

# 易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基 金

## 2020 年中期报告

### 2020 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：二〇二〇年八月二十八日

## 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 2020 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 2020 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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
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.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12	投资组合报告附注 .....	60
8	基金份额持有人信息 .....	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	63
9	开放式基金份额变动 .....	63
10	重大事件揭示 .....	63
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	63
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4	基金投资策略的改变 .....	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8	其他重大事件 .....	65
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
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 .....	67
12	备查文件目录 .....	67
12.1	备查文件目录 .....	67
12.2	存放地点 .....	67
12.3	查阅方式 .....	67

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	110,908,843.00 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，基金管理人将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。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衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	李申

负责人	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		020-85104666	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	27,718,920.12
本期利润	17,091,652.07
加权平均基金份额本期利润	0.0972
本期加权平均净值利润率	9.71%
本期基金份额净值增长率	10.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	10,845,774.25
期末可供分配基金份额利润	0.0978
期末基金资产净值	122,157,361.08
期末基金份额净值	1.1014

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.14%

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

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

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。

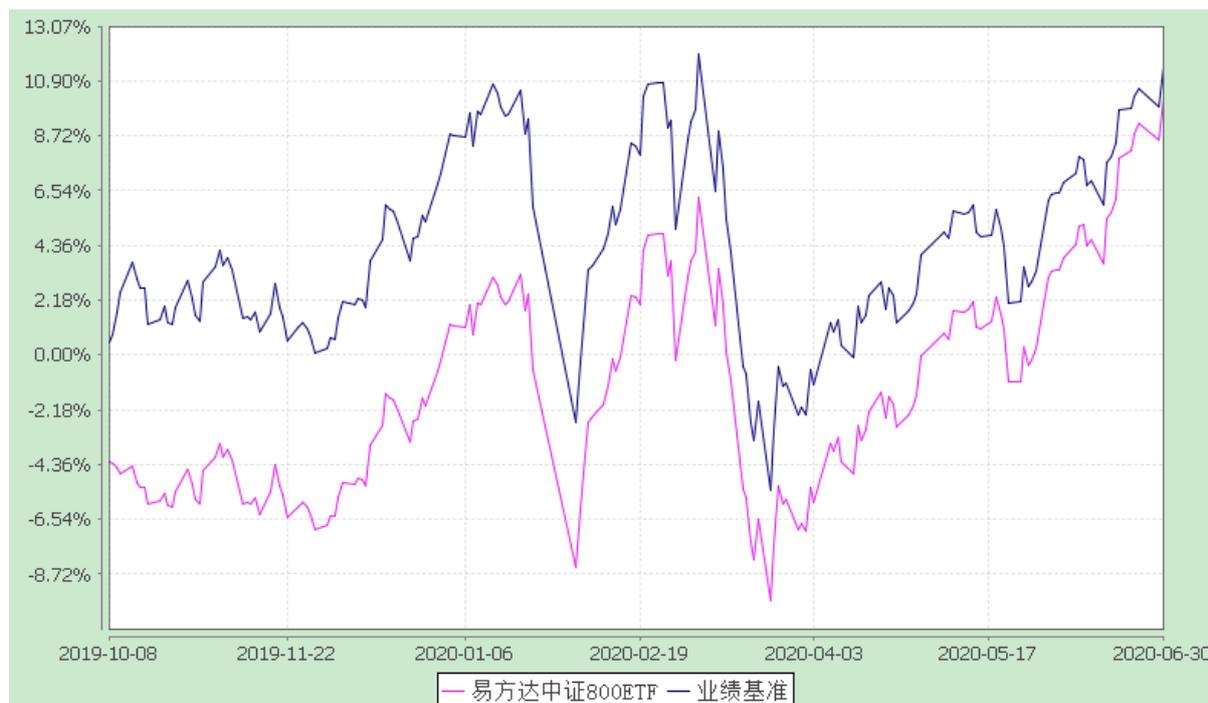
## 3.2 基金净值表现

### 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	9.83%	0.87%	7.87%	0.87%	1.96%	0.00%
过去三个月	18.04%	0.92%	13.79%	0.92%	4.25%	0.00%
过去六个月	10.40%	1.54%	3.94%	1.56%	6.46%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.14%	1.35%	11.44%	1.34%	-1.30%	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 2020 年 6 月 30 日）



注：1.本基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 10.14%，同期业绩比较基准收益率为 11.44%。

## 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，总部设在广州，在北京、上海、香港等地设有分公司或子公司。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、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局，为境内外客户提供包括标准化公募基金与定制化私募产品在内的资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员	2019-10-08	-	12 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投资部指数量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易	2019-10-08	-	13 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、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

<p>方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、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基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>				
--	--	--	--	--

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。本基金管理人规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 59 次，均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。

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，中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，兼具成长性与价值性，综合反映中国 A 股市场大中小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 指数完全覆盖 28 个申万一级行业，成份股由各行业的龙头企业组成，指数走势的表现主要受国内外经济形式与市场情绪影响。2020 年上半年，受新冠疫情的影响，全球股票市场大幅波动，尤其是 3 月份新冠疫情在海外蔓延后，美国标普 500 指数多次触发熔断，上证指数一度跌至 2647 点。二季度，随着各国陆续出台经济刺激政策对冲疫情的影响，投资者的恐慌情绪得到缓解，全球证券市场开始低位大幅反弹，纳斯达克指数更是突破了疫情前的高点创出新高。国内市场上，随着新冠疫情得到有效的控制和缓解，各行业陆续复工、复产，国内经济在系列政策的刺激和支持下逐步走向复苏，A 股市场开始大幅上扬。行业上，医药、TMT、消费等行业表现较好，大幅战胜市场；而金融、采掘等周期行业仍然受疫情影响较大，涨幅靠后。本报告期，中证 800 指数上涨 4%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作。

##### 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 1.1014 元，本报告期份额净值增长率为 10.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.94%，日跟踪偏离度的均值为 0.06%，年化跟踪误差为 1.19%，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

展望下半年，稳增长、保就业仍是国内各项政策的出发点，宽财政、松货币等经济刺激政策有望延续。随着生产生活逐步恢复正常，前期政策逐步落地将支持下半年经济逐渐修复，预计下半年 GDP 增速将回归正常区间。

下半年证券市场走势可能难以延续 7 月初的快速上涨行情，波动难免。一方面，国内各种经济刺激政策短时间内退出的概率较低，经济持续修复的大背景下有利于股市向好；另一方面，全球疫情依然严重，疫情爆发以来中美之间的冲突加剧，外部不确定性对证券市场走势仍是一大影响。中证 800 指数走势及行业构成与大盘接近。作为被动投资的基金，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，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

#### 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任何重大利益冲突。

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。

## 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，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,812,715.90	5,092,704.58
结算备付金		1,758,395.14	441,317.98
存出保证金		977,593.24	156,868.69
交易性金融资产	6.4.7.2	112,572,605.95	396,352,802.48
其中：股票投资		112,549,005.95	395,718,112.30
基金投资		-	-

债券投资		23,600.00	634,690.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,586,892.97	1,112,869.44
应收利息	6.4.7.5	2,115.49	2,044.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,409.89	-
资产总计		123,785,728.58	403,158,607.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,339,626.10	1,000,591.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,966.99	56,768.18
应付托管费		4,989.00	18,922.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,234.46	614,499.19
应交税费		-	3.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	255,550.95	525,476.20
负债合计		1,628,367.50	2,216,261.27
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	110,908,843.00	401,908,843.00
未分配利润	6.4.7.10	11,248,518.08	-966,497.05
所有者权益合计		122,157,361.08	400,942,345.95
负债和所有者权益总计		123,785,728.58	403,158,607.22

注：1.本基金合同生效日为 2019 年 10 月 8 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 8 日至 2019 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1014 元，基金份额总额 110,908,843.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>17,864,767.26</b>
1.利息收入		46,114.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,982.73
债券利息收入		131.37
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）		28,486,276.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,264,398.18
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	216,550.70
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-97,100.00
股利收益	6.4.7.15	1,102,427.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-10,627,268.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-40,355.14
<b>减：二、费用</b>		<b>773,115.19</b>
1. 管理人报酬		133,379.69
2. 托管费		44,459.89
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	343,913.77
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.40
7. 其他费用	6.4.7.19	251,361.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17,091,652.07</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17,091,652.07</b>

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 8 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告

期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	401,908,843.00	-966,497.05	400,942,345.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,091,652.07	17,091,652.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-291,000,000.00	-4,876,636.94	-295,876,636.94
其中：1.基金申购款	171,000,000.00	-785,363.66	170,214,636.34
2.基金赎回款	-462,000,000.00	-4,091,273.28	-466,091,273.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	110,908,843.00	11,248,518.08	122,157,361.08

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 8 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：邱毅华

### 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

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(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	6,812,715.90
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	6,812,715.90

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	105,020,511.91	112,549,005.95	7,528,494.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	23,600.00	23,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	23,600.00	23,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	105,044,111.91	112,572,605.95	7,528,494.04

