| 472 | 000513 | 丽珠集团  | 1,283  | 46,457.43 | 0.04 |
| 473 | 002203 | 海亮股份  | 4,000  | 46,200.00 | 0.04 |
| 474 | 600673 | 东阳光   | 5,100  | 45,849.00 | 0.04 |
| 475 | 000623 | 吉林敖东  | 3,100  | 45,756.00 | 0.04 |
| 476 | 600848 | 上海临港  | 3,367  | 45,656.52 | 0.04 |
| 477 | 603198 | 迎驾贡酒  | 700    | 45,598.00 | 0.04 |
| 478 | 000729 | 燕京啤酒  | 4,700  | 45,402.00 | 0.04 |
| 479 | 600316 | 洪都航空  | 1,500  | 45,360.00 | 0.04 |
| 480 | 300017 | 网宿科技  | 8,400  | 45,024.00 | 0.04 |
| 481 | 300001 | 特锐德   | 2,600  | 45,006.00 | 0.04 |
| 482 | 600801 | 华新水泥  | 2,300  | 44,873.00 | 0.04 |
| 483 | 600369 | 西南证券  | 11,300 | 44,861.00 | 0.04 |
| 484 | 300383 | 光环新网  | 4,300  | 44,806.00 | 0.04 |
| 485 | 600529 | 山东药玻  | 1,600  | 44,720.00 | 0.04 |
| 486 | 002131 | 利欧股份  | 23,000 | 44,620.00 | 0.04 |
| 487 | 300474 | 景嘉微   | 650    | 44,453.50 | 0.04 |
| 488 | 600166 | 福田汽车  | 15,700 | 44,431.00 | 0.04 |
| 489 | 002409 | 雅克科技  | 800    | 44,408.00 | 0.04 |
| 490 | 688188 | 柏楚电子  | 200    | 44,008.00 | 0.04 |
| 491 | 002439 | 启明星辰  | 2,200  | 43,846.00 | 0.04 |
| 492 | 002430 | 杭氧股份  | 1,400  | 43,764.00 | 0.04 |
| 493 | 601005 | 重庆钢铁  | 22,900 | 43,739.00 | 0.04 |
| 494 | 002195 | 二三四五  | 19,400 | 43,650.00 | 0.04 |
| 495 | 600027 | 华电国际  | 11,100 | 43,623.00 | 0.04 |
| 496 | 600909 | 华安证券  | 9,540  | 43,407.00 | 0.04 |
| 497 | 002444 | 巨星科技  | 2,300  | 43,332.00 | 0.04 |
| 498 | 600580 | 卧龙电驱  | 3,000  | 43,260.00 | 0.04 |
| 499 | 601717 | 郑煤机   | 3,000  | 43,230.00 | 0.04 |
| 500 | 603218 | 日月股份  | 1,700  | 43,180.00 | 0.04 |
| 501 | 603087 | 甘李药业  | 900    | 43,173.00 | 0.04 |
| 502 | 600325 | 华发股份  | 5,700  | 43,149.00 | 0.04 |
| 503 | 600008 | 首创环保  | 14,850 | 43,065.00 | 0.04 |
| 504 | 300024 | 机器人   | 4,200  | 42,336.00 | 0.04 |
| 505 | 002373 | 千方科技  | 3,800  | 42,256.00 | 0.04 |
| 506 | 000825 | 太钢不锈  | 7,700  | 41,965.00 | 0.04 |
| 507 | 000050 | 深天马 A | 4,200  | 41,874.00 | 0.04 |
| 508 | 002500 | 山西证券  | 7,290  | 41,844.60 | 0.04 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 509 | 002212 | 天融信  | 4,100  | 41,615.00 | 0.04 |
| 510 | 600271 | 航天信息 | 3,800  | 41,572.00 | 0.04 |
| 511 | 002926 | 华西证券 | 5,300  | 41,552.00 | 0.04 |
| 512 | 000027 | 深圳能源 | 6,460  | 41,408.60 | 0.04 |
| 513 | 000739 | 普洛药业 | 2,000  | 41,280.00 | 0.04 |
| 514 | 603712 | 七一二  | 1,300  | 40,950.00 | 0.04 |
| 515 | 002250 | 联化科技 | 2,500  | 40,925.00 | 0.04 |
| 516 | 600038 | 中直股份 | 900    | 40,680.00 | 0.04 |
| 517 | 600863 | 内蒙华电 | 11,100 | 40,515.00 | 0.04 |
| 518 | 601866 | 中远海发 | 13,500 | 40,500.00 | 0.04 |
| 519 | 600208 | 新湖中宝 | 14,600 | 40,296.00 | 0.04 |
| 520 | 600118 | 中国卫星 | 2,000  | 40,160.00 | 0.04 |
| 521 | 000060 | 中金岭南 | 9,000  | 40,140.00 | 0.04 |
| 522 | 600021 | 上海电力 | 3,900  | 39,975.00 | 0.04 |
| 523 | 002249 | 大洋电机 | 6,500  | 39,910.00 | 0.04 |
| 524 | 300009 | 安科生物 | 3,916  | 39,590.76 | 0.04 |
| 525 | 000778 | 新兴铸管 | 8,200  | 39,524.00 | 0.04 |
| 526 | 002670 | 国盛金控 | 4,100  | 39,360.00 | 0.04 |
| 527 | 601992 | 金隅集团 | 14,200 | 39,334.00 | 0.04 |
| 528 | 002152 | 广电运通 | 4,200  | 38,934.00 | 0.03 |
| 529 | 600066 | 宇通客车 | 4,500  | 38,925.00 | 0.03 |
| 530 | 000401 | 冀东水泥 | 3,700  | 38,924.00 | 0.03 |
| 531 | 603444 | 吉比特  | 100    | 38,800.00 | 0.03 |
| 532 | 300168 | 万达信息 | 4,100  | 38,704.00 | 0.03 |
| 533 | 603156 | 养元饮品 | 1,700  | 38,624.00 | 0.03 |
