

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

金

2022 年年度报告

2022 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：二〇二三年三月三十日

§ 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 2023 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 2022 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	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计意见	15
6.2	形成审计意见的基础	15
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	16
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	净资产（基金净值）变动表	20
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	112
8.1	期末基金资产组合情况	112
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	112
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	113
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	125

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	127
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	127
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	127
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	127
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	127
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	127
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	128
8.12	投资组合报告附注	128
§ 9	基金份额持有人信息	129
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	129
9.2	期末上市基金前十名持有人	129
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	130
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	130
§ 10	开放式基金份额变动	130
§ 11	重大事件揭示	130
11.1	基金份额持有人大会决议	130
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	130
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	131
11.4	基金投资策略的改变	131
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	131
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	131
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	131
11.8	其他重大事件	133
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	135
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	135
§ 13	备查文件目录	135
13.1	备查文件目录	135
13.2	存放地点	135
13.3	查阅方式	135

§ 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	2,933,202,462.00 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	王玉	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	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 40-43 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-30,938,677.74	170,307,612.68	227,883,050.58
本期利润	-269,287,792.24	224,046,776.09	218,524,003.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1040	0.2677	1.6446
本期加权平均净值利润率	-14.26%	19.77%	26.18%
本期基金份额净值增长率	-18.02%	20.89%	30.85%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	143,038,920.26	356,877,126.95	70,255,924.13
期末可供分配基金份额利润	0.0488	0.2021	0.5502
期末基金资产净值	2,046,637,653.52	1,502,958,581.57	898,984,640.85
期末基金份额净值	0.6977	0.8511	7.0400
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	7.51%	31.15%	8.48%

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

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

3. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	2.97%	1.02%	2.63%	1.03%	0.34%	-0.01%
过去六个月	-8.09%	1.09%	-9.14%	1.10%	1.05%	-0.01%
过去一年	-18.02%	1.37%	-20.31%	1.38%	2.29%	-0.01%
过去三年	29.68%	1.34%	11.33%	1.35%	18.35%	-0.01%
过去五年	7.29%	1.38%	-6.18%	1.41%	13.47%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.51%	1.41%	-6.00%	1.51%	13.51%	-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

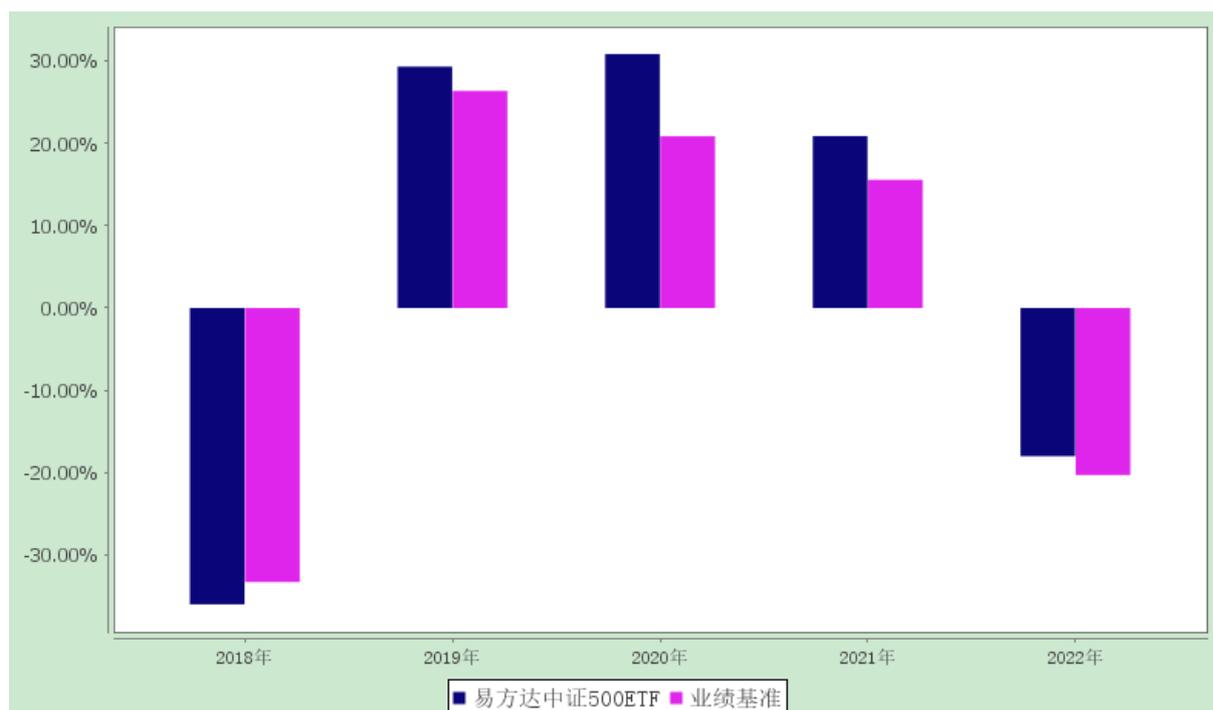
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 8 月 27 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 7.51%，同期业绩比较基准收益率为 -6.00%。

