

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：二〇二二年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计意见	16
6.2	形成审计意见的基础	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	67
8.1	期末基金资产组合情况	67
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	67
8.3	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	68
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	81
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	83

8.6	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	83
8.7	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	83
8.8	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	83
8.9	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	84
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	84
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12	投资组合报告附注	84
§ 9	基金份额持有人信息	85
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2	期末上市基金前十名持有人	86
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	87
§ 10	开放式基金份额变动	87
§ 11	重大事件揭示	87
11.1	基金份额持有人大会决议	87
11.2	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	87
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4	基金投资策略的改变	88
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	88
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	88
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	88
11.8	其他重大事件	90
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	92
12.1	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	92
§ 13	备查文件目录	93
13.1	备查文件目录	93
13.2	存放地点	93
13.3	查阅方式	93

§ 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	1,765,965,150.00 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，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>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</p>

	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荣粤道 188号6层	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	170,307,612.68	227,883,050.58	21,456,090.99
本期利润	224,046,776.09	218,524,003.18	65,486,439.84
加权平均基金份额本期利润	0.2677	1.6446	0.5608
本期加权平均净值利润率	19.77%	26.18%	11.11%
本期基金份额净值增长率	20.89%	30.85%	29.33%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	356,877,126.95	70,255,924.13	-186,317,983.46
期末可供分配基金份额利润	0.2021	0.5502	-1.1097
期末基金资产净值	1,502,958,581.57	898,984,640.85	903,301,912.88
期末基金份额净值	0.8511	7.0400	5.3801
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	31.15%	8.48%	-17.10%

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。

4. 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。

3.2 基金净值表现

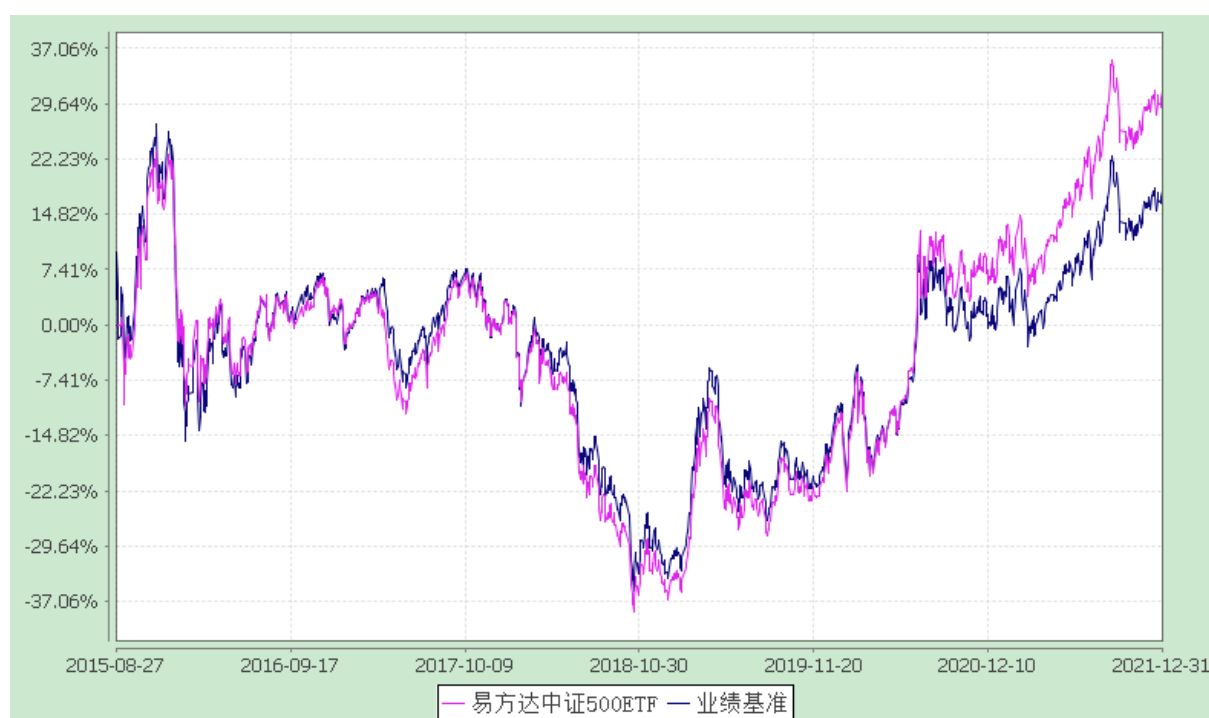
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月	3.98%	0.75%	3.60%	0.76%	0.38%	-0.01%
过去六个月	9.96%	0.95%	8.10%	0.96%	1.86%	-0.01%
过去一年	20.89%	0.97%	15.58%	0.97%	5.31%	0.00%
过去三年	104.59%	1.37%	76.57%	1.38%	28.02%	-0.01%
过去五年	29.43%	1.30%	17.49%	1.33%	11.94%	-0.03%
自基金合同生效起至今	31.15%	1.42%	17.97%	1.52%	13.18%	-0.10%

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

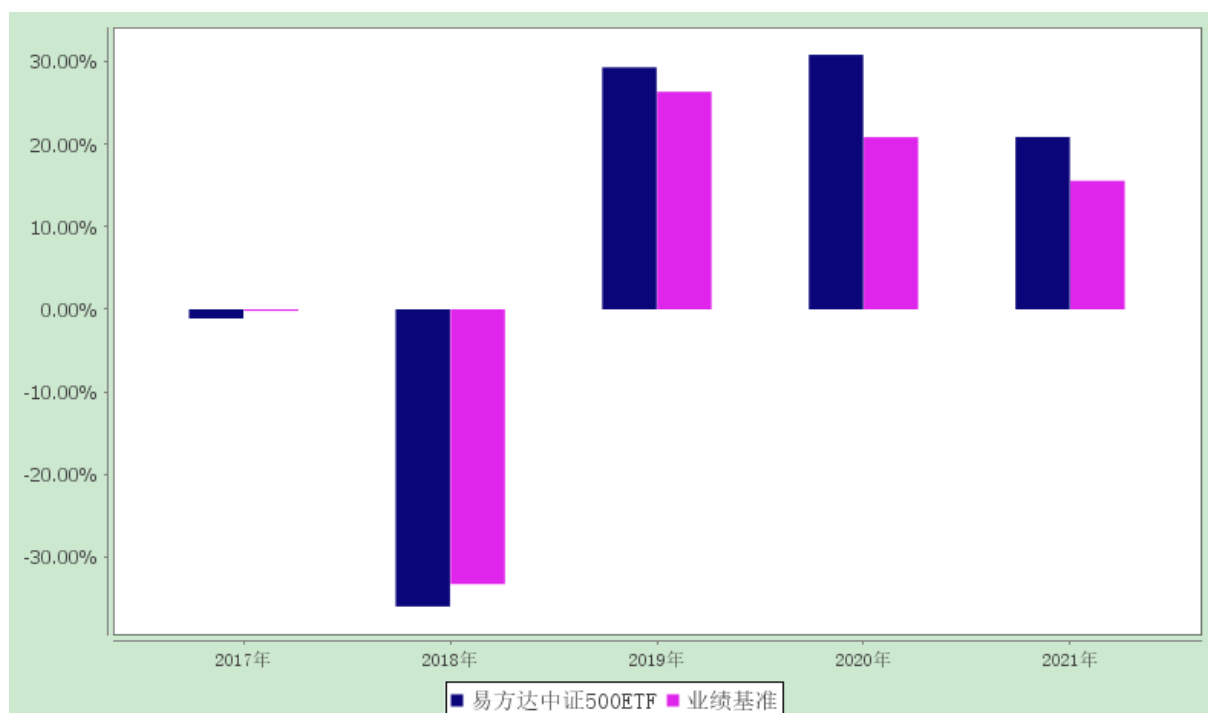
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 8 月 27 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 31.15%，同期业绩比较基准收益率为 17.97%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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	本基金的基金经理、易方达沪深300	2016-	-	16年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

海燕	<p>医药卫生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 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 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 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、易方达中证海外中国互联网 50 交易</p>	04-16		<p>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</p>
----	---	-------	--	--

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 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、易方达日兴资管日经 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、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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中

交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 30 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 500 指数，该指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后，剔除过去一年日均成交金额排名后 20% 的证券，再选取过去一年日均总市值排名靠前的 500 只证券组成，以综合反映中国 A 股市场上小市值公司的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

回顾 2021 年，新冠肺炎疫情仍然是对全球各国经济形势和宏观政策制定构成重大影响的因素。常态化疫情防控以来，我国坚持动态清零的防疫总方针，以及“外防输入、内防反弹”的防疫策略，

最大限度保护了人民生命安全和身体健康，经济发展和疫情防控保持全球领先地位，实现了“十四五”良好开局。根据国家统计局公布的数据，2021 年我国国内生产总值达到 114.4 万亿元，按不变价格计算，比上年增长 8.1%，两年平均增长 5.1%，增速在全球主要经济体中名列前茅。宏观政策方面，实施积极的财政政策和稳健的货币政策，财政政策和货币政策协调联动，强调跨周期和逆周期宏观调控政策有机结合。

资本市场方面，在国民经济持续稳定恢复、宏观政策稳健有效的背景下，2021 年 A 股市场整体表现较好，报告期内上证指数上涨 4.8%，实现连续三年上涨。从市场结构上看，不同的风格和行业板块受宏观环境和自身基本面状况影响，收益率表现差异较大。在风格方面，中小市值风格收益率高于大市值风格，成长风格收益率高于价值风格，具体来看，报告期内中证 1000 指数、中证 500 指数、创业板指涨幅居前，分别上涨 20.5%、15.6%、12.0%；上证 50 指数、沪深 300 指数跌幅居前，分别下跌 10.1%、5.2%。在行业方面，电力设备、有色金属、煤炭、基础化工、钢铁、公用事业等行业涨幅居前，家用电器、非银金融、房地产、社会服务、食品饮料、医药生物等行业跌幅居前。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8511 元，本报告期份额净值增长率为 20.89%，同期业绩比较基准收益率为 15.58%，年化跟踪误差 0.58%，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 2022 年，全球经济复苏进程将延续，但各国宏观政策和疫情不断演化背景下防控措施的差异，或将导致经济恢复节奏不同步、水平不均衡，从而影响不同资本市场的表现。2022 年是我国实施“十四五”规划的关键之年，在经济高质量发展稳步推进的同时，也面临着众多的内外部挑战。统筹疫情防控和社会经济发展仍是下一阶段我国社会经济工作的重中之重，以稳增长为导向的货币与财政政策将着力于增强经济发展的韧性。货币政策保持流动性合理充裕，财政发力将适度前置，为提振内需、新基建投资和产业转型升级提供精准有力支持，推动创新驱动的新发展格局逐渐形成，经济运行有望保持在合理区间。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。另一方面，我国资本市场改革进入关键阶段，高水平双向开放的步伐不断加快，注册制改革将为多层次资本市场带来更多的优质上市公司，长期视角下 A 股市场在国内与全球资产配置中的重要性有望进一步提升。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务创新发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 培育合规文化、严守合规底线、防控违法违规行为是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，秉持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，树立弘扬“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，促进公司合规文化建设。加大力度持续开展员工合规风控教育培训、强化合规监督考评机制，不断提高员工合规风控意识，深入践行“受人之托、为人理财”的信义义务。