| 534 | 002191 | 劲嘉股份 | 3,600  | 38,592.00 | 0.03 |
| 535 | 300182 | 捷成股份 | 7,000  | 38,500.00 | 0.03 |
| 536 | 002831 | 裕同科技 | 1,300  | 38,415.00 | 0.03 |
| 537 | 002966 | 苏州银行 | 6,260  | 38,186.00 | 0.03 |
| 538 | 603658 | 安图生物 | 780    | 38,134.20 | 0.03 |
| 539 | 300070 | 碧水源  | 7,300  | 38,033.00 | 0.03 |
| 540 | 300251 | 光线传媒 | 4,000  | 37,880.00 | 0.03 |
| 541 | 600970 | 中材国际 | 3,900  | 37,791.00 | 0.03 |
| 542 | 600755 | 厦门国贸 | 5,000  | 37,500.00 | 0.03 |
| 543 | 000656 | 金科股份 | 13,100 | 37,466.00 | 0.03 |
| 544 | 603858 | 步长制药 | 1,900  | 37,449.00 | 0.03 |
| 545 | 002221 | 东华能源 | 4,000  | 37,240.00 | 0.03 |
| 546 | 600390 | 五矿资本 | 7,600  | 37,164.00 | 0.03 |
| 547 | 002505 | 鹏都农牧 | 10,900 | 36,951.00 | 0.03 |
| 548 | 600998 | 九州通  | 3,100  | 36,921.00 | 0.03 |
| 549 | 600667 | 太极实业 | 5,000  | 36,900.00 | 0.03 |
| 550 | 601089 | 福元医药 | 1,749  | 36,816.45 | 0.03 |
| 551 | 600056 | 中国医药 | 2,480  | 36,753.60 | 0.03 |
| 552 | 603707 | 健友股份 | 1,300  | 36,660.00 | 0.03 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 553 | 002244 | 滨江集团 | 4,200  | 36,330.00 | 0.03 |
| 554 | 600528 | 中铁工业 | 4,500  | 36,225.00 | 0.03 |
| 555 | 002396 | 星网锐捷 | 1,600  | 36,224.00 | 0.03 |
| 556 | 600498 | 烽火通信 | 2,500  | 36,200.00 | 0.03 |
| 557 | 000021 | 深科技  | 3,100  | 36,084.00 | 0.03 |
| 558 | 600297 | 广汇汽车 | 13,800 | 36,018.00 | 0.03 |
| 559 | 600839 | 四川长虹 | 12,500 | 36,000.00 | 0.03 |
| 560 | 603885 | 吉祥航空 | 2,000  | 35,980.00 | 0.03 |
| 561 | 600062 | 华润双鹤 | 1,400  | 35,924.00 | 0.03 |
| 562 | 002128 | 电投能源 | 2,500  | 35,800.00 | 0.03 |
| 563 | 002127 | 南极电商 | 6,700  | 35,778.00 | 0.03 |
| 564 | 600201 | 生物股份 | 3,900  | 35,724.00 | 0.03 |
| 565 | 000997 | 新大陆  | 2,700  | 35,667.00 | 0.03 |
| 565 | 600827 | 百联股份 | 2,700  | 35,667.00 | 0.03 |
| 567 | 600155 | 华创阳安 | 4,200  | 35,616.00 | 0.03 |
| 568 | 000785 | 居然之家 | 8,000  | 35,600.00 | 0.03 |
| 569 | 000987 | 越秀金控 | 5,060  | 35,571.80 | 0.03 |
| 570 | 600598 | 北大荒  | 2,400  | 35,424.00 | 0.03 |
| 571 | 600566 | 济川药业 | 1,300  | 35,308.00 | 0.03 |
| 572 | 002985 | 北摩高科 | 602    | 35,265.16 | 0.03 |
| 573 | 600959 | 江苏有线 | 10,800 | 35,208.00 | 0.03 |
| 574 | 002266 | 浙富控股 | 7,300  | 34,967.00 | 0.03 |
| 575 | 002019 | 亿帆医药 | 2,500  | 34,950.00 | 0.03 |
| 576 | 600511 | 国药股份 | 1,300  | 34,814.00 | 0.03 |
| 577 | 300618 | 寒锐钴业 | 600    | 34,752.00 | 0.03 |
| 578 | 600409 | 三友化工 | 4,200  | 34,398.00 | 0.03 |
| 579 | 000930 | 中粮科技 | 3,800  | 34,352.00 | 0.03 |
| 580 | 000883 | 湖北能源 | 6,700  | 34,237.00 | 0.03 |
| 581 | 000012 | 南玻 A | 4,600  | 34,132.00 | 0.03 |
| 582 | 601778 | 晶科科技 | 6,300  | 34,020.00 | 0.03 |
| 583 | 002155 | 湖南黄金 | 2,800  | 33,992.00 | 0.03 |
| 584 | 000800 | 一汽解放 | 3,600  | 33,624.00 | 0.03 |
| 585 | 600282 | 南钢股份 | 10,600 | 33,390.00 | 0.03 |
| 586 | 600718 | 东软集团 | 2,900  | 33,379.00 | 0.03 |
| 587 | 002153 | 石基信息 | 2,100  | 33,327.00 | 0.03 |
| 588 | 300888 | 稳健医疗 | 500    | 33,250.00 | 0.03 |
| 589 | 002124 | 天邦食品 | 4,940  | 33,196.80 | 0.03 |
| 590 | 300866 | 安克创新 | 500    | 33,160.00 | 0.03 |
| 591 | 601236 | 红塔证券 | 3,620  | 33,050.60 | 0.03 |
| 592 | 000686 | 东北证券 | 4,700  | 32,853.00 | 0.03 |
| 593 | 600782 | 新钢股份 | 6,500  | 32,760.00 | 0.03 |
| 593 | 601179 | 中国西电 | 7,000  | 32,760.00 | 0.03 |
| 595 | 000581 | 威孚高科 | 1,700  | 32,725.00 | 0.03 |
| 596 | 601880 | 辽港股份 | 19,200 | 32,640.00 | 0.03 |