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,967,540.00	-	-	-
IC2009	2,129,360.00	-	-	-
IF2009	5,838,180.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,967,540.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IC2009	IC2009	2	2,265,760.00	136,400.00
IF2009	IF2009	5	6,101,400.00	263,220.00
总额合计				399,620.00
减：可抵销期货暂收款				399,620.00
股指期货投资净额				0.00

注：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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,370.25
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	704.44
应收债券利息	2.10
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	38.70
合计	2,115.49

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,409.89
合计	75,409.89

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	13,234.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,234.46

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,452.08
应付替代款	116,405.17
可退替代款	4,693.70
其他应付款	35,000.00
合计	255,550.95

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	401,908,843.00	401,908,843.00
本期申购	171,000,000.00	171,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-462,000,000.00	-462,000,000.00
本期末	110,908,843.00	110,908,843.00

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,016,979.95	15,050,482.90	-966,497.05
本期利润	27,718,920.12	-10,627,268.05	17,091,652.07
本期基金份额交易产生的变动数	-856,165.92	-4,020,471.02	-4,876,636.94
其中：基金申购款	7,409,616.03	-8,194,979.69	-785,363.66
基金赎回款	-8,265,781.95	4,174,508.67	-4,091,273.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,845,774.25	402,743.83	11,248,518.08

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	33,517.20
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	11,062.48
其他	1,403.05
合计	45,982.73

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,091,149.39
股票投资收益——赎回差价收入	1,173,248.79
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	27,264,398.18

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	244,651,494.83

减：卖出股票成本总额	218,560,345.44
买卖股票差价收入	26,091,149.39

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	466,091,273.28
减：现金支付赎回款总额	182,399,792.28
减：赎回股票成本总额	282,518,232.21
赎回差价收入	1,173,248.79

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,275,656.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,058,889.59
减：应收利息总额	216.01
买卖债券差价收入	216,550.70

## 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	-97,100.00

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,102,427.47
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	1,102,427.47

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-11,026,888.05
——股票投资	-11,026,888.05
——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	399,620.00
——权证投资	-
——期货投资	399,620.00
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	-10,627,268.05

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	-40,355.14
其他	-
合计	-40,355.14

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。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	343,913.77
银行间市场交易费用	-
合计	343,913.77

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,775.77

指数使用费	70,543.48
其他	84,534.59
合计	251,361.44

#### 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(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
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
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	133,379.69

其中：支付销售机构的客户维护费	416.26
-----------------	--------

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,459.89

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
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	42,060,300.00	37.9233%	89,270,200.00	22.2116%
广发证券	2,966,176.00	2.6744%	4,205,800.00	1.0465%

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	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	6,812,715.90	33,517.20

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**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

**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。

## 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（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	1,320	47,757.60	47,757.60	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股流通受限	12.04	12.04	5,852	70,458.08	70,458.08	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股流通受限	16.42	16.42	3,411	56,008.62	56,008.62	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	16.21	16.21	3,719	60,284.99	60,284.99	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2021-01-04	新股流通受限	15.50	15.50	3,645	56,497.50	56,497.50	-
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股流通受限	5.00	6.54	2,790	13,950.00	18,246.60	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	新发流通受限	100.00	100.00	163	16,300.00	16,300.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	新发流通受限	100.00	100.00	47	4,700.00	4,700.00	-
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	新发流通受限	100.00	100.00	26	2,600.00	2,600.00	-

注:基金持有的股票在流通受限期内,如获得股票红利、送股、转增股、配股的,则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020-06-22	重大事项停牌	1.72	2020-07-08	1.89	16,500	30,197.39	28,380.00	-

#### 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 2020 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 2020 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、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、集中交易室、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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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 2020 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 0.02%(2019 年 12 月 31 日：0.16%)。

##### 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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	11,000.38
AAA 以下	23,602.10	623,772.64
未评级	0.00	0.00
合计	23,602.10	634,773.02

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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

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。

于 2020 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。

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

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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 2020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	6,812,715.90	-	-	-	6,812,715.90
结算备付金	1,758,395.14	-	-	-	1,758,395.14
存出保证金	977,593.24	-	-	-	977,593.24
交易性金融资产	-	-	23,600.00	112,549,005.95	112,572,605.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收证券清算款	-	-	-	1,586,892.97	1,586,892.97
应收利息	-	-	-	2,115.49	2,115.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,409.89	75,409.89
资产总计	9,548,704.28	-	23,600.00	114,213,424.30	123,785,728.58
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	-	-	-	1,339,626.10	1,339,626.10
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	14,966.99	14,966.99
应付托管费	-	-	-	4,989.00	4,989.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,234.46	13,234.46
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	255,550.95	255,550.95
负债总计	-	-	-	1,628,367.50	1,628,367.50
利率敏感度缺口	9,548,704.28	-	23,600.00	112,585,056.80	122,157,361.08
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,092,704.58	-	-	-	5,092,704.58
结算备付金	441,317.98	-	-	-	441,317.98
存出保证金	156,868.69	-	-	-	156,868.69
交易性金融资产	-	-	634,690.18	395,718,112.30	396,352,802.48

					8
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,112,869.44	1,112,869.44
应收利息	-	-	-	2,044.05	2,044.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,690,891.25	-	634,690.18	396,833,025.79	403,158,607.22
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	-	-	-	1,000,591.60	1,000,591.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,768.18	56,768.18
应付托管费	-	-	-	18,922.72	18,922.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	614,499.19	614,499.19
应交税费	-	-	-	3.38	3.38
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	525,476.20	525,476.20
负债总计	-	-	-	2,216,261.27	2,216,261.27
利率敏感度缺口	5,690,891.25	-	634,690.18	394,616,764.52	400,942,345.95

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	112,549,005.95	92.13	395,718,112.30	98.70
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	112,549,005.95	92.13	395,718,112.30	98.70

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	5,624,545.50	19,830,535.75
2.业绩比较基准下降 5%	-5,624,545.50	-19,830,535.75	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 112,208,318.58 元，属于第二层次的余额为 364,287.37 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 395,330,085.05 元，第二层次 1,022,717.43 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 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	112,549,005.95	90.92
	其中：股票	112,549,005.95	90.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,600.00	0.02
	其中：债券	23,600.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,571,111.04	6.92
8	其他各项资产	2,642,011.59	2.13
9	合计	123,785,728.58	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 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	1,451,050.00	1.19
B	采矿业	2,516,699.85	2.06
C	制造业	57,813,338.70	47.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,295,142.72	1.88
E	建筑业	1,971,863.00	1.61
F	批发和零售业	2,483,869.00	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,936,570.12	2.40
H	住宿和餐饮业	119,199.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,837,655.26	5.60
J	金融业	24,675,837.96	20.20

K	房地产业	4,060,967.84	3.32
L	租赁和商务服务业	1,740,721.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	773,968.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	296,276.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	135,795.00	0.11
Q	卫生和社会工作	1,205,988.50	0.99
R	文化、体育和娱乐业	942,133.00	0.77
S	综合	291,931.00	0.24
	合计	112,549,005.95	92.13

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	601318	中国平安	59,900	4,276,860.00	3.50
2	600519	贵州茅台	2,800	4,096,064.00	3.35
3	600036	招商银行	57,015	1,922,545.80	1.57
4	600276	恒瑞医药	20,600	1,901,380.00	1.56
5	000858	五粮液	10,800	1,848,096.00	1.51
6	000333	美的集团	27,200	1,626,288.00	1.33
7	000651	格力电器	26,700	1,510,419.00	1.24
8	002475	立讯精密	23,399	1,201,538.65	0.98
9	600030	中信证券	47,100	1,135,581.00	0.93
10	601166	兴业银行	68,200	1,076,196.00	0.88
11	600887	伊利股份	33,535	1,043,944.55	0.85
12	000002	万科 A	37,900	990,706.00	0.81
13	601398	工商银行	197,100	981,558.00	0.80
14	600900	长江电力	48,500	918,590.00	0.75
15	601888	中国中免	5,500	847,165.00	0.69
16	000661	长春高新	1,900	827,070.00	0.68
17	601328	交通银行	151,700	778,221.00	0.64
18	300059	东方财富	35,520	717,504.00	0.59
19	600585	海螺水泥	13,300	703,703.00	0.58
20	000725	京东方 A	150,400	702,368.00	0.57
21	600000	浦发银行	65,100	688,758.00	0.56
22	000001	平安银行	53,700	687,360.00	0.56
23	603288	海天味业	5,480	681,712.00	0.56