(2) 坚持“守底线、保合规、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示；认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 参与新产品设计、新业务拓展工作，持续督促健全公募基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，严格进行合规审查，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券基金期货经营机构投资者投诉处理工作指引（试行）》等法律法规和监管政策、自律准则，进一步完善基金销售相关业务规范，加强投资者权益保护、促进长期理性投资。持续优化投资者适当性管理和客户投诉纠纷处理机制，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”职责义务，保障投资者合法权益。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，进一步健全信息披露管理工作机制流程，不断推进信息披露文件制作审核的系统化，持续做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，

下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

(7) 深入贯彻落实《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》等规定，不断完善业务过程中的廉洁从业管理机制，加强对员工廉洁从业、职业操守和道德规范等方面的教育宣导和培训，努力将廉洁从业、职业操守和道德规范要求渗透落实到业务活动和日常经营的各个环节。

(8) 以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，坚持不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司内控及合规管理有效性的提升。

(9) 不断检讨回顾合规管控框架和机制，促进监察稽核自身制度流程和工具手段的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

(10) 继续顺利通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、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 托管人对本年度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本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 25154 号

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就

可能导致对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2022 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	49,287,676.08	24,560,741.47
结算备付金		25,426,182.63	25,350,698.37
存出保证金		12,209,530.45	8,104,726.77
交易性金融资产	7.4.7.2	1,416,537,060.15	842,091,890.16
其中：股票投资		1,416,421,060.91	841,629,794.03
基金投资		-	-
债券投资		115,999.24	462,096.13
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,888,948.61	4,380,633.29
应收利息	7.4.7.5	35,927.23	53,384.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,506,385,325.15	904,542,074.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,372,580.19	3,943,910.10
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		184,444.54	111,895.30
应付托管费		61,481.50	37,298.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	64,185.62	141,847.20
应交税费		179,900.03	60,377.33
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	564,151.70	1,262,104.98
负债合计		3,426,743.58	5,557,433.37

所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,146,081,454.62	828,728,716.72
未分配利润	7.4.7.10	356,877,126.95	70,255,924.13
所有者权益合计		1,502,958,581.57	898,984,640.85
负债和所有者权益总计		1,506,385,325.15	904,542,074.22

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8511 元，基金份额总额 1,765,965,150.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		228,260,331.76	223,175,083.76
1.利息收入		2,404,078.43	713,733.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	540,793.51	675,327.08
债券利息收入		572.06	876.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		1,862,712.86	37,529.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		170,665,095.70	231,726,671.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	140,452,825.34	205,001,712.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	498,304.59	1,304,719.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	15,718,902.91	18,394,456.30

股利收益	7.4.7.15	13,995,062.86	7,025,782.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	53,739,163.41	-9,359,047.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,451,994.22	93,726.14
减：二、费用		4,213,555.67	4,651,080.58
1. 管理人报酬		1,693,661.11	1,248,023.24
2. 托管费		564,553.65	416,007.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,348,676.08	2,442,930.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		63,296.51	66,358.16
7. 其他费用	7.4.7.19	543,368.32	477,760.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		224,046,776.09	218,524,003.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		224,046,776.09	218,524,003.18

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	224,046,776.09	224,046,776.09

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）	317,352,737.90	62,574,426.73	379,927,164.63
其中：1.基金申购款	1,038,587,743.22	182,217,068.79	1,220,804,812.01
2.基金赎回款	-721,235,005.32	-119,642,642.06	-840,877,647.38
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）	1,146,081,454.62	356,877,126.95	1,502,958,581.57
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	1,089,619,896.34	-186,317,983.46	903,301,912.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	218,524,003.18	218,524,003.18
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）	-260,891,179.62	38,049,904.41	-222,841,275.21
其中：1.基金申购款	2,262,354,854.82	-7,081,835.57	2,255,273,019.25
2.基金赎回款	-2,523,246,034.44	45,131,739.98	-2,478,114,294.46
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）	828,728,716.72	70,255,924.13	898,984,640.85
-----------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

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》、《易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务并调整场内份额最小申购、赎回单位及相关业务安排的公告》和《易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及场内份额恢复交易和申购、赎回业务的公告》的有关规定，本基金的基金管理人确定 2021 年 7 月 16 日为本基金的基金份额拆分日。拆分前场内基金份额总额为 144,496,515.00 份，场外基金份额总额为 733,113.00 份，拆分前基金份额净值为 7.9090 元。

根据基金份额拆分公式,基金份额拆分比例为 10,拆分后场内基金份额总额为 1,444,965,150.00 份,场外基金份额总额为 7,331,130.00 份,拆分后基金份额净值为 0.7909 元。本基金登记结算机构(场内份额登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司,场外份额登记结算机构为易方达基金管理有限公司)已根据上述拆分比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分,并于 2021 年 7 月 16 日进行了变更登记。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行

调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)每一基金份额享有同等分配权；

(2)本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；

(3)基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配；

(4)本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5)基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	49,287,676.08	24,560,741.47

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	49,287,676.08	24,560,741.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,333,672,038.16	1,416,421,060.91	82,749,022.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	115,999.24	115,999.24
	银行间市场	-	-
	合计	115,999.24	115,999.24
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,333,788,037.40	1,416,537,060.15	82,749,022.75
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	811,089,844.69	841,629,794.03	30,539,949.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	462,096.13	462,096.13
	银行间市场	-	-

	合计	462,096.13	462,096.13	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	811,551,940.82	842,091,890.16	30,539,949.34

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	77,705,840.00	-	-	-
IC2203	33,118,280.00	-	-	-
IC2206	44,587,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	77,705,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	50,508,410.00	-	-	-
IC2101	7,432,890.00	-	-	-
IC2103	21,764,120.00	-	-	-
IC2106	21,311,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	50,508,410.00	-	-	-

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 12 月 31 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)
IC2203	IC2203	24	35,067,840.00	1,949,560.00
IC2206	IC2206	32	45,745,920.00	1,158,360.00
总额合计				3,107,920.00
减:可抵销期货暂收款				3,107,920.00
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。

于 2020 年 12 月 31 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)
IC2101	IC2101	6	7,612,560.00	179,670.00
IC2103	IC2103	18	22,505,040.00	740,920.00
IC2106	IC2106	18	21,968,640.00	657,240.00
总额合计				1,577,830.00
减:可抵销期货暂收款				1,577,830.00
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,717.72	2,375.86
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	12,329.05	12,184.00
应收债券利息	13.31	36.74
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	18,827.75	38,656.26
其他	39.40	131.30
合计	35,927.23	53,384.16

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	64,185.62	141,847.20
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	64,185.62	141,847.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	200,000.00	200,000.00
应付替代款	237,343.53	990,136.65
可退替代款	19,948.00	4,330.40
其他应付款	106,860.17	67,637.93
合计	564,151.70	1,262,104.98

7.4.7.9 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 12 月 31 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	90,733,113.00	588,842,512.58
本期赎回（以“-”号填列）	-73,200,000.00	-475,055,580.56
2021 年 7 月 16 日基金拆分/份额 折算前	145,229,628.00	942,515,648.74
基金拆分/份额折算调整	1,307,066,652.00	-
本期申购	693,000,000.00	449,745,230.64
本期赎回（以“-”号填列）	-379,331,130.00	-246,179,424.76
本期末	1,765,965,150.00	1,146,081,454.62

注：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。

7.4.7.10 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	170,307,612.68	53,739,163.41	224,046,776.09
本期基金份额交易产生的 变动数	237,805,610.82	-175,231,184.09	62,574,426.73
其中：基金申购款	738,936,206.47	-556,719,137.68	182,217,068.79
基金赎回款	-501,130,595.65	381,487,953.59	-119,642,642.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	934,977,388.84	-578,100,261.89	356,877,126.95

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	143,162.16	149,090.25
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	394,420.64	523,699.02
其他	3,210.71	2,537.81
合计	540,793.51	675,327.08

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	114,627,512.11	150,919,920.11
股票投资收益——赎回差价收入	25,825,313.23	54,081,792.57
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	140,452,825.34	205,001,712.68

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	894,917,103.62	1,670,510,278.26
减：卖出股票成本总额	780,289,591.51	1,519,590,358.15
买卖股票差价收入	114,627,512.11	150,919,920.11

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	834,937,906.90	2,478,114,294.46
减：现金支付赎回款总额	438,553,039.90	1,365,379,019.46
减：赎回股票成本总额	370,559,553.77	1,058,653,482.43
赎回差价收入	25,825,313.23	54,081,792.57

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,671,004.82	7,825,271.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,172,064.45	6,519,358.53
减：应收利息总额	635.78	1,193.18
买卖债券差价收入	498,304.59	1,304,719.50

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	15,718,902.91	18,394,456.30

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,995,062.86	7,025,782.79
其中：证券出借权益补偿收入	1,530,225.35	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,995,062.86	7,025,782.79

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	52,209,073.41	-9,221,717.40
——股票投资	52,209,073.41	-9,221,717.40
——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	1,530,090.00	-137,330.00
——权证投资	-	-
——期货投资	1,530,090.00	-137,330.00
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	53,739,163.41	-9,359,047.40

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	8,909.61	-
基金申购费收入	2,748.63	-
替代损益收入	1,440,335.98	93,726.14
其他	-	-
合计	1,451,994.22	93,726.14

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,348,676.08	2,442,930.64
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,348,676.08	2,442,930.64

