

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	55
7.1 期末基金资产组合情况.....	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12	投资组合报告附注	73
8	基金份额持有人信息	74
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
8.2	期末上市基金前十名持有人	75
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	76
9	开放式基金份额变动	76
10	重大事件揭示	76
10.1	基金份额持有人大会决议	76
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	76
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4	基金投资策略的改变	77
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8	其他重大事件	79
11	影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
12	备查文件目录	80
12.1	备查文件目录	80
12.2	存放地点	81
12.3	查阅方式	81

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500ETF
场内简称	ZZ500ETF、中证 500ETF 易方达
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	141,629,628.00 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	2015 年 9 月 14 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，基金管理人可采取包括抽样复制在内的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，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。为更好地实现投资目标，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 500 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室一42891（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
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
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	73,991,381.05
本期利润	99,915,436.14
加权平均基金份额本期利润	0.7890
本期加权平均净值利润率	10.90%
本期基金份额净值增长率	9.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	177,083,234.42
期末可供分配基金份额利润	1.2503
期末基金资产净值	1,096,235,493.85
期末基金份额净值	7.7402
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.27%

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	2.19%	0.74%	1.18%	0.73%	1.01%	0.01%
过去三个月	11.01%	0.68%	8.86%	0.68%	2.15%	0.00%
过去六个月	9.95%	0.99%	6.93%	0.99%	3.02%	0.00%
过去一年	25.14%	1.25%	16.09%	1.25%	9.05%	0.00%
过去三年	47.91%	1.46%	30.48%	1.48%	17.43%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.27%	1.45%	9.13%	1.56%	10.14%	-0.11%

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 500 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

（2015 年 8 月 27 日至 2021 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 19.27%，同期业绩比较基准收益率为 9.13%。

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 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
余海燕	本基金的基金经理、易方达上证 50 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、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达日兴资	2016-04-16	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资

管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达中证 500 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、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2017 年 07 月 27 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2017 年 07 月 14 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达中证军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2015 年 07 月 08 日至 2020 年 12 月 31 日）、易方达中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2015 年 07 月 08 日至 2020 年 12 月 31 日）、易方达中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2015 年 06 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日）、易方达上证 50 指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2015 年 04 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日）、易方达沪深				发展部产品经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理。
---	--	--	--	---

300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				
---	--	--	--	--

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。

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 15 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

2021 年上半年中国经济稳健复苏，GDP 保持了较高的增长，增长质量也在不断上行。从趋势上看，经济已经形成稳中加固的恢复态势；从结构上看，比较能代表经济内生动能的制造业投资明显向好，即便受到了广深局部疫情的扰动，消费也维持了逐渐改善态势，这对经济后续的稳步恢复也起到了较强的支撑作用。根据国家统计局公布的数据，二季度 GDP 增长 7.9%，两年平均增长 5.5%，相比一季度加快 0.5 个百分点。工业生产运行平稳，6 月份规模以上工业增加值同比实际增长 8.3%，两年复合增速来看，则连续 4 个月保持在 6.5%左右的区间范围，反映出工业生产仍然在较高景气区间延续平稳增长。制造业投资继续向好，上半年固定资产投资增速累计同比增长 12.6%，其中两年平均增速 4.4%。消费的修复节奏也好于市场预期，6 月份社会消费品零售总额同比增长 12.1%，两年复合增速 4.9%，较上月的复合增速抬升 0.4 个百分点。宏观政策方面，货币政策延续“温和正常化”态势，市场流动性依然保持在合理充裕的水平。资本市场方面，A 股市场在春节前延续了去年四季度以来的普涨行情，春节后经济复苏预期继续强化带动了部分价值板块反弹，A 股市场出现了较大的风格转换；后续随着美债收益率加速反弹引发了市场的担忧，投资者风险偏好明显回落，市场主要指数均出现了不同幅度的调整；二季度以来 A 股市场整体震荡上涨，市场再次出现风格切换，以创业板指为代表的成长板块大幅反弹，不同指数间表现差异明显，最终上半年上证综指以上涨 3.40% 收官。在风格方面，创业板、科创板等成长板块经过 2、3 月份的调整后大幅反弹再次显著跑赢价值板块，报告期间创业板指、科创 50 指数、上证 50 指数、沪深 300 指数收益率分别为 17.22%、14.01%、-3.90%、0.24%；行业方面，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色金属、电子等板块涨幅居前，保险、家用电器、国防军工、证券公司、房地产等板块表现相对落后。报告期内中证 500 指数上涨 6.93%。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，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。

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 7.7402 元，本报告期份额净值增长率为 9.95%，同期业绩比较基准收益率为 6.93%，年化跟踪误差 0.54%，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，随着疫苗逐步落地，百年一遇的疫情渐行渐远，全球经济会进一步复苏。下半年中国经济在全球将率先演绎“疫后复苏、政策退出”的情景，经济增长动能可能会有所回落，主要

是由于受抑制需求消退、重新开放的发达市场转向服务消费导致我国出口减弱、房地产收紧调控的影响终将显现、原材料价格飙升拖累实际需求等因素导致。与此同时，宏观政策将保持“相机抉择”的态势，在经济增速回落的背景下政策可能稳中趋松。这种市场环境下资本市场的焦点可能会从此前的通胀转向更加关注增长可持续性，产业升级、消费升级所代表的“新经济”趋势可能会重回市场的主线。在当前时点，流动性推升全球多数主要国家地区的股票市场创下历史或阶段性新高，相比之下 A 股的宏观经济复苏更早、企业的盈利增速确定性更高、货币政策更早常态化，且 A 股正处于资本市场制度建设和对外开放的上升期；同时我们也看到了疫情检验了中国制造业的韧性和竞争力，中国制造业正在借助内需大市场衍生出的众多优势实现了产业升级与产业自主趋势强化；本次疫情更是一场对不同经济体的大考，中国从社会管理、社会组织、资源动员、制度等方面都经受了考验，领先全球，这一因素理应也会在未来逐步体现到中国资产的风险溢价中。当前海外刺激政策仍持续、国内经济表现强劲的基本面环境意味着风险资产仍更受青睐。资本市场在近年持续改革之后与新经济领域正在形成相互促进的良性互动，资本市场也在进入快速发展的新阶段。改革与开放继续落地，中国资本市场正在经历新的大发展，股市流动性相对充裕。中国经济依然具有较强的内生动力，中长期乐观趋势不改。2021 年是中国“十四五”规划的开局之年，在十四五规划纲要中，强调高质量发展是新阶段的显著特征，中国经济的结构转型仍在深化，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点，A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地。通过资本市场把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业升级，改善上市公司业绩，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

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，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期高成长提供良好的投资工具。

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。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	42,471,424.09	24,560,741.47
结算备付金		23,135,227.34	25,350,698.37
存出保证金		10,658,842.73	8,104,726.77
交易性金融资产	6.4.7.2	1,020,889,363.74	842,091,890.16
其中：股票投资		1,020,376,367.12	841,629,794.03
基金投资		-	-
债券投资		512,996.62	462,096.13
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		5,065,057.91	4,380,633.29
应收利息	6.4.7.5	43,542.85	53,384.16
应收股利		113,535.71	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,102,376,994.37	904,542,074.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,060,641.49	3,943,910.10
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		125,036.04	111,895.30
应付托管费		41,678.66	37,298.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	54,651.00	141,847.20

应交税费		84,699.87	60,377.33
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	774,793.46	1,262,104.98
负债合计		6,141,500.52	5,557,433.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	919,152,259.43	828,728,716.72
未分配利润	6.4.7.10	177,083,234.42	70,255,924.13
所有者权益合计		1,096,235,493.85	898,984,640.85
负债和所有者权益总计		1,102,376,994.37	904,542,074.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.7402 元，基金份额总额 141,629,628.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		101,718,015.13	125,249,850.80
1.利息收入		1,214,960.46	313,300.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	243,208.59	312,744.04
债券利息收入		406.06	556.75
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		971,345.81	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		73,407,609.79	99,917,741.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	60,535,415.10	88,457,451.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	170,870.11	890,856.66
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	4,599,718.45	5,757,025.59
股利收益	6.4.7.15	8,101,606.13	4,812,407.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	25,924,055.09	25,825,256.05
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	1,171,389.79	-806,447.29

减：二、费用		1,802,578.99	1,991,172.20
1. 管理人报酬		680,445.52	589,629.41
2. 托管费		226,815.11	196,543.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	637,652.46	976,482.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		20,056.78	20,727.22
7. 其他费用	6.4.7.19	237,609.12	207,790.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		99,915,436.14	123,258,678.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		99,915,436.14	123,258,678.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	828,728,716.72	70,255,924.13	898,984,640.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	99,915,436.14	99,915,436.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	90,423,542.71	6,911,874.15	97,335,416.86
其中：1.基金申购款	538,221,835.78	59,395,545.34	597,617,381.12
2.基金赎回款	-447,798,293.07	-52,483,671.19	-500,281,964.26
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）	919,152,259.43	177,083,234.42	1,096,235,493.85
项目	上年度可比期间 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	1,089,619,896.34	-186,317,983.46	903,301,912.88

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	123,258,678.60	123,258,678.60
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)	-330,981,347.16	27,461,711.04	-303,519,636.12
其中: 1.基金申购款	782,673,538.38	-117,025,579.66	665,647,958.72
2.基金赎回款	-1,113,654,885.54	144,487,290.70	-969,167,594.84
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)	758,638,549.18	-35,597,593.82	723,040,955.36

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 500 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[2014]999 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2015]2176 号《关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金延期募集备案的回函》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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 295,259,000.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 16,000.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与中证 500 指数进行对比,根据《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,易方达基金管理有限公司确定 2015 年 9 月 9 日为本基金的基金份额折算日。当日中证 500 指数收盘值为 6551.01 点,本基金资产净值为 298,052,917.95 元,折算前基金份额总额为 295,259,000 份,折算前基金份额净值为 1.0095 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.15409267,折算后基金份额总额

