

易方达中证 800 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。安永华明会计师事务所（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	16
6.3	其他信息	17
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5	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	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	71

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73
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	73
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	74
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12	投资组合报告附注	74
§ 9	基金份额持有人信息	75
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2	期末上市基金前十名持有人	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
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	76
§ 10	开放式基金份额变动	77
§ 11	重大事件揭示	77
11.1	基金份额持有人大会决议	77
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	77
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4	基金投资策略的改变	77
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8	其他重大事件	79
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
§ 13	备查文件目录	81
13.1	备查文件目录	81
13.2	存放地点	81
13.3	查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 800ETF
场内简称	ZZ800ETF、中证 800ETF
基金主代码	515810
交易代码	515810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 8 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	68,908,843.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<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，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。</p>

业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号 楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永 大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	12,832,973.54	58,075,395.57	-40,523,050.49
本期利润	2,282,759.58	51,910,026.57	-21,967,668.40
加权平均基金份额本期利润	0.0327	0.3919	-0.0360
本期加权平均净值利润率	2.26%	35.26%	-3.78%
本期基金份额净值增长率	1.94%	43.87%	-0.24%
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	31,912,218.52	29,219,194.12	-16,016,979.95
期末可供分配基金份额利润	0.4631	0.4063	-0.0399
期末基金资产净值	100,821,061.52	103,202,921.39	400,942,345.95
期末基金份额净值	1.4631	1.4352	0.9976
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	46.31%	43.52%	-0.24%

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.本基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	2.27%	0.72%	2.01%	0.73%	0.26%	-0.01%
过去六个月	-1.17%	0.92%	-2.44%	0.93%	1.27%	-0.01%
过去一年	1.94%	1.06%	-0.76%	1.07%	2.70%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	46.31%	1.23%	33.84%	1.23%	12.47%	0.00%

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

较

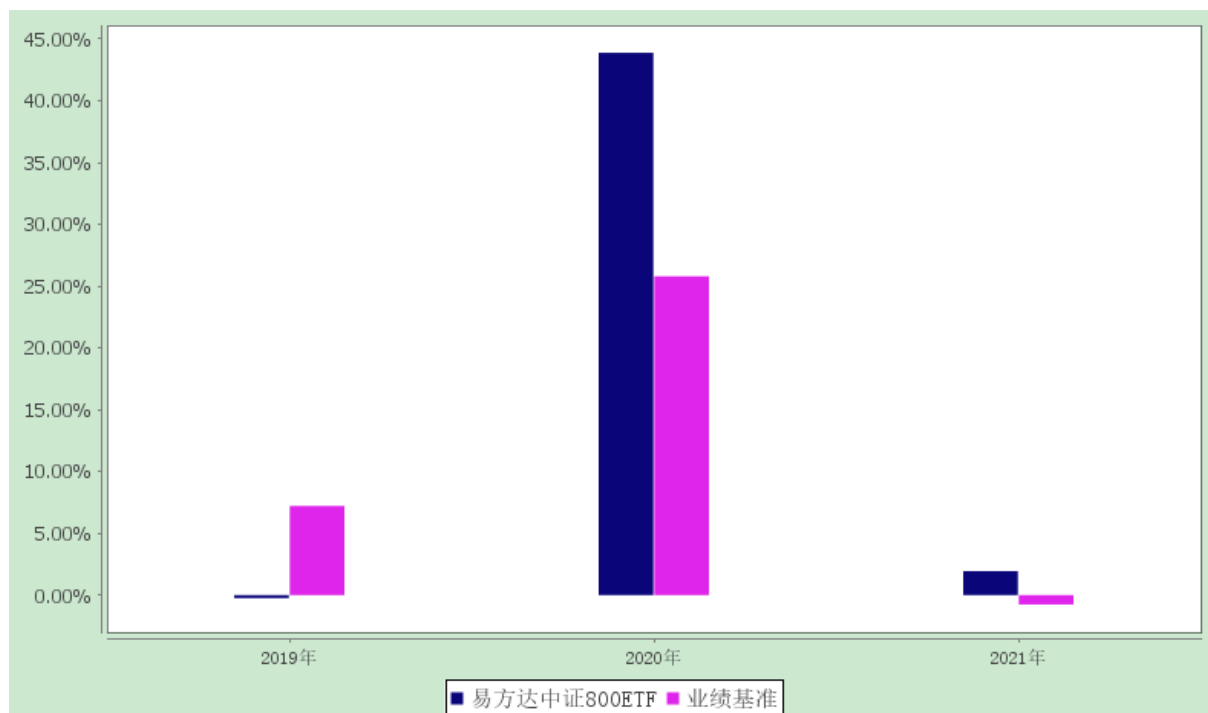
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2019 年 10 月 8 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 46.31%，同期业绩比较基准收益率为 33.84%。

3.2.3 自基金合同生效以来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 800 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为2019年10月8日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2019年10月8日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 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、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员	2019-10-08	-	13 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理
刘树荣	本基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中小企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2018 年 08	2019-10-08	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理

<p>月 11 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理（自 2020 年 04 月 28 日至 2021 年 11 月 26 日）、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2020 年 04 月 29 日至 2021 年 11 月 03 日）、易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>				
---	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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遵规守信情况的说明

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

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。报告期内，本基金主要采取完全复制法的投资策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

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。

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，中证 800 指数下跌 0.8%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.4631 元，本报告期份额净值增长率为 1.94%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%，年化跟踪误差 0.60%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

安永华明(2022)审字第 60468000_G54 号

易方达中证 800 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

我们审计了易方达中证 800 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)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为,后附的易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了易方达中证 800 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。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 800 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。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。

6.3 其他信息

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估易方达中证 800 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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 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：

（1）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。

(2) 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。

(3) 评价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。

(4) 对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 800 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 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

昌华 马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

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 800 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	3,888,186.85	5,578,664.43
结算备付金		1,712,677.72	1,173,990.72
存出保证金		820,614.95	961,608.70

交易性金融资产	7.4.7.2	94,560,913.24	95,689,141.38
其中：股票投资		94,346,914.59	95,633,541.62
基金投资		-	-
债券投资		213,998.65	55,599.76
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		73,609.73	1,864,899.25
应收利息	7.4.7.5	1,136.22	1,037.61
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		101,057,138.71	105,269,342.09
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		20.00	1,425,506.63
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,277.13	13,484.46
应付托管费		4,425.73	4,494.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	16,744.73	10,124.95
应交税费		-	12,924.12

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	201,609.60	599,885.74
负债合计		236,077.19	2,066,420.70
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	68,908,843.00	71,908,843.00
未分配利润	7.4.7.10	31,912,218.52	31,294,078.39
所有者权益合计		100,821,061.52	103,202,921.39
负债和所有者权益总计		101,057,138.71	105,269,342.09

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4631 元，基金份额总额 68,908,843.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		3,103,010.67	53,202,778.31
1.利息收入		39,174.04	71,468.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	39,116.32	71,301.85
债券利息收入		57.72	166.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,583,722.14	58,984,666.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,258,921.39	54,815,605.45
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	54,118.21	273,889.81
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	966,857.87	1,885,611.65
股利收益	7.4.7.15	1,303,824.67	2,009,559.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-10,550,213.96	-6,165,369.00
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	30,328.45	312,012.42
减：二、费用		820,251.09	1,292,751.74
1. 管理人报酬		151,517.36	223,882.81
2. 托管费		50,505.80	74,627.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	156,396.66	505,340.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,876.30	6,788.62
7. 其他费用	7.4.7.19	457,954.97	482,112.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,282,759.58	51,910,026.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,282,759.58	51,910,026.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	71,908,843.00	31,294,078.39	103,202,921.39

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,282,759.58	2,282,759.58
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)	-3,000,000.00	-1,664,619.45	-4,664,619.45
其中: 1.基金申购款	129,000,000.00	57,305,521.13	186,305,521.13
2.基金赎回款	-132,000,000.00	-58,970,140.58	-190,970,140.58
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)	68,908,843.00	31,912,218.52	100,821,061.52
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)	401,908,843.00	-966,497.05	400,942,345.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,910,026.57	51,910,026.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-330,000,000.00	-19,649,451.13	-349,649,451.13
其中: 1.基金申购款	261,000,000.00	24,272,578.58	285,272,578.58
2.基金赎回款	-591,000,000.00	-43,922,029.71	-634,922,029.71

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）	71,908,843.00	31,294,078.39	103,202,921.39

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 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1400 号《关于准予易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 887,908,843.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余

成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，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将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 转融通证券出借业务利息收入，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本

的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

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) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(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) 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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部

分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	3,888,186.85	5,578,664.43
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	3,888,186.85	5,578,664.43
----	--------------	--------------

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		92,693,235.46	94,346,914.59	1,653,679.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	213,998.65	213,998.65	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	213,998.65	213,998.65	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		92,907,234.11	94,560,913.24	1,653,679.13
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		83,432,908.53	95,633,541.62	12,200,633.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	55,599.76	55,599.76	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	55,599.76	55,599.76	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		83,488,508.29	95,689,141.38	12,200,633.09