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	4,636.02	3,156.20
指数使用费	338,732.30	249,604.61
其他	-	25,000.00
合计	543,368.32	477,760.81

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
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：1.广东省广晟资产经营有限公司自 2021 年 3 月 12 日起将名称变更为广东省广晟控股集团有限公司；盈峰控股集团有限公司自 2021 年 7 月 26 日起将名称变更为盈峰集团有限公司。2.以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,693,661.11	1,248,023.24
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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	564,553.65	416,007.73

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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 12 月 31 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额	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总额

		总份额的比 例		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	1,355,824,540.00	76.7753%	98,962,500.00	77.4982%
广发证券	1,714,451.00	0.0971%	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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	49,287,676.08	143,162.16	24,560,741.47	149,090.25

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。

7.4.10.7 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12月31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	301038	深水规院	新股网下 发行	2,660	17,768.80
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12月31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

				股/张)	
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股流通	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

				受限						
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫	2021-08-27	2022-03-07	新股	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-

	股份			流通受限						
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-

301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股 流通 受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股 流通 受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股 流通 受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股 流通 受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股 流通 受限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股 流通 受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股 流通 受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股 流通 受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股 流通 受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股 流通 受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股 流通 受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	新股 流通 受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股 流通 受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股 流通 受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股 流通	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-

				受限							
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-	
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-	
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-	
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-	
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-	
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-	
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-	
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-	
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-	
600941	中国移动	2021-12-27	2022-01-05	新股流通受限	57.58	57.58	1,000	57,580.00	57,580.00	-	
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-	
688091	上海谊众	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	38.10	42.81	3,294	125,501.40	141,016.14	-	
688103	国力	2021-09-02	2022-03-10	新股	12.04	66.10	1,595	19,203.80	105,429.50	-	

股份	流通受限									
688248	南网科技	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	12.24	18.90	11,763	143,979.12	222,320.70	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688711	宏微科技	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-
871245	威博液压	2021-12-24	2022-01-06	新股流通受限	9.68	9.68	200	1,936.00	1,936.00	-

7.4.12.1.2 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
110084	贵燃转债	2021-12-28	2022-01-18	新发流通受限	100.00	100.00	400	39,999.74	39,999.74	-
113634	珀莱转债	2021-12-09	2022-01-04	新发流通受限	100.00	100.00	760	75,999.50	75,999.50	-

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。

7.4.12.2 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
002683	宏大爆破	2021-12-20	重大事项停牌	30.12	2022-01-04	31.00	86,600	2,698,869.79	2,608,392.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	14.43	89,700.00	1,294,371.0 0
2	000039	中集集团	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	17.16	56,200.00	964,392.00
3	000400	许继电气	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	26.10	27,700.00	722,970.00
4	000513	丽珠集团	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	40.21	16,900.00	679,549.00
5	000630	铜陵有色	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	3.48	246,600.00	858,168.00
6	000723	美锦能源	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	16.23	117,600.00	1,908,648.0 0
7	000738	航发控制	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	30.28	30,000.00	908,400.00
8	000739	普洛药业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	35.09	27,000.00	947,430.00
9	000807	云铝股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	11.17	64,200.00	717,114.00
10	000830	鲁西化工	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	15.26	48,500.00	740,110.00
11	000988	华工科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	27.86	23,800.00	663,068.00
12	000997	新大陆	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	18.12	37,900.00	686,748.00
13	000998	隆平高科	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	23.26	33,100.00	769,906.00
14	002002	鸿达兴业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	6.06	114,700.00	695,082.00
15	002013	中航机电	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	18.18	74,000.00	1,345,320.0 0
16	002028	思源电气	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	49.21	27,900.00	1,372,959.0 0
17	002030	达安基因	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	20.06	37,000.00	742,220.00
18	002078	太阳纸业	2022 年 1 月 11 日	11.49	58,100.00	667,569.00

			-2022 年 1 月 11 日			
19	002080	中材科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	34.02	21,000.00	714,420.00
20	002092	中泰化学	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	9.54	70,700.00	674,478.00
21	002138	顺络电子	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	38.18	29,500.00	1,126,310.00
22	002156	通富微电	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	19.43	42,600.00	827,718.00
23	002180	纳思达	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	47.76	29,800.00	1,423,248.00
24	002185	华天科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	12.71	93,600.00	1,189,656.00
25	002203	海亮股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	12.43	54,100.00	672,463.00
26	002249	大洋电机	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	8.79	87,100.00	765,609.00
27	002268	卫士通	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	55.94	27,100.00	1,515,974.00
28	002340	格林美	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	10.35	47,300.00	489,555.00
29	002353	杰瑞股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	40.00	25,700.00	1,028,000.00
30	002372	伟星新材	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	24.32	29,100.00	707,712.00
31	002373	千方科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	14.95	50,800.00	759,460.00
32	002385	大北农	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	10.49	105,200.00	1,103,548.00
33	002424	贵州百灵	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	7.60	27,600.00	209,760.00
34	002429	兆驰股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.86	57,900.00	281,394.00
35	002434	万里扬	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	14.74	21,000.00	309,540.00
36	002439	启明星辰	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	28.53	16,500.00	470,745.00
37	002440	闰土股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.59	42,100.00	403,739.00
38	002444	巨星科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	30.51	23,800.00	726,138.00
39	002468	申通快递	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.09	28,000.00	254,520.00
40	002500	山西证券	2022 年 1 月 12 日	6.60	73,800.00	487,080.00

			-2022 年 1 月 12 日			
41	002505	鹏都农牧	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.82	104,300.00	398,426.00
42	002506	协鑫集成	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	3.80	188,500.00	716,300.00
43	002507	涪陵榨菜	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	37.80	18,200.00	687,960.00
44	002511	中顺洁柔	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	16.71	36,200.00	604,902.00
45	002557	洽洽食品	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	61.36	13,900.00	852,904.00
46	002572	索菲亚	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	22.20	29,200.00	648,240.00
47	002603	以岭药业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	19.60	35,500.00	695,800.00
48	002670	国盛金控	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.60	52,000.00	499,200.00
49	002701	奥瑞金	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	7.00	69,800.00	488,600.00
50	002705	新宝股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	24.70	15,100.00	372,970.00
51	002745	木林森	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	15.13	40,800.00	617,304.00
52	002797	第一创业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	7.32	113,200.00	828,624.00
53	002925	盈趣科技	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	34.03	14,300.00	486,629.00
54	002926	华西证券	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.85	48,600.00	478,710.00
55	002958	青农商行	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.86	87,000.00	335,820.00
56	003035	南网能源	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.29	18,600.00	154,194.00
57	300001	特锐德	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	24.87	28,600.00	711,282.00
58	300009	安科生物	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.09	49,400.00	646,646.00
59	300026	红日药业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	7.83	57,400.00	449,442.00
60	300037	新宙邦	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	113.0 0	13,000.00	1,469,000.0 0
61	300088	长信科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	13.28	88,200.00	1,171,296.0 0
62	300115	长盈精密	2022 年 1 月 11 日	19.84	33,300.00	660,672.00

			-2022 年 1 月 11 日			
63	300133	华策影视	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.77	48,200.00	326,314.00
64	300146	汤臣倍健	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	26.96	35,200.00	948,992.00
65	300168	万达信息	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.02	35,500.00	462,210.00
66	300182	捷成股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.33	57,100.00	361,443.00
67	300251	光线传媒	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	12.85	53,800.00	691,330.00
68	300253	卫宁健康	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	16.76	52,000.00	871,520.00
69	300257	开山股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	15.88	7,700.00	122,276.00
70	300285	国瓷材料	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	42.57	27,300.00	1,162,161.00
71	300296	利亚德	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	10.25	69,800.00	715,450.00
72	300308	中际旭创	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	42.50	23,000.00	977,500.00
73	300315	掌趣科技	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.86	88,800.00	431,568.00
74	300357	我武生物	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	57.30	14,300.00	819,390.00
75	300383	光环新网	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	14.84	22,000.00	326,480.00
76	300418	昆仑万维	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	23.15	6,300.00	145,845.00
77	300463	迈克生物	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	29.19	5,900.00	172,221.00
78	300482	万孚生物	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	39.38	14,200.00	559,196.00
79	300699	光威复材	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	84.48	14,200.00	1,199,616.00
80	600006	东风汽车	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.81	26,700.00	181,827.00
81	600008	首创环保	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.41	144,100.00	491,381.00
82	600021	上海电力	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	12.82	32,900.00	421,778.00
83	600022	山东钢铁	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	1.79	180,100.00	322,379.00
84	600026	中远海能	2022 年 1 月 12 日	5.92	53,300.00	315,536.00

			-2022 年 1 月 12 日			
85	600027	华电国际	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.35	113,700.00	608,295.00
86	600037	歌华有线	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.68	36,800.00	319,424.00
87	600038	中直股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	80.30	13,500.00	1,084,050.00
88	600039	四川路桥	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	12.04	64,400.00	775,376.00
89	600056	中国医药	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	11.81	18,000.00	212,580.00
90	600062	华润双鹤	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.37	16,900.00	225,953.00
91	600064	南京高科	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.34	38,000.00	354,920.00
92	600118	中国卫星	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	27.15	27,100.00	735,765.00
93	600120	浙江东方	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.42	56,500.00	249,730.00
94	600126	杭钢股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.13	20,300.00	104,139.00
95	600141	兴发集团	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	37.88	35,800.00	1,356,104.00
96	600155	华创阳安	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.96	41,300.00	411,348.00
97	600158	中体产业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	15.12	35,400.00	535,248.00
98	600160	巨化股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	12.91	48,100.00	620,971.00
99	600166	福田汽车	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.44	148,500.00	510,840.00
100	600167	联美控股	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.01	39,700.00	357,697.00
101	600170	上海建工	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.60	154,900.00	557,640.00
102	600171	上海贝岭	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	25.66	25,300.00	649,198.00
103	600177	雅戈尔	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.89	86,900.00	598,741.00
104	600188	兖矿能源	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	23.53	40,900.00	962,377.00
105	600195	中牧股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.07	27,900.00	364,653.00
106	600201	生物股份	2022 年 1 月 11 日	16.35	45,400.00	742,290.00