为 45,496,515 份,折算后基金份额净值为 6.5511 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2015 年 9 月 10 日进行了变更登记。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增

值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	42,471,424.09
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	42,471,424.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		966,428,372.69	1,020,376,367.12	53,947,994.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	512,996.62	512,996.62	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	512,996.62	512,996.62	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		966,941,369.31	1,020,889,363.74	53,947,994.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	66,107,880.00	-	-	-
IC2107	17,020,160.00	-	-	-
IC2109	17,890,720.00	-	-	-
IC2112	31,197,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	66,107,880.00	-	-	-

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 2021 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)
IC2107	IC2107	13	17,594,720.00	574,560.00
IC2109	IC2109	15	20,001,000.00	2,110,280.00
IC2112	IC2112	25	32,606,000.00	1,409,000.00
总额合计				4,093,840.00
减:可抵销期货暂收款				4,093,840.00
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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,766.80
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	10,278.83
应收债券利息	29.30
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	29,415.90
其他	52.02
合计	43,542.85

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	54,651.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	54,651.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
预提费用	219,178.95
应付替代款	472,815.02
可退替代款	9,373.00
其他应付款	73,426.49
合计	774,793.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,696,515.00	828,728,716.72
本期申购	82,933,113.00	538,221,835.78
本期赎回（以“-”号填列）	-69,000,000.00	-447,798,293.07
本期末	141,629,628.00	919,152,259.43

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	526,864,165.34	-456,608,241.21	70,255,924.13
本期利润	73,991,381.05	25,924,055.09	99,915,436.14
本期基金份额交易产生的变动数	65,822,054.61	-58,910,180.46	6,911,874.15
其中：基金申购款	361,689,730.75	-302,294,185.41	59,395,545.34
基金赎回款	-295,867,676.14	243,384,004.95	-52,483,671.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	666,677,601.00	-489,594,366.58	177,083,234.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	60,890.54
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	180,012.06
其他	2,305.99
合计	243,208.59

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	48,494,408.90
股票投资收益——赎回差价收入	12,041,006.20
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	60,535,415.10

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	434,310,171.36
减：卖出股票成本总额	385,815,762.46
买卖股票差价收入	48,494,408.90

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	500,281,964.26
减：现金支付赎回款总额	264,098,339.26
减：赎回股票成本总额	224,142,618.80
赎回差价收入	12,041,006.20

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,022,387.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,851,074.72
减：应收利息总额	442.79
买卖债券差价收入	170,870.11

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	4,599,718.45

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	8,101,606.13
其中：证券出借权益补偿收入	954,166.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,101,606.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	23,408,045.09
——股票投资	23,408,045.09
——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	2,516,010.00
——权证投资	-
——期货投资	2,516,010.00
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	25,924,055.09

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	2,748.63
替代损益收入	1,168,641.16
其他	-
合计	1,171,389.79

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 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	637,652.46

银行间市场交易费用	-
合计	637,652.46

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,340.97
指数使用费	136,089.20
合计	237,609.12

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

本基金已于 2021 年 7 月 16 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 10,即每 1 份基金份额拆成 10 份。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	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 500 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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 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	680,445.52	589,629.41
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年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	226,815.11	196,543.11

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	106,274,300.00	75.0368%	98,962,500.00	77.4982%
广发证券	1,383,382.00	0.9768%	2,237,332.00	1.7521%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	42,471,424.09	60,890.54	26,900,306.64	108,049.48

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商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 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
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
-	-	-	-	-	-

注：报告期内本基金参与了九丰能源首次公开发行的申购，此次发行的分销商广发证券股份有限公司为本基金管理人的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

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（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
30092	博俊	2020-1	2021-0	新股	10.76	22.20	359	3,862.	7,969.	-

6	科技	2-29	7-12	流通受限				84	80	
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	705	33,367.65	177,631.80	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

				受限						
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301017	雷尔	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.00	9,069.00	-

6	伟	6-23	2-30	流通受限				25	50	
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
688216	气派科技	2021-06-15	2021-12-23	新股流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688597	煜邦电力	2021-06-09	2021-12-17	新股流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股流通受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688639	华恒生物	2021-04-14	2021-10-22	新股流通受限	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	新股流通受限	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-

688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	新股流通受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
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
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	2,590	258,997.73	258,997.73	-
113051	节能转债	2021-06-22	2021-07-22	新发流通受限	100.00	100.00	2,540	253,998.89	253,998.89	-

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项停牌	3.05	2021-07-14	3.36	488,866	1,769,058.25	1,491,041.30	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	128,910	3,153,351.48	7,264,078.50	-

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 2021 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 2021 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值总 额
1	000009	中国宝安	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	18.27	68,400.00	1,249,668.00
2	000012	南玻 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.24	36,400.00	372,736.00
3	000021	深科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	19.14	23,300.00	445,962.00
4	000027	深圳能源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.17	37,700.00	345,709.00
5	000031	大悦城	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.60	33,900.00	122,040.00
6	000039	中集集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	18.18	28,300.00	514,494.00
7	000046	泛海控股	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	2.30	17,900.00	41,170.00
8	000050	深天马 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	14.18	26,100.00	370,098.00
9	000060	中金岭南	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.52	66,100.00	298,772.00
10	000061	农产品	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	5.52	18,000.00	99,360.00
11	000078	海王生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.26	43,800.00	142,788.00
12	000089	深圳机场	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.77	27,000.00	209,790.00
13	000090	天健集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.53	34,600.00	191,338.00
14	000158	常山北明	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.49	25,400.00	291,846.00
15	000400	许继电气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.66	14,900.00	188,634.00
16	000401	冀东水泥	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.35	11,000.00	135,850.00
17	000402	金融街	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.75	31,700.00	213,975.00
18	000415	渤海租赁	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	2.42	28,400.00	68,728.00
19	000488	晨鸣纸业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.14	32,500.00	264,550.00
20	000537	广宇发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	5.23	14,900.00	77,927.00
21	000540	中天金融	2021 年 7 月 1 日	2.73	112,800.00	307,944.00

			-2021 年 7 月 8 日			
22	000547	航天发展	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	18.87	33,900.00	639,693.00
23	000559	万向钱潮	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.31	35,000.00	185,850.00
24	000563	陕国投 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.22	52,400.00	168,728.00
25	000581	威孚高科	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	20.83	13,200.00	274,956.00
26	000598	兴蓉环境	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.21	47,600.00	247,996.00
27	000623	吉林敖东	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	15.49	24,600.00	381,054.00
28	000629	攀钢钒钛	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.29	113,900.00	260,831.00
29	000630	铜陵有色	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.72	195,300.00	531,216.00
30	000681	视觉中国	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.93	11,200.00	144,816.00
31	000685	中山公用	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.16	23,300.00	190,128.00
32	000686	东北证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.45	37,000.00	312,650.00
33	000690	宝新能源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.11	46,100.00	235,571.00
34	000709	河钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.46	113,800.00	279,948.00
35	000717	韶钢松山	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.59	32,100.00	147,339.00
36	000718	苏宁环球	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.29	40,300.00	334,087.00
37	000729	燕京啤酒	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.24	37,200.00	269,328.00
38	000738	航发控制	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	20.83	15,300.00	318,699.00
39	000739	普洛药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	29.40	15,700.00	461,580.00
40	000750	国海证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.24	100,800.00	427,392.00
41	000778	新兴铸管	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.72	63,400.00	235,848.00
42	000807	云铝股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.90	41,300.00	491,470.00
43	000813	德展健康	2021 年 7 月 1 日	4.54	23,700.00	107,598.00

			-2021 年 7 月 8 日			
44	000825	太钢不锈	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.49	60,400.00	452,396.00
45	000830	鲁西化工	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	18.73	27,000.00	505,710.00
46	000877	天山股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	13.03	16,500.00	214,995.00
47	000878	云南铜业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	12.83	26,900.00	345,127.00
48	000883	湖北能源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.59	51,600.00	236,844.00
49	000887	中鼎股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	12.08	10,900.00	131,672.00
50	000898	鞍钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.45	63,500.00	282,575.00
51	000930	中粮科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.01	29,700.00	267,597.00
52	000932	华菱钢铁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.60	48,600.00	320,760.00
53	000937	冀中能源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.93	28,100.00	110,433.00
54	000959	首钢股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	5.62	18,200.00	102,284.00
55	000960	锡业股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	16.03	26,400.00	423,192.00
56	000967	盈峰环境	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	6.87	14,200.00	97,554.00
57	000970	中科三环	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.55	22,700.00	216,785.00
58	000975	银泰黄金	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.51	44,300.00	421,293.00
59	000983	山西焦煤	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.31	54,400.00	452,064.00
60	000988	华工科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	23.52	12,000.00	282,240.00
61	000990	诚志股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.73	16,500.00	210,045.00
62	000997	新大陆	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	16.59	19,200.00	318,528.00
63	000998	隆平高科	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	16.04	24,400.00	391,376.00
64	000999	华润三九	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	26.75	10,300.00	275,525.00
65	001914	招商积余	2021 年 7 月 8 日	17.18	11,300.00	194,134.00

			-2021 年 7 月 8 日			
66	002004	华邦健康	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.21	41,900.00	260,199.00
67	002010	传化智联	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.71	34,400.00	265,224.00
68	002013	中航机电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.07	51,200.00	515,584.00
69	002030	达安基因	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	21.24	15,700.00	333,468.00
70	002038	双鹭药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	10.53	15,900.00	167,427.00
71	002048	宁波华翔	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	19.50	13,200.00	257,400.00
72	002056	横店东磁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	13.00	12,200.00	158,600.00
73	002074	国轩高科	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	43.56	27,100.00	1,180,476.00
74	002075	沙钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.91	46,800.00	510,588.00
75	002078	太阳纸业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	13.35	41,300.00	551,355.00
76	002080	中材科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	26.17	10,400.00	272,168.00
77	002081	金螳螂	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.92	42,700.00	338,184.00
78	002092	中泰化学	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.27	45,500.00	467,285.00
79	002110	三钢闽光	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.74	32,500.00	219,050.00
80	002124	天邦股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.01	24,400.00	171,044.00
81	002128	露天煤业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	10.41	11,500.00	119,715.00
82	002131	利欧股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.34	178,800.00	418,392.00
83	002138	顺络电子	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	38.77	17,000.00	659,090.00
84	002152	广电运通	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	13.03	31,900.00	415,657.00
85	002155	湖南黄金	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.75	12,600.00	97,650.00
86	002156	通富微电	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	24.04	17,600.00	423,104.00
87	002174	游族网络	2021 年 7 月 1 日	17.17	11,000.00	188,870.00