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	5,682,540.00	-	-	-
IC2203	4,231,920.00	-	-	-
IF2203	1,450,620.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,682,540.00	-	-	-
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	7,001,620.00	-	-	-
IC2103	2,489,200.00	-	-	-
IF2103	4,512,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,001,620.00	-	-	-

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	3	4,383,480.00	151,560.00

IF2203	IF2203	1	1,485,180.00	34,560.00
总额合计				186,120.00
减：可抵销期货暂收款				186,120.00
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）
IC2103	IC2103	2	2,500,560.00	11,360.00
IF2103	IF2103	3	4,690,440.00	178,020.00
总额合计				189,380.00
减：可抵销期货暂收款				189,380.00
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	374.66	541.84
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	743.69	469.77
应收债券利息	4.97	4.10
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-

其他	12.90	21.90
合计	1,136.22	1,037.61

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	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	16,744.73	10,124.95
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	16,744.73	10,124.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	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	164,200.00	180,000.00
可退替代款	2,409.60	258.40
其他应付款	35,000.00	35,000.00
应付替代款	-	384,627.34
合计	201,609.60	599,885.74

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	71,908,843.00	71,908,843.00
本期申购	129,000,000.00	129,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-132,000,000.00	-132,000,000.00

本期末	68,908,843.00	68,908,843.00
-----	---------------	---------------

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	29,219,194.12	2,074,884.27	31,294,078.39
本期利润	12,832,973.54	-10,550,213.96	2,282,759.58
本期基金份额交易产生的变动数	-1,346,660.48	-317,958.97	-1,664,619.45
其中：基金申购款	69,502,120.34	-12,196,599.21	57,305,521.13
基金赎回款	-70,848,780.82	11,878,640.24	-58,970,140.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,705,507.18	-8,793,288.66	31,912,218.52

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	18,640.36	47,909.14
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	20,129.11	21,444.96
其他	346.85	1,947.75
合计	39,116.32	71,301.85

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	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
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,998,675.15	44,603,293.81
股票投资收益——赎回差价收入	4,260,246.24	10,212,311.64

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	11,258,921.39	54,815,605.45

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	105,143,329.15	344,551,481.88
减：卖出股票成本总额	98,144,654.00	299,948,188.07
买卖股票差价收入	6,998,675.15	44,603,293.81

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	190,970,140.58	634,922,029.71
减：现金支付赎回款总额	80,975,993.58	254,761,583.71
减：赎回股票成本总额	105,733,900.76	369,948,134.36
赎回差价收入	4,260,246.24	10,212,311.64

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 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	497,776.52	1,560,528.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	443,597.52	1,286,388.53
减：应收利息总额	60.79	250.42
买卖债券差价收入	54,118.21	273,889.81

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	966,857.87	1,885,611.65

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	1,303,824.67	2,009,559.82
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,303,824.67	2,009,559.82

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	-10,546,953.96	-6,354,749.00
——股票投资	-10,546,953.96	-6,354,749.00
——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	-3,260.00	189,380.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-3,260.00	189,380.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-10,550,213.96	-6,165,369.00

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	-	-
基金申购费收入	-	-

其他	-	-
替代损益收入	30,328.45	312,012.42
合计	30,328.45	312,012.42

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	156,396.66	505,340.46
银行间市场交易费用	-	-
合计	156,396.66	505,340.46

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	24,200.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,754.97	11,568.81
指数使用费	140,000.00	140,543.48
其他	170,000.00	170,000.00
合计	457,954.97	482,112.29

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

注：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

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	23,923,295.90	11.37%	24,323,227.37	4.43%

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	159,350.42	32.01%	121,310.86	7.77%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	10,318.50	35.05%	5,829.40	34.81%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	10,490.76	16.04%	3,959.72	39.11%

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

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

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	151,517.36	223,882.81
其中：支付销售机构的客户维护费	1,315.16	759.93

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2 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	50,505.80	74,627.56

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	29,566,279.00	42.9064%	33,012,358.00	45.9086%
广发证券	3,554,366.00	5.1581%	2,007,506.00	2.7917%

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	3,888,186.85	18,640.36	5,578,664.43	47,909.14

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

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：）	总金额

				股/张)	
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
-	-	-	-	-	-

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

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票建设银行。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券的 A 股的估值总额为人民币 243,441.00 元(2020 年 12 月 31 日: 175,824.00 元)，持有建设银行的 A 股的估值总额为人民币 131,264.00 元(2020 年 12 月 31 日: 154,488.00 元)。

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	-
688257	新锐股份	2021-10-19	2022-04-27	新股流通受限	62.30	61.10	822	51,210.60	50,224.20	-

688553	汇宇 制药	2021-10-14	2022-04-26	新股 流通 受限	38.87	32.11	1,205	46,838.35	38,692.55	-
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	100.0 0	10	999.99	999.99	-
113052	兴业 转债	2021-12-28	2022-01-14	新发 流通 受限	100.00	100.0 0	1,220	121,999.46	121,999.46	老股 东配 债
113052	兴业 转债	2021-12-29	2022-01-14	新发 流通 受限	100.00	100.0 0	890	88,999.22	88,999.22	新债 网下 发行
113634	珀莱 转债	2021-12-09	2022-01-04	新发 流通 受限	100.00	100.0 0	20	1,999.98	1,999.98	-

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	1,400	41,676.33	42,168.00	-

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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。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 0.21%(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	211,003.30	50,003.73
AAA 以下	3,000.32	5,600.13
未评级	0.00	0.00
合计	214,003.62	55,603.86

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	3,888,186.85	-	-	-	3,888,186.85
结算备付金	1,712,677.72	-	-	-	1,712,677.72
存出保证金	820,614.95	-	-	-	820,614.95
交易性金融资产	-	-	213,998.65	94,346,914.59	94,560,913.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收证券清算款	-	-	-	73,609.73	73,609.73
应收利息	-	-	-	1,136.22	1,136.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,421,479.52	-	213,998.65	94,421,660.54	101,057,138.71
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	20.00	20.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	13,277.13	13,277.13
应付托管费	-	-	-	4,425.73	4,425.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	16,744.73	16,744.73
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	201,609.60	201,609.60
负债总计	-	-	-	236,077.19	236,077.19
利率敏感度缺口	6,421,479.52	-	213,998.65	94,185,583.35	100,821,061.52
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	5,578,664.43	-	-	-	5,578,664.43
结算备付金	1,173,990.72	-	-	-	1,173,990.72
存出保证金	961,608.70	-	-	-	961,608.70
交易性金融资产	-	-	55,599.76	95,633,541.62	95,689,141.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收证券清算款	-	-	-	1,864,899.25	1,864,899.25
应收利息	-	-	-	1,037.61	1,037.61
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,714,263.85	-	55,599.76	97,499,478.48	105,269,342.09
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,425,506.63	1,425,506.63
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	13,484.46	13,484.46
应付托管费	-	-	-	4,494.80	4,494.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,124.95	10,124.95
应交税费	-	-	-	12,924.12	12,924.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	599,885.74	599,885.74
负债总计	-	-	-	2,066,420.70	2,066,420.70
利率敏感度缺口	7,714,263.85	-	55,599.76	95,433,057.78	103,202,921.39

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	94,346,914.59	93.58	95,633,541.62	92.67
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	94,346,914.59	93.58	95,633,541.62	92.67

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%	4,794,907.87	4,701,564.03
2.业绩比较基准下降 5%	-4,794,907.87	-4,701,564.03	

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 94,424,324.00 元，属于第二层次的余额为 136,589.24 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 93,403,648.83 元，第二层次 2,285,492.55 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	94,346,914.59	93.36
	其中：股票	94,346,914.59	93.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	213,998.65	0.21
	其中：债券	213,998.65	0.21
	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	5,600,864.57	5.54
8	其他各项资产	895,360.90	0.89
9	合计	101,057,138.71	100.00

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	1,020,199.60	1.01
B	采矿业	2,261,442.10	2.24
C	制造业	56,162,191.09	55.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,484,205.50	2.46
E	建筑业	1,610,461.60	1.60
F	批发和零售业	1,087,899.20	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	2,431,152.18	2.41
H	住宿和餐饮业	117,988.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,138,547.16	4.10

J	金融业	17,015,228.07	16.88
K	房地产业	1,789,039.03	1.77
L	租赁和商务服务业	1,218,543.20	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,322,414.20	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	172,270.30	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,732.00	0.05
Q	卫生和社会工作	765,641.76	0.76
R	文化、体育和娱乐业	476,190.60	0.47
S	综合	224,769.00	0.22
	合计	94,346,914.59	93.58