			-2022 年 1 月 11 日			
107	600208	新湖中宝	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	2.98	147,300.00	438,954.00
108	600216	浙江医药	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	17.08	21,800.00	372,344.00
109	600233	圆通速递	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	16.68	63,100.00	1,052,508.00
110	600236	桂冠电力	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	6.42	108,900.00	699,138.00
111	600256	广汇能源	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	6.54	211,500.00	1,383,210.00
112	600258	首旅酒店	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	26.13	27,100.00	708,123.00
113	600266	城建发展	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.50	48,400.00	217,800.00
114	600271	航天信息	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.39	42,800.00	573,092.00
115	600297	广汇汽车	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	2.67	186,600.00	498,222.00
116	600298	安琪酵母	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	60.36	23,000.00	1,388,280.00
117	600299	安迪苏	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	12.32	18,200.00	224,224.00
118	600307	酒钢宏兴	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	2.20	101,600.00	223,520.00
119	600315	上海家化	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	40.41	15,500.00	626,355.00
120	600316	洪都航空	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	39.06	14,200.00	554,652.00
121	600329	中新药业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	31.41	12,700.00	398,907.00
122	600339	中油工程	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.08	65,400.00	201,432.00
123	600348	华阳股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	11.85	38,400.00	455,040.00
124	600369	西南证券	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.29	106,900.00	565,501.00
125	600373	中文传媒	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	12.36	22,200.00	274,392.00
126	600376	首开股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.66	41,200.00	233,192.00
127	600380	健康元	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	12.84	17,600.00	225,984.00
128	600390	五矿资本	2022 年 1 月 12 日	5.32	70,100.00	372,932.00

			-2022 年 1 月 12 日			
129	600392	盛和资源	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	19.62	64,500.00	1,265,490.00
130	600409	三友化工	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.70	44,500.00	387,150.00
131	600415	小商品城	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.85	99,200.00	481,120.00
132	600418	江淮汽车	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	17.40	69,900.00	1,216,260.00
133	600435	北方导航	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	10.68	40,900.00	436,812.00
134	600446	金证股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	14.32	30,100.00	431,032.00
135	600466	蓝光发展	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	2.04	55,100.00	112,404.00
136	600482	中国动力	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	19.70	49,700.00	979,090.00
137	600487	亨通光电	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	15.12	86,900.00	1,313,928.00
138	600497	驰宏锌锗	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	4.99	163,900.00	817,861.00
139	600498	烽火通信	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	17.98	22,500.00	404,550.00
140	600500	中化国际	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.56	52,600.00	450,256.00
141	600507	方大特钢	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	7.80	59,600.00	464,880.00
142	600511	国药股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	31.53	17,100.00	539,163.00
143	600516	方大炭素	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	10.82	75,400.00	815,828.00
144	600517	国网英大	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	7.29	78,700.00	573,723.00
145	600521	华海药业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	21.66	41,000.00	888,060.00
146	600522	中天科技	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	16.96	122,400.00	2,075,904.00
147	600528	中铁工业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.21	44,400.00	364,524.00
148	600529	山东药玻	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	43.90	12,400.00	544,360.00
149	600535	天士力	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	15.85	41,600.00	659,360.00
150	600536	中国软件	2022 年 1 月 11 日	49.93	13,600.00	679,048.00

			-2022 年 1 月 11 日			
151	600546	山煤国际	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.21	45,700.00	375,197.00
152	600549	厦门钨业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	22.63	35,300.00	798,839.00
153	600566	济川药业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	28.34	16,200.00	459,108.00
154	600567	山鹰国际	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.29	111,400.00	366,506.00
155	600572	康恩贝	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.00	62,300.00	311,500.00
156	600580	卧龙电驱	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	18.29	42,100.00	770,009.00
157	600582	天地科技	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.38	62,600.00	274,188.00
158	600597	光明乳业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	14.52	26,000.00	377,520.00
159	600598	北大荒	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	14.56	28,600.00	416,416.00
160	600623	华谊集团	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.10	24,100.00	219,310.00
161	600637	东方明珠	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.45	72,600.00	686,070.00
162	600639	浦东金桥	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	12.77	15,500.00	197,935.00
163	600642	申能股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	7.37	88,400.00	651,508.00
164	600643	爱建集团	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.76	36,700.00	248,092.00
165	600648	外高桥	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.23	17,000.00	224,910.00
166	600649	城投控股	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.11	39,600.00	162,756.00
167	600663	陆家嘴	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	10.86	40,300.00	437,658.00
168	600667	太极实业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.08	48,900.00	395,112.00
169	600673	东阳光	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.88	53,100.00	471,528.00
170	600699	均胜电子	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	21.97	43,800.00	962,286.00
171	600704	物产中大	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.92	86,200.00	510,304.00
172	600705	中航产融	2022 年 1 月 11 日	3.97	245,900.00	976,223.00

			-2022 年 1 月 11 日			
173	600707	彩虹股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.82	64,900.00	442,618.00
174	600717	天津港	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.19	46,500.00	194,835.00
175	600718	东软集团	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.56	38,900.00	527,484.00
176	600728	佳都科技	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.33	56,600.00	471,478.00
177	600733	北汽蓝谷	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	10.02	80,300.00	804,606.00
178	600737	中粮糖业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	9.40	36,100.00	339,340.00
179	600739	辽宁成大	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	19.52	39,700.00	774,944.00
180	600754	锦江酒店	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	58.60	19,400.00	1,136,840.00
181	600755	厦门国贸	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	7.21	67,900.00	489,559.00
182	600764	中国海防	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	40.66	13,000.00	528,580.00
183	600765	中航重机	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	50.49	28,800.00	1,454,112.00
184	600776	东方通信	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	11.51	13,100.00	150,781.00
185	600782	新钢股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.28	88,000.00	464,640.00
186	600787	中储股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	6.24	40,300.00	251,472.00
187	600801	华新水泥	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	19.30	23,100.00	445,830.00
188	600803	新奥股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	18.36	39,200.00	719,712.00
189	600808	马钢股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.69	78,500.00	289,665.00
190	600811	东方集团	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.01	105,400.00	317,254.00
191	600820	隧道股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.38	66,100.00	355,618.00
192	600823	世茂股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.28	45,300.00	148,584.00
193	600827	百联股份	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	13.33	27,100.00	361,243.00
194	600835	上海机电	2022 年 1 月 12 日	15.92	14,700.00	234,024.00

			-2022 年 1 月 12 日			
195	600839	四川长虹	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.31	121,000.00	400,510.00
196	600859	王府井	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	27.00	26,900.00	726,300.00
197	600862	中航高科	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	35.76	38,400.00	1,373,184.00
198	600867	通化东宝	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	10.96	59,900.00	656,504.00
199	600875	东方电气	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	21.42	42,800.00	916,776.00
200	600884	杉杉股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	32.77	51,600.00	1,690,932.00
201	600885	宏发股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	74.64	15,500.00	1,156,920.00
202	600901	江苏租赁	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.09	37,300.00	189,857.00
203	600909	华安证券	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.41	93,300.00	504,753.00
204	600917	重庆燃气	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	8.39	14,300.00	119,977.00
205	600928	西安银行	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	4.30	45,000.00	193,500.00
206	600959	江苏有线	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.29	64,600.00	212,534.00
207	600968	海油发展	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	2.93	69,500.00	203,635.00
208	600970	中材国际	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	11.43	48,200.00	550,926.00
209	600985	淮北矿业	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	11.18	41,400.00	462,852.00
210	600988	赤峰黄金	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	14.90	61,300.00	913,370.00
211	600998	九州通	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	14.72	29,600.00	435,712.00
212	601005	重庆钢铁	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	2.09	222,700.00	465,443.00
213	601016	节能风电	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	6.51	106,600.00	693,966.00
214	601077	渝农商行	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 12 日	3.85	284,500.00	1,095,325.00
215	601106	中国一重	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.48	100,000.00	348,000.00
216	601117	中国化学	2022 年 1 月 11 日	12.00	140,400.00	1,684,800.00

			-2022 年 1 月 11 日			0
217	601118	海南橡胶	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.28	53,800.00	284,064.00
218	601128	常熟银行	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	6.61	103,000.00	680,830.00
219	601168	西部矿业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	13.61	68,500.00	932,285.00
220	601179	中国西电	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	5.55	73,700.00	409,035.00
221	601198	东兴证券	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	11.63	74,400.00	865,272.00
222	601228	广州港	2022 年 1 月 12 日 -2022 年 1 月 12 日	3.33	46,500.00	154,845.00
223	601555	东吴证券	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	8.86	178,700.00	1,583,282.00
224	601615	明阳智能	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	26.10	72,100.00	1,881,810.00
225	601636	旗滨集团	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	17.10	55,700.00	952,470.00
226	601689	拓普集团	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	53.00	16,200.00	858,600.00
227	603077	和邦生物	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	3.41	284,000.00	968,440.00
228	603218	日月股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	32.95	22,300.00	734,785.00
229	603456	九洲药业	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	56.26	23,000.00	1,293,980.00
230	603589	口子窖	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	70.87	16,400.00	1,162,268.00
231	603613	国联股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	107.50	11,100.00	1,193,250.00
232	603707	健友股份	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	42.00	16,600.00	697,200.00
合计	-	-	-	-	13,234,500.00	149,596,755.00

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，

并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。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约定申报的借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，对不同的借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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

7.4.13.2.1 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12月31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。

7.4.13.2.2 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12月31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

7.4.13.2.3 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12月31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

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	441,030.93
AAA 以下	116,012.55	21,101.94
未评级	0.00	0.00
合计	116,012.55	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。

7.4.13.2.5 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12月31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

7.4.13.2.6 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12月31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

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	49,287,676.08	-	-	-	49,287,676.08
结算备付金	25,426,182.63	-	-	-	25,426,182.63
存出保证金	12,209,530.45	-	-	-	12,209,530.45
交易性金融资产	-	-	115,999.24	1,416,421,060.91	1,416,537,060.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,888,948.61	2,888,948.61
应收利息	-	-	-	35,927.23	35,927.23
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	86,923,389.16	-	115,999.24	1,419,345,936.75	1,506,385,325.15
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	-	-	-	2,372,580.19	2,372,580.19
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	184,444.54	184,444.54
应付托管费	-	-	-	61,481.50	61,481.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	64,185.62	64,185.62
应交税费	-	-	-	179,900.03	179,900.03
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	564,151.70	564,151.70
负债总计	-	-	-	3,426,743.58	3,426,743.58
利率敏感度缺口	86,923,389.16	-	115,999.24	1,415,919,193.17	1,502,958,581.57
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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1,416,421,060.91	94.24	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	1,416,421,060.91	94.24	841,629,794.03	93.62