			-2021 年 7 月 1 日			
88	002183	怡亚通	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.73	39,400.00	225,762.00
89	002185	华天科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	15.39	58,200.00	895,698.00
90	002191	劲嘉股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.64	23,100.00	245,784.00
91	002195	二三四五	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	2.03	66,000.00	133,980.00
92	002203	海亮股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.64	25,900.00	275,576.00
93	002212	天融信	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	19.77	24,900.00	492,273.00
94	002221	东华能源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.95	30,500.00	333,975.00
95	002233	塔牌集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	10.28	10,600.00	108,968.00
96	002244	滨江集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.19	41,100.00	172,209.00
97	002249	大洋电机	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.25	37,500.00	196,875.00
98	002250	联化科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	27.90	18,900.00	527,310.00
99	002266	浙富控股	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	4.99	24,100.00	120,259.00
100	002268	卫士通	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	19.48	15,600.00	303,888.00
101	002273	水晶光电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	14.69	32,300.00	474,487.00
102	002281	光迅科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	24.60	11,100.00	273,060.00
103	002294	信立泰	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	32.90	11,100.00	365,190.00
104	002299	圣农发展	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	23.88	16,500.00	394,020.00
105	002340	格林美	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.35	101,300.00	947,155.00
106	002353	杰瑞股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	44.70	15,300.00	683,910.00
107	002372	伟星新材	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	20.67	16,500.00	341,055.00
108	002373	千方科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	16.70	11,800.00	197,060.00
109	002375	亚厦股份	2021 年 7 月 8 日	7.92	17,700.00	140,184.00

			-2021 年 7 月 8 日			
110	002382	蓝帆医疗	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	20.85	17,000.00	354,450.00
111	002385	大北农	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.80	77,800.00	529,040.00
112	002390	信邦制药	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.48	30,800.00	322,784.00
113	002396	星网锐捷	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	21.35	12,500.00	266,875.00
114	002408	齐翔腾达	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	12.42	10,600.00	131,652.00
115	002416	爱施德	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	10.03	16,100.00	161,483.00
116	002419	天虹股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	6.56	11,600.00	76,096.00
117	002424	贵州百灵	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.36	10,500.00	77,280.00
118	002429	兆驰股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.07	47,800.00	290,146.00
119	002434	万里扬	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	8.11	17,700.00	143,547.00
120	002440	闰土股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	8.85	10,300.00	91,155.00
121	002444	巨星科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	34.08	15,200.00	518,016.00
122	002458	益生股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	9.97	15,900.00	158,523.00
123	002465	海格通信	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.46	48,800.00	461,648.00
124	002468	申通快递	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	7.62	16,100.00	122,682.00
125	002500	山西证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.71	57,100.00	383,141.00
126	002505	鹏都农牧	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.24	67,600.00	151,424.00
127	002506	协鑫集成	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.48	80,700.00	280,836.00
128	002507	涪陵榨菜	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	37.66	14,700.00	553,602.00
129	002511	中顺洁柔	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	27.55	17,300.00	476,615.00
130	002563	森马服饰	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	11.95	12,100.00	144,595.00
131	002572	索菲亚	2021 年 7 月 8 日	24.20	16,800.00	406,560.00

			-2021 年 7 月 8 日			
132	002583	海能达	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.04	24,300.00	122,472.00
133	002595	豪迈科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	26.70	10,600.00	283,020.00
134	002603	以岭药业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	29.16	15,700.00	457,812.00
135	002670	国盛金控	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.39	30,600.00	348,534.00
136	002683	宏大爆破	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	27.77	14,000.00	388,780.00
137	002701	奥瑞金	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.14	44,800.00	230,272.00
138	002745	木林森	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	13.40	19,300.00	258,620.00
139	002797	第一创业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.14	78,100.00	557,634.00
140	002839	张家港行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.44	33,700.00	183,328.00
141	002926	华西证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.63	34,700.00	334,161.00
142	300001	特锐德	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	30.11	16,000.00	481,760.00
143	300002	神州泰岳	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.85	51,900.00	251,715.00
144	300009	安科生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	14.90	25,400.00	378,460.00
145	300010	豆神教育	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	5.67	8,100.00	45,927.00
146	300017	网宿科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.85	51,900.00	303,615.00
147	300024	机器人	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.67	33,200.00	354,244.00
148	300026	红日药业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.25	47,600.00	202,300.00
149	300058	蓝色光标	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.05	52,800.00	319,440.00
150	300070	碧水源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.31	58,700.00	429,097.00
151	300088	长信科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.26	65,000.00	536,900.00
152	300113	顺网科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	12.94	11,100.00	143,634.00
153	300133	华策影视	2021 年 7 月 1 日	5.92	32,600.00	192,992.00

			-2021 年 7 月 8 日			
154	300146	汤臣倍健	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	32.90	21,100.00	694,190.00
155	300166	东方国信	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	12.36	22,400.00	276,864.00
156	300168	万达信息	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	14.60	22,100.00	322,660.00
157	300180	华峰超纤	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.95	32,800.00	162,360.00
158	300207	欣旺达	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	32.56	29,300.00	954,008.00
159	300212	易华录	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	26.91	10,300.00	277,173.00
160	300223	北京君正	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	100.9 2	5,100.00	514,692.00
161	300244	迪安诊断	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	38.30	11,600.00	444,280.00
162	300271	华宇软件	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	19.25	17,200.00	331,100.00
163	300285	国瓷材料	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	48.75	20,300.00	989,625.00
164	300296	利亚德	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	7.82	20,700.00	161,874.00
165	300315	掌趣科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.25	72,900.00	309,825.00
166	300316	晶盛机电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	50.50	17,000.00	858,500.00
167	300357	我武生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	64.12	8,400.00	538,608.00
168	300418	昆仑万维	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	16.38	21,800.00	357,084.00
169	300463	迈克生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	42.09	5,900.00	248,331.00
170	300474	景嘉微	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	97.92	4,000.00	391,680.00
171	300482	万孚生物	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	64.69	3,300.00	213,477.00
172	300618	寒锐钴业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	78.84	4,000.00	315,360.00
173	300630	普利制药	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	52.40	6,900.00	361,560.00
174	300699	光威复材	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	75.95	3,800.00	288,610.00
175	600006	东风汽车	2021 年 7 月 1 日	7.30	12,000.00	87,600.00

			-2021 年 7 月 1 日			
176	600008	首创环保	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.01	116,700.00	351,267.00
177	600021	上海电力	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.91	21,900.00	151,329.00
178	600022	山东钢铁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	1.72	145,000.00	249,400.00
179	600026	中远海能	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.16	36,800.00	226,688.00
180	600037	歌华有线	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.61	25,900.00	248,899.00
181	600039	四川路桥	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.27	42,000.00	263,340.00
182	600056	中国医药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.15	14,100.00	171,315.00
183	600060	海信视像	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	16.90	11,800.00	199,420.00
184	600062	华润双鹤	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	11.91	13,800.00	164,358.00
185	600064	南京高科	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.29	23,000.00	213,670.00
186	600089	特变电工	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	12.85	99,500.00	1,278,575.00
187	600094	大名城	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.77	42,200.00	159,094.00
188	600120	浙江东方	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.28	35,500.00	151,940.00
189	600126	杭钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.13	35,800.00	183,654.00
190	600141	兴发集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	18.83	14,900.00	280,567.00
191	600153	建发股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.10	45,500.00	368,550.00
192	600155	华创阳安	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.70	32,300.00	345,610.00
193	600158	中体产业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	11.41	17,800.00	203,098.00
194	600160	巨化股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.84	35,800.00	316,472.00
195	600166	福田汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.45	122,100.00	421,245.00
196	600167	联美控股	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.93	24,200.00	216,106.00
197	600170	上海建工	2021 年 7 月 1 日	2.76	119,500.00	329,820.00

			-2021 年 7 月 8 日			
198	600188	兖州煤业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	15.36	23,700.00	364,032.00
199	600195	中牧股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	11.96	15,300.00	182,988.00
200	600201	生物股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	17.45	29,900.00	521,755.00
201	600216	浙江医药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	16.01	17,900.00	286,579.00
202	600219	南山铝业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.60	192,200.00	691,920.00
203	600256	广汇能源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.33	107,500.00	357,975.00
204	600258	首旅酒店	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	23.86	12,700.00	303,022.00
205	600266	城建发展	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	4.74	20,300.00	96,222.00
206	600282	南钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.56	81,400.00	289,784.00
207	600307	酒钢宏兴	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.32	83,100.00	192,792.00
208	600312	平高电气	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	5.84	12,200.00	71,248.00
209	600325	华发股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.74	44,800.00	301,952.00
210	600339	中油工程	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.84	44,200.00	125,528.00
211	600348	华阳股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.42	31,900.00	236,698.00
212	600350	山东高速	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	6.15	16,500.00	101,475.00
213	600372	中航电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	16.55	11,700.00	193,635.00
214	600373	中文传媒	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	9.86	10,200.00	100,572.00
215	600376	首开股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.60	34,100.00	190,960.00
216	600380	健康元	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	13.73	31,000.00	425,630.00
217	600388	龙净环保	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	8.52	10,000.00	85,200.00
218	600392	盛和资源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	17.36	36,800.00	638,848.00
219	600398	海澜之家	2021 年 7 月 1 日	7.24	34,600.00	250,504.00