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	600519	贵州茅台	2,100	4,305,000.00	4.27
2	300750	宁德时代	4,600	2,704,800.00	2.68
3	600036	招商银行	41,215	2,007,582.65	1.99
4	601318	中国平安	36,100	1,819,801.00	1.80
5	000858	五粮液	6,500	1,447,290.00	1.44
6	601012	隆基股份	14,380	1,239,556.00	1.23
7	000333	美的集团	16,400	1,210,484.00	1.20
8	300059	东方财富	27,564	1,022,900.04	1.01
9	601166	兴业银行	48,500	923,440.00	0.92
10	600900	长江电力	36,700	833,090.00	0.83
11	002594	比亚迪	3,100	831,172.00	0.82
12	002415	海康威视	15,600	816,192.00	0.81
13	603259	药明康德	6,840	811,087.20	0.80
14	002475	立讯精密	16,399	806,830.80	0.80
15	600276	恒瑞医药	14,920	756,593.20	0.75
16	600030	中信证券	28,400	750,044.00	0.74
17	600887	伊利股份	17,435	722,855.10	0.72
18	601888	中国中免	3,200	702,112.00	0.70
19	000568	泸州老窖	2,500	634,675.00	0.63
20	300760	迈瑞医疗	1,600	609,280.00	0.60
21	000651	格力电器	15,800	585,074.00	0.58

22	603501	韦尔股份	1,800	559,386.00	0.55
23	600309	万华化学	5,400	545,400.00	0.54
24	601398	工商银行	116,600	539,858.00	0.54
25	000001	平安银行	32,300	532,304.00	0.53
26	600809	山西汾酒	1,680	530,510.40	0.53
27	300274	阳光电源	3,500	510,300.00	0.51
28	002142	宁波银行	13,240	506,827.20	0.50
29	000725	京东方 A	99,900	504,495.00	0.50
30	600436	片仔癀	1,100	480,865.00	0.48
31	002714	牧原股份	8,740	466,366.40	0.46
32	601899	紫金矿业	48,000	465,600.00	0.46
33	002352	顺丰控股	6,600	454,872.00	0.45
34	600031	三一重工	19,900	453,720.00	0.45
35	002812	恩捷股份	1,800	450,720.00	0.45
36	300014	亿纬锂能	3,803	449,438.54	0.45
37	000002	万科 A	22,700	448,552.00	0.44
38	603288	海天味业	4,264	448,189.04	0.44
39	002241	歌尔股份	8,000	432,800.00	0.43
40	300124	汇川技术	6,150	421,890.00	0.42
41	601328	交通银行	91,500	421,815.00	0.42
42	600438	通威股份	9,000	404,640.00	0.40
43	600837	海通证券	32,200	394,772.00	0.39
44	601919	中远海控	21,090	394,172.10	0.39
45	002460	赣锋锂业	2,700	385,695.00	0.38
46	300015	爱尔眼科	9,067	383,352.76	0.38
47	600690	海尔智家	12,600	376,614.00	0.37
48	600048	保利发展	24,000	375,120.00	0.37
49	600406	国电南瑞	9,340	373,880.20	0.37
50	002466	天齐锂业	3,400	363,800.00	0.36
51	000063	中兴通讯	10,600	355,100.00	0.35
52	603799	华友钴业	3,200	352,992.00	0.35
53	601668	中国建筑	69,800	349,000.00	0.35
54	002304	洋河股份	2,100	345,933.00	0.34
55	601288	农业银行	116,300	341,922.00	0.34
56	600111	北方稀土	7,400	338,920.00	0.34
57	002049	紫光国微	1,500	337,500.00	0.33
58	300122	智飞生物	2,700	336,420.00	0.33
59	600000	浦发银行	39,100	333,523.00	0.33
60	688981	中芯国际	6,274	332,459.26	0.33
61	002230	科大讯飞	6,200	325,562.00	0.32
62	600745	闻泰科技	2,505	323,896.50	0.32
63	600585	海螺水泥	8,000	322,400.00	0.32
64	002129	中环股份	7,700	321,475.00	0.32
65	600016	民生银行	82,400	321,360.00	0.32

66	600104	上汽集团	15,503	319,826.89	0.32
67	601816	京沪高铁	65,400	315,882.00	0.31
68	603986	兆易创新	1,796	315,826.60	0.31
69	002371	北方华创	900	312,318.00	0.31
70	601601	中国太保	11,500	311,880.00	0.31
71	002271	东方雨虹	5,900	310,812.00	0.31
72	601688	华泰证券	17,100	303,696.00	0.30
73	000661	长春高新	1,100	298,540.00	0.30
74	300142	沃森生物	5,300	297,860.00	0.30
75	000100	TCL 科技	46,600	287,522.00	0.29
76	600893	航发动力	4,500	285,570.00	0.28
77	000338	潍柴动力	15,900	284,451.00	0.28
78	300498	温氏股份	14,760	284,277.60	0.28
79	002027	分众传媒	33,700	276,003.00	0.27
80	300450	先导智能	3,700	275,169.00	0.27
81	601211	国泰君安	15,000	268,350.00	0.27
82	300782	卓胜微	800	261,440.00	0.26
83	601088	中国神华	11,000	247,720.00	0.25
84	601766	中国中车	40,500	246,645.00	0.24
85	600570	恒生电子	3,922	243,752.30	0.24
86	000776	广发证券	9,900	243,441.00	0.24
87	600050	中国联通	61,800	242,874.00	0.24
88	300347	泰格医药	1,800	230,040.00	0.23
89	600919	江苏银行	39,300	229,119.00	0.23
90	601229	上海银行	32,100	228,873.00	0.23
91	600660	福耀玻璃	4,700	221,558.00	0.22
92	688599	天合光能	2,806	221,393.40	0.22
93	601169	北京银行	49,300	218,892.00	0.22
94	600999	招商证券	12,340	217,801.00	0.22
95	002821	凯莱英	500	217,500.00	0.22
96	002709	天赐材料	1,870	214,395.50	0.21
97	601988	中国银行	70,200	214,110.00	0.21
98	600019	宝钢股份	29,700	212,652.00	0.21
99	600010	包钢股份	75,900	211,761.00	0.21
100	002410	广联达	3,300	211,134.00	0.21
101	688111	金山办公	796	210,940.00	0.21
102	600905	三峡能源	27,800	208,778.00	0.21
103	600958	东方证券	14,000	206,360.00	0.20
104	002311	海大集团	2,800	205,240.00	0.20
105	601669	中国电建	25,400	205,232.00	0.20
106	600196	复星医药	4,100	200,654.00	0.20
107	601633	长城汽车	4,100	199,014.00	0.20
108	600588	用友网络	5,491	197,017.08	0.20
109	601390	中国中铁	33,900	196,281.00	0.19

110	002459	晶澳科技	2,100	194,670.00	0.19
111	601877	正泰电器	3,600	194,004.00	0.19
112	603659	璞泰来	1,200	192,732.00	0.19
113	601985	中国核电	23,200	192,560.00	0.19
114	000625	长安汽车	12,640	192,001.60	0.19
115	000166	申万宏源	37,400	191,488.00	0.19
116	002179	中航光电	1,900	191,064.00	0.19
117	600028	中国石化	44,400	187,812.00	0.19
118	601658	邮储银行	36,200	184,620.00	0.18
119	002493	荣盛石化	10,100	183,416.00	0.18
120	601818	光大银行	55,100	182,932.00	0.18
121	000895	双汇发展	5,700	179,835.00	0.18
122	300408	三环集团	4,000	178,400.00	0.18
123	000538	云南白药	1,700	177,905.00	0.18
124	601377	兴业证券	17,900	176,852.00	0.18
125	603806	福斯特	1,296	169,192.80	0.17
126	601628	中国人寿	5,600	168,504.00	0.17
127	000768	中航西飞	4,600	167,900.00	0.17
128	002001	新和成	5,280	164,313.60	0.16
129	600346	恒力石化	7,100	163,087.00	0.16
130	300896	爱美客	300	160,833.00	0.16
131	601989	中国重工	37,800	159,516.00	0.16
132	600763	通策医疗	800	159,200.00	0.16
133	601857	中国石油	32,400	159,084.00	0.16
134	601225	陕西煤业	13,035	159,027.00	0.16
135	601600	中国铝业	26,100	158,949.00	0.16
136	601138	工业富联	13,200	157,344.00	0.16
137	002008	大族激光	2,900	156,600.00	0.16
138	600426	华鲁恒升	4,940	154,622.00	0.15
139	600009	上海机场	3,300	154,077.00	0.15
140	002202	金风科技	9,300	153,171.00	0.15
141	600741	华域汽车	5,400	152,820.00	0.15
142	002050	三花智控	6,000	151,800.00	0.15
143	300433	蓝思科技	6,600	151,668.00	0.15
144	000733	振华科技	1,200	149,136.00	0.15
145	600150	中国船舶	6,000	148,740.00	0.15
146	601009	南京银行	16,600	148,736.00	0.15
147	601100	恒立液压	1,796	146,912.80	0.15
148	300316	晶盛机电	2,100	145,950.00	0.14
149	600176	中国巨石	8,001	145,618.20	0.14
150	300413	芒果超媒	2,500	143,050.00	0.14
151	600011	华能国际	14,600	141,474.00	0.14
152	001979	招商蛇口	10,600	141,404.00	0.14
153	688036	传音控股	899	141,053.10	0.14