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	70,681,397.66	41,816,135.50
2.业绩比较基准下降 5%	-70,681,397.66	-41,816,135.50	

7.4.14 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 12 月 31 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 1,410,220,998.31 元,属于第二层次的余额为 6,316,061.84 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 12 月 31 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,416,421,060.91	94.03
	其中：股票	1,416,421,060.91	94.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	115,999.24	0.01
	其中：债券	115,999.24	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	74,713,858.71	4.96
8	其他各项资产	15,134,406.29	1.00
9	合计	1,506,385,325.15	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 149,596,755.00 元，占净值比例 9.95%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	15,716,696.81	1.05
B	采矿业	46,117,763.02	3.07
C	制造业	856,345,861.88	56.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,819,402.60	3.51
E	建筑业	26,777,800.00	1.78
F	批发和零售业	43,739,725.75	2.91
G	交通运输、仓储和邮政业	33,099,124.95	2.20
H	住宿和餐饮业	8,531,378.18	0.57

I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,347,074.38	8.21
J	金融业	101,167,033.00	6.73
K	房地产业	36,595,065.40	2.43
L	租赁和商务服务业	17,248,957.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	5,407,877.12	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	12,124,631.50	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,978,700.08	0.20
R	文化、体育和娱乐业	18,232,851.44	1.21
S	综合	16,171,117.80	1.08
	合计	1,416,421,060.91	94.24

8.3 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	002340	格林美	959,150	9,927,202.50	0.66
2	600522	中天科技	534,200	9,060,032.00	0.60
3	000733	振华科技	71,600	8,898,448.00	0.59
4	000723	美锦能源	513,500	8,334,105.00	0.55
5	601615	明阳智能	314,900	8,218,890.00	0.55
6	600157	永泰能源	4,459,700	8,116,654.00	0.54
7	600399	抚顺特钢	317,300	7,859,521.00	0.52
8	600885	宏发股份	104,972	7,835,110.08	0.52
9	600884	杉杉股份	232,007	7,602,869.39	0.51
10	000009	中国宝安	516,780	7,457,135.40	0.50
11	002384	东山精密	274,700	7,444,370.00	0.50
12	601117	中国化学	612,900	7,354,800.00	0.49
13	002013	中航机电	389,700	7,084,746.00	0.47
14	601555	东吴证券	794,300	7,037,498.00	0.47
15	002385	大北农	664,900	6,974,801.00	0.46
16	300285	国瓷材料	161,400	6,870,798.00	0.46
17	688099	晶晨股份	52,156	6,790,711.20	0.45
18	002180	纳思达	139,000	6,638,640.00	0.44
19	002268	卫士通	118,620	6,635,602.80	0.44
20	605358	立昂微	55,100	6,612,551.00	0.44

21	300751	迈为股份	10,200	6,551,460.00	0.44
22	300088	长信科技	492,910	6,545,844.80	0.44
23	688005	容百科技	56,415	6,520,445.70	0.43
24	300037	新宙邦	57,700	6,520,100.00	0.43
25	600765	中航重机	126,020	6,362,749.80	0.42
26	600563	法拉电子	26,542	6,168,360.80	0.41
27	600298	安琪酵母	100,800	6,084,288.00	0.40
28	600256	广汇能源	923,200	6,037,728.00	0.40
29	002028	思源电气	122,050	6,006,080.50	0.40
30	600862	中航高科	167,720	5,997,667.20	0.40
31	600141	兴发集团	156,488	5,927,765.44	0.39
32	300363	博腾股份	65,100	5,823,195.00	0.39
33	300253	卫宁健康	343,500	5,757,060.00	0.38
34	600487	亨通光电	379,600	5,739,552.00	0.38
35	002185	华天科技	449,900	5,718,229.00	0.38
36	603456	九洲药业	100,800	5,671,008.00	0.38
37	000988	华工科技	202,680	5,646,664.80	0.38
38	601636	旗滨集团	323,900	5,538,690.00	0.37
39	600392	盛和资源	281,583	5,524,658.46	0.37
40	600754	锦江酒店	92,630	5,428,118.00	0.36
41	300058	蓝色光标	499,920	5,364,141.60	0.36
42	600418	江淮汽车	305,199	5,310,462.60	0.35
43	300223	北京君正	39,400	5,279,600.00	0.35
44	300699	光威复材	62,200	5,254,656.00	0.35
45	603267	鸿远电子	29,200	5,239,648.00	0.35
46	603613	国联股份	48,700	5,235,250.00	0.35
47	601168	西部矿业	382,840	5,210,452.40	0.35
48	000630	铜陵有色	1,479,400	5,148,312.00	0.34
49	603589	口子窖	71,549	5,070,677.63	0.34
50	600486	扬农化工	38,100	4,998,720.00	0.33
51	600516	方大炭素	457,600	4,951,232.00	0.33
52	300136	信维通信	195,400	4,947,528.00	0.33
53	002797	第一创业	674,300	4,935,876.00	0.33
54	000998	隆平高科	211,900	4,928,794.00	0.33
55	002138	顺络电子	128,700	4,913,766.00	0.33
56	688536	思瑞浦	6,344	4,872,192.00	0.32
57	300724	捷佳伟创	42,500	4,857,750.00	0.32
58	601077	渝农商行	1,241,700	4,780,545.00	0.32
59	300474	景嘉微	31,400	4,779,080.00	0.32
60	600875	东方电气	223,030	4,777,302.60	0.32
61	300308	中际旭创	112,401	4,777,042.50	0.32
62	601689	拓普集团	89,442	4,740,426.00	0.32
63	600038	中直股份	59,000	4,737,700.00	0.32
64	603893	瑞芯微	34,500	4,723,050.00	0.31

65	000728	国元证券	612,900	4,719,330.00	0.31
66	002409	雅克科技	57,300	4,651,041.00	0.31
67	002353	杰瑞股份	115,150	4,606,000.00	0.31
68	600233	圆通速递	275,700	4,598,676.00	0.31
69	300146	汤臣倍健	170,500	4,596,680.00	0.31
70	002212	天融信	237,300	4,549,041.00	0.30
71	002080	中材科技	133,700	4,548,474.00	0.30
72	002223	鱼跃医疗	120,280	4,546,584.00	0.30
73	688065	凯赛生物	24,615	4,536,052.20	0.30
74	300763	锦浪科技	19,500	4,515,225.00	0.30
75	000519	中兵红箭	167,650	4,471,225.50	0.30
76	688208	道通科技	56,040	4,449,576.00	0.30
77	300418	昆仑万维	191,100	4,423,965.00	0.29
78	688002	睿创微纳	56,058	4,404,477.06	0.29
79	002673	西部证券	538,900	4,348,923.00	0.29
80	600733	北汽蓝谷	430,750	4,316,115.00	0.29
81	000547	航天发展	258,371	4,314,795.70	0.29
82	000636	风华高科	144,716	4,312,536.80	0.29
83	002439	启明星辰	150,600	4,296,618.00	0.29
84	600482	中国动力	216,902	4,272,969.40	0.28
85	600705	中航产融	1,073,100	4,260,207.00	0.28
86	000932	华菱钢铁	831,780	4,250,395.80	0.28
87	603077	和邦生物	1,239,590	4,227,001.90	0.28
88	600529	山东药玻	96,200	4,223,180.00	0.28
89	000039	中集集团	245,452	4,211,956.32	0.28
90	600739	辽宁成大	215,200	4,200,704.00	0.28
91	600188	兖矿能源	178,500	4,200,105.00	0.28
92	600699	均胜电子	191,060	4,197,588.20	0.28
93	300296	利亚德	407,400	4,175,850.00	0.28
94	002444	巨星科技	136,550	4,166,140.50	0.28
95	000739	普洛药业	118,000	4,140,620.00	0.28
96	603605	珀莱雅	19,700	4,103,707.00	0.27
97	000807	云铝股份	367,129	4,100,830.93	0.27
98	002465	海格通信	370,800	4,049,136.00	0.27
99	002507	涪陵榨菜	107,100	4,048,380.00	0.27
100	688521	芯原股份	52,331	4,048,326.16	0.27
101	600988	赤峰黄金	267,600	3,987,240.00	0.27
102	002030	达安基因	198,249	3,976,874.94	0.26
103	000738	航发控制	131,100	3,969,708.00	0.26
104	000960	锡业股份	201,840	3,941,935.20	0.26
105	601016	节能风电	603,850	3,931,063.50	0.26
106	002273	水晶光电	223,247	3,882,265.33	0.26
107	600521	华海药业	179,100	3,879,306.00	0.26
108	600637	东方明珠	410,200	3,876,390.00	0.26

109	600549	厦门钨业	170,600	3,860,678.00	0.26
110	603290	斯达半导	10,100	3,848,100.00	0.26
111	600177	雅戈尔	557,200	3,839,108.00	0.26
112	603127	昭衍新药	33,200	3,832,276.00	0.25
113	002985	北摩高科	31,810	3,831,832.60	0.25
114	600732	爱旭股份	163,600	3,821,696.00	0.25
115	601198	东兴证券	324,700	3,776,261.00	0.25
116	002557	洽洽食品	60,800	3,730,688.00	0.25
117	002078	太阳纸业	323,920	3,721,840.80	0.25
118	600704	物产中大	625,000	3,700,000.00	0.25
119	600201	生物股份	225,819	3,692,140.65	0.25
120	300383	光环新网	246,600	3,659,544.00	0.24
121	002299	圣农发展	150,613	3,640,316.21	0.24
122	601128	常熟银行	550,260	3,637,218.60	0.24
123	600642	申能股份	493,100	3,634,147.00	0.24
124	002156	通富微电	185,900	3,612,037.00	0.24
125	600879	航天电子	436,840	3,599,561.60	0.24
126	300357	我武生物	62,750	3,595,575.00	0.24
127	603444	吉比特	8,522	3,595,005.70	0.24
128	600497	驰宏锌锗	715,400	3,569,846.00	0.24
129	300618	寒锐钴业	44,100	3,535,938.00	0.24
130	600369	西南证券	666,700	3,526,843.00	0.23
131	600027	华电国际	654,900	3,503,715.00	0.23
132	600160	巨化股份	271,160	3,500,675.60	0.23
133	000830	鲁西化工	228,971	3,494,097.46	0.23
134	600372	中航电子	155,300	3,477,167.00	0.23
135	002739	万达电影	223,800	3,464,424.00	0.23
136	002092	中泰化学	362,960	3,462,638.40	0.23
137	600039	四川路桥	287,110	3,456,804.40	0.23
138	002508	老板电器	95,900	3,454,318.00	0.23
139	000623	吉林敖东	185,900	3,433,573.00	0.23
140	600316	洪都航空	87,420	3,414,625.20	0.23
141	000983	山西焦煤	410,040	3,391,030.80	0.23
142	603198	迎驾贡酒	48,560	3,372,492.00	0.22
143	002422	科伦药业	178,000	3,369,540.00	0.22
144	600580	卧龙电驱	183,980	3,364,994.20	0.22
145	000629	攀钢钒钛	863,000	3,357,070.00	0.22
146	300115	长盈精密	168,680	3,346,611.20	0.22
147	002249	大洋电机	380,130	3,341,342.70	0.22
148	601997	贵阳银行	513,020	3,339,760.20	0.22
149	002131	利欧股份	1,356,830	3,337,801.80	0.22
150	002373	千方科技	222,080	3,320,096.00	0.22
151	300017	网宿科技	491,500	3,288,135.00	0.22
152	002603	以岭药业	167,580	3,284,568.00	0.22