24	002714	牧原股份	8,100	664,200.00	0.54
25	600016	民生银行	116,800	662,256.00	0.54
26	002415	海康威视	20,700	628,245.00	0.51
27	601688	华泰证券	32,900	618,520.00	0.51
28	600031	三一重工	32,700	613,452.00	0.50
29	000063	中兴通讯	15,000	601,950.00	0.49
30	601012	隆基股份	14,700	598,731.00	0.49
31	600048	保利地产	39,500	583,810.00	0.48
32	600837	海通证券	44,900	564,842.00	0.46
33	601668	中国建筑	115,800	552,366.00	0.45
34	603259	药明康德	5,700	550,620.00	0.45
35	300498	温氏股份	24,760	539,768.00	0.44
36	601288	农业银行	159,100	537,758.00	0.44
37	300015	爱尔眼科	11,230	487,943.50	0.40
38	603986	兆易创新	2,040	481,256.40	0.39
39	600436	片仔癀	2,800	476,700.00	0.39
40	601601	中国太保	17,400	474,150.00	0.39
41	600570	恒生电子	4,330	466,341.00	0.38
42	000100	TCL 科技	74,800	463,760.00	0.38
43	601229	上海银行	55,700	462,310.00	0.38
44	002371	北方华创	2,700	461,457.00	0.38
45	300601	康泰生物	2,800	454,048.00	0.37
46	300142	沃森生物	8,500	445,060.00	0.36
47	002142	宁波银行	16,700	438,709.00	0.36
48	601211	国泰君安	25,200	434,952.00	0.36
49	600309	万华化学	8,700	434,913.00	0.36
50	002352	顺丰控股	7,500	410,250.00	0.34
51	601988	中国银行	116,700	406,116.00	0.33
52	601169	北京银行	81,700	400,330.00	0.33
53	600009	上海机场	5,500	396,385.00	0.32
54	002594	比亚迪	5,500	394,900.00	0.32
55	600588	用友网络	8,891	392,093.10	0.32
56	600809	山西汾酒	2,700	391,500.00	0.32
57	002410	广联达	5,500	383,350.00	0.31
58	601766	中国中车	67,900	378,203.00	0.31
59	600690	海尔智家	21,000	371,700.00	0.30
60	300122	智飞生物	3,700	370,555.00	0.30
61	002241	歌尔股份	12,600	369,936.00	0.30
62	000338	潍柴动力	26,600	364,952.00	0.30
63	600745	闻泰科技	2,805	353,289.75	0.29
64	002304	洋河股份	3,300	346,962.00	0.28
65	600999	招商证券	15,800	346,810.00	0.28
66	000568	泸州老窖	3,800	346,256.00	0.28
67	000876	新希望	11,600	345,680.00	0.28

68	600703	三安光电	13,600	340,000.00	0.28
69	601899	紫金矿业	76,100	334,840.00	0.27
70	002555	三七互娱	7,100	332,280.00	0.27
71	600104	上汽集团	19,403	329,656.97	0.27
72	002230	科大讯飞	8,500	318,155.00	0.26
73	002027	分众传媒	56,800	316,376.00	0.26
74	601818	光大银行	88,300	316,114.00	0.26
75	002007	华兰生物	6,080	304,668.80	0.25
76	600028	中国石化	76,500	299,115.00	0.24
77	600919	江苏银行	51,100	289,737.00	0.24
78	001979	招商蛇口	17,600	289,344.00	0.24
79	300347	泰格医药	2,800	285,264.00	0.23
80	000538	云南白药	2,900	272,049.00	0.22
81	002841	视源股份	2,700	268,704.00	0.22
82	600547	山东黄金	7,300	267,326.00	0.22
83	601088	中国神华	18,400	264,224.00	0.22
84	300014	亿纬锂能	5,503	263,318.55	0.22
85	600406	国电南瑞	12,800	259,200.00	0.21
86	300003	乐普医疗	7,000	255,640.00	0.21
87	000895	双汇发展	5,500	253,495.00	0.21
88	002271	东方雨虹	6,200	251,906.00	0.21
89	000166	申万宏源	49,800	251,490.00	0.21
90	601628	中国人寿	9,200	250,332.00	0.20
91	600050	中国联通	51,400	248,776.00	0.20
92	600438	通威股份	14,300	248,534.00	0.20
93	300413	芒果超媒	3,800	247,760.00	0.20
94	002129	中环股份	10,900	244,814.00	0.20
95	601009	南京银行	33,100	242,623.00	0.20
96	000938	紫光股份	5,600	240,688.00	0.20
97	601939	建设银行	37,300	235,363.00	0.19
98	000776	广发证券	16,400	231,568.00	0.19
99	601006	大秦铁路	32,800	230,912.00	0.19
100	600196	复星医药	6,800	230,180.00	0.19
101	000977	浪潮信息	5,800	227,244.00	0.19
102	601390	中国中铁	44,800	224,896.00	0.18
103	600019	宝钢股份	49,300	224,808.00	0.18
104	603019	中科曙光	5,820	223,488.00	0.18
105	603160	汇顶科技	1,000	222,900.00	0.18
106	601857	中国石油	52,100	218,299.00	0.18
107	300253	卫宁健康	9,490	217,700.60	0.18
108	002044	美年健康	15,100	217,591.00	0.18
109	300496	中科创达	2,800	217,560.00	0.18
110	002050	三花智控	9,900	216,810.00	0.18
111	300124	汇川技术	5,700	216,543.00	0.18

112	601100	恒立液压	2,700	216,540.00	0.18
113	002460	赣锋锂业	4,000	214,280.00	0.18
114	601186	中国铁建	25,500	213,690.00	0.17
115	002624	完美世界	3,700	213,268.00	0.17
116	002602	世纪华通	13,900	212,809.00	0.17
117	300136	信维通信	4,000	212,080.00	0.17
118	002001	新和成	7,200	209,520.00	0.17
119	600015	华夏银行	34,100	208,692.00	0.17
120	603501	韦尔股份	1,000	201,950.00	0.17
121	300433	蓝思科技	7,200	201,888.00	0.17
122	601933	永辉超市	21,300	199,794.00	0.16
123	002127	南极电商	9,400	198,998.00	0.16
124	603517	绝味食品	2,800	198,072.00	0.16
125	601989	中国重工	48,800	195,200.00	0.16
126	002311	海大集团	4,100	195,119.00	0.16
127	300595	欧普康视	2,800	194,152.00	0.16
128	002456	欧菲光	10,500	193,095.00	0.16
129	002236	大华股份	10,000	192,100.00	0.16
130	601336	新华保险	4,300	190,404.00	0.16
131	600958	东方证券	19,800	187,902.00	0.15
132	600352	浙江龙盛	14,500	185,455.00	0.15
133	300628	亿联网络	2,700	184,302.00	0.15
134	000157	中联重科	28,600	183,898.00	0.15
135	600183	生益科技	6,200	181,474.00	0.15
136	600741	华域汽车	8,700	180,873.00	0.15
137	002024	苏宁易购	20,600	180,662.00	0.15
138	601377	兴业证券	25,900	177,415.00	0.15
139	300357	我武生物	2,800	174,300.00	0.14
140	601788	光大证券	10,800	173,448.00	0.14
141	601155	新城控股	5,498	171,757.52	0.14
142	600383	金地集团	12,500	171,250.00	0.14
143	000860	顺鑫农业	3,000	170,940.00	0.14
144	002185	华天科技	12,600	170,478.00	0.14
145	002821	凯莱英	700	170,100.00	0.14
146	600201	生物股份	6,100	169,824.00	0.14
147	601138	工业富联	11,100	168,165.00	0.14
148	300558	贝达药业	1,200	167,976.00	0.14
149	002463	沪电股份	6,700	167,366.00	0.14
150	603444	吉比特	300	164,703.00	0.13
151	600346	恒力石化	11,600	162,400.00	0.13
151	600529	山东药玻	2,800	162,400.00	0.13
153	002120	韵达股份	6,600	161,370.00	0.13
154	300408	三环集团	5,800	160,660.00	0.13
155	300033	同花顺	1,200	159,696.00	0.13