154	002236	大华股份	6,000	140,880.00	0.14
155	300601	康泰生物	1,400	137,956.00	0.14
156	002340	格林美	13,200	136,620.00	0.14
157	600132	重庆啤酒	900	136,188.00	0.14
158	600760	中航沈飞	1,960	133,358.40	0.13
159	603993	洛阳钼业	23,600	131,688.00	0.13
160	601939	建设银行	22,400	131,264.00	0.13
161	600584	长电科技	4,200	130,284.00	0.13
162	600522	中天科技	7,600	128,896.00	0.13
163	601066	中信建投	4,400	128,700.00	0.13
164	600989	宝丰能源	7,400	128,464.00	0.13
165	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.13
166	601006	大秦铁路	19,900	127,360.00	0.13
167	300759	康龙化成	900	127,143.00	0.13
168	600926	杭州银行	9,900	126,918.00	0.13
169	688008	澜起科技	1,502	125,972.74	0.12
170	002602	世纪华通	14,860	124,675.40	0.12
171	003816	中国广核	39,300	123,009.00	0.12
172	601360	三六零	9,600	122,112.00	0.12
173	000596	古井贡酒	500	122,000.00	0.12
174	000786	北新建材	3,400	121,822.00	0.12
174	000977	浪潮信息	3,400	121,822.00	0.12
176	002555	三七互娱	4,500	121,590.00	0.12
177	603486	科沃斯	800	120,760.00	0.12
178	000963	华东医药	3,000	120,600.00	0.12
179	601186	中国铁建	15,400	120,120.00	0.12
180	600600	青岛啤酒	1,200	118,800.00	0.12
181	000157	中联重科	16,500	118,305.00	0.12
182	601615	明阳智能	4,500	117,450.00	0.12
183	000723	美锦能源	7,200	116,856.00	0.12
184	600029	南方航空	17,000	115,770.00	0.11
185	300033	同花顺	800	115,664.00	0.11
186	000876	新希望	7,600	115,596.00	0.11
187	600015	华夏银行	20,600	115,360.00	0.11
188	600157	永泰能源	62,900	114,478.00	0.11
189	601868	中国能建	41,920	114,441.60	0.11
190	002601	龙佰集团	4,000	114,360.00	0.11
191	603369	今世缘	2,100	114,240.00	0.11
192	601555	东吴证券	12,868	114,010.48	0.11
193	600547	山东黄金	6,000	112,920.00	0.11
194	601238	广汽集团	7,400	112,406.00	0.11
195	600885	宏发股份	1,500	111,960.00	0.11
196	600399	抚顺特钢	4,500	111,465.00	0.11
197	603882	金域医学	1,000	111,370.00	0.11

198	002736	国信证券	9,700	111,356.00	0.11
199	600886	国投电力	9,700	111,259.00	0.11
200	600352	浙江龙盛	8,700	109,881.00	0.11
201	000425	徐工机械	18,300	109,617.00	0.11
202	000938	紫光股份	4,780	109,223.00	0.11
203	601336	新华保险	2,800	108,864.00	0.11
204	601901	方正证券	13,800	108,192.00	0.11
205	603019	中科曙光	3,920	108,074.40	0.11
206	002007	华兰生物	3,680	107,235.20	0.11
207	603392	万泰生物	480	106,320.00	0.11
208	002384	东山精密	3,900	105,690.00	0.10
209	600884	杉杉股份	3,220	105,519.40	0.10
210	688005	容百科技	912	105,408.96	0.10
211	601117	中国化学	8,700	104,400.00	0.10
212	688099	晶晨股份	800	104,160.00	0.10
213	688012	中微公司	818	103,558.80	0.10
214	600085	同仁堂	2,300	103,454.00	0.10
215	000009	中国宝安	7,100	102,453.00	0.10
216	601799	星宇股份	500	102,125.00	0.10
217	002938	鹏鼎控股	2,400	101,832.00	0.10
218	300037	新宙邦	900	101,700.00	0.10
219	601800	中国交建	11,800	101,244.00	0.10
220	600383	金地集团	7,600	98,572.00	0.10
221	601865	福莱特	1,700	98,498.00	0.10
222	300363	博腾股份	1,100	98,395.00	0.10
223	002013	中航机电	5,400	98,172.00	0.10
224	300628	亿联网络	1,200	97,740.00	0.10
225	002841	视源股份	1,200	97,680.00	0.10
226	601916	浙商银行	27,900	97,650.00	0.10
227	300595	欧普康视	1,700	97,529.00	0.10
228	000783	长江证券	12,900	97,266.00	0.10
229	000069	华侨城 A	13,800	97,152.00	0.10
230	601788	光大证券	6,500	97,045.00	0.10
231	002385	大北农	9,100	95,459.00	0.09
232	002268	卫士通	1,700	95,098.00	0.09
233	300003	乐普医疗	4,200	95,046.00	0.09
234	600115	中国东航	18,300	94,428.00	0.09
235	600795	国电电力	29,700	94,149.00	0.09
236	300285	国瓷材料	2,200	93,654.00	0.09
237	601108	财通证券	8,400	93,408.00	0.09
238	600563	法拉电子	400	92,960.00	0.09
239	000301	东方盛虹	4,800	92,832.00	0.09
240	002252	上海莱士	13,500	92,070.00	0.09
241	600183	生益科技	3,900	91,845.00	0.09

242	600109	国金证券	8,100	91,773.00	0.09
243	603833	欧派家居	622	91,745.00	0.09
244	601111	中国国航	10,000	91,300.00	0.09
245	601618	中国中冶	23,800	91,154.00	0.09
246	600765	中航重机	1,800	90,882.00	0.09
247	002791	坚朗五金	500	90,795.00	0.09
248	002180	纳思达	1,900	90,744.00	0.09
249	600918	中泰证券	9,100	90,727.00	0.09
250	300529	健帆生物	1,700	90,610.00	0.09
251	600298	安琪酵母	1,500	90,540.00	0.09
252	300088	长信科技	6,800	90,304.00	0.09
253	601155	新城控股	3,098	90,244.74	0.09
254	603517	绝味食品	1,300	88,829.00	0.09
255	300999	金龙鱼	1,400	88,102.00	0.09
256	601838	成都银行	7,300	87,600.00	0.09
257	603160	汇顶科技	800	86,216.00	0.09
258	600862	中航高科	2,400	85,824.00	0.09
259	600256	广汇能源	13,000	85,020.00	0.08
260	300699	光威复材	1,000	84,480.00	0.08
261	603456	九洲药业	1,500	84,390.00	0.08
262	603444	吉比特	200	84,370.00	0.08
263	601966	玲珑轮胎	2,300	84,065.00	0.08
264	603899	晨光文具	1,300	83,863.00	0.08
265	002028	思源电气	1,700	83,657.00	0.08
266	000066	中国长城	5,900	83,544.00	0.08
267	600332	白云山	2,400	82,080.00	0.08
268	600487	亨通光电	5,400	81,648.00	0.08
269	688561	奇安信	926	81,413.92	0.08
270	002916	深南电路	660	80,401.20	0.08
271	300223	北京君正	600	80,400.00	0.08
272	600038	中直股份	1,000	80,300.00	0.08
273	002624	完美世界	3,950	80,224.50	0.08
274	002185	华天科技	6,300	80,073.00	0.08
275	600489	中金黄金	9,700	79,831.00	0.08
276	002120	韵达股份	3,900	79,794.00	0.08
277	600141	兴发集团	2,100	79,548.00	0.08
278	000703	恒逸石化	7,490	79,543.80	0.08
279	603260	合盛硅业	600	79,182.00	0.08
280	300676	华大基因	900	79,020.00	0.08
281	300253	卫宁健康	4,700	78,772.00	0.08
282	600486	扬农化工	600	78,720.00	0.08
283	601636	旗滨集团	4,600	78,660.00	0.08
284	600392	盛和资源	4,000	78,480.00	0.08
285	002414	高德红外	3,236	78,343.56	0.08