|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 597 | 002511 | 中顺洁柔 | 2,600  | 32,552.00 | 0.03 |
| 598 | 000709 | 河钢股份 | 14,400 | 32,544.00 | 0.03 |
| 599 | 600060 | 海信视像 | 2,600  | 32,500.00 | 0.03 |
| 600 | 300376 | 易事特  | 4,000  | 32,480.00 | 0.03 |
| 601 | 600895 | 张江高科 | 2,600  | 32,370.00 | 0.03 |
| 602 | 600022 | 山东钢铁 | 18,600 | 32,364.00 | 0.03 |
| 603 | 002701 | 奥瑞金  | 6,200  | 32,240.00 | 0.03 |
| 604 | 002468 | 申通快递 | 2,700  | 32,184.00 | 0.03 |
| 605 | 601808 | 中海油服 | 2,300  | 32,085.00 | 0.03 |
| 606 | 000690 | 宝新能源 | 7,300  | 31,974.00 | 0.03 |
| 607 | 600064 | 南京高科 | 2,900  | 31,900.00 | 0.03 |
| 608 | 688521 | 芯原股份 | 640    | 31,616.00 | 0.03 |
| 609 | 002002 | 鸿达兴业 | 8,500  | 31,535.00 | 0.03 |
| 610 | 600535 | 天士力  | 3,000  | 31,530.00 | 0.03 |
| 611 | 002939 | 长城证券 | 3,100  | 31,496.00 | 0.03 |
| 612 | 600808 | 马钢股份 | 8,300  | 31,457.00 | 0.03 |
| 613 | 600216 | 浙江医药 | 2,300  | 31,395.00 | 0.03 |
| 614 | 300482 | 万孚生物 | 770    | 31,346.70 | 0.03 |
| 615 | 002595 | 豪迈科技 | 1,400  | 31,276.00 | 0.03 |
| 616 | 600500 | 中化国际 | 4,700  | 31,255.00 | 0.03 |
| 617 | 000598 | 兴蓉环境 | 6,100  | 31,171.00 | 0.03 |
| 618 | 300463 | 迈克生物 | 1,500  | 30,735.00 | 0.03 |
| 619 | 002429 | 兆驰股份 | 8,000  | 30,720.00 | 0.03 |
| 620 | 601860 | 紫金银行 | 10,700 | 30,709.00 | 0.03 |
| 621 | 002532 | 天山铝业 | 4,700  | 30,691.00 | 0.03 |
| 622 | 600517 | 国网英大 | 5,900  | 30,621.00 | 0.03 |
| 623 | 603195 | 公牛集团 | 200    | 30,582.00 | 0.03 |
| 624 | 600567 | 山鹰国际 | 11,000 | 30,470.00 | 0.03 |
| 625 | 600259 | 广晟有色 | 600    | 30,390.00 | 0.03 |
| 626 | 600728 | 佳都科技 | 4,700  | 30,362.00 | 0.03 |
| 627 | 603927 | 中科软  | 1,300  | 30,316.00 | 0.03 |
| 628 | 600037 | 歌华有线 | 3,200  | 30,048.00 | 0.03 |
| 629 | 600663 | 陆家嘴  | 2,900  | 30,044.00 | 0.03 |
| 630 | 600398 | 海澜之家 | 6,300  | 29,925.00 | 0.03 |
| 631 | 002004 | 华邦健康 | 5,300  | 29,574.00 | 0.03 |
| 632 | 601568 | 北元集团 | 4,660  | 29,544.40 | 0.03 |
| 633 | 300166 | 东方国信 | 3,200  | 29,504.00 | 0.03 |
| 634 | 603866 | 桃李面包 | 1,780  | 29,459.00 | 0.03 |
| 635 | 601456 | 国联证券 | 2,400  | 29,448.00 | 0.03 |
| 636 | 688289 | 圣湘生物 | 992    | 29,373.12 | 0.03 |
| 637 | 300979 | 华利集团 | 400    | 29,232.00 | 0.03 |
| 638 | 600597 | 光明乳业 | 2,300  | 29,049.00 | 0.03 |
| 639 | 603225 | 新凤鸣  | 2,500  | 28,850.00 | 0.03 |
| 640 | 600871 | 石化油服 | 15,200 | 28,728.00 | 0.03 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 641 | 300115 | 长盈精密 | 2,780  | 28,661.80 | 0.03 |
| 642 | 002705 | 新宝股份 | 1,300  | 28,587.00 | 0.03 |
| 643 | 601106 | 中国一重 | 9,300  | 28,551.00 | 0.03 |
| 644 | 600572 | 康恩贝  | 6,400  | 28,352.00 | 0.03 |
| 645 | 002745 | 木林森  | 2,900  | 28,333.00 | 0.03 |
| 646 | 002390 | 信邦制药 | 4,100  | 28,331.00 | 0.03 |
| 647 | 601958 | 金钼股份 | 3,200  | 28,288.00 | 0.03 |
| 648 | 601118 | 海南橡胶 | 5,900  | 28,202.00 | 0.03 |
| 649 | 002032 | 苏泊尔  | 500    | 28,170.00 | 0.03 |
| 650 | 601718 | 际华集团 | 9,000  | 27,900.00 | 0.02 |
| 651 | 600507 | 方大特钢 | 3,991  | 27,897.09 | 0.02 |
| 652 | 600737 | 中粮糖业 | 3,700  | 27,824.00 | 0.02 |
| 653 | 000089 | 深圳机场 | 3,600  | 27,792.00 | 0.02 |
| 654 | 000937 | 冀中能源 | 3,700  | 27,602.00 | 0.02 |
| 655 | 000540 | 中天金融 | 14,300 | 27,599.00 | 0.02 |
| 656 | 002048 | 宁波华翔 | 1,700  | 27,234.00 | 0.02 |
| 657 | 000156 | 华数传媒 | 3,400  | 27,098.00 | 0.02 |
| 658 | 002010 | 传化智联 | 4,200  | 27,006.00 | 0.02 |
| 659 | 001914 | 招商积余 | 1,500  | 26,955.00 | 0.02 |
| 660 | 002690 | 美亚光电 | 1,240  | 26,883.20 | 0.02 |
| 661 | 000559 | 万向钱潮 | 4,500  | 26,730.00 | 0.02 |
| 662 | 003035 | 南网能源 | 4,200  | 26,670.00 | 0.02 |
| 663 | 000959 | 首钢股份 | 5,600  | 26,656.00 | 0.02 |
| 664 | 603638 | 艾迪精密 | 1,300  | 26,650.00 | 0.02 |
| 665 | 002368 | 太极股份 | 1,380  | 26,509.80 | 0.02 |
| 666 | 000898 | 鞍钢股份 | 8,200  | 26,404.00 | 0.02 |
| 667 | 002281 | 光迅科技 | 1,500  | 26,370.00 | 0.02 |
| 668 | 600582 | 天地科技 | 5,500  | 26,290.00 | 0.02 |
| 669 | 688208 | 道通科技 | 798    | 26,270.16 | 0.02 |
| 670 | 002925 | 盈趣科技 | 1,220  | 26,254.40 | 0.02 |