156	600845	宝信软件	2,700	159,516.00	0.13
157	600739	辽宁成大	8,400	159,012.00	0.13
158	601225	陕西煤业	22,035	158,872.35	0.13
159	002008	大族激光	4,400	158,180.00	0.13
160	601877	正泰电器	6,000	158,100.00	0.13
161	300212	易华录	2,800	156,800.00	0.13
162	600660	福耀玻璃	7,500	156,525.00	0.13
163	601901	方正证券	22,000	155,760.00	0.13
164	600522	中天科技	13,600	155,720.00	0.13
165	002736	国信证券	13,600	153,680.00	0.13
166	600340	华夏幸福	6,700	153,162.00	0.13
167	000425	徐工机械	25,900	153,069.00	0.13
168	600109	国金证券	13,400	152,894.00	0.13
169	603899	晨光文具	2,800	152,880.00	0.13
170	002557	洽洽食品	2,800	151,732.00	0.12
171	002202	金风科技	15,200	151,544.00	0.12
172	300144	宋城演艺	8,680	150,164.00	0.12
173	300088	长信科技	13,400	150,080.00	0.12
174	002385	大北农	16,200	147,582.00	0.12
175	002439	启明星辰	3,500	147,245.00	0.12
176	603369	今世缘	3,700	147,223.00	0.12
177	600079	人福医药	5,400	146,988.00	0.12
178	601669	中国电建	42,200	146,012.00	0.12
179	000783	长江证券	21,600	145,584.00	0.12
180	002131	利欧股份	37,700	145,522.00	0.12
181	601800	中国交建	19,800	145,332.00	0.12
182	300012	华测检测	7,300	144,248.00	0.12
183	603799	华友钴业	3,700	143,782.00	0.12
184	601108	财通证券	14,000	143,500.00	0.12
185	603993	洛阳钼业	39,000	143,130.00	0.12
186	002690	美亚光电	2,700	142,020.00	0.12
187	601985	中国核电	34,500	141,105.00	0.12
188	601555	东吴证券	17,160	140,025.60	0.11
189	600089	特变电工	20,500	138,785.00	0.11
190	000069	华侨城 A	22,600	136,956.00	0.11
191	600010	包钢股份	125,900	135,972.00	0.11
192	002938	鹏鼎控股	2,700	135,162.00	0.11
193	600315	上海家化	2,800	134,120.00	0.11
194	300285	国瓷材料	4,000	134,040.00	0.11
195	002773	康弘药业	2,700	133,920.00	0.11
196	000513	丽珠集团	2,783	133,611.83	0.11
197	600298	安琪酵母	2,700	133,596.00	0.11
198	000768	中航飞机	7,500	133,050.00	0.11
199	002465	海格通信	10,200	131,988.00	0.11

200	600161	天坛生物	2,900	131,457.00	0.11
201	600867	通化东宝	7,500	130,725.00	0.11
202	600143	金发科技	9,900	130,383.00	0.11
203	000066	中国长城	9,800	129,360.00	0.11
204	002493	荣盛石化	10,500	129,150.00	0.11
205	600893	航发动力	5,500	129,140.00	0.11
206	002157	正邦科技	7,300	127,604.00	0.10
207	002916	深南电路	760	127,315.20	0.10
208	002179	中航光电	3,100	127,131.00	0.10
209	600521	华海药业	3,730	126,558.90	0.10
210	600606	绿地控股	20,300	125,454.00	0.10
211	300482	万孚生物	1,200	124,800.00	0.10
212	600487	亨通光电	7,500	123,075.00	0.10
213	600859	王府井	2,700	122,985.00	0.10
214	000009	中国宝安	14,300	121,693.00	0.10
215	002075	沙钢股份	9,700	121,250.00	0.10
216	002223	鱼跃医疗	3,300	120,120.00	0.10
217	600061	国投资本	9,400	119,662.00	0.10
218	600029	南方航空	23,100	119,427.00	0.10
219	601099	太平洋	37,500	118,875.00	0.10
220	000625	长安汽车	10,800	118,800.00	0.10
221	600705	中航资本	29,900	118,404.00	0.10
222	002368	太极股份	2,700	117,963.00	0.10
223	002422	科伦药业	5,600	117,600.00	0.10
224	600926	杭州银行	13,100	116,852.00	0.10
225	600795	国电电力	63,000	116,550.00	0.10
226	603882	金域医学	1,300	116,350.00	0.10
227	600886	国投电力	14,800	116,328.00	0.10
228	601607	上海医药	6,300	115,794.00	0.09
229	601162	天风证券	19,010	115,200.60	0.09
230	600038	中直股份	2,800	114,996.00	0.09
231	002273	水晶光电	6,700	114,838.00	0.09
232	601066	中信建投	2,900	114,202.00	0.09
233	600511	国药股份	2,800	113,876.00	0.09
234	000963	华东医药	4,500	113,850.00	0.09
235	603658	安图生物	700	113,708.00	0.09
236	300207	欣旺达	6,000	113,400.00	0.09
237	601128	常熟银行	14,900	111,899.00	0.09
238	600111	北方稀土	12,000	111,840.00	0.09
239	002212	南洋股份	4,200	111,636.00	0.09
240	300315	掌趣科技	15,100	110,683.00	0.09
241	002074	国轩高科	4,100	110,044.00	0.09
242	600426	华鲁恒升	6,200	109,616.00	0.09
243	002153	石基信息	2,800	109,284.00	0.09

244	601111	中国国航	16,500	109,065.00	0.09
245	600885	宏发股份	2,700	108,324.00	0.09
246	600637	东方明珠	11,200	108,080.00	0.09
247	002507	涪陵榨菜	3,000	108,030.00	0.09
248	000636	风华高科	3,700	108,003.00	0.09
249	603939	益丰药房	1,180	107,380.00	0.09
250	600498	烽火通信	3,700	106,967.00	0.09
251	601360	三六零	5,800	106,198.00	0.09
252	002603	以岭药业	3,400	106,046.00	0.09
253	002466	天齐锂业	4,620	106,029.00	0.09
254	601816	京沪高铁	17,000	105,910.00	0.09
255	600115	东方航空	25,000	105,500.00	0.09
256	000975	银泰黄金	6,700	105,056.00	0.09
257	002340	格林美	21,100	104,867.00	0.09
258	300418	昆仑万维	4,200	104,832.00	0.09
258	600233	圆通速递	7,200	104,832.00	0.09
260	300271	华宇软件	3,700	104,377.00	0.09
261	002242	九阳股份	2,800	104,356.00	0.09
262	600011	华能国际	24,600	103,812.00	0.08
263	002414	高德红外	3,540	103,651.20	0.08
264	002601	龙鳞佰利	5,600	103,600.00	0.08
265	002607	中公教育	3,700	102,675.00	0.08
266	600176	中国巨石	11,200	102,480.00	0.08
267	600132	重庆啤酒	1,400	102,200.00	0.08
268	601799	星宇股份	800	101,600.00	0.08
269	003816	中国广核	34,100	100,936.00	0.08
270	600271	航天信息	6,200	100,688.00	0.08
271	000988	华工科技	4,100	100,163.00	0.08
272	601727	上海电气	19,700	99,288.00	0.08
273	002353	杰瑞股份	3,200	99,200.00	0.08
274	002396	星网锐捷	2,800	98,924.00	0.08
275	300244	迪安诊断	2,800	98,840.00	0.08
276	601021	春秋航空	2,800	98,672.00	0.08
277	600118	中国卫星	3,200	98,656.00	0.08
278	000547	航天发展	7,200	98,424.00	0.08
279	600332	白云山	3,000	96,990.00	0.08
280	601600	中国铝业	35,100	96,876.00	0.08
281	601618	中国中冶	38,400	96,384.00	0.08
282	300009	安科生物	5,380	96,302.00	0.08
283	000656	金科股份	11,800	96,288.00	0.08
284	300024	机器人	7,000	95,690.00	0.08
285	601838	成都银行	12,000	95,520.00	0.08
286	600221	海航控股	63,600	95,400.00	0.08
287	300168	万达信息	4,300	94,901.00	0.08

288	000703	恒逸石化	10,390	94,860.70	0.08
289	002252	上海莱士	11,200	94,752.00	0.08
290	002709	天赐材料	2,800	94,612.00	0.08
291	600489	中金黄金	10,300	94,142.00	0.08
292	002797	第一创业	13,600	94,112.00	0.08
293	000728	国元证券	11,200	94,080.00	0.08
294	000786	北新建材	4,400	93,852.00	0.08
295	601919	中远海控	27,000	93,690.00	0.08
296	002373	千方科技	3,900	93,561.00	0.08
297	002030	达安基因	3,410	93,024.80	0.08
298	002156	通富微电	3,700	92,685.00	0.08
299	002138	顺络电子	3,700	92,315.00	0.08
300	002281	光迅科技	2,800	92,008.00	0.08
301	600760	中航沈飞	2,800	91,896.00	0.08
302	300017	网宿科技	10,800	91,692.00	0.08
303	000961	中南建设	10,300	91,670.00	0.08
304	600177	雅戈尔	15,368	91,593.28	0.07
305	002174	游族网络	3,500	91,280.00	0.07
306	600390	五矿资本	12,900	91,074.00	0.07
307	000750	国海证券	20,980	91,053.20	0.07
308	600699	均胜电子	3,800	90,478.00	0.07
309	600068	葛洲坝	15,200	90,440.00	0.07
310	600066	宇通客车	7,400	90,280.00	0.07
311	000596	古井贡酒	600	90,144.00	0.07
312	000998	隆平高科	5,400	89,910.00	0.07
313	601997	贵阳银行	12,500	89,500.00	0.07
314	603858	步长制药	3,100	89,435.00	0.07
315	603233	大参林	1,100	89,342.00	0.07
316	300316	晶盛机电	3,600	89,064.00	0.07
317	002195	二三四五	31,600	88,796.00	0.07
318	600037	歌华有线	5,800	88,160.00	0.07
319	600380	健康元	5,400	87,696.00	0.07
320	600535	天士力	5,400	87,588.00	0.07
321	601998	中信银行	17,000	87,550.00	0.07
322	600667	太极实业	7,400	87,468.00	0.07
323	002019	亿帆医药	3,800	87,286.00	0.07
324	002508	老板电器	2,800	87,108.00	0.07
325	600004	白云机场	5,700	86,868.00	0.07
326	000401	冀东水泥	5,400	86,616.00	0.07
327	001914	招商积余	2,800	86,044.00	0.07
328	000050	深天马 A	5,600	86,016.00	0.07
329	300058	蓝色光标	11,000	85,800.00	0.07
330	002152	广电运通	6,600	85,404.00	0.07
331	600801	华新水泥	3,600	85,356.00	0.07