			-2021 年 7 月 8 日			
220	600409	三友化工	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.11	32,900.00	332,619.00
221	600415	小商品城	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	5.15	40,900.00	210,635.00
222	600418	江淮汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	12.43	35,100.00	436,293.00
223	600435	北方导航	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.94	27,500.00	218,350.00
224	600446	金证股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	14.44	14,700.00	212,268.00
225	600460	士兰微	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	56.35	12,000.00	676,200.00
226	600497	驰宏锌锗	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.31	67,300.00	290,063.00
227	600500	中化国际	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.86	36,700.00	288,462.00
228	600507	方大特钢	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	6.78	16,200.00	109,836.00
229	600516	方大炭素	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.44	61,200.00	455,328.00
230	600517	国网英大	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	6.81	16,700.00	113,727.00
231	600528	中铁工业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	8.10	20,000.00	162,000.00
232	600529	山东药玻	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	33.95	11,300.00	383,635.00
233	600535	天士力	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	14.81	24,000.00	355,440.00
234	600546	山煤国际	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.18	12,100.00	86,878.00
235	600549	厦门钨业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	20.83	12,700.00	264,541.00
236	600567	山鹰国际	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.45	85,300.00	294,285.00
237	600572	康恩贝	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.44	49,400.00	219,336.00
238	600580	卧龙电驱	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	13.30	11,800.00	156,940.00
239	600582	天地科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	3.90	24,800.00	96,720.00
240	600597	光明乳业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	14.41	15,600.00	224,796.00
241	600598	北大荒	2021 年 7 月 1 日	14.96	10,600.00	158,576.00

			-2021 年 7 月 1 日			
242	600623	华谊集团	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	8.81	14,800.00	130,388.00
243	600633	浙数文化	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.18	11,800.00	84,724.00
244	600642	申能股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.14	65,200.00	400,328.00
245	600643	爱建集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	6.98	12,200.00	85,156.00
246	600649	城投控股	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.76	33,600.00	159,936.00
247	600657	信达地产	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.48	22,800.00	79,344.00
248	600667	太极实业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.10	39,100.00	355,810.00
249	600673	东阳光	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.49	40,000.00	179,600.00
250	600699	均胜电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	25.52	12,300.00	313,896.00
251	600704	物产中大	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.87	67,000.00	527,290.00
252	600717	天津港	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.92	32,000.00	125,440.00
253	600718	东软集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.78	22,800.00	222,984.00
254	600728	佳都科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.41	37,100.00	274,911.00
255	600733	北汽蓝谷	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	13.48	55,500.00	748,140.00
256	600737	中粮糖业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.01	28,300.00	283,283.00
257	600739	辽宁成大	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	20.81	32,400.00	674,244.00
258	600755	厦门国贸	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.21	34,600.00	284,066.00
259	600776	东方通信	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.40	11,900.00	147,560.00
260	600782	新钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	5.58	24,000.00	133,920.00
261	600787	中储股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.33	23,200.00	123,656.00
262	600801	华新水泥	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	17.57	10,200.00	179,214.00
263	600804	鹏博士	2021 年 7 月 1 日	4.84	37,900.00	183,436.00

			-2021 年 7 月 8 日			
264	600808	马钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.29	63,000.00	270,270.00
265	600811	东方集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.05	78,800.00	240,340.00
266	600820	隧道股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.29	50,000.00	264,500.00
267	600823	世茂股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.04	29,900.00	120,796.00
268	600827	百联股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	20.15	12,100.00	243,815.00
269	600839	四川长虹	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.91	97,800.00	284,598.00
270	600862	中航高科	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	30.78	10,500.00	323,190.00
271	600863	内蒙华电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.33	61,700.00	143,761.00
272	600867	通化东宝	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.94	38,100.00	454,914.00
273	600871	石化油服	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	1.97	51,000.00	100,470.00
274	600875	东方电气	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	10.97	29,500.00	323,615.00
275	600879	航天电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.52	57,700.00	433,904.00
276	600881	亚泰集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.85	86,200.00	245,670.00
277	600884	杉杉股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	23.32	30,000.00	699,600.00
278	600895	张江高科	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	18.27	11,700.00	213,759.00
279	600901	江苏租赁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.20	31,700.00	164,840.00
280	600909	华安证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	5.57	32,700.00	182,139.00
281	600928	西安银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	4.66	20,200.00	94,132.00
282	600959	江苏有线	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.05	52,700.00	160,735.00
283	600967	内蒙一机	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	10.12	12,700.00	128,524.00
284	600968	海油发展	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.59	54,600.00	141,414.00
285	600970	中材国际	2021 年 7 月 1 日	9.17	27,600.00	253,092.00

			-2021 年 7 月 8 日			
286	601000	唐山港	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.41	78,600.00	189,426.00
287	601005	重庆钢铁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.67	155,400.00	414,918.00
288	601016	节能风电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.74	52,800.00	197,472.00
289	601098	中南传媒	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	8.82	10,700.00	94,374.00
290	601099	太平洋	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.39	180,700.00	612,573.00
291	601106	中国一重	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.39	72,500.00	245,775.00
292	601118	海南橡胶	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.09	45,300.00	230,577.00
293	601128	常熟银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.20	72,400.00	448,880.00
294	601139	深圳燃气	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	6.56	15,300.00	100,368.00
295	601168	西部矿业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.93	50,600.00	603,658.00
296	601179	中国西电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.12	54,400.00	224,128.00
297	601228	广州港	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.18	33,100.00	105,258.00
298	601233	桐昆股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	24.09	39,600.00	953,964.00
299	601298	青岛港	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	6.18	10,600.00	65,508.00
300	601333	广深铁路	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.12	90,000.00	190,800.00
301	601598	中国外运	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.05	41,700.00	210,585.00
302	601608	中信重工	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.74	46,000.00	172,040.00
303	601611	中国核建	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.22	12,000.00	86,640.00
304	601615	明阳智能	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	16.19	10,000.00	161,900.00
305	601699	潞安环能	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.81	31,700.00	374,377.00
306	601717	郑煤机	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.63	27,600.00	320,988.00
307	601718	际华集团	2021 年 7 月 1 日	2.82	58,300.00	164,406.00

			-2021 年 7 月 8 日			
308	601801	皖新传媒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	4.72	15,900.00	75,048.00
309	601828	美凯龙	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	12.00	11,900.00	142,800.00
310	601860	紫金银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.63	48,400.00	175,692.00
311	601928	凤凰传媒	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	7.14	11,500.00	82,110.00
312	601958	金钼股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	6.48	25,700.00	166,536.00
313	601969	海南矿业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	11.63	10,300.00	119,789.00
314	601975	招商南油	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.14	91,600.00	196,024.00
315	601992	金隅集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.69	111,900.00	301,011.00
316	601997	贵阳银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	7.16	69,100.00	494,756.00
317	603000	人民网	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	17.19	14,700.00	252,693.00
318	603077	和邦生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	2.08	140,300.00	291,824.00
319	603858	步长制药	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	22.49	15,200.00	341,848.00
320	603885	吉祥航空	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	15.26	15,900.00	242,634.00
321	688099	晶晨股份	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	112.20	3,200.00	359,040.00
合计	-	-	-	-	11,631,000.00	95,545,310.00

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

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。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对约定申报的债券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的债券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2021 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 0.05%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	259,015.90	441,030.93
AAA 以下	254,010.02	21,101.94
未评级	0.00	0.00
合计	513,025.92	462,132.87

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021 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 2021 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	42,471,424.09	-	-	-	42,471,424.09
结算备付金	23,135,227.34	-	-	-	23,135,227.34
存出保证金	10,658,842.73	-	-	-	10,658,842.73
交易性金融资产	-	-	512,996.62	1,020,376,367.12	1,020,889,363.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,065,057.91	5,065,057.91
应收利息	-	-	-	43,542.85	43,542.85
应收股利	-	-	-	113,535.71	113,535.71

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	76,265,494.16	-	512,996.62	1,025,598,503.59	1,102,376,994.37
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	-	-	-	5,060,641.49	5,060,641.49
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	125,036.04	125,036.04
应付托管费	-	-	-	41,678.66	41,678.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	54,651.00	54,651.00
应交税费	-	-	-	84,699.87	84,699.87
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	774,793.46	774,793.46
负债总计	-	-	-	6,141,500.52	6,141,500.52
利率敏感度缺口	76,265,494.16	-	512,996.62	1,019,457,003.07	1,096,235,493.85
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,560,741.47	-	-	-	24,560,741.47
结算备付金	25,350,698.37	-	-	-	25,350,698.37
存出保证金	8,104,726.77	-	-	-	8,104,726.77
交易性金融资产	-	-	462,096.13	841,629,794.03	842,091,890.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	4,380,633.29	4,380,633.29
应收利息	-	-	-	53,384.16	53,384.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	58,016,166.61	-	462,096.13	846,063,811.48	904,542,074.22
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	-	-	-	3,943,910.10	3,943,910.10
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	111,895.30	111,895.30
应付托管费	-	-	-	37,298.46	37,298.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	141,847.20	141,847.20
应交税费	-	-	-	60,377.33	60,377.33
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,262,104.98	1,262,104.98
负债总计	-	-	-	5,557,433.37	5,557,433.37
利率敏感度缺口	58,016,166.61	-	462,096.13	840,506,378.11	898,984,640.85

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,020,376,367.12	93.08	841,629,794.03	93.62
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,020,376,367.12	93.08	841,629,794.03	93.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	50,708,787.16	41,816,135.50
	2.业绩比较基准下降 5%	-50,708,787.16	-41,816,135.50

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 2021 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 1,005,336,589.78 元,属于第二层次的余额为 15,552,773.96 元,无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日:第一层次 833,006,947.81 元,第二层次 9,084,942.35 元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票,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 2021 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(2020 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	1,020,376,367.12	92.56
	其中:股票	1,020,376,367.12	92.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	512,996.62	0.05