| 671 | 000877 | 天山股份 | 2,100  | 25,830.00 | 0.02 |
| 672 | 688002 | 睿创微纳 | 650    | 25,818.00 | 0.02 |
| 673 | 601000 | 唐山港  | 10,000 | 25,800.00 | 0.02 |
| 674 | 002110 | 三钢闽光 | 4,200  | 25,578.00 | 0.02 |
| 675 | 600967 | 内蒙一机 | 2,800  | 25,536.00 | 0.02 |
| 676 | 300630 | 普利制药 | 726    | 25,518.90 | 0.02 |
| 677 | 601333 | 广深铁路 | 11,500 | 25,070.00 | 0.02 |
| 678 | 688065 | 凯赛生物 | 224    | 25,043.20 | 0.02 |
| 679 | 601187 | 厦门银行 | 4,200  | 25,032.00 | 0.02 |
| 680 | 600435 | 北方导航 | 2,900  | 24,998.00 | 0.02 |
| 681 | 600195 | 中牧股份 | 2,036  | 24,961.36 | 0.02 |
| 682 | 002233 | 塔牌集团 | 2,800  | 24,780.00 | 0.02 |
| 683 | 000537 | 广宇发展 | 1,900  | 24,681.00 | 0.02 |
| 684 | 601825 | 沪农商行 | 3,900  | 24,453.00 | 0.02 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 685 | 000402 | 金融街   | 4,100  | 24,395.00 | 0.02 |
| 686 | 300212 | 易华录   | 1,400  | 24,360.00 | 0.02 |
| 687 | 600120 | 浙江东方  | 6,004  | 24,076.04 | 0.02 |
| 688 | 600811 | 东方集团  | 8,500  | 24,055.00 | 0.02 |
| 689 | 002948 | 青岛银行  | 6,620  | 23,964.40 | 0.02 |
| 690 | 688088 | 虹软科技  | 756    | 23,882.04 | 0.02 |
| 691 | 002242 | 九阳股份  | 1,300  | 23,868.00 | 0.02 |
| 692 | 600095 | 湘财股份  | 3,100  | 23,839.00 | 0.02 |
| 693 | 603883 | 老百姓   | 702    | 23,783.76 | 0.02 |
| 694 | 000488 | 晨鸣纸业  | 4,200  | 23,688.00 | 0.02 |
| 695 | 600126 | 杭钢股份  | 4,600  | 23,552.00 | 0.02 |
| 696 | 002174 | 游族网络  | 2,400  | 23,448.00 | 0.02 |
| 697 | 601200 | 上海环境  | 2,300  | 23,368.00 | 0.02 |
| 698 | 002867 | 周大生   | 1,500  | 23,295.00 | 0.02 |
| 699 | 000967 | 盈峰环境  | 4,600  | 23,276.00 | 0.02 |
| 700 | 688321 | 微芯生物  | 923    | 23,250.37 | 0.02 |
| 701 | 002416 | 爱施德   | 2,500  | 23,250.00 | 0.02 |
| 702 | 000990 | 诚志股份  | 2,100  | 22,995.00 | 0.02 |
| 703 | 600373 | 中文传媒  | 2,300  | 22,977.00 | 0.02 |
| 704 | 002382 | 蓝帆医疗  | 2,400  | 22,920.00 | 0.02 |
| 705 | 002081 | 金螳螂   | 4,500  | 22,860.00 | 0.02 |
| 706 | 002399 | 海普瑞   | 1,300  | 22,854.00 | 0.02 |
| 707 | 600446 | 金证股份  | 2,200  | 22,836.00 | 0.02 |
| 708 | 000158 | 常山北明  | 3,800  | 22,800.00 | 0.02 |
| 709 | 601608 | 中信重工  | 6,000  | 22,740.00 | 0.02 |
| 710 | 601098 | 中南传媒  | 2,400  | 22,656.00 | 0.02 |
| 711 | 002387 | 维信诺   | 3,365  | 22,612.80 | 0.02 |
| 712 | 600167 | 联美控股  | 3,000  | 22,470.00 | 0.02 |
| 713 | 600707 | 彩虹股份  | 4,800  | 22,464.00 | 0.02 |
| 714 | 600623 | 华谊集团  | 2,700  | 22,410.00 | 0.02 |
| 715 | 000685 | 中山公用  | 2,900  | 22,272.00 | 0.02 |
| 716 | 002423 | 中粮资本  | 3,300  | 22,143.00 | 0.02 |
| 717 | 001965 | 招商公路  | 2,900  | 22,127.00 | 0.02 |
| 718 | 002146 | 荣盛发展  | 7,300  | 22,119.00 | 0.02 |
| 719 | 601611 | 中国核建  | 2,600  | 21,814.00 | 0.02 |
| 720 | 600376 | 首开股份  | 4,400  | 21,604.00 | 0.02 |
| 721 | 600131 | 国网信通  | 1,600  | 21,520.00 | 0.02 |
| 722 | 603000 | 人民网   | 1,900  | 21,280.00 | 0.02 |
| 723 | 600901 | 江苏租赁  | 4,100  | 21,033.00 | 0.02 |
| 724 | 300257 | 开山股份  | 1,400  | 20,944.00 | 0.02 |
| 725 | 000563 | 陕国投 A | 6,700  | 20,904.00 | 0.02 |
| 726 | 000528 | 柳工    | 3,200  | 20,832.00 | 0.02 |
| 727 | 600307 | 酒钢宏兴  | 10,700 | 20,758.00 | 0.02 |
| 728 | 601991 | 大唐发电  | 8,500  | 20,655.00 | 0.02 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 729 | 601598 | 中国外运  | 5,300 | 20,564.00 | 0.02 |
| 730 | 601698 | 中国卫通  | 1,800 | 20,358.00 | 0.02 |
| 731 | 600764 | 中国海防  | 800   | 20,192.00 | 0.02 |
| 732 | 000961 | 中南建设  | 6,500 | 19,825.00 | 0.02 |
| 733 | 603317 | 天味食品  | 696   | 19,815.12 | 0.02 |
| 734 | 600906 | 财达证券  | 2,200 | 19,778.00 | 0.02 |
| 735 | 601969 | 海南矿业  | 2,300 | 19,757.00 | 0.02 |
| 736 | 600329 | 达仁堂   | 800   | 19,664.00 | 0.02 |
| 737 | 600006 | 东风汽车  | 2,600 | 19,630.00 | 0.02 |
| 738 | 600717 | 天津港   | 4,832 | 19,376.32 | 0.02 |
| 739 | 002434 | 万里扬   | 2,200 | 18,810.00 | 0.02 |
| 740 | 000718 | 苏宁环球  | 5,100 | 18,768.00 | 0.02 |
| 741 | 000415 | 渤海租赁  | 8,500 | 18,445.00 | 0.02 |
| 742 | 000553 | 安道麦 A | 1,500 | 18,165.00 | 0.02 |
| 743 | 601928 | 凤凰传媒  | 2,500 | 17,875.00 | 0.02 |
| 744 | 600835 | 上海机电  | 1,300 | 17,849.00 | 0.02 |