286	600362	江西铜业	3,500	78,155.00	0.08
287	688065	凯赛生物	424	78,134.72	0.08
288	300677	英科医疗	1,350	78,084.00	0.08
289	000988	华工科技	2,800	78,008.00	0.08
290	002568	百润股份	1,300	77,779.00	0.08
291	601607	上海医药	3,900	77,493.00	0.08
292	300144	宋城演艺	5,380	77,041.60	0.08
293	603290	斯达半导	200	76,200.00	0.08
294	300058	蓝色光标	7,100	76,183.00	0.08
295	600754	锦江酒店	1,300	76,180.00	0.08
296	300474	景嘉微	500	76,100.00	0.08
297	600143	金发科技	6,000	75,480.00	0.07
298	603613	国联股份	700	75,250.00	0.07
299	600418	江淮汽车	4,300	74,820.00	0.07
300	600079	人福医药	3,300	74,316.00	0.07
301	601021	春秋航空	1,300	73,840.00	0.07
302	601990	南京证券	7,400	73,334.00	0.07
303	002409	雅克科技	900	73,053.00	0.07
304	600872	中炬高新	1,900	72,143.00	0.07
305	601168	西部矿业	5,300	72,133.00	0.07
306	300558	贝达药业	900	71,847.00	0.07
307	603267	鸿远电子	400	71,776.00	0.07
308	002044	美年健康	9,100	71,435.00	0.07
309	300136	信维通信	2,800	70,896.00	0.07
310	603589	口子窖	1,000	70,870.00	0.07
311	600061	国投资本	8,604	70,724.88	0.07
312	000630	铜陵有色	20,300	70,644.00	0.07
313	600845	宝信软件	1,160	70,562.80	0.07
314	002600	领益智造	9,500	69,920.00	0.07
315	601878	浙商证券	5,300	69,854.00	0.07
316	000708	中信特钢	3,400	69,632.00	0.07
317	300763	锦浪科技	300	69,465.00	0.07
318	601689	拓普集团	1,300	68,900.00	0.07
319	002138	顺络电子	1,800	68,724.00	0.07
320	300724	捷佳伟创	600	68,580.00	0.07
321	603893	瑞芯微	500	68,450.00	0.07
322	688396	华润微	1,054	68,088.40	0.07
323	300308	中际旭创	1,600	68,000.00	0.07
324	601077	渝农商行	17,600	67,760.00	0.07
325	600516	方大炭素	6,260	67,733.20	0.07
326	000998	隆平高科	2,900	67,454.00	0.07
327	603338	浙江鼎力	840	67,418.40	0.07
328	002797	第一创业	9,200	67,344.00	0.07
329	000728	国元证券	8,740	67,298.00	0.07

330	600161	天坛生物	2,320	67,187.20	0.07
331	688002	睿创微纳	850	66,784.50	0.07
332	600875	东方电气	3,100	66,402.00	0.07
333	603939	益丰药房	1,200	66,132.00	0.07
334	601728	中国电信	15,100	65,383.00	0.06
335	600233	圆通速递	3,900	65,052.00	0.06
336	688521	芯原股份	840	64,982.40	0.06
337	300418	昆仑万维	2,800	64,820.00	0.06
338	300146	汤臣倍健	2,400	64,704.00	0.06
339	002080	中材科技	1,900	64,638.00	0.06
340	688126	沪硅产业	2,488	64,240.16	0.06
341	600018	上港集团	11,700	64,116.00	0.06
342	002353	杰瑞股份	1,600	64,000.00	0.06
343	688208	道通科技	798	63,361.20	0.06
344	002212	天融信	3,300	63,261.00	0.06
345	603605	珀莱雅	300	62,493.00	0.06
346	601696	中银证券	4,600	61,870.00	0.06
347	600699	均胜电子	2,800	61,516.00	0.06
348	300866	安克创新	600	61,500.00	0.06
349	600529	山东药玻	1,400	61,460.00	0.06
350	002557	洽洽食品	1,000	61,360.00	0.06
351	002673	西部证券	7,600	61,332.00	0.06
352	600482	中国动力	3,100	61,070.00	0.06
353	002223	鱼跃医疗	1,600	60,480.00	0.06
354	600705	中航产融	15,200	60,344.00	0.06
355	000932	华菱钢铁	11,800	60,298.00	0.06
356	000547	航天发展	3,600	60,120.00	0.06
356	600733	北汽蓝谷	6,000	60,120.00	0.06
358	000039	中集集团	3,500	60,060.00	0.06
359	002439	启明星辰	2,100	59,913.00	0.06
360	603077	和邦生物	17,500	59,675.00	0.06
361	000739	普洛药业	1,700	59,653.00	0.06
362	601216	君正集团	11,300	59,099.00	0.06
363	600188	兖矿能源	2,500	58,825.00	0.06
364	601162	天风证券	14,410	58,360.50	0.06
365	002444	巨星科技	1,900	57,969.00	0.06
366	603127	昭衍新药	500	57,715.00	0.06
367	600739	辽宁成大	2,950	57,584.00	0.06
368	300296	利亚德	5,600	57,400.00	0.06
369	300357	我武生物	1,000	57,300.00	0.06
370	002507	涪陵榨菜	1,500	56,700.00	0.06
371	600988	赤峰黄金	3,800	56,620.00	0.06
372	600521	华海药业	2,600	56,316.00	0.06
373	000807	云铝股份	5,000	55,850.00	0.06

374	002465	海格通信	5,100	55,692.00	0.06
375	002030	达安基因	2,776	55,686.56	0.06
376	600606	绿地控股	12,780	55,465.20	0.06
377	000960	锡业股份	2,800	54,684.00	0.05
378	600655	豫园股份	5,300	54,590.00	0.05
379	000738	航发控制	1,800	54,504.00	0.05
380	600549	厦门钨业	2,400	54,312.00	0.05
381	601016	节能风电	8,300	54,033.00	0.05
382	601995	中金公司	1,100	53,933.00	0.05
383	002273	水晶光电	3,100	53,909.00	0.05
384	600637	东方明珠	5,700	53,865.00	0.05
385	600732	爱旭股份	2,300	53,728.00	0.05
386	600177	雅戈尔	7,768	53,521.52	0.05
387	601198	东兴证券	4,600	53,498.00	0.05
388	002985	北摩高科	440	53,002.40	0.05
389	002078	太阳纸业	4,600	52,854.00	0.05
390	002156	通富微电	2,700	52,461.00	0.05
391	002157	正邦科技	5,400	52,164.00	0.05
392	300383	光环新网	3,500	51,940.00	0.05
393	002024	苏宁易购	12,400	51,088.00	0.05
394	600704	物产中大	8,600	50,912.00	0.05
395	002299	圣农发展	2,100	50,757.00	0.05
396	600201	生物股份	3,100	50,685.00	0.05
397	002508	老板电器	1,400	50,428.00	0.05
398	600497	驰宏锌锗	10,100	50,399.00	0.05
399	600879	航天电子	6,100	50,264.00	0.05
400	688257	新锐股份	822	50,224.20	0.05
401	603195	公牛集团	300	50,190.00	0.05
402	600642	申能股份	6,800	50,116.00	0.05
403	600536	中国软件	1,000	49,930.00	0.05
404	000623	吉林敖东	2,700	49,869.00	0.05
405	601128	常熟银行	7,500	49,575.00	0.05
406	002739	万达电影	3,200	49,536.00	0.05
407	600580	卧龙电驱	2,700	49,383.00	0.05
408	600372	中航电子	2,200	49,258.00	0.05
409	601933	永辉超市	12,100	49,005.00	0.05
410	000830	鲁西化工	3,200	48,832.00	0.05
411	002607	中公教育	6,200	48,732.00	0.05
412	603198	迎驾贡酒	700	48,615.00	0.05
413	600848	上海临港	3,267	48,580.29	0.05
414	603658	安图生物	880	48,452.80	0.05
415	600039	四川路桥	4,000	48,160.00	0.05
416	600027	华电国际	9,000	48,150.00	0.05
417	600369	西南证券	9,100	48,139.00	0.05

418	601881	中国银河	4,300	48,117.00	0.05
419	300618	寒锐钴业	600	48,108.00	0.05
420	002064	华峰化学	4,600	48,024.00	0.05
421	002373	千方科技	3,200	47,840.00	0.05
422	600160	巨化股份	3,700	47,767.00	0.05
423	002092	中泰化学	5,000	47,700.00	0.05
424	002249	大洋电机	5,400	47,466.00	0.05
425	300115	长盈精密	2,380	47,219.20	0.05
426	601998	中信银行	10,200	47,124.00	0.05
427	000983	山西焦煤	5,690	47,056.30	0.05
428	600316	洪都航空	1,200	46,872.00	0.05
429	300017	网宿科技	7,000	46,830.00	0.05
430	002603	以岭药业	2,380	46,648.00	0.05
431	603233	大参林	1,100	46,321.00	0.05
432	002936	郑州银行	14,644	46,275.04	0.05
433	601997	贵阳银行	7,100	46,221.00	0.05
434	600118	中国卫星	1,700	46,155.00	0.05
435	603218	日月股份	1,400	46,130.00	0.05
436	000629	攀钢钒钛	11,800	45,902.00	0.05
437	600803	新奥股份	2,500	45,900.00	0.05
437	600859	王府井	1,700	45,900.00	0.05
439	000887	中鼎股份	2,100	45,801.00	0.05
440	002131	利欧股份	18,600	45,756.00	0.05
441	000825	太钢不锈	6,400	45,056.00	0.04
442	300001	特锐德	1,800	44,766.00	0.04
443	601319	中国人保	9,500	44,650.00	0.04
444	300070	碧水源	6,200	44,578.00	0.04
445	000400	许继电气	1,700	44,370.00	0.04
446	002926	华西证券	4,500	44,325.00	0.04
447	000050	深天马 A	3,400	44,268.00	0.04
448	000027	深圳能源	5,460	44,226.00	0.04
449	688006	杭可科技	411	44,215.38	0.04
450	002506	协鑫集成	11,600	44,080.00	0.04
451	600170	上海建工	12,200	43,920.00	0.04
452	002191	劲嘉股份	2,900	43,877.00	0.04
453	002372	伟星新材	1,800	43,776.00	0.04
454	600166	福田汽车	12,700	43,688.00	0.04
455	000513	丽珠集团	1,083	43,547.43	0.04
456	002422	科伦药业	2,300	43,539.00	0.04
457	600153	建发股份	4,800	43,536.00	0.04
458	000997	新大陆	2,400	43,488.00	0.04
459	002266	浙富控股	6,100	43,432.00	0.04
460	002056	横店东磁	2,300	43,401.00	0.04
461	603712	七一二	1,000	43,300.00	0.04