332	300070	碧水源	10,500	85,260.00	0.07
333	000623	吉林敖东	5,400	84,942.00	0.07
334	603833	欧派家居	730	84,607.00	0.07
335	002572	索菲亚	3,500	84,595.00	0.07
336	600729	重庆百货	2,700	84,294.00	0.07
337	600085	同仁堂	3,100	84,072.00	0.07
338	603568	伟明环保	3,610	83,752.00	0.07
339	002294	信立泰	2,800	83,048.00	0.07
340	000021	深科技	3,800	82,954.00	0.07
341	002250	联化科技	3,800	82,840.00	0.07
342	600155	华创阳安	6,900	82,731.00	0.07
343	601881	中国银河	7,200	82,584.00	0.07
344	002511	中顺洁柔	3,700	82,510.00	0.07
345	600486	扬农化工	1,000	82,500.00	0.07
346	601198	东兴证券	7,500	81,750.00	0.07
347	000999	华润三九	2,800	81,732.00	0.07
348	002500	山西证券	12,490	81,684.60	0.07
349	600895	张江高科	4,000	81,480.00	0.07
350	002382	蓝帆医疗	2,700	81,297.00	0.07
351	002078	太阳纸业	8,500	80,920.00	0.07
352	601231	环旭电子	3,700	80,808.00	0.07
353	300274	阳光电源	5,600	80,584.00	0.07
354	600219	南山铝业	39,600	80,388.00	0.07
355	600410	华胜天成	5,900	80,240.00	0.07
356	600642	申能股份	13,500	79,785.00	0.07
357	600516	方大炭素	12,660	79,504.80	0.07
358	600018	上港集团	18,900	79,380.00	0.06
359	000739	普洛药业	3,400	79,186.00	0.06
360	000630	铜陵有色	41,000	79,130.00	0.06
361	600645	中源协和	2,800	79,100.00	0.06
362	603338	浙江鼎力	1,040	78,800.80	0.06
363	002673	西部证券	9,600	78,336.00	0.06
364	002013	中航机电	9,900	78,210.00	0.06
365	601689	拓普集团	2,800	78,120.00	0.06
366	601233	桐昆股份	6,100	77,836.00	0.06
367	601018	宁波港	21,800	77,826.00	0.06
368	600754	锦江酒店	2,800	77,700.00	0.06
369	603707	健友股份	1,200	77,484.00	0.06
370	600167	联美控股	5,400	77,436.00	0.06
371	601319	中国人保	12,000	77,280.00	0.06
372	002831	裕同科技	2,800	77,028.00	0.06
373	600126	杭钢股份	7,400	76,960.00	0.06
374	002146	荣盛发展	9,500	76,950.00	0.06
375	600362	江西铜业	5,700	76,722.00	0.06

376	002926	华西证券	7,200	76,536.00	0.06
377	600655	豫园股份	8,600	76,196.00	0.06
378	600153	建发股份	9,400	76,140.00	0.06
379	600879	航天电子	11,800	75,992.00	0.06
380	600170	上海建工	24,700	75,829.00	0.06
381	601117	中国化学	13,700	75,076.00	0.06
382	600848	上海临港	3,456	74,200.32	0.06
383	601878	浙商证券	7,400	73,334.00	0.06
384	600998	九州通	3,900	72,618.00	0.06
385	600415	小商品城	14,900	72,563.00	0.06
386	603228	景旺电子	2,060	72,491.40	0.06
387	300010	立思辰	3,700	72,409.00	0.06
388	603659	璞泰来	700	72,114.00	0.06
389	600297	广汇汽车	22,600	72,094.00	0.06
390	600811	东方集团	16,300	72,046.00	0.06
391	300251	光线传媒	6,600	72,006.00	0.06
392	600369	西南证券	15,600	71,604.00	0.06
393	600566	济川药业	2,800	71,288.00	0.06
394	300113	顺网科技	2,800	71,120.00	0.06
395	600208	新湖中宝	23,800	70,924.00	0.06
396	688277	天智航	5,852	70,458.08	0.06
397	002958	青农商行	15,900	70,437.00	0.06
398	002399	海普瑞	2,800	70,112.00	0.06
399	600884	杉杉股份	5,920	69,796.80	0.06
400	002635	安洁科技	2,800	69,720.00	0.06
401	002028	思源电气	3,400	69,564.00	0.06
402	601658	邮储银行	15,200	69,464.00	0.06
403	600216	浙江医药	3,600	69,336.00	0.06
404	300001	特锐德	3,300	69,102.00	0.06
405	600779	水井坊	1,100	68,662.00	0.06
406	600674	川投能源	7,400	68,598.00	0.06
407	600909	华安证券	10,000	68,300.00	0.06
408	002268	卫士通	3,200	68,288.00	0.06
409	000581	威孚高科	3,300	68,244.00	0.06
410	002939	长城证券	5,500	67,760.00	0.06
411	300002	神州泰岳	10,900	67,471.00	0.06
412	600728	佳都科技	7,400	67,414.00	0.06
413	600804	鹏博士	7,400	66,452.00	0.05
414	300115	长盈精密	2,900	66,265.00	0.05
415	002739	万达电影	4,300	65,661.00	0.05
416	600325	华发股份	9,300	65,658.00	0.05
417	600528	中铁工业	7,400	65,268.00	0.05
418	600418	江淮汽车	7,300	64,459.00	0.05
419	600446	金证股份	3,300	64,020.00	0.05

420	002032	苏泊尔	900	63,900.00	0.05
421	000686	东北证券	7,400	62,530.00	0.05
422	600959	江苏有线	16,600	62,416.00	0.05
423	600733	北汽蓝谷	9,700	62,371.00	0.05
424	600027	华电国际	18,200	62,244.00	0.05
425	002317	众生药业	3,600	61,776.00	0.05
426	002387	维信诺	4,265	60,904.20	0.05
427	601168	西部矿业	10,500	60,900.00	0.05
428	000997	新大陆	3,800	60,724.00	0.05
429	600256	广汇能源	22,400	60,480.00	0.05
430	688568	中科星图	3,719	60,284.99	0.05
431	603156	养元饮品	2,800	60,200.00	0.05
432	600460	士兰微	4,100	60,188.00	0.05
433	603883	老百姓	600	60,024.00	0.05
434	600598	北大荒	3,700	59,570.00	0.05
435	603000	人民网	3,000	59,490.00	0.05
436	300296	利亚德	9,800	59,486.00	0.05
437	002670	国盛金控	6,500	59,475.00	0.05
438	000878	云南铜业	5,600	59,416.00	0.05
439	000564	供销大集	13,200	59,268.00	0.05
440	600827	百联股份	4,100	59,245.00	0.05
441	002558	巨人网络	3,400	59,160.00	0.05
441	300630	普利制药	800	59,160.00	0.05
443	002468	申通快递	3,600	59,076.00	0.05
444	603806	福斯特	1,180	58,893.80	0.05
445	600820	隧道股份	10,400	58,760.00	0.05
446	600704	物产中大	13,900	58,519.00	0.05
447	600839	四川长虹	20,300	58,261.00	0.05
448	002081	金螳螂	7,400	58,164.00	0.05
449	600497	驰宏锌锗	16,900	58,136.00	0.05
450	000800	一汽解放	5,400	57,996.00	0.05
451	000671	阳光城	9,100	57,694.00	0.05
452	002080	中材科技	3,700	57,350.00	0.05
453	000627	天茂集团	11,000	57,310.00	0.05
454	600673	东阳光	8,200	56,662.00	0.05
455	600572	康恩贝	10,300	56,650.00	0.05
456	002815	崇达技术	2,800	56,644.00	0.05
457	600482	中国动力	3,600	56,520.00	0.05
458	688600	皖仪科技	3,645	56,497.50	0.05
459	000158	常山北明	5,400	56,376.00	0.05
460	601992	金隅集团	18,400	56,304.00	0.05
461	002221	东华能源	6,400	56,256.00	0.05
462	688377	迪威尔	3,411	56,008.62	0.05
463	603866	桃李面包	1,100	55,979.00	0.05