153	002936	郑州银行	1,032,985	3,264,232.60	0.22
154	000887	中鼎股份	147,910	3,225,917.10	0.21
155	603218	日月股份	97,700	3,219,215.00	0.21
156	600170	上海建工	893,200	3,215,520.00	0.21
157	000825	太钢不锈	456,700	3,215,168.00	0.21
158	600118	中国卫星	118,400	3,214,560.00	0.21
159	000050	深天马 A	245,600	3,197,712.00	0.21
160	300070	碧水源	444,500	3,195,955.00	0.21
161	600166	福田汽车	924,490	3,180,245.60	0.21
162	600859	王府井	117,450	3,171,150.00	0.21
163	000400	许继电气	120,980	3,157,578.00	0.21
164	000750	国海证券	765,330	3,145,506.30	0.21
165	600803	新奥股份	171,200	3,143,232.00	0.21
166	002191	劲嘉股份	207,340	3,137,054.20	0.21
167	600867	通化东宝	285,400	3,127,984.00	0.21
168	002506	协鑫集成	822,900	3,127,020.00	0.21
169	600153	建发股份	344,300	3,122,801.00	0.21
170	002926	华西证券	316,800	3,120,480.00	0.21
171	300001	特锐德	124,750	3,102,532.50	0.21
172	600258	首旅酒店	118,586	3,098,652.18	0.21
173	000027	深圳能源	382,196	3,095,787.60	0.21
174	300168	万达信息	237,600	3,093,552.00	0.21
175	002372	伟星新材	127,080	3,090,585.60	0.21
176	002056	横店东磁	163,440	3,084,112.80	0.21
177	002266	浙富控股	431,550	3,072,636.00	0.20
178	600909	华安证券	565,148	3,057,450.68	0.20
179	600236	桂冠电力	475,600	3,053,352.00	0.20
180	603707	健友股份	72,520	3,045,840.00	0.20
181	002002	鸿达兴业	500,615	3,033,726.90	0.20
182	300251	光线传媒	234,900	3,018,465.00	0.20
183	600008	首创环保	884,000	3,014,440.00	0.20
184	002065	东华软件	386,100	3,011,580.00	0.20
185	300009	安科生物	229,840	3,008,605.60	0.20
186	600066	宇通客车	272,700	3,005,154.00	0.20
187	000997	新大陆	165,710	3,002,665.20	0.20
188	600271	航天信息	223,100	2,987,309.00	0.20
189	002152	广电运通	250,430	2,980,117.00	0.20
190	000513	丽珠集团	74,086	2,978,998.06	0.20
191	600536	中国软件	59,400	2,965,842.00	0.20
192	000021	深科技	187,010	2,962,238.40	0.20
193	300244	迪安诊断	88,190	2,960,538.30	0.20
194	002408	齐翔腾达	281,663	2,957,461.50	0.20
195	002203	海亮股份	236,200	2,935,966.00	0.20
196	000975	银泰黄金	334,264	2,934,837.92	0.20

197	600171	上海贝岭	114,350	2,934,221.00	0.20
198	002221	东华能源	231,240	2,911,311.60	0.19
199	300630	普利制药	52,818	2,907,102.72	0.19
200	603156	养元饮品	102,000	2,897,820.00	0.19
201	000656	金科股份	643,900	2,884,672.00	0.19
202	600535	天士力	181,518	2,877,060.30	0.19
203	002500	山西证券	432,790	2,856,414.00	0.19
204	600348	华阳股份	240,530	2,850,280.50	0.19
205	300026	红日药业	362,910	2,841,585.30	0.19
206	002572	索菲亚	127,500	2,830,500.00	0.19
207	300024	机器人	251,700	2,811,489.00	0.19
208	601005	重庆钢铁	1,344,691	2,810,404.19	0.19
209	300212	易华录	79,220	2,800,427.00	0.19
210	600998	九州通	187,078	2,753,788.16	0.18
211	000878	云南铜业	205,440	2,746,732.80	0.18
212	000012	南玻 A	275,643	2,737,134.99	0.18
213	600315	上海家化	67,720	2,736,565.20	0.18
214	603568	伟明环保	74,861	2,734,672.33	0.18
215	000970	中科三环	170,240	2,732,352.00	0.18
216	002127	南极电商	393,900	2,717,910.00	0.18
217	601699	潞安环能	239,400	2,707,614.00	0.18
218	000537	广宇发展	112,100	2,701,610.00	0.18
219	002745	木林森	178,220	2,696,468.60	0.18
220	002195	二三四五	1,149,482	2,689,787.88	0.18
221	300315	掌趣科技	553,400	2,689,524.00	0.18
222	002250	联化科技	149,050	2,678,428.50	0.18
223	600673	东阳光	301,380	2,676,254.40	0.18
224	600415	小商品城	551,100	2,672,835.00	0.18
225	603712	七一二	61,700	2,671,610.00	0.18
226	601872	招商轮船	651,500	2,671,150.00	0.18
227	000999	华润三九	77,420	2,650,860.80	0.18
228	002511	中顺洁柔	158,100	2,641,851.00	0.18
229	300463	迈克生物	90,300	2,635,857.00	0.18
230	002019	亿帆医药	149,380	2,632,075.60	0.18
231	002153	石基信息	91,200	2,621,088.00	0.17
232	600801	华新水泥	135,568	2,616,462.40	0.17
233	300182	捷成股份	412,360	2,610,238.80	0.17
234	002683	宏大爆破	86,600	2,608,392.00	0.17
235	000690	宝新能源	436,980	2,586,921.60	0.17
236	600863	内蒙华电	655,310	2,581,921.40	0.17
237	600208	新湖中宝	863,900	2,574,422.00	0.17
238	688006	杭可科技	23,819	2,562,448.02	0.17
239	600970	中材国际	222,700	2,545,461.00	0.17
240	601866	中远海发	779,754	2,534,200.50	0.17

241	000060	中金岭南	512,200	2,514,902.00	0.17
242	000401	冀东水泥	210,170	2,513,633.20	0.17
243	600517	国网英大	343,800	2,506,302.00	0.17
244	002831	裕同科技	73,940	2,491,038.60	0.17
245	601778	晶科科技	289,900	2,472,847.00	0.16
246	002294	信立泰	90,500	2,472,460.00	0.16
247	000686	东北证券	281,600	2,472,448.00	0.16
248	600380	健康元	192,000	2,465,280.00	0.16
249	300482	万孚生物	62,250	2,451,405.00	0.16
250	600839	四川长虹	740,220	2,450,128.20	0.16
251	002505	鹏都农牧	640,750	2,447,665.00	0.16
252	000930	中粮科技	224,587	2,441,260.69	0.16
253	600498	烽火通信	135,200	2,430,896.00	0.16
254	600155	华创阳安	243,448	2,424,742.08	0.16
255	603858	步长制药	114,400	2,412,696.00	0.16
256	002939	长城证券	186,000	2,408,700.00	0.16
257	600390	五矿资本	451,000	2,399,320.00	0.16
258	000729	燕京啤酒	282,590	2,393,537.30	0.16
259	600667	太极实业	295,100	2,384,408.00	0.16
260	002701	奥瑞金	340,430	2,383,010.00	0.16
261	600500	中化国际	277,547	2,375,802.32	0.16
262	601992	金隅集团	836,500	2,375,660.00	0.16
263	600718	东软集团	174,240	2,362,694.40	0.16
264	600511	国药股份	74,890	2,361,281.70	0.16
265	600728	佳都科技	282,100	2,349,893.00	0.16
266	600895	张江高科	155,900	2,347,854.00	0.16
267	600158	中体产业	154,645	2,338,232.40	0.16
268	300376	易事特	231,670	2,328,283.50	0.15
269	002382	蓝帆医疗	142,600	2,322,954.00	0.15
270	600764	中国海防	57,000	2,317,620.00	0.15
271	002004	华邦健康	318,490	2,305,867.60	0.15
272	688188	柏楚电子	5,977	2,303,894.42	0.15
273	002128	电投能源	154,800	2,298,780.00	0.15
274	600216	浙江医药	134,550	2,298,114.00	0.15
275	002430	杭氧股份	76,500	2,295,765.00	0.15
276	603225	新凤鸣	154,082	2,288,117.70	0.15
277	600282	南钢股份	617,600	2,285,120.00	0.15
278	002532	天山铝业	280,000	2,282,000.00	0.15
279	000598	兴蓉环境	360,810	2,280,319.20	0.15
280	601179	中国西电	410,500	2,278,275.00	0.15
281	002966	苏州银行	334,400	2,263,888.00	0.15
282	688029	南微医学	10,640	2,262,808.80	0.15
283	002174	游族网络	147,900	2,253,996.00	0.15
284	300072	三聚环保	282,700	2,241,811.00	0.15