| 745 | 600968 | 海油发展  | 6,900 | 17,802.00 | 0.02 |
| 746 | 603228 | 景旺电子  | 760   | 17,730.80 | 0.02 |
| 747 | 600648 | 外高桥   | 1,300 | 17,680.00 | 0.02 |
| 748 | 000031 | 大悦城   | 4,400 | 17,600.00 | 0.02 |
| 749 | 603056 | 德邦股份  | 1,300 | 17,459.00 | 0.02 |
| 750 | 605499 | 东鹏饮料  | 100   | 17,086.00 | 0.02 |
| 751 | 300869 | 康泰医学  | 600   | 16,956.00 | 0.02 |
| 752 | 600928 | 西安银行  | 4,500 | 16,515.00 | 0.01 |
| 753 | 000062 | 深圳华强  | 1,300 | 16,510.00 | 0.01 |
| 754 | 600787 | 中储股份  | 2,900 | 16,501.00 | 0.01 |
| 755 | 688819 | 天能股份  | 473   | 16,356.34 | 0.01 |
| 756 | 603650 | 彤程新材  | 500   | 16,290.00 | 0.01 |
| 757 | 600339 | 中油工程  | 5,600 | 16,184.00 | 0.01 |
| 758 | 002563 | 森马服饰  | 2,700 | 15,984.00 | 0.01 |
| 759 | 601228 | 广州港   | 4,200 | 15,414.00 | 0.01 |
| 760 | 002815 | 崇达技术  | 1,200 | 15,372.00 | 0.01 |
| 761 | 688006 | 杭可科技  | 211   | 14,782.66 | 0.01 |
| 762 | 600377 | 宁沪高速  | 1,700 | 14,569.00 | 0.01 |
| 763 | 000717 | 韶钢松山  | 4,100 | 14,350.00 | 0.01 |
| 764 | 600299 | 安迪苏   | 1,400 | 13,412.00 | 0.01 |
| 765 | 601139 | 深圳燃气  | 1,900 | 13,186.00 | 0.01 |
| 766 | 001289 | 龙源电力  | 600   | 13,056.00 | 0.01 |
| 767 | 001227 | 兰州银行  | 2,600 | 12,792.00 | 0.01 |
| 768 | 601298 | 青岛港   | 2,300 | 12,581.00 | 0.01 |
| 769 | 601828 | 美凯龙   | 2,020 | 12,241.20 | 0.01 |
| 770 | 002945 | 华林证券  | 800   | 12,200.00 | 0.01 |
| 771 | 600927 | 永安期货  | 600   | 12,102.00 | 0.01 |
| 772 | 000028 | 国药一致  | 400   | 11,916.00 | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 773 | 000869 | 张裕 A | 400   | 11,896.00 | 0.01 |
| 774 | 600823 | 世茂股份 | 3,900 | 11,622.00 | 0.01 |
| 775 | 001268 | 联合精密 | 409   | 11,337.48 | 0.01 |
| 776 | 603379 | 三美股份 | 500   | 11,125.00 | 0.01 |
| 777 | 600350 | 山东高速 | 2,100 | 11,025.00 | 0.01 |
| 778 | 001872 | 招商港口 | 700   | 10,920.00 | 0.01 |
| 779 | 601156 | 东航物流 | 500   | 9,900.00  | 0.01 |
| 780 | 002653 | 海思科  | 600   | 9,666.00  | 0.01 |
| 781 | 601869 | 长飞光纤 | 300   | 9,276.00  | 0.01 |
| 782 | 300741 | 华宝股份 | 300   | 8,346.00  | 0.01 |
| 783 | 601665 | 齐鲁银行 | 1,700 | 8,296.00  | 0.01 |
| 784 | 001203 | 大中矿业 | 700   | 7,910.00  | 0.01 |
| 785 | 603868 | 飞科电器 | 100   | 7,575.00  | 0.01 |
| 786 | 603515 | 欧普照明 | 400   | 6,980.00  | 0.01 |
| 787 | 688029 | 南微医学 | 80    | 6,976.00  | 0.01 |
| 788 | 601003 | 柳钢股份 | 1,700 | 6,885.00  | 0.01 |
| 789 | 603355 | 莱克电气 | 260   | 6,559.80  | 0.01 |
| 790 | 002946 | 新乳业  | 500   | 6,495.00  | 0.01 |
| 791 | 603786 | 科博达  | 100   | 6,157.00  | 0.01 |
| 792 | 603719 | 良品铺子 | 200   | 5,726.00  | 0.01 |
| 793 | 600917 | 重庆燃气 | 700   | 5,054.00  | 0.00 |
| 794 | 600956 | 新天绿能 | 400   | 4,928.00  | 0.00 |
| 795 | 002901 | 大博医疗 | 100   | 3,914.00  | 0.00 |
| 796 | 603983 | 丸美股份 | 100   | 2,680.00  | 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  | 2,575,782.00 | 2.55           |
| 2  | 000858 | 五粮液   | 1,410,479.00 | 1.40           |
| 3  | 000333 | 美的集团  | 1,110,580.00 | 1.10           |
| 4  | 300059 | 东方财富  | 1,020,165.00 | 1.01           |
| 5  | 300760 | 迈瑞医疗  | 903,898.00   | 0.90           |
| 6  | 002594 | 比亚迪   | 808,091.00   | 0.80           |
| 7  | 002415 | 海康威视  | 730,403.00   | 0.72           |
| 8  | 002475 | 立讯精密  | 723,542.00   | 0.72           |
| 9  | 000792 | 盐湖股份  | 646,049.00   | 0.64           |
| 10 | 000651 | 格力电器  | 616,978.00   | 0.61           |
| 11 | 000725 | 京东方 A | 613,095.00   | 0.61           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 002812 | 恩捷股份 | 613,066.00 | 0.61 |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 578,110.00 | 0.57 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖 | 577,933.00 | 0.57 |
| 15 | 002714 | 牧原股份 | 572,372.82 | 0.57 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 554,759.00 | 0.55 |
| 17 | 002049 | 紫光国微 | 549,744.00 | 0.55 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 524,246.00 | 0.52 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 517,877.00 | 0.51 |
| 20 | 002466 | 天齐锂业 | 506,094.00 | 0.50 |