	其中：债券	512,996.62	0.05
	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	65,606,651.43	5.95
8	其他各项资产	15,880,979.20	1.44
9	合计	1,102,376,994.37	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 95,545,310.00 元，占净值比例 8.72%。

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	9,929,497.54	0.91
B	采矿业	31,648,769.14	2.89
C	制造业	644,903,664.44	58.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,602,209.43	2.70
E	建筑业	18,703,671.76	1.71
F	批发和零售业	34,746,618.37	3.17
G	交通运输、仓储和邮政业	19,566,215.30	1.78
H	住宿和餐饮业	5,420,454.46	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,112,303.12	7.67
J	金融业	59,262,937.12	5.41
K	房地产业	33,057,072.39	3.02
L	租赁和商务服务业	13,385,915.06	1.22
M	科学研究和技术服务业	2,671,441.50	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	8,624,950.25	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	649,374.74	0.06

Q	卫生和社会工作	2,757,217.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	10,196,768.70	0.93
S	综合	11,137,286.80	1.02
	合计	1,020,376,367.12	93.08

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	002709	天赐材料	94,803	10,104,103.74	0.92
2	000799	酒鬼酒	38,100	9,738,360.00	0.89
3	603486	科沃斯	38,335	8,743,446.80	0.80
4	600089	特变电工	613,300	7,880,905.00	0.72
5	000009	中国宝安	426,280	7,788,135.60	0.71
6	002340	格林美	790,550	7,391,642.50	0.67
7	002074	国轩高科	169,400	7,379,064.00	0.67
8	600460	士兰微	128,910	7,264,078.50	0.66
9	300285	国瓷材料	132,600	6,464,250.00	0.59
10	601233	桐昆股份	264,400	6,369,396.00	0.58
11	300207	欣旺达	181,700	5,916,152.00	0.54
12	002185	华天科技	362,300	5,575,797.00	0.51
13	600885	宏发股份	86,172	5,402,984.40	0.49
14	300316	晶盛机电	106,300	5,368,150.00	0.49
15	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.47
16	601636	旗滨集团	266,000	4,936,960.00	0.45
17	600733	北汽蓝谷	353,850	4,769,898.00	0.44
18	300037	新宙邦	47,400	4,744,740.00	0.43
19	300146	汤臣倍健	140,900	4,635,610.00	0.42
20	300253	卫宁健康	282,000	4,588,140.00	0.42
21	002648	卫星石化	113,520	4,448,848.80	0.41
22	002625	光启技术	213,700	4,447,097.00	0.41
23	002223	鱼跃医疗	115,680	4,410,878.40	0.40
24	600884	杉杉股份	188,607	4,398,315.24	0.40
25	603737	三棵树	24,980	4,396,480.00	0.40
26	601127	小康股份	64,060	4,270,880.20	0.39
27	600219	南山铝业	1,184,600	4,264,560.00	0.39
28	002353	杰瑞股份	95,250	4,257,675.00	0.39
29	002138	顺络电子	106,700	4,136,759.00	0.38
30	600779	水井坊	32,700	4,131,645.00	0.38
31	603589	口子窖	59,849	4,051,178.81	0.37

32	000547	航天发展	212,371	4,007,440.77	0.37
33	002797	第一创业	555,600	3,966,984.00	0.36
34	600704	物产中大	503,700	3,964,119.00	0.36
35	688099	晶晨股份	34,967	3,923,297.40	0.36
36	000988	华工科技	166,580	3,917,961.60	0.36
37	300699	光威复材	51,500	3,911,425.00	0.36
38	002212	天融信	195,600	3,867,012.00	0.35
39	002444	巨星科技	113,150	3,856,152.00	0.35
40	603893	瑞芯微	27,600	3,849,096.00	0.35
41	601099	太平洋	1,125,975	3,817,055.25	0.35
42	603444	吉比特	7,122	3,774,660.00	0.34
43	002422	科伦药业	188,700	3,764,565.00	0.34
44	601168	西部矿业	315,340	3,762,006.20	0.34
45	688002	睿创微纳	37,502	3,743,824.66	0.34
46	002385	大北农	547,100	3,720,280.00	0.34
47	000807	云铝股份	309,829	3,686,965.10	0.34
48	600739	辽宁成大	176,800	3,679,208.00	0.34
49	300308	中际旭创	94,601	3,644,030.52	0.33
50	002439	启明星辰	123,800	3,591,438.00	0.33
51	000636	风华高科	118,716	3,587,597.52	0.33
52	601117	中国化学	407,600	3,570,576.00	0.33
53	000830	鲁西化工	189,071	3,541,299.83	0.32
54	600563	法拉电子	22,342	3,538,079.12	0.32
55	600862	中航高科	114,820	3,534,159.60	0.32
56	600392	盛和资源	202,683	3,518,576.88	0.32
57	002078	太阳纸业	260,120	3,472,602.00	0.32
58	600699	均胜电子	136,060	3,472,251.20	0.32
59	600754	锦江酒店	60,830	3,464,268.50	0.32
60	002030	达安基因	162,749	3,456,788.76	0.32
61	600486	扬农化工	30,800	3,442,516.00	0.31
62	002180	纳思达	106,600	3,432,520.00	0.31
63	002250	联化科技	122,550	3,419,145.00	0.31
64	600068	葛洲坝	456,300	3,417,687.00	0.31
65	600315	上海家化	56,820	3,417,154.80	0.31
66	603605	珀莱雅	17,100	3,363,741.00	0.31
67	300088	长信科技	405,710	3,351,164.60	0.31
68	002507	涪陵榨菜	88,000	3,314,080.00	0.30
69	000630	铜陵有色	1,217,000	3,310,240.00	0.30
70	600201	生物股份	186,419	3,253,011.55	0.30
71	002013	中航机电	321,000	3,232,470.00	0.29
72	000039	中集集团	176,352	3,206,079.36	0.29
73	002075	沙钢股份	292,100	3,186,811.00	0.29
74	002127	南极电商	324,500	3,170,365.00	0.29
75	300223	北京君正	31,100	3,138,612.00	0.29

76	300001	特锐德	103,550	3,117,890.50	0.28
77	002028	思源电气	101,050	3,111,329.50	0.28
78	000513	丽珠集团	61,886	3,095,537.72	0.28
79	601997	贵阳银行	423,200	3,030,112.00	0.28
80	600177	雅戈尔	458,700	3,022,833.00	0.28
81	002511	中顺洁柔	108,400	2,986,420.00	0.27
82	000021	深科技	154,610	2,959,235.40	0.27
83	002299	圣农发展	123,813	2,956,654.44	0.27
84	601005	重庆钢铁	1,107,291	2,956,466.97	0.27
85	002273	水晶光电	200,947	2,951,911.43	0.27
86	600549	厦门钨业	141,000	2,937,030.00	0.27
87	002092	中泰化学	283,560	2,912,161.20	0.27
88	002080	中材科技	110,800	2,899,636.00	0.26
89	002603	以岭药业	99,200	2,892,672.00	0.26
90	600988	赤峰黄金	192,500	2,885,575.00	0.26
91	002465	海格通信	304,500	2,880,570.00	0.26
92	300618	寒锐钴业	36,500	2,877,660.00	0.26
93	000739	普洛药业	97,800	2,875,320.00	0.26
94	000050	深天马 A	202,700	2,874,286.00	0.26
95	300168	万达信息	196,200	2,864,520.00	0.26
96	600171	上海贝岭	94,050	2,861,941.50	0.26
97	300482	万孚生物	44,150	2,856,063.50	0.26
98	300009	安科生物	189,740	2,827,126.00	0.26
99	000825	太钢不锈	376,100	2,816,989.00	0.26
100	000983	山西焦煤	338,640	2,814,098.40	0.26
101	600867	通化东宝	235,300	2,809,482.00	0.26
102	600516	方大炭素	377,600	2,809,344.00	0.26
103	601128	常熟银行	452,860	2,807,732.00	0.26
104	600066	宇通客车	224,000	2,797,760.00	0.26
105	000998	隆平高科	174,000	2,790,960.00	0.25
106	600536	中国软件	48,900	2,783,877.00	0.25
107	600637	东方明珠	338,700	2,773,953.00	0.25
108	300357	我武生物	43,250	2,773,190.00	0.25
109	300244	迪安诊断	71,990	2,757,217.00	0.25
110	601689	拓普集团	73,042	2,733,962.06	0.25
111	600316	洪都航空	70,920	2,729,001.60	0.25
112	600418	江淮汽车	218,899	2,720,914.57	0.25
113	300463	迈克生物	64,500	2,714,805.00	0.25
114	600879	航天电子	359,740	2,705,244.80	0.25
115	688208	道通科技	31,041	2,700,256.59	0.25
116	600529	山东药玻	79,300	2,692,235.00	0.25
117	002152	广电运通	205,530	2,678,055.90	0.24
118	300070	碧水源	366,000	2,675,460.00	0.24
119	000932	华菱钢铁	405,280	2,674,848.00	0.24