285	600985	淮北矿业	200,200	2,238,236.00	0.15
286	002670	国盛金控	232,495	2,231,952.00	0.15
287	000540	中天金融	843,000	2,225,520.00	0.15
288	002396	星网锐捷	94,407	2,225,172.99	0.15
289	002368	太极股份	80,383	2,213,747.82	0.15
290	600528	中铁工业	267,976	2,200,082.96	0.15
291	002595	豪迈科技	79,200	2,198,592.00	0.15
292	601717	郑煤机	189,406	2,195,215.54	0.15
293	002048	宁波华翔	100,990	2,184,413.70	0.15
294	000581	威孚高科	101,250	2,180,925.00	0.15
295	600297	广汇汽车	814,600	2,174,982.00	0.14
296	600409	三友化工	249,800	2,173,260.00	0.14
297	002958	青农商行	557,300	2,151,178.00	0.14
298	600827	百联股份	161,276	2,149,809.08	0.14
299	603866	桃李面包	75,572	2,146,244.80	0.14
300	603638	艾迪精密	67,080	2,141,193.60	0.14
301	600755	厦门国贸	296,631	2,138,709.51	0.14
302	600567	山鹰国际	649,200	2,135,868.00	0.14
303	002010	传化智联	245,500	2,135,850.00	0.14
304	002925	盈趣科技	62,510	2,127,215.30	0.14
305	600060	海信视像	158,010	2,125,234.50	0.14
306	300271	华宇软件	166,400	2,113,280.00	0.14
307	600131	国网信通	96,600	2,110,710.00	0.14
308	603885	吉祥航空	118,100	2,096,275.00	0.14
309	603883	老百姓	42,422	2,094,798.36	0.14
310	000709	河钢股份	851,500	2,094,690.00	0.14
311	600598	北大荒	143,710	2,092,417.60	0.14
312	000778	新兴铸管	481,340	2,084,202.20	0.14
313	002183	怡亚通	313,620	2,076,164.40	0.14
314	002075	沙钢股份	353,400	2,060,322.00	0.14
315	000883	湖北能源	391,600	2,051,984.00	0.14
316	600325	华发股份	339,579	2,044,265.58	0.14
317	600967	内蒙一机	170,844	2,041,585.80	0.14
318	600820	隧道股份	379,000	2,039,020.00	0.14
319	002690	美亚光电	54,360	2,036,325.60	0.14
320	600507	方大特钢	260,352	2,030,745.60	0.14
321	600782	新钢股份	384,100	2,028,048.00	0.13
322	600021	上海电力	158,000	2,025,560.00	0.13
323	601456	国联证券	144,800	2,022,856.00	0.13
324	600737	中粮糖业	214,971	2,020,727.40	0.13
325	600566	济川药业	70,700	2,003,638.00	0.13
326	002281	光迅科技	85,490	1,991,062.10	0.13
327	000990	诚志股份	125,160	1,980,031.20	0.13
328	600597	光明乳业	135,880	1,972,977.60	0.13

329	002434	万里扬	133,450	1,967,053.00	0.13
330	600022	山东钢铁	1,098,806	1,966,862.74	0.13
331	601880	辽港股份	1,134,870	1,963,325.10	0.13
332	600707	彩虹股份	287,600	1,961,432.00	0.13
333	000987	越秀金控	223,700	1,946,190.00	0.13
334	603927	中科软	70,860	1,938,729.60	0.13
335	688088	虹软科技	43,772	1,928,594.32	0.13
336	601106	中国一重	550,700	1,916,436.00	0.13
337	600663	陆家嘴	176,200	1,913,532.00	0.13
338	600435	北方导航	178,760	1,909,156.80	0.13
339	002146	荣盛发展	436,600	1,899,210.00	0.13
340	002124	天邦股份	294,500	1,896,580.00	0.13
341	601577	长沙银行	241,300	1,884,553.00	0.13
342	600446	金证股份	131,336	1,880,731.52	0.13
343	600572	康恩贝	375,260	1,876,300.00	0.12
344	603650	彤程新材	36,800	1,851,776.00	0.12
345	600259	广晟有色	37,200	1,831,728.00	0.12
346	688321	微芯生物	52,110	1,824,371.10	0.12
347	601118	海南橡胶	343,100	1,811,568.00	0.12
348	000898	鞍钢股份	482,000	1,807,500.00	0.12
349	600329	中新药业	57,490	1,805,760.90	0.12
350	002390	信邦制药	243,140	1,804,098.80	0.12
351	600811	东方集团	596,966	1,796,867.66	0.12
352	000877	天山股份	117,080	1,792,494.80	0.12
353	603228	景旺电子	51,523	1,779,089.19	0.12
354	002233	塔牌集团	167,520	1,772,361.60	0.12
355	000488	晨鸣纸业	244,710	1,771,700.40	0.12
356	002429	兆驰股份	364,500	1,771,470.00	0.12
357	600808	马钢股份	479,940	1,770,978.60	0.12
358	002440	闰土股份	183,980	1,764,368.20	0.12
359	300166	东方国信	162,110	1,750,788.00	0.12
360	002155	湖南黄金	168,810	1,748,871.60	0.12
361	001914	招商积余	86,300	1,748,438.00	0.12
362	600037	歌华有线	196,694	1,707,303.92	0.11
363	002416	爱施德	149,968	1,706,635.84	0.11
364	002085	万丰奥威	308,300	1,692,567.00	0.11
365	000559	万向钱潮	265,700	1,692,509.00	0.11
366	600908	无锡银行	297,970	1,689,489.90	0.11
367	601200	上海环境	134,107	1,688,407.13	0.11
368	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.11
369	600398	海澜之家	260,785	1,671,631.85	0.11
370	600373	中文传媒	134,900	1,667,364.00	0.11
371	002110	三钢闽光	245,000	1,666,000.00	0.11
372	600906	财达证券	129,400	1,651,144.00	0.11

373	600167	联美控股	182,970	1,648,559.70	0.11
374	600026	中远海能	278,290	1,647,476.80	0.11
375	600546	山煤国际	199,900	1,641,179.00	0.11
376	601000	唐山港	595,299	1,637,072.25	0.11
377	002081	金螳螂	268,500	1,632,480.00	0.11
378	002705	新宝股份	65,900	1,627,730.00	0.11
379	600064	南京高科	173,380	1,619,369.20	0.11
380	601991	大唐发电	497,600	1,612,224.00	0.11
381	000528	柳工	207,894	1,602,862.74	0.11
382	603000	人民网	110,950	1,599,899.00	0.11
383	601611	中国核建	159,800	1,593,206.00	0.11
384	600195	中牧股份	121,873	1,592,880.11	0.11
385	000961	中南建设	384,200	1,590,588.00	0.11
386	002867	周大生	89,000	1,582,420.00	0.11
387	601718	际华集团	529,900	1,579,102.00	0.11
388	002038	双鹭药业	145,330	1,571,017.30	0.10
389	000685	中山公用	177,140	1,567,689.00	0.10
390	000158	常山北明	224,480	1,553,401.60	0.10
391	601608	中信重工	347,700	1,550,742.00	0.10
392	300133	华策影视	228,610	1,547,689.70	0.10
393	002387	维信诺	166,500	1,545,120.00	0.10
394	000090	天健集团	263,133	1,544,590.71	0.10
395	000959	首钢股份	268,700	1,539,651.00	0.10
396	600120	浙江东方	348,018	1,538,239.56	0.10
397	003022	联泓新科	41,900	1,526,836.00	0.10
398	601333	广深铁路	679,900	1,522,976.00	0.10
399	000089	深圳机场	206,471	1,511,367.72	0.10
400	000758	中色股份	276,730	1,510,945.80	0.10
401	000671	阳光城	498,600	1,505,772.00	0.10
402	600126	杭钢股份	288,500	1,480,005.00	0.10
403	600376	首开股份	259,700	1,469,902.00	0.10
404	600582	天地科技	332,230	1,455,167.40	0.10
405	000415	渤海租赁	496,600	1,445,106.00	0.10
406	000718	苏宁环球	305,720	1,439,941.20	0.10
407	002242	九阳股份	61,390	1,424,248.00	0.09
408	601598	中国外运	317,200	1,421,056.00	0.09
409	600062	华润双鹤	105,024	1,404,170.88	0.09
410	601975	招商南油	695,400	1,397,754.00	0.09
411	688289	圣湘生物	23,638	1,394,642.00	0.09
412	601098	中南传媒	145,200	1,389,564.00	0.09
413	000967	盈峰环境	189,400	1,388,302.00	0.09
414	600307	酒钢宏兴	627,670	1,380,874.00	0.09
415	000402	金融街	239,200	1,353,872.00	0.09
416	002458	益生股份	119,100	1,347,021.00	0.09

417	600556	天下秀	109,000	1,346,150.00	0.09
418	601958	金钼股份	195,500	1,339,175.00	0.09
419	001965	招商公路	173,300	1,329,211.00	0.09
420	600643	爱建集团	196,500	1,328,340.00	0.09
421	600959	江苏有线	400,850	1,318,796.50	0.09
422	000563	陕国投 A	397,306	1,283,298.38	0.09
423	002399	海普瑞	74,300	1,270,530.00	0.08
424	600056	中国医药	107,450	1,268,984.50	0.08
425	003035	南网能源	152,700	1,265,883.00	0.08
426	002563	森马服饰	162,400	1,255,352.00	0.08
427	300257	开山股份	78,790	1,251,185.20	0.08
428	601928	凤凰传媒	153,810	1,244,322.90	0.08
429	601860	紫金银行	368,282	1,233,744.70	0.08
430	603317	天味食品	45,836	1,228,863.16	0.08
431	600266	城建发展	271,985	1,223,932.50	0.08
432	600901	江苏租赁	239,000	1,216,510.00	0.08
433	600717	天津港	289,882	1,214,605.58	0.08
434	600968	海油发展	407,100	1,192,803.00	0.08
435	000937	冀中能源	213,200	1,174,732.00	0.08
436	002815	崇达技术	69,660	1,173,771.00	0.08
437	002244	滨江集团	251,020	1,169,753.20	0.08
438	000028	国药一致	31,630	1,169,677.40	0.08
439	600095	湘财股份	114,500	1,158,740.00	0.08
440	300741	华宝股份	24,200	1,157,970.00	0.08
441	600928	西安银行	268,000	1,152,400.00	0.08
442	000717	韶钢松山	241,900	1,149,025.00	0.08
443	002423	中粮资本	140,000	1,134,000.00	0.08
444	002468	申通快递	122,400	1,112,616.00	0.07
445	600776	东方通信	96,600	1,111,866.00	0.07
446	600787	中储股份	176,200	1,099,488.00	0.07
447	600729	重庆百货	42,208	1,098,252.16	0.07
448	600006	东风汽车	160,811	1,095,122.91	0.07
449	002424	贵州百灵	142,700	1,084,520.00	0.07
450	000062	深圳华强	62,702	1,080,355.46	0.07
451	600649	城投控股	254,861	1,047,478.71	0.07
452	600339	中油工程	336,030	1,034,972.40	0.07
453	600623	华谊集团	113,500	1,032,850.00	0.07
454	600835	上海机电	64,337	1,024,245.04	0.07
455	601139	深圳燃气	115,300	1,018,099.00	0.07
456	002375	亚厦股份	133,510	999,989.90	0.07
457	600299	安迪苏	79,700	981,904.00	0.07
458	600648	外高桥	74,190	981,533.70	0.07
459	000031	大悦城	258,920	965,771.60	0.06
460	601969	海南矿业	80,060	961,520.60	0.06