464	600640	号百控股	2,800	55,860.00	0.05
465	300618	寒锐钴业	900	55,818.00	0.05
466	600583	海油工程	12,200	55,510.00	0.05
467	600260	凯乐科技	4,100	55,432.00	0.05
468	600008	首创股份	18,400	55,384.00	0.05
469	002920	德赛西威	900	55,197.00	0.05
470	300026	红日药业	9,900	54,648.00	0.04
471	601966	玲珑轮胎	2,700	54,540.00	0.04
472	002595	豪迈科技	2,800	54,488.00	0.04
473	601236	红塔证券	2,800	54,320.00	0.04
474	002217	合力泰	10,300	54,075.00	0.04
475	603605	珀莱雅	300	54,006.00	0.04
476	002124	天邦股份	4,200	53,970.00	0.04
477	601179	中国西电	11,100	53,724.00	0.04
478	300166	东方国信	4,300	53,363.00	0.04
479	000877	天山股份	3,500	52,850.00	0.04
480	600021	上海电力	7,100	52,540.00	0.04
481	600567	山鹰纸业	17,800	52,510.00	0.04
482	600862	中航高科	3,100	52,452.00	0.04
483	600881	亚泰集团	18,000	52,380.00	0.04
484	600171	上海贝岭	3,000	52,140.00	0.04
485	000681	视觉中国	2,800	52,136.00	0.04
486	002429	兆驰股份	10,500	51,975.00	0.04
487	002458	益生股份	3,400	51,918.00	0.04
488	600094	大名城	8,700	51,765.00	0.04
489	600718	东软集团	4,500	51,750.00	0.04
490	601633	长城汽车	6,700	51,724.00	0.04
491	000060	中金岭南	13,800	51,336.00	0.04
492	600875	东方电气	5,800	51,330.00	0.04
493	600977	中国电影	3,900	51,207.00	0.04
494	600160	巨化股份	7,400	50,986.00	0.04
495	000729	燕京啤酒	7,400	50,690.00	0.04
496	600597	光明乳业	3,400	50,524.00	0.04
497	000090	天健集团	7,300	50,443.00	0.04
498	002648	卫星石化	3,100	50,437.00	0.04
499	601698	中国卫通	2,800	50,428.00	0.04
500	300133	华策影视	6,900	50,025.00	0.04
501	603712	七一二	1,300	49,894.00	0.04
502	600549	厦门钨业	4,200	49,728.00	0.04
503	601238	广汽集团	5,500	49,500.00	0.04
504	600392	盛和资源	6,900	48,645.00	0.04
505	600060	海信视像	4,000	48,600.00	0.04
506	600329	中新药业	2,800	48,496.00	0.04
507	600273	嘉化能源	5,500	48,070.00	0.04

508	000709	河钢股份	23,500	47,940.00	0.04
509	000708	中信特钢	2,800	47,852.00	0.04
510	601005	重庆钢铁	32,100	47,829.00	0.04
511	600026	中远海能	7,400	47,804.00	0.04
512	688027	国盾量子	1,320	47,757.60	0.04
513	601916	浙商银行	12,100	47,674.00	0.04
514	000629	攀钢钒钛	23,700	47,637.00	0.04
515	600755	厦门国贸	7,200	47,520.00	0.04
516	600282	南钢股份	14,700	47,481.00	0.04
517	600835	上海机电	2,800	47,404.00	0.04
518	002056	横店东磁	4,200	47,250.00	0.04
518	002203	海亮股份	5,400	47,250.00	0.04
520	601216	君正集团	18,600	47,244.00	0.04
521	300474	景嘉微	700	47,110.00	0.04
522	000960	锡业股份	5,500	47,080.00	0.04
523	002004	华邦健康	8,700	46,806.00	0.04
524	002085	万丰奥威	7,200	46,656.00	0.04
525	600039	四川路桥	12,200	46,604.00	0.04
526	002807	江阴银行	11,800	46,374.00	0.04
527	002506	协鑫集成	17,700	46,197.00	0.04
528	601975	招商南油	19,300	46,127.00	0.04
529	300324	旋极信息	6,900	45,954.00	0.04
530	600737	中粮糖业	5,900	45,902.00	0.04
531	601118	海南橡胶	9,400	45,684.00	0.04
532	000598	兴蓉环境	9,900	45,540.00	0.04
533	600195	中牧股份	2,800	45,444.00	0.04
534	600166	福田汽车	25,200	45,360.00	0.04
535	000690	宝新能源	9,600	45,312.00	0.04
536	002110	三钢闽光	6,800	45,288.00	0.04
537	601577	长沙银行	5,700	45,258.00	0.04
538	603816	顾家家居	1,000	45,010.00	0.04
539	600580	卧龙电驱	4,000	44,960.00	0.04
540	000778	新兴铸管	13,100	44,933.00	0.04
541	000400	许继电气	3,400	44,880.00	0.04
542	600639	浦东金桥	2,800	44,744.00	0.04
543	600466	蓝光发展	8,300	44,737.00	0.04
544	002745	木林森	2,900	44,689.00	0.04
545	600967	内蒙一机	4,300	44,677.00	0.04
546	000967	盈峰环境	5,400	44,550.00	0.04
547	002233	塔牌集团	3,700	44,511.00	0.04
548	601860	紫金银行	10,500	44,415.00	0.04
549	300182	捷成股份	11,100	44,289.00	0.04
550	600316	洪都航空	2,800	44,240.00	0.04
551	000402	金融街	6,600	43,824.00	0.04

552	002038	双鹭药业	3,400	43,554.00	0.04
553	600563	法拉电子	700	43,260.00	0.04
554	002048	宁波华翔	2,800	43,232.00	0.04
555	600515	海航基础	8,300	43,160.00	0.04
556	600675	中华企业	10,600	43,142.00	0.04
557	603087	甘李药业	430	43,129.00	0.04
558	600435	北方导航	5,700	43,092.00	0.04
559	600398	海澜之家	7,400	43,068.00	0.04
560	000970	中科三环	4,400	43,032.00	0.04
561	600643	爱建集团	5,400	42,930.00	0.04
562	000089	深圳机场	5,600	42,896.00	0.04
563	600064	南京高科	4,400	42,768.00	0.04
564	000039	中集集团	5,900	42,657.00	0.03
565	002092	中泰化学	9,400	42,582.00	0.03
566	000723	美锦能源	6,800	42,568.00	0.03
567	600056	中国医药	3,000	42,450.00	0.03
568	600373	中文传媒	3,600	42,408.00	0.03
569	000930	中粮科技	6,200	42,346.00	0.03
570	000501	鄂武商 A	2,700	42,336.00	0.03
571	000738	航发控制	3,100	42,315.00	0.03
572	600808	马钢股份	16,400	42,312.00	0.03
573	601808	中海油服	3,200	42,048.00	0.03
574	601106	中国一重	14,900	41,869.00	0.03
575	601333	广深铁路	18,600	41,850.00	0.03
576	600120	浙江东方	6,088	41,824.56	0.03
577	000830	鲁西化工	5,600	41,776.00	0.03
578	600376	首开股份	7,100	41,606.00	0.03
579	000983	西山煤电	11,090	41,587.50	0.03
580	600649	城投控股	7,000	41,580.00	0.03
581	000825	太钢不锈	12,500	41,500.00	0.03
582	600258	首旅酒店	2,700	41,499.00	0.03
583	002839	张家港行	7,200	41,472.00	0.03
584	000415	渤海租赁	13,900	41,422.00	0.03
585	601718	际华集团	12,400	41,168.00	0.03
586	002583	海能达	5,400	40,986.00	0.03
587	600776	东方通信	2,700	40,743.00	0.03
588	002183	怡亚通	7,600	40,736.00	0.03
589	000062	深圳华强	2,800	40,712.00	0.03
590	002372	伟星新材	3,500	40,705.00	0.03
591	002925	盈趣科技	700	40,558.00	0.03
592	000563	陕国投 A	10,900	40,439.00	0.03
593	600188	兖州煤业	4,600	40,296.00	0.03
594	002191	劲嘉股份	4,500	40,095.00	0.03
595	601866	中远海发	21,700	39,928.00	0.03