462	000750	国海证券	10,480	43,072.80	0.04
463	600236	桂冠电力	6,700	43,014.00	0.04
464	300168	万达信息	3,300	42,966.00	0.04
465	000021	深科技	2,700	42,768.00	0.04
466	600867	通化东宝	3,900	42,744.00	0.04
467	688009	中国通号	8,581	42,733.38	0.04
468	688029	南微医学	200	42,534.00	0.04
469	600909	华安证券	7,840	42,414.40	0.04
470	300251	光线传媒	3,300	42,405.00	0.04
471	002203	海亮股份	3,400	42,262.00	0.04
472	603087	甘李药业	600	42,204.00	0.04
473	002683	宏大爆破	1,400	42,168.00	0.04
474	300009	安科生物	3,216	42,097.44	0.04
475	603707	健友股份	1,000	42,000.00	0.04
476	600066	宇通客车	3,800	41,876.00	0.04
477	002002	鸿达兴业	6,900	41,814.00	0.04
478	600258	首旅酒店	1,600	41,808.00	0.04
479	600271	航天信息	3,100	41,509.00	0.04
480	600008	首创环保	12,150	41,431.50	0.04
481	002065	东华软件	5,300	41,340.00	0.04
482	600171	上海贝岭	1,600	41,056.00	0.04
483	000656	金科股份	9,100	40,768.00	0.04
484	002408	齐翔腾达	3,880	40,740.00	0.04
485	603568	伟明环保	1,110	40,548.30	0.04
486	002152	广电运通	3,400	40,460.00	0.04
487	600315	上海家化	1,000	40,410.00	0.04
488	002221	东华能源	3,200	40,288.00	0.04
489	300244	迪安诊断	1,200	40,284.00	0.04
490	002500	山西证券	6,090	40,194.00	0.04
491	000975	银泰黄金	4,560	40,036.80	0.04
492	002572	索菲亚	1,800	39,960.00	0.04
493	300630	普利制药	726	39,959.04	0.04
494	603156	养元饮品	1,400	39,774.00	0.04
495	600998	九州通	2,700	39,744.00	0.04
496	600535	天士力	2,500	39,625.00	0.04
497	600025	华能水电	6,000	39,540.00	0.04
498	002745	木林森	2,600	39,338.00	0.04
499	300026	红日药业	5,000	39,150.00	0.04
500	600348	华阳股份	3,300	39,105.00	0.04
501	300024	机器人	3,500	39,095.00	0.04
502	300212	易华录	1,100	38,885.00	0.04
503	688553	汇宇制药	1,205	38,692.55	0.04
504	601005	重庆钢铁	18,500	38,665.00	0.04
505	000537	广宇发展	1,600	38,560.00	0.04

506	000970	中科三环	2,400	38,520.00	0.04
507	002511	中顺洁柔	2,300	38,433.00	0.04
508	601236	红塔证券	3,220	38,382.40	0.04
509	300482	万孚生物	970	38,198.60	0.04
510	601872	招商轮船	9,280	38,048.00	0.04
511	300463	迈克生物	1,300	37,947.00	0.04
512	601898	中煤能源	6,000	37,740.00	0.04
513	002250	联化科技	2,100	37,737.00	0.04
514	000012	南玻 A	3,800	37,734.00	0.04
515	000999	华润三九	1,100	37,664.00	0.04
516	000878	云南铜业	2,800	37,436.00	0.04
517	300315	掌趣科技	7,700	37,422.00	0.04
518	002153	石基信息	1,300	37,362.00	0.04
519	002032	苏泊尔	600	37,344.00	0.04
520	601699	潞安环能	3,300	37,323.00	0.04
521	600673	东阳光	4,200	37,296.00	0.04
522	002127	南极电商	5,400	37,260.00	0.04
523	002831	裕同科技	1,100	37,059.00	0.04
524	002019	亿帆医药	2,100	37,002.00	0.04
525	600415	小商品城	7,600	36,860.00	0.04
526	002195	二三四五	15,700	36,738.00	0.04
527	000690	宝新能源	6,200	36,704.00	0.04
528	600801	华新水泥	1,900	36,670.00	0.04
529	600764	中国海防	900	36,594.00	0.04
530	605499	东鹏饮料	200	36,368.00	0.04
531	688363	华熙生物	233	36,184.90	0.04
532	300182	捷成股份	5,700	36,081.00	0.04
533	002430	杭氧股份	1,200	36,012.00	0.04
534	600517	国网英大	4,900	35,721.00	0.04
535	002294	信立泰	1,300	35,516.00	0.04
536	600863	内蒙华电	9,000	35,460.00	0.04
537	600970	中材国际	3,100	35,433.00	0.04
538	601231	环旭电子	2,200	35,332.00	0.04
539	600208	新湖中宝	11,800	35,164.00	0.03
540	601778	晶科科技	4,100	34,973.00	0.03
541	002939	长城证券	2,700	34,965.00	0.03
542	000060	中金岭南	7,100	34,861.00	0.03
543	000401	冀东水泥	2,900	34,684.00	0.03
544	600511	国药股份	1,100	34,683.00	0.03
545	601866	中远海发	10,600	34,450.00	0.03
546	000686	东北证券	3,900	34,242.00	0.03
547	600498	烽火通信	1,900	34,162.00	0.03
548	600155	华创阳安	3,400	33,864.00	0.03
549	600839	四川长虹	10,200	33,762.00	0.03

550	603858	步长制药	1,600	33,744.00	0.03
551	000930	中粮科技	3,100	33,697.00	0.03
552	002505	鹏都农牧	8,800	33,616.00	0.03
553	600390	五矿资本	6,300	33,516.00	0.03
554	600380	健康元	2,600	33,384.00	0.03
555	600158	中体产业	2,200	33,264.00	0.03
556	300376	易事特	3,300	33,165.00	0.03
557	600895	张江高科	2,200	33,132.00	0.03
558	600667	太极实业	4,100	33,128.00	0.03
559	000729	燕京啤酒	3,900	33,033.00	0.03
560	601992	金隅集团	11,600	32,944.00	0.03
561	000800	一汽解放	3,200	32,928.00	0.03
562	002701	奥瑞金	4,700	32,900.00	0.03
563	002128	电投能源	2,200	32,670.00	0.03
564	002532	天山铝业	4,000	32,600.00	0.03
565	002004	华邦健康	4,500	32,580.00	0.03
565	002382	蓝帆医疗	2,000	32,580.00	0.03
567	600718	东软集团	2,400	32,544.00	0.03
568	600500	中化国际	3,800	32,528.00	0.03
569	002368	太极股份	1,180	32,497.20	0.03
570	600728	佳都科技	3,900	32,487.00	0.03
571	600216	浙江医药	1,900	32,452.00	0.03
572	002174	游族网络	2,100	32,004.00	0.03
573	603638	艾迪精密	1,000	31,920.00	0.03
574	601179	中国西电	5,700	31,635.00	0.03
575	603883	老百姓	640	31,603.20	0.03
576	000598	兴蓉环境	5,000	31,600.00	0.03
577	600282	南钢股份	8,500	31,450.00	0.03
578	002925	盈趣科技	920	31,307.60	0.03
579	600985	淮北矿业	2,800	31,304.00	0.03
580	603866	桃李面包	1,100	31,240.00	0.03
581	603225	新凤鸣	2,100	31,185.00	0.03
582	002966	苏州银行	4,600	31,142.00	0.03
583	002670	国盛金控	3,200	30,720.00	0.03
584	002396	星网锐捷	1,300	30,641.00	0.03
585	000540	中天金融	11,600	30,624.00	0.03
586	600131	国网信通	1,400	30,590.00	0.03
587	002595	豪迈科技	1,100	30,536.00	0.03
588	600528	中铁工业	3,700	30,377.00	0.03
589	002048	宁波华翔	1,400	30,282.00	0.03
590	603885	吉祥航空	1,700	30,175.00	0.03
591	000581	威孚高科	1,400	30,156.00	0.03
592	601717	郑煤机	2,600	30,134.00	0.03
593	601808	中海油服	2,000	30,000.00	0.03