461	300869	康泰医学	23,700	961,035.00	0.06
462	000156	华数传媒	111,600	944,136.00	0.06
463	002653	海思科	43,700	891,480.00	0.06
464	600871	石化油服	407,600	872,264.00	0.06
465	000869	张裕 A	27,200	866,592.00	0.06
466	600639	浦东金桥	67,760	865,295.20	0.06
467	600377	宁沪高速	100,100	862,862.00	0.06
468	603379	三美股份	37,600	856,528.00	0.06
469	601828	美凯龙	95,000	836,950.00	0.06
470	601228	广州港	249,800	831,834.00	0.06
471	603708	家家悦	49,200	818,688.00	0.05
472	002302	西部建设	101,800	817,454.00	0.05
473	601298	青岛港	141,800	806,842.00	0.05
474	601156	东航物流	36,000	787,680.00	0.05
475	000046	泛海控股	418,300	786,404.00	0.05
476	601869	长飞光纤	23,900	782,486.00	0.05
477	001872	招商港口	45,900	778,005.00	0.05
478	002948	青岛银行	165,400	765,802.00	0.05
479	000553	安道麦 A	88,400	746,096.00	0.05
480	002945	华林证券	54,300	741,738.00	0.05
481	600823	世茂股份	225,720	740,361.60	0.05
482	603786	科博达	8,700	698,610.00	0.05
483	001203	大中矿业	45,900	692,172.00	0.05
484	603719	良品铺子	15,800	671,026.00	0.04
485	603355	莱克电气	22,602	662,690.64	0.04
486	603515	欧普照明	31,450	652,902.00	0.04
487	600350	山东高速	124,900	644,484.00	0.04
488	601568	北元集团	78,700	639,831.00	0.04
489	600657	信达地产	171,529	639,803.17	0.04
490	603056	德邦股份	61,600	630,168.00	0.04
491	600466	蓝光发展	305,736	623,701.44	0.04
492	002946	新乳业	35,800	570,652.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	101,600	566,928.00	0.04
494	601003	柳钢股份	103,200	538,704.00	0.04
495	600917	重庆燃气	62,760	526,556.40	0.04
496	600956	新天绿能	29,500	507,695.00	0.03
497	600903	贵州燃气	46,140	446,635.20	0.03
498	002901	大博医疗	8,800	445,456.00	0.03
499	603868	飞科电器	9,467	411,057.14	0.03
500	601187	厦门银行	58,200	401,580.00	0.03
501	603983	丸美股份	10,300	328,261.00	0.02
502	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
503	688248	南网科技	11,763	222,320.70	0.01
504	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.01

505	688091	上海谊众	3,294	141,016.14	0.01
506	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.01
507	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
508	600941	中国移动	1,000	57,580.00	0.00
509	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
510	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
511	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
512	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
513	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
514	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
515	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
516	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
517	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
518	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
519	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
520	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
521	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
522	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
523	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
524	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
525	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
526	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
527	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
528	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
529	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
530	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
531	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
532	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
533	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
534	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
535	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
536	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
537	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
538	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
539	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
540	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
541	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
542	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
543	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
544	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
545	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
546	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
547	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
548	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00

549	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
550	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
551	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
552	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
553	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
554	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
555	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
556	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
557	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
558	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
559	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
560	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
561	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
562	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
563	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
564	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
565	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
566	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
567	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
568	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
569	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
570	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
571	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
572	871245	威博液压	200	1,936.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	14,637,941.37	1.63
2	002340	格林美	10,392,897.38	1.16
3	002709	天赐材料	9,464,478.12	1.05
4	002074	国轩高科	9,004,656.51	1.00
5	600522	中天科技	8,779,423.38	0.98
6	000733	振华科技	8,220,020.00	0.91
7	300274	阳光电源	8,138,352.10	0.91
8	000009	中国宝安	8,063,140.60	0.90
9	600157	永泰能源	8,030,748.00	0.89
10	300037	新宙邦	7,757,516.90	0.86
11	300285	国瓷材料	7,642,719.80	0.85

12	601868	中国能建	7,276,425.75	0.81
13	300253	卫宁健康	7,188,473.50	0.80
14	300751	迈为股份	7,171,007.00	0.80
15	002384	东山精密	7,135,866.83	0.79
16	600399	抚顺特钢	7,083,201.00	0.79
17	605358	立昂微	7,046,705.00	0.78
18	601555	东吴证券	6,757,784.00	0.75
19	688005	容百科技	6,505,279.05	0.72
20	300363	博腾股份	6,328,619.00	0.70

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。

8.4.2 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	002709	天赐材料	20,984,425.53	2.33
3	002074	国轩高科	18,690,769.92	2.08
4	600089	特变电工	16,795,496.93	1.87
5	300207	欣旺达	15,016,839.32	1.67
6	000799	酒鬼酒	14,805,072.00	1.65
7	300316	晶盛机电	13,472,270.22	1.50
8	300012	华测检测	12,294,139.57	1.37
9	600460	士兰微	10,556,315.99	1.17
10	002625	光启技术	9,788,746.40	1.09
11	300496	中科创达	9,760,385.38	1.09
12	300595	欧普康视	9,349,150.56	1.04
13	002648	卫星化学	8,994,589.22	1.00
14	603486	科沃斯	8,479,544.25	0.94
15	600905	三峡能源	7,929,620.03	0.88
16	600426	华鲁恒升	7,683,264.30	0.85
17	601233	桐昆股份	7,232,419.00	0.80
18	002568	百润股份	7,170,691.27	0.80
19	600219	南山铝业	7,029,100.00	0.78
20	601868	中国能建	6,807,034.95	0.76

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。

8.4.3 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	1,111,839,084.92
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	894,917,103.62
--------------	----------------

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。

8.5 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）	115,999.24	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	115,999.24	0.01

8.6 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	113634	珀莱转债	760	75,999.50	0.01
2	110084	贵燃转债	400	39,999.74	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2203	IC2203	24	35,067,840.00	1,949,560.00	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。
IC2206	IC2206	32	45,745,920.00	1,158,360.00	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)					3,107,920.00
股指期货投资本期收益(元)					15,718,902.91
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,530,090.00

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 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。

8.12.3 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	12,209,530.45
2	应收证券清算款	2,888,948.61
3	应收股利	-
4	应收利息	35,927.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,134,406.29

8.12.4 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。

8.12.5 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	600522	中天科技	2,075,904.00	0.14	转融通流通受限
2	000723	美锦能源	1,908,648.00	0.13	转融通流通受限
3	601615	明阳智能	1,881,810.00	0.13	转融通流通受限
4	600884	杉杉股份	1,690,932.00	0.11	转融通流通受限
5	000009	中国宝安	1,294,371.00	0.09	转融通流通受限
6	600885	宏发股份	1,156,920.00	0.08	转融通流通受限
7	002340	格林美	489,555.00	0.03	转融通流通受限

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 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	户均持有	持有人结构
-------	------	-------

(户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		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	
		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
18,755	94,159.70	1,423,091,4 50.00	80.58%	342,873,700 .00	19.42%	1,355,824, 540.00	76.78%

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。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	17,461,822.00	0.99%
2	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	10,530,600.00	0.60%
3	杜晓军	9,305,400.00	0.53%
4	华泰证券股份有限公司	6,734,281.00	0.38%
5	东方证券股份有限公司	6,660,660.00	0.38%
6	王锦效	5,572,770.00	0.32%
7	申万宏源证券有限公司	5,305,400.00	0.30%
8	郑杰甫	2,925,100.00	0.17%
9	中国国际金融股份有限公司	2,820,468.00	0.16%
10	邵楠	2,721,900.00	0.15%
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	1,355,824,540.00	76.78%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 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	783,733,113.00
减：本报告期基金总赎回份额	452,531,130.00
本报告期基金拆分变动份额	1,307,066,652.00
本报告期期末基金份额总额	1,765,965,150.00

注：总申购份额包含场外总申购份额 733,113 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 7,331,130 份；
拆分变动份额包括拆分调整份额，包含场外拆分变动份额 6,598,017 份。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 7 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 80,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	1	1,071,320,013.36	54.62%	107,148.69	54.68%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	2,167,140.31	0.11%	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-

中泰证券	2	397,545,420.50	20.27%	39,753.90	20.29%	-
中信建投	3	490,417,098.66	25.00%	49,041.87	25.03%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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,新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	782,905.82	16.76%	-	-	-	-
中信建投	3,888,099.00	83.24%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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

12	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加中泰证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2021-07-05
13	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务并调整场内份额最小申购、赎回单位及相关业务安排的公告	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	2021-07-07
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中金财富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	2021-07-08
15	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务并调整场内份额最小申购、赎回单位及相关业务安排的第一次提示性公告	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	2021-07-13
16	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务并调整场内份额最小申购、赎回单位及相关业务安排的第二次提示性公告	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	2021-07-15
17	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	2021-07-17
18	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及场内份额恢复交易和申购、赎回业务的公告	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	2021-07-19
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-07-20
20	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	2021-07-24
21	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	2021-07-24
22	易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告	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	2021-07-28
23	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	2021-07-30
24	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分 ETF 场外基金份额赎回转申购易方达货币市场基金有关业务规则的公告	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	2021-08-18
25	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	上海证券报	2021-08-28

26	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方财富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	2021-09-15
27	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-10-27
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2021-11-15
29	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	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	2021-12-17
30	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加开源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	2021-12-27

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 12 月 31 日	98,962,500.00	1,509,479,900.00	252,617,860.00	1,355,824,540.00	76.78 %
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20% 的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如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。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日