596	601615	明阳智能	3,200	39,840.00	0.03
597	600648	外高桥	2,800	39,592.00	0.03
598	600928	西安银行	7,500	39,450.00	0.03
599	002407	多氟多	3,700	39,368.00	0.03
600	603486	科沃斯	1,300	39,273.00	0.03
601	002010	传化智联	7,200	39,168.00	0.03
602	601098	中南传媒	3,700	39,146.00	0.03
603	300134	大富科技	2,800	39,144.00	0.03
604	600633	浙数文化	4,000	39,120.00	0.03
605	600025	华能水电	10,300	39,037.00	0.03
606	600557	康缘药业	2,800	38,976.00	0.03
607	601898	中煤能源	10,200	38,760.00	0.03
608	603056	德邦股份	2,864	38,749.92	0.03
609	600372	中航电子	2,900	38,628.00	0.03
610	600022	山东钢铁	29,700	38,313.00	0.03
611	603077	和邦生物	29,000	38,280.00	0.03
612	000078	海王生物	9,100	38,129.00	0.03
613	000932	华菱钢铁	10,100	38,077.00	0.03
614	000883	湖北能源	10,800	38,016.00	0.03
615	600388	龙净环保	4,300	37,840.00	0.03
616	300180	华峰超纤	4,400	37,664.00	0.03
617	002640	跨境通	5,800	37,642.00	0.03
618	002064	华峰氨纶	7,400	37,518.00	0.03
618	600266	城建发展	7,400	37,518.00	0.03
620	000807	云铝股份	8,600	37,496.00	0.03
621	600500	中化国际	7,400	37,444.00	0.03
622	000959	首钢股份	8,700	37,410.00	0.03
623	002945	华林证券	2,700	37,287.00	0.03
624	000301	东方盛虹	6,700	37,252.00	0.03
625	000012	南玻 A	7,400	37,148.00	0.03
626	600062	华润双鹤	2,800	37,016.00	0.03
627	002544	杰赛科技	2,800	36,820.00	0.03
628	002375	亚厦股份	3,600	36,792.00	0.03
629	601699	潞安环能	6,600	36,762.00	0.03
630	002244	滨江集团	8,600	36,722.00	0.03
631	002936	郑州银行	10,640	36,601.60	0.03
632	300257	开山股份	2,800	36,596.00	0.03
633	601000	唐山港	16,300	36,349.00	0.03
634	000031	大悦城	7,100	36,139.00	0.03
635	000488	晨鸣纸业	7,300	36,062.00	0.03
636	000028	国药一致	800	36,008.00	0.03
637	000528	柳工	5,700	35,967.00	0.03
638	000559	万向钱潮	7,400	35,816.00	0.03
639	002444	巨星科技	3,000	35,640.00	0.03

640	000990	诚志股份	2,800	35,532.00	0.03
641	600782	新钢股份	8,700	35,496.00	0.03
642	600989	宝丰能源	4,200	35,364.00	0.03
643	600073	上海梅林	3,700	35,113.00	0.03
644	000987	越秀金控	3,000	34,980.00	0.03
645	600908	无锡银行	7,100	34,861.00	0.03
646	000519	中兵红箭	3,700	34,854.00	0.03
647	000685	中山公用	4,500	34,650.00	0.03
648	600299	安迪苏	2,800	34,216.00	0.03
649	000027	深圳能源	7,360	34,150.40	0.03
650	002266	浙富控股	8,800	34,056.00	0.03
651	000046	泛海控股	9,000	33,930.00	0.03
652	600777	新潮能源	22,300	33,896.00	0.03
653	002155	湖南黄金	4,300	33,884.00	0.03
654	002440	闰土股份	3,700	33,818.00	0.03
655	000712	锦龙股份	2,700	33,750.00	0.03
656	000156	华数传媒	3,100	33,573.00	0.03
656	601717	郑煤机	5,700	33,573.00	0.03
658	000813	德展健康	5,400	33,480.00	0.03
659	601958	金钼股份	5,400	33,372.00	0.03
660	002390	信邦制药	7,300	33,288.00	0.03
661	603377	东方时尚	2,000	33,120.00	0.03
662	000898	鞍钢股份	13,300	32,585.00	0.03
663	600291	西水股份	3,600	32,580.00	0.03
664	601608	中信重工	9,500	32,490.00	0.03
665	601200	上海环境	2,700	32,400.00	0.03
666	002434	万里扬	3,700	32,116.00	0.03
667	002625	光启技术	4,400	31,900.00	0.03
668	000008	神州高铁	10,800	31,752.00	0.03
669	002505	大康农业	14,100	31,725.00	0.03
670	600409	三友化工	6,800	31,688.00	0.03
671	601077	渝农商行	6,700	31,624.00	0.03
672	600138	中青旅	3,200	31,584.00	0.03
673	600863	内蒙华电	12,800	31,488.00	0.03
674	601228	广州港	10,300	31,312.00	0.03
675	600312	平高电气	4,200	31,164.00	0.03
676	002701	奥瑞金	7,400	31,006.00	0.03
677	600751	海航科技	9,900	30,987.00	0.03
678	000758	中色股份	7,400	30,932.00	0.03
679	002424	贵州百灵	3,700	30,710.00	0.03
680	002002	鸿达兴业	8,500	30,685.00	0.03
681	600765	中航重机	3,000	30,660.00	0.03
682	600507	方大特钢	5,891	30,574.29	0.03
683	002589	瑞康医药	5,700	30,552.00	0.03

684	603198	迎驾贡酒	1,400	30,478.00	0.02
685	600158	中体产业	3,700	30,266.00	0.02
686	600478	科力远	6,400	30,144.00	0.02
687	600125	铁龙物流	5,400	30,132.00	0.02
688	600259	广晟有色	1,000	30,000.00	0.02
689	000887	中鼎股份	3,800	29,830.00	0.02
690	600545	卓郎智能	6,300	29,799.00	0.02
691	601828	美凯龙	2,800	29,652.00	0.02
692	002563	森马服饰	4,200	29,610.00	0.02
693	600970	中材国际	5,600	29,568.00	0.02
694	002503	搜于特	10,400	29,224.00	0.02
695	603328	依顿电子	2,800	29,204.00	0.02
696	603885	吉祥航空	3,200	29,120.00	0.02
697	600717	天津港	6,560	28,995.20	0.02
698	601880	大连港	16,500	28,380.00	0.02
699	600901	江苏租赁	5,400	28,134.00	0.02
700	300376	易事特	5,400	28,080.00	0.02
701	600338	西藏珠峰	2,800	28,000.00	0.02
702	000732	泰禾集团	5,500	27,995.00	0.02
703	600348	阳泉煤业	6,600	27,852.00	0.02
704	601598	中国外运	8,600	27,778.00	0.02
705	600748	上实发展	5,400	27,594.00	0.02
706	000826	启迪环境	3,700	27,454.00	0.02
707	000061	农产品	3,700	27,417.00	0.02
708	600823	世茂股份	6,100	27,267.00	0.02
709	002665	首航高科	11,100	27,084.00	0.02
710	002302	西部建设	2,800	26,880.00	0.02
711	603888	新华网	1,200	26,832.00	0.02
712	002249	大洋电机	7,400	26,714.00	0.02
713	002867	周大生	1,200	26,604.00	0.02
714	601928	凤凰传媒	3,900	26,520.00	0.02
715	600307	酒钢宏兴	17,200	26,488.00	0.02
716	600582	天地科技	9,000	26,370.00	0.02
717	600968	海油发展	11,200	26,096.00	0.02
718	600141	兴发集团	2,900	25,955.00	0.02
719	603983	丸美股份	300	25,809.00	0.02
720	002419	天虹股份	2,700	25,785.00	0.02
721	000718	苏宁环球	8,300	25,647.00	0.02
722	600664	哈药股份	8,300	25,564.00	0.02
723	000717	韶钢松山	6,700	25,460.00	0.02
724	600017	日照港	10,200	25,398.00	0.02
725	601611	中国核建	4,100	25,338.00	0.02
726	000848	承德露露	3,590	25,130.00	0.02
726	002416	爱施德	3,500	25,130.00	0.02

728	000543	皖能电力	6,200	24,924.00	0.02
729	002093	国脉科技	2,800	24,780.00	0.02
730	601678	滨化股份	5,800	24,592.00	0.02
731	000553	安道麦 A	2,700	24,354.00	0.02
732	600277	亿利洁能	7,400	24,124.00	0.02
733	002128	露天煤业	3,100	24,025.00	0.02
734	002653	海思科	900	23,949.00	0.02
735	000869	张裕 A	700	23,905.00	0.02
736	002901	大博医疗	200	23,858.00	0.02
737	600869	智慧能源	5,900	23,600.00	0.02
738	603650	彤程新材	1,000	23,270.00	0.02
739	002408	齐翔腾达	3,700	22,977.00	0.02
740	300197	铁汉生态	9,000	22,860.00	0.02
741	603786	科博达	300	22,605.00	0.02
742	601127	小康股份	2,700	22,437.00	0.02
743	000785	居然之家	2,800	22,176.00	0.02
744	000537	广宇发展	3,000	21,900.00	0.02
745	603515	欧普照明	800	21,896.00	0.02
746	601019	山东出版	3,500	21,875.00	0.02
747	603260	合盛硅业	800	21,872.00	0.02
748	600985	淮北矿业	2,800	21,812.00	0.02
749	603766	隆鑫通用	5,600	21,672.00	0.02
750	601298	青岛港	3,800	21,584.00	0.02
751	601869	长飞光纤	700	21,567.00	0.02
752	600350	山东高速	3,500	21,490.00	0.02
753	002948	青岛银行	4,200	21,378.00	0.02
754	603317	天味食品	380	21,120.40	0.02
755	600565	迪马股份	7,500	20,925.00	0.02
756	600053	九鼎投资	700	20,888.00	0.02
757	600339	中油工程	9,100	20,657.00	0.02
758	601139	深圳燃气	3,100	20,150.00	0.02
759	002491	通鼎互联	3,900	19,968.00	0.02
760	600996	贵广网络	2,800	19,964.00	0.02
761	600787	中储股份	4,500	19,755.00	0.02
762	002051	中工国际	2,700	19,656.00	0.02
763	601212	白银有色	7,700	19,635.00	0.02
764	600770	综艺股份	4,000	19,200.00	0.02
765	600694	大商股份	800	19,192.00	0.02
766	601801	皖新传媒	3,400	18,904.00	0.02
767	000600	建投能源	3,700	18,833.00	0.02
768	002285	世联行	6,700	18,693.00	0.02
769	600874	创业环保	2,800	18,592.00	0.02
770	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
771	601016	节能风电	8,700	18,444.00	0.02