594	002690	美亚光电	800	29,968.00	0.03
595	600297	广汇汽车	11,200	29,904.00	0.03
596	002958	青农商行	7,700	29,722.00	0.03
597	600060	海信视像	2,200	29,590.00	0.03
598	002010	传化智联	3,400	29,580.00	0.03
598	600409	三友化工	3,400	29,580.00	0.03
600	600755	厦门国贸	4,100	29,561.00	0.03
601	601456	国联证券	2,100	29,337.00	0.03
602	600827	百联股份	2,200	29,326.00	0.03
603	600567	山鹰国际	8,900	29,281.00	0.03
604	300271	华宇软件	2,300	29,210.00	0.03
605	002183	怡亚通	4,400	29,128.00	0.03
606	600598	北大荒	2,000	29,120.00	0.03
607	600782	新钢股份	5,500	29,040.00	0.03
608	600507	方大特钢	3,691	28,789.80	0.03
609	000709	河钢股份	11,700	28,782.00	0.03
610	600967	内蒙一机	2,400	28,680.00	0.03
611	000778	新兴铸管	6,600	28,578.00	0.03
612	002075	沙钢股份	4,900	28,567.00	0.03
613	000990	诚志股份	1,800	28,476.00	0.03
614	600566	济川药业	1,000	28,340.00	0.03
615	000883	湖北能源	5,400	28,296.00	0.03
616	600325	华发股份	4,700	28,294.00	0.03
617	600329	中新药业	900	28,269.00	0.03
618	600021	上海电力	2,200	28,204.00	0.03
619	600737	中粮糖业	3,000	28,200.00	0.03
620	002434	万里扬	1,900	28,006.00	0.03
621	600820	隧道股份	5,200	27,976.00	0.03
622	002281	光迅科技	1,200	27,948.00	0.03
623	000987	越秀金控	3,200	27,840.00	0.03
624	600597	光明乳业	1,900	27,588.00	0.03
625	603927	中科软	1,000	27,360.00	0.03
626	600707	彩虹股份	4,000	27,280.00	0.03
627	600446	金证股份	1,900	27,208.00	0.03
628	600663	陆家嘴	2,500	27,150.00	0.03
629	600022	山东钢铁	15,100	27,029.00	0.03
630	601880	辽港股份	15,500	26,815.00	0.03
631	600435	北方导航	2,500	26,700.00	0.03
632	601577	长沙银行	3,400	26,554.00	0.03
633	002146	荣盛发展	6,100	26,535.00	0.03
634	601106	中国一重	7,600	26,448.00	0.03
635	603228	景旺电子	760	26,242.80	0.03
636	002124	天邦股份	4,040	26,017.60	0.03
637	600572	康恩贝	5,200	26,000.00	0.03

638	002233	塔牌集团	2,400	25,392.00	0.03
639	002390	信邦制药	3,400	25,228.00	0.03
640	603650	彤程新材	500	25,160.00	0.02
641	002416	爱施德	2,200	25,036.00	0.02
642	002440	闰土股份	2,600	24,934.00	0.02
643	002155	湖南黄金	2,400	24,864.00	0.02
644	300166	东方国信	2,300	24,840.00	0.02
645	601118	海南橡胶	4,700	24,816.00	0.02
646	000898	鞍钢股份	6,600	24,750.00	0.02
647	300888	稳健医疗	300	24,735.00	0.02
648	002705	新宝股份	1,000	24,700.00	0.02
649	600811	东方集团	8,200	24,682.00	0.02
650	600259	广晟有色	500	24,620.00	0.02
651	000488	晨鸣纸业	3,400	24,616.00	0.02
652	688088	虹软科技	556	24,497.36	0.02
653	000877	天山股份	1,600	24,496.00	0.02
654	600808	马钢股份	6,600	24,354.00	0.02
655	001914	招商积余	1,200	24,312.00	0.02
656	600037	歌华有线	2,800	24,304.00	0.02
657	002429	兆驰股份	5,000	24,300.00	0.02
658	600906	财达证券	1,900	24,244.00	0.02
659	688289	圣湘生物	407	24,013.00	0.02
660	601200	上海环境	1,900	23,921.00	0.02
661	688321	微芯生物	675	23,631.75	0.02
662	002085	万丰奥威	4,300	23,607.00	0.02
663	000559	万向钱潮	3,700	23,569.00	0.02
664	600373	中文传媒	1,900	23,484.00	0.02
665	600167	联美控股	2,600	23,426.00	0.02
666	600908	无锡银行	4,100	23,247.00	0.02
667	002242	九阳股份	1,000	23,200.00	0.02
668	002110	三钢闽光	3,400	23,120.00	0.02
669	600398	海澜之家	3,600	23,076.00	0.02
670	603000	人民网	1,600	23,072.00	0.02
671	600546	山煤国际	2,800	22,988.00	0.02
672	002038	双鹭药业	2,100	22,701.00	0.02
673	600195	中牧股份	1,736	22,689.52	0.02
674	601000	唐山港	8,200	22,550.00	0.02
675	002081	金螳螂	3,700	22,496.00	0.02
675	600026	中远海能	3,800	22,496.00	0.02
677	600064	南京高科	2,400	22,416.00	0.02
678	000528	柳工	2,900	22,359.00	0.02
679	000158	常山北明	3,200	22,144.00	0.02
680	000685	中山公用	2,500	22,125.00	0.02
681	601991	大唐发电	6,800	22,032.00	0.02

682	002387	维信诺	2,365	21,947.20	0.02
683	000961	中南建设	5,300	21,942.00	0.02
684	601611	中国核建	2,200	21,934.00	0.02
685	003022	联泓新科	600	21,864.00	0.02
686	601718	际华集团	7,300	21,754.00	0.02
687	300133	华策影视	3,200	21,664.00	0.02
688	601698	中国卫通	1,500	21,585.00	0.02
689	601608	中信重工	4,800	21,408.00	0.02
690	002867	周大生	1,200	21,336.00	0.02
691	600120	浙江东方	4,804	21,233.68	0.02
692	000089	深圳机场	2,900	21,228.00	0.02
693	000959	首钢股份	3,700	21,201.00	0.02
694	000090	天健集团	3,600	21,132.00	0.02
695	601333	广深铁路	9,400	21,056.00	0.02
696	000758	中色股份	3,800	20,748.00	0.02
697	600376	首开股份	3,600	20,376.00	0.02
698	601598	中国外运	4,500	20,160.00	0.02
699	600582	天地科技	4,600	20,148.00	0.02
700	600062	华润双鹤	1,500	20,055.00	0.02
701	000967	盈峰环境	2,700	19,791.00	0.02
702	000415	渤海租赁	6,800	19,788.00	0.02
703	000718	苏宁环球	4,200	19,782.00	0.02
704	601975	招商南油	9,600	19,296.00	0.02
705	002458	益生股份	1,700	19,227.00	0.02
706	601958	金铝股份	2,800	19,180.00	0.02
707	001965	招商公路	2,500	19,175.00	0.02
708	300741	华宝股份	400	19,140.00	0.02
708	601098	中南传媒	2,000	19,140.00	0.02
710	600643	爱建集团	2,800	18,928.00	0.02
711	600307	酒钢宏兴	8,600	18,920.00	0.02
712	002399	海普瑞	1,100	18,810.00	0.02
713	000402	金融街	3,300	18,678.00	0.02
714	603317	天味食品	696	18,659.76	0.02
715	000028	国药一致	500	18,490.00	0.02
716	600126	杭钢股份	3,600	18,468.00	0.02
717	600959	江苏有线	5,500	18,095.00	0.02
718	002563	森马服饰	2,300	17,779.00	0.02
719	000563	陕国投 A	5,500	17,765.00	0.02
720	600056	中国医药	1,500	17,715.00	0.02
721	300257	开山股份	1,100	17,468.00	0.02
722	003035	南网能源	2,100	17,409.00	0.02
723	000062	深圳华强	1,000	17,230.00	0.02
724	600095	湘财股份	1,700	17,204.00	0.02
725	600266	城建发展	3,800	17,100.00	0.02