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  | 2,148,003.00 | 2.13           |
| 2  | 000858 | 五粮液   | 1,196,854.00 | 1.19           |
| 3  | 000333 | 美的集团  | 932,149.00   | 0.92           |
| 4  | 300059 | 东方财富  | 818,650.00   | 0.81           |
| 5  | 300760 | 迈瑞医疗  | 783,039.00   | 0.78           |
| 6  | 002594 | 比亚迪   | 643,214.00   | 0.64           |
| 7  | 002475 | 立讯精密  | 618,818.00   | 0.61           |
| 8  | 002415 | 海康威视  | 612,843.00   | 0.61           |
| 9  | 002812 | 恩捷股份  | 530,629.00   | 0.53           |
| 10 | 000651 | 格力电器  | 518,717.00   | 0.51           |
| 11 | 002049 | 紫光国微  | 490,834.00   | 0.49           |
| 12 | 000001 | 平安银行  | 484,808.00   | 0.48           |
| 13 | 000661 | 长春高新  | 478,807.00   | 0.47           |
| 14 | 000568 | 泸州老窖  | 477,396.00   | 0.47           |
| 15 | 002714 | 牧原股份  | 473,803.00   | 0.47           |
| 16 | 002142 | 宁波银行  | 463,803.00   | 0.46           |
| 17 | 300274 | 阳光电源  | 458,515.00   | 0.45           |
| 18 | 002466 | 天齐锂业  | 434,267.00   | 0.43           |
| 19 | 000725 | 京东方 A | 426,164.00   | 0.42           |
| 20 | 300124 | 汇川技术  | 407,000.00   | 0.40           |