120	600369	西南证券	548,600	2,671,682.00	0.24
121	600487	亨通光电	234,300	2,671,020.00	0.24
122	600827	百联股份	132,476	2,669,391.40	0.24
123	000750	国海证券	629,530	2,669,207.20	0.24
124	000723	美锦能源	352,800	2,667,168.00	0.24
125	600380	健康元	193,970	2,663,208.10	0.24
126	000960	锡业股份	165,940	2,660,018.20	0.24
127	002156	通富微电	109,800	2,639,592.00	0.24
128	300271	华宇软件	136,700	2,631,475.00	0.24
129	300296	利亚德	336,500	2,631,430.00	0.24
130	600166	福田汽车	760,190	2,622,655.50	0.24
131	000975	银泰黄金	275,464	2,619,662.64	0.24
132	002373	千方科技	156,580	2,614,886.00	0.24
133	002131	利欧股份	1,116,130	2,611,744.20	0.24
134	601615	明阳智能	160,800	2,603,352.00	0.24
135	600909	华安证券	466,950	2,600,911.50	0.24
136	600038	中直股份	48,900	2,578,986.00	0.24
137	300383	光环新网	178,300	2,565,737.00	0.23
138	002572	索菲亚	105,600	2,555,520.00	0.23
139	603290	斯达半导	7,900	2,528,000.00	0.23
140	002926	华西证券	260,200	2,505,726.00	0.23
141	601198	东兴证券	228,200	2,494,226.00	0.23
142	600642	申能股份	405,900	2,492,226.00	0.23
143	002690	美亚光电	44,660	2,490,241.60	0.23
144	300115	长盈精密	119,480	2,461,288.00	0.22
145	601866	中远海发	654,954	2,456,077.50	0.22
146	300474	景嘉微	25,000	2,448,000.00	0.22
147	002065	东华软件	308,600	2,447,198.00	0.22
148	002294	信立泰	73,900	2,431,310.00	0.22
149	603638	艾迪精密	56,480	2,421,297.60	0.22
150	600271	航天信息	184,100	2,398,823.00	0.22
151	603156	养元饮品	83,800	2,395,004.00	0.22
152	002500	山西证券	356,190	2,390,034.90	0.22
153	000623	吉林敖东	153,700	2,380,813.00	0.22
154	600998	九州通	154,678	2,377,400.86	0.22
155	600415	小商品城	455,600	2,346,340.00	0.21
156	600895	张江高科	128,000	2,338,560.00	0.21
157	601699	潞安环能	197,600	2,333,656.00	0.21
158	000012	南玻 A	227,243	2,326,968.32	0.21
159	600153	建发股份	283,800	2,298,780.00	0.21
160	300630	普利制药	43,318	2,269,863.20	0.21
161	600188	兖州煤业	147,600	2,267,136.00	0.21
162	600707	彩虹股份	237,200	2,232,052.00	0.20
163	600256	广汇能源	669,500	2,229,435.00	0.20

164	600535	天士力	150,018	2,221,766.58	0.20
165	600390	五矿资本	371,400	2,220,972.00	0.20
166	300418	昆仑万维	135,400	2,217,852.00	0.20
167	600667	太极实业	243,400	2,214,940.00	0.20
168	300024	机器人	206,600	2,204,422.00	0.20
169	600060	海信视像	129,710	2,192,099.00	0.20
170	600008	首创环保	727,900	2,190,979.00	0.20
171	002670	国盛金控	191,895	2,185,684.05	0.20
172	002372	伟星新材	105,380	2,178,204.60	0.20
173	600497	驰宏锌锗	504,400	2,173,964.00	0.20
174	002557	洽洽食品	50,400	2,172,240.00	0.20
175	002382	蓝帆医疗	104,100	2,170,485.00	0.20
176	000878	云南铜业	168,640	2,163,651.20	0.20
177	000027	深圳能源	235,896	2,163,166.32	0.20
178	600208	新湖中宝	710,400	2,159,616.00	0.20
179	600155	华创阳安	200,948	2,150,143.60	0.20
180	603858	步长制药	94,600	2,127,554.00	0.19
181	002019	亿帆医药	122,880	2,119,680.00	0.19
182	600765	中航重机	93,520	2,118,228.00	0.19
183	002390	信邦制药	201,640	2,113,187.20	0.19
184	600372	中航电子	127,500	2,110,125.00	0.19
185	300251	光线传媒	193,900	2,096,059.00	0.19
186	002221	东华能源	190,840	2,089,698.00	0.19
187	002174	游族网络	121,700	2,089,589.00	0.19
188	600141	兴发集团	110,888	2,088,021.04	0.19
189	600498	烽火通信	112,000	2,086,560.00	0.19
190	000718	苏宁环球	251,020	2,080,955.80	0.19
191	603260	合盛硅业	26,900	2,068,879.00	0.19
192	002683	宏大爆破	74,500	2,068,865.00	0.19
193	600511	国药股份	62,490	2,065,919.40	0.19
194	600409	三友化工	204,300	2,065,473.00	0.19
195	688029	南微医学	6,588	2,053,413.72	0.19
196	600170	上海建工	735,500	2,029,980.00	0.19
197	002146	荣盛发展	359,500	2,027,580.00	0.18
198	000997	新大陆	122,110	2,025,804.90	0.18
199	002966	苏州银行	275,600	2,025,660.00	0.18
200	000401	冀东水泥	163,870	2,023,794.50	0.18
201	002506	协鑫集成	580,500	2,020,140.00	0.18
202	600875	东方电气	184,130	2,019,906.10	0.18
203	601717	郑煤机	172,306	2,003,918.78	0.18
204	300058	蓝色光标	329,020	1,990,571.00	0.18
205	000738	航发控制	95,000	1,978,850.00	0.18
206	600801	华新水泥	112,368	1,974,305.76	0.18
207	002408	齐翔腾达	158,888	1,973,388.96	0.18

208	600160	巨化股份	222,760	1,969,198.40	0.18
209	603866	桃李面包	63,072	1,967,846.40	0.18
210	002958	青农商行	458,700	1,963,236.00	0.18
211	000686	东北证券	232,200	1,962,090.00	0.18
212	600258	首旅酒店	81,986	1,956,185.96	0.18
213	600663	陆家嘴	145,800	1,942,056.00	0.18
214	300315	掌趣科技	455,500	1,935,875.00	0.18
215	603707	健友股份	46,200	1,928,850.00	0.18
216	688088	虹软科技	34,584	1,928,058.00	0.18
217	002195	二三四五	945,882	1,920,140.46	0.18
218	002268	卫士通	98,320	1,915,273.60	0.17
219	000540	中天金融	694,300	1,895,439.00	0.17
220	300017	网宿科技	324,000	1,895,400.00	0.17
221	688321	微芯生物	41,020	1,894,713.80	0.17
222	603225	新凤鸣	92,982	1,887,534.60	0.17
223	600325	华发股份	279,879	1,886,384.46	0.17
224	600732	爱旭股份	134,400	1,870,848.00	0.17
225	000060	中金岭南	412,800	1,865,856.00	0.17
226	601016	节能风电	496,950	1,858,593.00	0.17
227	600859	王府井	64,183	1,853,605.04	0.17
228	601992	金隅集团	688,900	1,853,141.00	0.17
229	600027	华电国际	538,400	1,852,096.00	0.17
230	603712	七一二	51,200	1,848,320.00	0.17
231	000961	中南建设	311,900	1,846,448.00	0.17
232	002831	裕同科技	62,140	1,844,936.60	0.17
233	600567	山鹰国际	534,000	1,842,300.00	0.17
234	603883	老百姓	34,622	1,823,886.96	0.17
235	603077	和邦生物	875,690	1,821,435.20	0.17
236	000158	常山北明	158,180	1,817,488.20	0.17
237	002429	兆驰股份	299,300	1,816,751.00	0.17
238	600282	南钢股份	508,800	1,811,328.00	0.17
239	603927	中科软	42,100	1,808,195.00	0.16
240	002191	劲嘉股份	169,540	1,803,905.60	0.16
241	600500	中化国际	228,847	1,798,737.42	0.16
242	600216	浙江医药	111,550	1,785,915.50	0.16
243	600528	中铁工业	220,076	1,782,615.60	0.16
244	601577	长沙银行	199,200	1,780,848.00	0.16
245	300212	易华录	66,020	1,776,598.20	0.16
246	600839	四川长虹	609,920	1,774,867.20	0.16
247	000671	阳光城	340,600	1,771,120.00	0.16
248	603198	迎驾贡酒	39,960	1,770,228.00	0.16
249	600737	中粮糖业	176,571	1,767,475.71	0.16
250	002595	豪迈科技	66,100	1,764,870.00	0.16
251	002056	横店东磁	135,540	1,762,020.00	0.16

252	000898	鞍钢股份	395,900	1,761,755.00	0.16
253	002081	金螳螂	221,500	1,754,280.00	0.16
254	600598	北大荒	117,210	1,753,461.60	0.16
255	000581	威孚高科	83,150	1,732,014.50	0.16
256	000999	华润三九	64,720	1,731,260.00	0.16
257	000709	河钢股份	702,100	1,727,166.00	0.16
258	600580	卧龙电驱	129,780	1,726,074.00	0.16
259	600728	佳都科技	232,200	1,720,602.00	0.16
260	002203	海亮股份	161,400	1,717,296.00	0.16
261	002281	光迅科技	69,390	1,706,994.00	0.16
262	002124	天邦股份	242,900	1,702,729.00	0.16
263	300182	捷成股份	340,560	1,699,394.40	0.16
264	600808	马钢股份	394,140	1,690,860.60	0.15
265	000729	燕京啤酒	232,990	1,686,847.60	0.15
266	002010	传化智联	218,500	1,684,635.00	0.15
267	000930	中粮科技	185,287	1,669,435.87	0.15
268	002396	星网锐捷	77,907	1,663,314.45	0.15
269	300166	东方国信	133,810	1,653,891.60	0.15
270	002242	九阳股份	50,890	1,653,416.10	0.15
271	002745	木林森	123,120	1,649,808.00	0.15
272	002387	维信诺	157,900	1,646,897.00	0.15
273	600820	隧道股份	311,300	1,646,777.00	0.15
274	000488	晨鸣纸业	202,010	1,644,361.40	0.15
275	000629	攀钢钒钛	709,600	1,624,984.00	0.15
276	002004	华邦健康	261,590	1,624,473.90	0.15
277	002048	宁波华翔	82,190	1,602,705.00	0.15
278	002563	森马服饰	133,600	1,596,520.00	0.15
279	600755	厦门国贸	193,031	1,584,784.51	0.14
280	600970	中材国际	172,300	1,579,991.00	0.14
281	300002	神州泰岳	323,990	1,571,351.50	0.14
282	603000	人民网	91,150	1,566,868.50	0.14
283	600803	新奥股份	94,400	1,558,544.00	0.14
284	600022	山东钢铁	904,306	1,555,406.32	0.14
285	600037	歌华有线	161,494	1,551,957.34	0.14
286	600398	海澜之家	214,185	1,550,699.40	0.14
287	000598	兴蓉环境	296,310	1,543,775.10	0.14
288	600881	亚泰集团	536,750	1,529,737.50	0.14
289	601106	中国一重	451,100	1,529,229.00	0.14
290	002925	盈趣科技	39,110	1,521,770.10	0.14
291	603885	吉祥航空	97,900	1,493,954.00	0.14
292	002002	鸿达兴业	379,515	1,491,493.95	0.14
293	600811	东方集团	488,866	1,491,041.30	0.14
294	600039	四川路桥	236,710	1,484,171.70	0.14
295	601456	国联证券	96,200	1,481,480.00	0.14