726	601860	紫金银行	5,100	17,085.00	0.02
727	601928	凤凰传媒	2,100	16,989.00	0.02
728	600717	天津港	4,032	16,894.08	0.02
729	002815	崇达技术	1,000	16,850.00	0.02
730	600901	江苏租赁	3,300	16,797.00	0.02
731	000937	冀中能源	3,000	16,530.00	0.02
732	600968	海油发展	5,600	16,408.00	0.02
733	002244	滨江集团	3,500	16,310.00	0.02
734	300869	康泰医学	400	16,220.00	0.02
735	002423	中粮资本	2,000	16,200.00	0.02
736	000717	韶钢松山	3,400	16,150.00	0.02
737	600776	东方通信	1,400	16,114.00	0.02
738	603786	科博达	200	16,060.00	0.02
739	600928	西安银行	3,700	15,910.00	0.02
740	600729	重庆百货	600	15,612.00	0.02
741	600787	中储股份	2,500	15,600.00	0.02
742	002468	申通快递	1,700	15,453.00	0.02
743	002424	贵州百灵	2,000	15,200.00	0.02
744	600006	东风汽车	2,200	14,982.00	0.01
745	600299	安迪苏	1,200	14,784.00	0.01
746	600623	华谊集团	1,600	14,560.00	0.01
747	600648	外高桥	1,100	14,553.00	0.01
748	601969	海南矿业	1,200	14,412.00	0.01
749	600649	城投控股	3,500	14,385.00	0.01
750	600835	上海机电	900	14,328.00	0.01
751	002653	海思科	700	14,280.00	0.01
752	002375	亚厦股份	1,900	14,231.00	0.01
753	600339	中油工程	4,600	14,168.00	0.01
754	601139	深圳燃气	1,600	14,128.00	0.01
755	603379	三美股份	600	13,668.00	0.01
756	000156	华数传媒	1,600	13,536.00	0.01
757	000031	大悦城	3,600	13,428.00	0.01
758	601869	长飞光纤	400	13,096.00	0.01
759	600639	浦东金桥	1,000	12,770.00	0.01
760	000869	张裕 A	400	12,744.00	0.01
761	603719	良品铺子	300	12,741.00	0.01
762	600871	石化油服	5,700	12,198.00	0.01
763	600377	宁沪高速	1,400	12,068.00	0.01
764	001872	招商港口	700	11,865.00	0.01
765	603708	家家悦	700	11,648.00	0.01
766	601828	美凯龙	1,320	11,629.20	0.01
767	601298	青岛港	2,000	11,380.00	0.01
768	601228	广州港	3,400	11,322.00	0.01
769	002302	西部建设	1,400	11,242.00	0.01

770	000046	泛海控股	5,900	11,092.00	0.01
771	601156	东航物流	500	10,940.00	0.01
772	002945	华林证券	800	10,928.00	0.01
773	002948	青岛银行	2,300	10,649.00	0.01
774	001203	大中矿业	700	10,556.00	0.01
775	603355	莱克电气	360	10,555.20	0.01
776	603515	欧普照明	500	10,380.00	0.01
777	603056	德邦股份	1,000	10,230.00	0.01
778	600823	世茂股份	3,100	10,168.00	0.01
779	000553	安道麦 A	1,200	10,128.00	0.01
780	002901	大博医疗	200	10,124.00	0.01
781	600350	山东高速	1,800	9,288.00	0.01
782	600657	信达地产	2,400	8,952.00	0.01
783	601568	北元集团	1,100	8,943.00	0.01
784	603868	飞科电器	200	8,684.00	0.01
785	600466	蓝光发展	4,200	8,568.00	0.01
786	600917	重庆燃气	1,000	8,390.00	0.01
787	601665	齐鲁银行	1,500	8,370.00	0.01
788	002946	新乳业	500	7,970.00	0.01
789	601003	柳钢股份	1,500	7,830.00	0.01
790	600956	新天绿能	400	6,884.00	0.01
791	600903	贵州燃气	700	6,776.00	0.01
792	603983	丸美股份	200	6,374.00	0.01
793	601187	厦门银行	900	6,210.00	0.01
794	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.01
795	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	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	300750	宁德时代	3,613,142.00	3.50
2	000858	五粮液	3,055,578.00	2.96
3	000333	美的集团	2,549,427.00	2.47
4	300059	东方财富	2,058,285.00	1.99
5	002415	海康威视	1,975,867.42	1.91
6	002594	比亚迪	1,618,726.00	1.57
7	000661	长春高新	1,484,942.00	1.44
8	002475	立讯精密	1,470,026.00	1.42
9	000651	格力电器	1,468,727.00	1.42

10	000001	平安银行	1,344,480.00	1.30
11	300274	阳光电源	1,291,006.00	1.25
12	000725	京东方 A	1,253,830.00	1.21
13	002812	恩捷股份	1,166,352.00	1.13
14	600519	贵州茅台	1,080,164.00	1.05
15	000002	万科 A	1,071,562.00	1.04
16	000568	泸州老窖	1,058,012.00	1.03
17	002142	宁波银行	1,027,862.80	1.00
18	300014	亿纬锂能	1,004,915.00	0.97
19	002714	牧原股份	972,316.00	0.94
20	300015	爱尔眼科	963,524.00	0.93

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	000858	五粮液	3,308,952.00	3.21
2	000333	美的集团	2,722,603.00	2.64
3	300059	东方财富	2,156,413.00	2.09
4	002415	海康威视	1,847,006.00	1.79
5	002594	比亚迪	1,642,107.00	1.59
6	000651	格力电器	1,556,919.98	1.51
7	000661	长春高新	1,514,335.00	1.47
8	002475	立讯精密	1,452,371.46	1.41
9	000001	平安银行	1,423,260.00	1.38
10	300274	阳光电源	1,293,442.00	1.25
11	000725	京东方 A	1,233,969.00	1.20
12	601995	中金公司	1,145,379.33	1.11
13	000002	万科 A	1,138,580.00	1.10
14	002812	恩捷股份	1,117,553.63	1.08
15	000568	泸州老窖	1,100,348.00	1.07
16	002714	牧原股份	1,063,566.80	1.03
17	300014	亿纬锂能	1,060,173.00	1.03
18	002142	宁波银行	977,986.00	0.95
19	002352	顺丰控股	926,374.00	0.90
20	002049	紫光国微	908,588.16	0.88

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	107,620,434.69
卖出股票收入（成交）总额	105,143,329.15

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）	213,998.65	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	213,998.65	0.21

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	113052	兴业转债	2,110	210,998.68	0.21
2	113634	珀莱转债	20	1,999.98	0.00
3	110084	贵燃转债	10	999.99	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	3	4,383,480.00	151,560.00	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。
IF2203	IF2203	1	1,485,180.00	34,560.00	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。
公允价值变动总额合计(元)					186,120.00
股指期货投资本期收益(元)					966,857.87
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-3,260.00

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对冲需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内,本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中,兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局福建省分局、中国人民银行的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	820,614.95
2	应收证券清算款	73,609.73
3	应收股利	-
4	应收利息	1,136.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	895,360.90

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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)	户均持有的基金份 额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	
				中国建设银行股份有 限公司—易方达中证 800 交易型开放式指数 证券投资基金发起式

						联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
626	110,078.02	46,322,752.00	67.22%	22,586,091.00	32.78%	29,566,279.00	42.91%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行股份有限公司—易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	张招兴	5,000,000.00	7.26%
2	国泰君安证券股份有限公司	4,574,917.00	6.64%
3	华泰证券股份有限公司	3,762,338.00	5.46%
4	广发证券股份有限公司	3,554,366.00	5.16%
5	邓玉良	2,213,600.00	3.21%
6	申万宏源证券有限公司	2,170,411.00	3.15%
7	中信证券股份有限公司	1,776,481.00	2.58%
8	万娜	1,372,600.00	1.99%
9	海通证券股份有限公司	912,700.00	1.32%
10	刘晓彬	565,000.00	0.82%
11	中国建设银行股份有限公司—易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	29,566,279.00	42.91%

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(2019 年 10 月 8 日)基金份额总额	887,908,843.00
本报告期期初基金份额总额	71,908,843.00
本报告期基金总申购份额	129,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	132,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	68,908,843.00

§ 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 3 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 24,200.00 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	
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	23,923,295.90	11.37%	10,318.50	35.05%	-
华创证券	2	185,167,029.24	87.97%	18,518.68	62.91%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	1,391,506.00	0.66%	600.13	2.04%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为长江证券股份有限公司。

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
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	159,350.42	32.01%	-	-	-	-
华创证券	338,426.10	67.99%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
10	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15

		金电子披露网站	
11	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	中国证券报	2021-04-19
12	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-08
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-17
14	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	中国证券报	2021-07-20
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-23
16	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
17	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
18	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
19	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30
20	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	中国证券报	2021-08-28
21	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国泰君安证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-09
22	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	中国证券报	2021-10-27
23	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-15
24	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17
25	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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
中国建设银行股份有限公司—易方达中证800交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2021年01月01日~2021年12月31日	33,012,358.00	8,200,000.00	11,646,079.00	29,566,279.00	42.91%
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；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金将面临基金财产清算并终止的风险；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 13备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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