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 | 52,036,315.35 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 43,060,475.46 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值      | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|-----------|------------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -                |
| 2  | 央行票据      | -         | -                |
| 3  | 金融债券      | -         | -                |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -                |
| 4  | 企业债券      | -         | -                |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -                |
| 6  | 中期票据      | -         | -                |
| 7  | 可转债（可交换债） | 15,701.30 | 0.01             |
| 8  | 同业存单      | -         | -                |
| 9  | 其他        | -         | -                |
| 10 | 合计        | 15,701.30 | 0.01             |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量（张） | 公允价值      | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|----|--------|---------|-------|-----------|------------------|
| 1  | 113060 | 浙 22 转债 | 140   | 14,000.98 | 0.01             |
| 2  | 127064 | 杭氧转债    | 17    | 1,700.32  | 0.00             |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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外汇管理局福建省分局、中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。

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 | 725,859.93 |
| 2  | 应收清算款 | 28,026.15  |
| 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    | 829,502.32 |

**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<br>(户) | 户均持有的基金份<br>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<br>额比例 | 持有份额        | 占总份<br>额比例 | 持有份额   | 占总份<br>额比例 |
| 745          | 112,629.3     | 60,851,859. | 72.52%     | 23,056,984. | 27.48%     | 37,912,279.                                  | 45.18%     |