296	000883	湖北能源	322,600	1,480,734.00	0.14
297	601880	辽港股份	865,470	1,479,953.70	0.14
298	600348	华阳股份	198,530	1,473,092.60	0.13
299	000778	新兴铸管	395,340	1,470,664.80	0.13
300	000887	中鼎股份	121,710	1,470,256.80	0.13
301	600782	新钢股份	263,300	1,469,214.00	0.13
302	000690	宝新能源	287,380	1,468,511.80	0.13
303	600260	凯乐科技	165,288	1,467,757.44	0.13
304	600597	光明乳业	101,680	1,465,208.80	0.13
305	002705	新宝股份	55,100	1,446,375.00	0.13
306	601118	海南橡胶	282,700	1,438,943.00	0.13
307	002249	大洋电机	273,830	1,437,607.50	0.13
308	002701	奥瑞金	279,630	1,437,298.20	0.13
309	002867	周大生	72,700	1,437,279.00	0.13
310	600126	杭钢股份	279,096	1,431,762.48	0.13
311	600967	内蒙一机	141,144	1,428,377.28	0.13
312	603568	伟明环保	62,461	1,425,984.63	0.13
313	600908	无锡银行	245,770	1,425,466.00	0.13
314	600645	中源协和	62,090	1,424,965.50	0.13
315	002085	万丰奥威	253,200	1,417,920.00	0.13
316	600026	中远海能	229,390	1,413,042.40	0.13
317	600718	东软集团	144,240	1,410,667.20	0.13
318	600410	华胜天成	181,240	1,406,422.40	0.13
319	002183	怡亚通	245,220	1,405,110.60	0.13
320	603650	彤程新材	29,100	1,399,710.00	0.13
321	000528	柳工	170,694	1,399,690.80	0.13
322	601179	中国西电	339,000	1,396,680.00	0.13
323	600985	淮北矿业	113,200	1,382,172.00	0.13
324	600572	康恩贝	308,260	1,368,674.40	0.12
325	002110	三钢闽光	202,200	1,362,828.00	0.12
326	000877	天山股份	104,180	1,357,465.40	0.12
327	600167	联美控股	151,270	1,350,841.10	0.12
328	000970	中科三环	141,240	1,348,842.00	0.12
329	600446	金证股份	93,136	1,344,883.84	0.12
330	002368	太极股份	66,983	1,343,678.98	0.12
331	300072	三聚环保	233,100	1,337,994.00	0.12
332	600064	南京高科	143,580	1,333,858.20	0.12
333	000402	金融街	197,400	1,332,450.00	0.12
334	601200	上海环境	111,107	1,329,950.79	0.12
335	600329	中新药业	47,290	1,328,376.10	0.12
336	002266	浙富控股	265,950	1,327,090.50	0.12
337	002128	露天煤业	127,100	1,323,111.00	0.12
338	000990	诚志股份	103,860	1,322,137.80	0.12
339	000089	深圳机场	169,571	1,317,566.67	0.12

340	002985	北摩高科	13,510	1,317,225.00	0.12
341	601598	中国外运	260,500	1,315,525.00	0.12
342	600517	国网英大	189,200	1,288,452.00	0.12
343	000400	许继电气	100,580	1,273,342.80	0.12
344	300026	红日药业	298,010	1,266,542.50	0.12
345	600158	中体产业	110,845	1,264,741.45	0.12
346	003035	南网能源	125,400	1,246,476.00	0.11
347	000519	中兵红箭	114,850	1,231,192.00	0.11
348	300376	易事特	152,870	1,229,074.80	0.11
349	600120	浙江东方	286,918	1,228,009.04	0.11
350	601718	际华集团	435,200	1,227,264.00	0.11
351	601975	招商南油	571,900	1,223,866.00	0.11
352	002233	塔牌集团	118,620	1,219,413.60	0.11
353	000959	首钢股份	215,600	1,211,672.00	0.11
354	600195	中牧股份	101,273	1,211,225.08	0.11
355	001914	招商积余	70,300	1,207,754.00	0.11
356	600507	方大特钢	177,952	1,206,514.56	0.11
357	600307	酒钢宏兴	517,370	1,200,298.40	0.11
358	000685	中山公用	146,540	1,195,766.40	0.11
359	000090	天健集团	216,133	1,195,215.49	0.11
360	600376	首开股份	213,200	1,193,920.00	0.11
361	601333	广深铁路	560,300	1,187,836.00	0.11
362	601000	唐山港	489,799	1,180,415.59	0.11
363	002505	鹏都农牧	526,250	1,178,800.00	0.11
364	002440	闰土股份	132,980	1,176,873.00	0.11
365	600435	北方导航	147,760	1,173,214.40	0.11
366	000559	万向钱潮	218,300	1,159,173.00	0.11
367	600804	鹏博士	236,700	1,145,628.00	0.10
368	002839	张家港行	209,500	1,139,680.00	0.10
369	600643	爱建集团	160,500	1,120,290.00	0.10
370	600673	东阳光	249,380	1,119,716.20	0.10
371	300133	华策影视	188,810	1,117,755.20	0.10
372	603228	景旺电子	42,323	1,108,862.60	0.10
373	600373	中文传媒	111,800	1,102,348.00	0.10
374	601860	紫金银行	302,382	1,097,646.66	0.10
375	000758	中色股份	228,130	1,083,617.50	0.10
376	601991	大唐发电	409,600	1,081,344.00	0.10
377	002038	双鹭药业	102,330	1,077,534.90	0.10
378	000967	盈峰环境	156,600	1,075,842.00	0.10
379	002155	湖南黄金	138,710	1,075,002.50	0.10
380	600056	中国医药	88,250	1,072,237.50	0.10
381	601608	中信重工	286,600	1,071,884.00	0.10
382	600582	天地科技	273,830	1,067,937.00	0.10
383	002936	郑州银行	289,350	1,061,914.50	0.10

384	600266	城建发展	223,385	1,058,844.90	0.10
385	600388	龙净环保	124,040	1,056,820.80	0.10
386	000563	陕国投 A	327,306	1,053,925.32	0.10
387	600131	国网信通	79,600	1,053,904.00	0.10
388	000681	视觉中国	81,490	1,053,665.70	0.10
389	601098	中南传媒	119,100	1,050,462.00	0.10
390	300113	顺网科技	80,820	1,045,810.80	0.10
391	003022	联泓新科	34,000	1,043,800.00	0.10
392	300741	华宝股份	20,500	1,039,760.00	0.09
393	600095	湘财股份	88,600	1,037,506.00	0.09
394	601958	金钼股份	159,600	1,034,208.00	0.09
395	002416	爱施德	102,768	1,030,763.04	0.09
396	600062	华润双鹤	86,224	1,026,927.84	0.09
397	600901	江苏租赁	197,300	1,025,960.00	0.09
398	600928	西安银行	220,100	1,025,666.00	0.09
399	600764	中国海防	36,000	1,018,800.00	0.09
400	600259	广晟有色	30,030	1,015,314.30	0.09
401	600959	江苏有线	330,250	1,007,262.50	0.09
402	300180	华峰超纤	203,300	1,006,335.00	0.09
403	600649	城投控股	209,361	996,558.36	0.09
404	600094	大名城	263,150	992,075.50	0.09
405	600776	东方通信	79,900	990,760.00	0.09
406	000415	渤海租赁	408,800	989,296.00	0.09
407	002399	海普瑞	62,100	989,253.00	0.09
408	002458	益生股份	98,700	984,039.00	0.09
409	600006	东风汽车	132,111	964,410.30	0.09
410	601611	中国核建	131,300	947,986.00	0.09
411	600729	重庆百货	34,508	947,244.60	0.09
412	600556	天下秀	89,500	945,120.00	0.09
413	300257	开山股份	65,690	943,965.30	0.09
414	600546	山煤国际	131,000	940,580.00	0.09
415	600717	天津港	238,982	936,809.44	0.09
416	000028	国药一致	24,630	931,999.20	0.09
417	002317	众生药业	107,720	927,469.20	0.08
418	600633	浙数文化	129,150	927,297.00	0.08
419	000717	韶钢松山	199,700	916,623.00	0.08
420	600648	外高桥	61,990	916,212.20	0.08
421	601928	凤凰传媒	126,310	901,853.40	0.08
422	002434	万里扬	110,650	897,371.50	0.08
423	000501	鄂武商 A	76,620	896,454.00	0.08
424	600021	上海电力	129,700	896,227.00	0.08
425	600863	内蒙华电	384,010	894,743.30	0.08
426	603355	莱克电气	14,330	891,755.90	0.08
427	000078	海王生物	272,950	889,817.00	0.08