772	600657	信达地产	4,400	18,128.00	0.01
773	600428	中远海特	5,800	17,864.00	0.01
774	600575	淮河能源	8,500	17,765.00	0.01
775	002118	紫鑫药业	4,000	17,760.00	0.01
776	600757	长江传媒	3,400	17,306.00	0.01
777	000937	冀中能源	5,700	17,214.00	0.01
778	601865	福莱特	900	16,920.00	0.01
779	600058	五矿发展	2,800	16,912.00	0.01
780	600707	彩虹股份	3,700	16,872.00	0.01
781	600006	东风汽车	4,100	16,523.00	0.01
782	603556	海兴电力	1,100	15,884.00	0.01
783	002941	新疆交建	1,100	15,565.00	0.01
784	600623	华谊集团	3,000	15,480.00	0.01
785	603868	飞科电器	300	14,799.00	0.01
786	601969	海南矿业	2,800	13,664.00	0.01
787	600903	贵州燃气	1,300	12,792.00	0.01
788	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
789	600335	国机汽车	2,700	12,474.00	0.01
790	601003	柳钢股份	2,800	12,404.00	0.01
791	002946	新乳业	700	12,145.00	0.01
792	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
793	601512	中新集团	1,000	11,500.00	0.01
794	000025	特力 A	600	10,998.00	0.01
795	601068	中铝国际	2,800	10,948.00	0.01
796	603379	三美股份	500	10,735.00	0.01
797	603355	莱克电气	400	9,956.00	0.01
798	002818	富森美	800	9,840.00	0.01
799	601811	新华文轩	900	9,153.00	0.01
800	603225	新凤鸣	900	8,982.00	0.01
801	001872	招商港口	600	8,730.00	0.01
802	002423	中粮资本	1,000	8,700.00	0.01
803	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
804	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
805	603025	大豪科技	1,000	7,270.00	0.01
806	002957	科瑞技术	300	7,170.00	0.01
807	600917	重庆燃气	1,000	7,140.00	0.01
808	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
809	603256	宏和科技	500	5,720.00	0.00
810	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	000651	格力电器	3,028,541.79	0.76
2	000333	美的集团	2,689,748.00	0.67
3	000858	五粮液	2,640,285.96	0.66
4	600519	贵州茅台	2,196,325.00	0.55
5	000002	万科 A	1,809,909.00	0.45
6	002714	牧原股份	1,517,143.00	0.38
7	002475	立讯精密	1,500,114.00	0.37
8	002371	北方华创	1,462,280.80	0.36
9	000001	平安银行	1,383,289.00	0.35
10	002415	海康威视	1,210,192.00	0.30
11	000725	京东方 A	1,196,697.00	0.30
12	300498	温氏股份	1,159,491.00	0.29
13	000063	中兴通讯	1,091,503.00	0.27
14	002594	比亚迪	1,033,753.00	0.26
15	603288	海天味业	1,022,952.46	0.26
16	300059	东方财富	963,540.00	0.24
17	601318	中国平安	927,203.00	0.23
18	002142	宁波银行	859,527.00	0.21
19	000568	泸州老窖	849,602.43	0.21
20	002230	科大讯飞	849,437.00	0.21

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	000651	格力电器	8,120,962.98	2.03
2	000333	美的集团	7,249,903.46	1.81
3	000858	五粮液	6,925,499.91	1.73
4	000002	万科 A	4,552,830.00	1.14
5	000001	平安银行	3,889,423.00	0.97
6	002475	立讯精密	3,742,887.04	0.93
7	002415	海康威视	3,322,911.27	0.83
8	300498	温氏股份	3,261,365.37	0.81
9	000725	京东方 A	2,949,763.00	0.74
10	000661	长春高新	2,813,017.00	0.70
11	002714	牧原股份	2,586,517.27	0.65
12	000063	中兴通讯	2,569,448.64	0.64
13	300059	东方财富	2,428,623.00	0.61
14	002371	北方华创	2,180,116.00	0.54

15	002142	宁波银行	2,064,833.00	0.51
16	000100	TCL 科技	1,890,255.00	0.47
17	000338	潍柴动力	1,809,773.00	0.45
18	000568	泸州老窖	1,795,435.51	0.45
19	002594	比亚迪	1,761,163.56	0.44
20	002230	科大讯飞	1,689,457.40	0.42

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	133,160,702.60
卖出股票收入（成交）总额	244,651,494.83

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 (%)
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）	23,600.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,600.00	0.02

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	163	16,300.00	0.01
2	128114	正邦转债	47	4,700.00	0.00
3	128115	巨星转债	26	2,600.00	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2009	IC2009	2	2,265,760.00	136,400.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
IF2009	IF2009	5	6,101,400.00	263,220.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					399,620.00
股指期货投资本期收益（元）					-97,100.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					399,620.00

### 7.10.2 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行作出责令改正、并处罚款 40 万元的行政处罚决定：1、2016 年 1 月至 2018 年 1 月在为部分客户办理信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度；2、2016 年至 2018 年 8 月对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职的违法违规行为。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心在为部分客户办理信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度的行为，对招商银行股份有限公司处以责令改正，并处罚款 20 万元。

2019 年 11 月 18 日，珠海市交通运输局对珠海格力电器股份有限公司违反《超限运输车辆行驶公路管理规定》第四十三条的行为作出“罚款 4000 元”的行政处罚决定。

2019 年 12 月 4 日，珠海市交通运输局对珠海格力电器股份有限公司违反《超限运输车辆行驶公路管理规定》第四十三条的行为作出“罚款 4000 元”的行政处罚决定。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行、兴业银行、格力电器外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票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	977,593.24
2	应收证券清算款	1,586,892.97
3	应收股利	-
4	应收利息	2,115.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.89
8	其他	-
9	合计	2,642,011.59

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有限 公司一易方达中证 800 交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基 金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,139	97,373.87	50,983,517. 00	45.97%	59,925,326. 00	54.03%	42,060,300. 00	37.92%

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”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	沙迪南	6,689,600.00	6.03%
2	张招兴	5,000,000.00	4.51%
3	刘青	3,990,000.00	3.60%
4	广发证券股份有限公司	2,966,176.00	2.67%
5	中信证券股份有限公司	2,518,969.00	2.27%
6	邓玉良	2,213,600.00	2.00%
7	夏维	2,031,600.00	1.83%
8	殷红国	990,000.00	0.89%
9	招商证券股份有限公司	989,365.00	0.89%
10	方正证券股份有限公司	972,992.00	0.88%
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	42,060,300.00	37.92%

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 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	401,908,843.00
本报告期基金总申购份额	171,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	462,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,908,843.00

#### 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 2020 年 6 月 22 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起聘任张坤先生、陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员。

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

本报告期内，本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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	49,877,573.33	13.41%	4,988.75	12.73%	-
申万宏源	4	6,006,044.20	1.61%	2,589.38	6.61%	-
华创证券	2	316,172,855.25	84.98%	31,622.02	80.67%	-
广发证券	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。西藏东方财富证券股份有限公司更名为东方财富证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。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
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	913,431.80	71.60%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	362,224.50	28.40%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下部分 ETF 增加海通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	2020-01-02
2	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加华泰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	2020-01-02
3	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加中泰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	2020-01-08
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中金公司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	2020-01-13
5	易方达基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式相关业务规则并修订部分基金基金合同的公告	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	2020-01-18
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2020-01-18
7	易方达基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 1 月 31 日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告	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	2020-01-30

8	易方达基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	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	2020-02-04
9	易方达基金管理有限公司关于部分沪市上市基金增加扩位证券简称的公告	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	2020-03-13
10	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分 A 股 ETF 标的指数许可使用费收取下限的公告	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	2020-03-30
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证券报	2020-03-31
12	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加广发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	2020-04-07
13	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	2020-04-10
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加浙商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	2020-04-15
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2020-04-21
16	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加湘财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	2020-04-28
17	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加兴业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	2020-04-28
18	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中信证券华南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	2020-04-28
19	易方达基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
20	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东吴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	2020-06-01
21	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	2020-06-22

## 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	2020年01月01日~2020年06月30日	89,270,200.00	16,000,000.00	63,209,900.00	42,060,300.00	37.92%
产品特有风险							
<p>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；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；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。</p>							

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

二〇二〇年八月二十八日