|  |   |    |  |    |  |    |  |
|--|---|----|--|----|--|----|--|
|  | 2 | 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“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称  | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|--|---------------|----------|
| 1  | 国泰君安证券股份有限公司                                 | 5,297,602.00  | 6.31%    |
| 2  | 张招兴  | 5,000,000.00  | 5.96%    |
| 3  | 申万宏源证券有限公司                                   | 3,771,311.00  | 4.49%    |
| 4  | 广发证券股份有限公司                                   | 3,443,866.00  | 4.10%    |
| 5  | 华泰证券股份有限公司                                   | 3,269,083.00  | 3.90%    |
| 6  | 中信证券股份有限公司                                   | 2,784,158.00  | 3.32%    |
| 7  | 邓玉良  | 2,213,600.00  | 2.64%    |
| 8  | 广发基金－招商银行－广发基金和润 1 号集合资产管理计划                 | 1,666,900.00  | 1.99%    |
| 9  | 招商证券股份有限公司                                   | 1,363,100.00  | 1.62%    |
| 10 | 海通证券股份有限公司                                   | 666,200.00    | 0.79%    |
| 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 | 37,912,279.00 | 45.18%   |

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的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>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                   | 68,908,843.00  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 78,000,000.00  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 63,000,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 83,908,843.00  |

### 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 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

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

### 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 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东方财富 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券 | 2      | 9,848,612.52  | 10.40%       | 4,247.70  | 33.17%     | -  |
| 华创证券 | 2      | 84,611,071.36 | 89.37%       | 8,462.67  | 66.09%     | -  |
| 平安证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源 | 4      | 217,644.00    | 0.23%        | 93.88     | 0.73%      | -  |
| 招商证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能

力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 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 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券 | 18,766.44  | 3.98%        | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券 | 453,287.30 | 96.02%       | -      | -              | -    | -            |
| 平安证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |

#### 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  | 易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |
| 2  | 易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告                    | 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 | 2022-01-07 |
| 3  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第四季度报告提示性公告         | 中国证券报                       | 2022-01-21 |
| 4  | 易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加天风证券为申购赎回代办证券公司的公告  | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金       | 2022-01-26 |

|    |   |                             |            |
|----|---|-----------------------------|------------|
|    |   | 电子披露网站                      |            |
| 5  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告               | 中国证券报                       | 2022-03-30 |
| 6  | 易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华安证券为申购赎回代办证券公司的公告      | 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 | 2022-04-01 |
| 7  | 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 | 2022-04-11 |
| 8  | 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 | 2022-04-21 |
| 9  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告           | 中国证券报                       | 2022-04-22 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金参与东方证券股份有限公司 A 股配股的公告        | 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 | 2022-04-30 |
| 11 | 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 | 2022-05-13 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告                       | 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 | 2022-05-14 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-18 |

## 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    |
| 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              | 2022 年 01 月 01 日~2022 年 06 月 30 日 | 29,566,279.00 | 18,026,000.00 | 9,680,000.00 | 37,912,279.00 | 45.18 % |
| 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，基金将面临基金财产清算并终止的风险；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

二〇二二年八月三十日