428	601828	美凯龙	73,400	880,800.00	0.08
429	000062	深圳华强	52,002	879,353.82	0.08
430	002375	亚厦股份	110,610	876,031.20	0.08
431	600968	海油发展	337,400	873,866.00	0.08
432	600835	上海机电	53,437	868,351.25	0.08
433	002244	滨江集团	206,020	863,223.80	0.08
434	002424	贵州百灵	117,000	861,120.00	0.08
435	605358	立昂微	7,300	843,734.00	0.08
436	000869	张裕 A	22,500	835,650.00	0.08
437	600623	华谊集团	93,900	827,259.00	0.08
438	600377	宁沪高速	82,300	803,248.00	0.07
439	600566	济川药业	44,000	787,600.00	0.07
440	600339	中油工程	276,930	786,481.20	0.07
441	600312	平高电气	134,380	784,779.20	0.07
442	600639	浦东金桥	56,960	777,504.00	0.07
443	600787	中储股份	145,700	776,581.00	0.07
444	002468	申通快递	101,700	774,954.00	0.07
445	002583	海能达	151,940	765,777.60	0.07
446	000031	大悦城	212,620	765,432.00	0.07
447	000826	启迪环境	141,000	754,350.00	0.07
448	600823	世茂股份	186,220	752,328.80	0.07
449	601969	海南矿业	64,660	751,995.80	0.07
450	601778	晶科科技	136,800	746,928.00	0.07
451	603888	新华网	35,130	743,702.10	0.07
452	600466	蓝光发展	251,036	740,556.20	0.07
453	603317	天味食品	24,936	733,866.48	0.07
454	002815	崇达技术	58,460	729,580.80	0.07
455	601298	青岛港	115,600	714,408.00	0.07
456	002532	天山铝业	84,600	709,794.00	0.06
457	000156	华数传媒	91,700	707,007.00	0.06
458	603708	家家悦	40,500	703,485.00	0.06
459	000937	冀中能源	175,100	688,143.00	0.06
460	002635	安洁科技	46,290	677,222.70	0.06
461	002948	青岛银行	135,900	675,423.00	0.06
462	000813	德展健康	148,300	673,282.00	0.06
463	000553	安道麦 A	72,200	669,294.00	0.06
464	002302	西部建设	83,600	660,440.00	0.06
465	601228	广州港	204,300	649,674.00	0.06
466	300010	豆神教育	114,580	649,668.60	0.06
467	603377	东方时尚	60,746	649,374.74	0.06
468	600640	号百控股	52,760	643,144.40	0.06
469	603515	欧普照明	25,050	643,033.50	0.06
470	001872	招商港口	38,000	642,960.00	0.06
471	600350	山东高速	103,700	637,755.00	0.06

472	601139	深圳燃气	95,400	625,824.00	0.06
473	600871	石化油服	314,200	618,974.00	0.06
474	000061	农产品	111,980	618,129.60	0.06
475	000046	泛海控股	257,600	592,480.00	0.05
476	002653	海思科	26,700	574,584.00	0.05
477	603379	三美股份	30,380	568,409.80	0.05
478	603056	德邦股份	51,100	561,589.00	0.05
479	601568	北元集团	65,600	561,536.00	0.05
480	603786	科博达	7,300	551,150.00	0.05
481	002901	大博医疗	7,400	539,386.00	0.05
482	002419	天虹股份	79,900	524,144.00	0.05
483	601003	柳钢股份	84,800	500,320.00	0.05
484	601512	中新集团	49,700	495,012.00	0.05
485	601869	长飞光纤	20,300	494,508.00	0.05
486	600657	信达地产	141,729	493,216.92	0.04
487	000537	广宇发展	92,700	484,821.00	0.04
488	601801	皖新传媒	99,200	468,224.00	0.04
489	601187	厦门银行	48,100	455,988.00	0.04
490	603983	丸美股份	8,600	448,146.00	0.04
491	002946	新乳业	28,700	434,805.00	0.04
492	600917	重庆燃气	52,060	425,330.20	0.04
493	603719	良品铺子	9,300	418,500.00	0.04
494	000732	泰禾集团	165,100	356,616.00	0.03
495	600903	贵州燃气	38,140	350,888.00	0.03
496	603868	飞科电器	7,967	335,092.02	0.03
497	002818	富森美	24,931	300,667.86	0.03
498	002423	中粮资本	30,500	276,025.00	0.03
499	600956	新天绿能	23,400	274,014.00	0.02
500	603256	宏和科技	29,100	265,974.00	0.02
501	300957	贝泰妮	705	177,631.80	0.02
502	601068	中铝国际	50,900	175,605.00	0.02
503	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.01
504	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.01
505	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
506	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
507	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.01
508	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
509	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
510	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
511	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
512	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
513	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
514	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
515	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00

516	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
517	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
518	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
519	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
520	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
521	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
522	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
523	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
524	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
525	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
526	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
527	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
528	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
529	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
530	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
531	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
532	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
533	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
534	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
535	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
536	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
537	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
538	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
539	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
540	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
541	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
542	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
543	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
544	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
545	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
546	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
547	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
548	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
549	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
550	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
551	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
552	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
553	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
554	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
555	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
556	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
557	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
558	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
559	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

560	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
561	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
562	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
563	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
564	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
565	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000799	酒鬼酒	9,274,342.00	1.03
2	300274	阳光电源	8,138,352.10	0.91
3	002340	格林美	5,052,999.38	0.56
4	300253	卫宁健康	4,562,561.70	0.51
5	300037	新宙邦	4,539,590.00	0.50
6	601636	旗滨集团	4,312,073.00	0.48
7	300012	华测检测	4,212,376.00	0.47
8	300285	国瓷材料	4,183,927.80	0.47
9	002074	国轩高科	4,073,878.94	0.45
10	002422	科伦药业	3,867,946.37	0.43
11	002439	启明星辰	3,857,729.00	0.43
12	300308	中际旭创	3,761,539.87	0.42
13	002709	天赐材料	3,693,630.10	0.41
14	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.38
15	002625	光启技术	3,230,865.00	0.36
16	002385	大北农	3,156,924.00	0.35
17	300496	中科创达	3,152,276.00	0.35
18	600177	雅戈尔	3,111,777.13	0.35
19	002127	南极电商	3,094,005.00	0.34
20	002444	巨星科技	2,940,238.60	0.33

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	300274	阳光电源	23,040,222.58	2.56
2	300012	华测检测	12,294,139.57	1.37
3	300496	中科创达	9,760,385.38	1.09

4	300595	欧普康视	9,349,150.56	1.04
5	600426	华鲁恒升	7,683,264.30	0.85
6	002568	百润股份	7,170,691.27	0.80
7	600132	重庆啤酒	6,324,804.62	0.70
8	603882	金域医学	5,947,038.00	0.66
9	002791	坚朗五金	5,579,100.00	0.62
10	600143	金发科技	5,540,679.00	0.62
11	603806	福斯特	4,917,882.44	0.55
12	601966	玲珑轮胎	4,584,010.91	0.51
13	601799	星宇股份	4,326,403.00	0.48
14	600079	人福医药	4,254,823.89	0.47
15	002064	华峰化学	4,203,878.49	0.47
16	603345	安井食品	4,086,743.00	0.45
17	002920	德赛西威	3,894,710.00	0.43
18	603816	顾家家居	3,779,717.59	0.42
19	000301	东方盛虹	3,688,745.00	0.41
20	002074	国轩高科	3,595,689.92	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	497,724,683.85
卖出股票收入（成交）总额	434,310,171.36

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）	512,996.62	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	512,996.62	0.05

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	113050	南银转债	2,590	258,997.73	0.02
2	113051	节能转债	2,540	253,998.89	0.02

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
IC2107	IC2107	13	17,594,720.00	574,560.00	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。

IC2109	IC2109	15	20,001,000.00	2,110,280.00	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。
IC2112	IC2112	25	32,606,000.00	1,409,000.00	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)					4,093,840.00
股指期货投资本期收益(元)					4,599,718.45
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,516,010.00

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管理需求。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 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	10,658,842.73
2	应收证券清算款	5,065,057.91
3	应收股利	113,535.71

4	应收利息	43,542.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,880,979.20

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	6,587,878.50	0.60	重大事项停牌
2	600460	士兰微	676,200.00	0.06	重大事项停牌、转融通流通受限
3	600089	特变电工	1,278,575.00	0.12	转融通流通受限
4	000009	中国宝安	1,249,668.00	0.11	转融通流通受限
5	002074	国轩高科	1,180,476.00	0.11	转融通流通受限
6	300285	国瓷材料	989,625.00	0.09	转融通流通受限
7	601233	桐昆股份	953,964.00	0.09	转融通流通受限
8	002340	格林美	947,155.00	0.09	转融通流通受限

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	中国工商银行股份有限公司一易方达中证 500 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
7,725	18,333.93	117,270,101 .00	82.80%	24,359,527. 00	17.20%	106,274,30 0.00	75.04%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 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	浦银安盛基金—兴业银行—浦银安盛盛卓 12 号 FOF 集合资产管理计划	3,310,200.00	2.35%
2	华泰证券股份有限公司	1,402,485.00	1.00%
3	广发证券股份有限公司	1,383,382.00	0.98%
4	东方证券股份有限公司	781,200.00	0.55%
5	中国国际金融股份有限公司	741,700.00	0.53%
6	张培宇	675,500.00	0.48%
7	中信证券股份有限公司	652,516.00	0.46%
8	王娟	602,100.00	0.43%
9	王锦效	557,277.00	0.40%
10	中信建投证券股份有限公司	527,717.00	0.37%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	106,274,300.00	75.43%

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（2015 年 8 月 27 日）基金份额总额	295,259,000.00
本报告期期初基金份额总额	127,696,515.00
本报告期基金总申购份额	82,933,113.00
减：本报告期基金总赎回份额	69,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	141,629,628.00

注：期末基金总份额包含场外份额 733,113 份；总申购份额包含场外总申购份额 733,113 份。

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 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在

中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

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	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	2,167,140.31	0.24%	-	-	-
中信建投	3	179,384,067.30	19.50%	17,938.50	19.54%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	573,960,866.35	62.39%	57,402.75	62.54%	-

高华证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	164,473,135.04	17.88%	16,447.74	17.92%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为粤开证券股份有限公司,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、个股分析的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	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	2,239,481.80	74.10%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	782,905.82	25.90%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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 增加南京证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东北证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加第一创业证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01

9	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-04-19
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加安信证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-17

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
中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2021 年 01 月 01 日~2021 年 06 月 30 日	98,962,500.00	29,900,000.00	22,588,200.00	106,274,300.00	75.04 %
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；如场外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，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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.中国证监会注册易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 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

二〇二一年八月二十八日