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、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（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-	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

海燕	医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银联接、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达日兴资管日经 225ETF(QDII)、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证军工 ETF 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	04-16			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 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理, 易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达北证 50 成份指数的基金经理, 指数研究部总经理	2022-12-17	-	13 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管, 华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理, 本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定, 以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内, 基金运作合法合规, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、原则和内容、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和分配机制,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交易、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 42 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,15 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 股市场中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。

2022 年面对更趋复杂严峻的国际环境和国内疫情形势等多重挑战，需求收缩、供给冲击、预期转弱“三重压力”进一步加大，在此背景下，我国统筹疫情防控和经济社会发展，加大宏观调控力度来应对宏观经济中的超预期因素冲击。随着疫情防控政策的调整优化，以及叠加稳增长政策发力，最终 2022 年中国 GDP 突破 120 万亿元大关，按不变价格计算同比增长 3%，国民经济顶住压力再上新台阶。受海外主要经济体“高通胀”“紧货币”等多重因素影响，2022 年国际金融市场剧烈震荡，全球股票和债券指数大幅下跌，美元指数创二十年新高，人民币汇率也出现了一定的贬值压力。在上述内外部环境多重因素的影响下，2022 年资本市场预期不稳，投资者风险偏好持续回落，随后在稳增长政策不断出台、国内防疫措施持续优化的背景下，市场信心在 11 月份迎来了较大幅度的修复。报告期内 A 股市场整体表现不佳，波动率维持在较高水平。中证 500 指数作为 A 股中小盘股的代表指数，其行业分布较为均衡，以周期型与成长型行业并重，其收益表现会受到 A 股整体大盘走势、市场风格以及不同行业基本面状况的影响。报告期内指数中的交通运输、煤炭等行业的成份股表现较好，对中证 500 指数收益贡献较大，而电子、电力设备、国防军工、非银金融、计算机等行业的成份股表现落后，拖累了指数的表现。报告期内中证 500 指数下跌 20.31%。

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 0.6977 元，本报告期份额净值增长率为-18.02%，同期业绩比较基准收益率为-20.31%，年化跟踪误差 0.48%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，随着优化疫情防控、稳增长等各项政策效果持续显现，中国经济有望重拾向上态势，这将进一步提振市场预期和信心。国内经济的复苏情况或将成为 2023 年对 A 股市场最重要的边际影响因素。更好统筹疫情防控和社会经济发展，大力提振市场信心，着力扩大国内需求，

推动经济运作整体好转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。货币政策精准有力，发挥直达实体经济的功能，通过“宽信用”“降成本”促进居民和企业扩张资产负债表，畅通经济正向循环。积极的财政政策加力增效，关乎经济发展与安全的传统基建与新基建有望持续发力，用于民生和直达消费的支持工具或将进一步丰富，为提振内需、基建投资等稳增长措施提供精准有力支持，保持经济运行在合理区间。在中国经济迈向复苏、货币政策宽松、信用环境改善的宏观背景下，中小市值公司有望迎来较强的盈利复苏预期，作为 A 股中小盘股的代表指数，中证 500 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

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，为投资者分享中国中小市值公司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发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，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) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上的核心价值观，加强员工合规风控、廉洁从业教育培训并完善合规监督考评机制，筑牢廉洁从业的红线认识，不断提高员工合规风控意识。

(2) 坚持投资合规风险闭环管理，认真贯彻落实法律法规、基金合同和公司制度的各项控制要求，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、情况核查和结果跟踪；持续推动投资、研究、交易等业务部门完善相应内控机制；加强公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，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) 持续提升产品合规审查质量，督促健全基金募集申请材料质量内控机制和工具手段；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，加强营销宣传、销售、客服等环节的合规管控，深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度，着力提高投资者获得感。

(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，完善信息披露管理工作机制

流程，不断提高信息披露文件制作、审核、报送的系统化水平，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) 贯彻落实风险为本的工作方法，进一步修订制度流程、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，建立健全洗钱风险自评估工作机制，扎实开展风险自评估，持续完善风险管控措施，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

(7) 以法律法规、基金合同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、信息技术、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时参考国际标准，聘请外部机构开展内控合规评估和业绩标准鉴证，报告期内通过 ISAE3402（国际鉴证业务准则 3402 号）内控鉴证和 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，通过内外部不同视角审视公司内控机制和执行情况，提升公司合规管理及内控水平。

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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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 2022 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(2023)第 25909 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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

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
2023 年 3 月 27 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	65,370,997.76	49,287,676.08
结算备付金		21,624,131.54	25,426,182.63
存出保证金		13,611,095.42	12,209,530.45
交易性金融资产	7.4.7.2	1,947,211,820.19	1,416,537,060.15
其中：股票投资		1,947,211,820.19	1,416,421,060.91
基金投资		-	-
债券投资		-	115,999.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		7,837.50	2,888,948.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	24,318.19	35,927.23
资产总计		2,047,850,200.60	1,506,385,325.15
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		239,424.77	2,372,580.19
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		266,907.63	184,444.54
应付托管费		88,969.21	61,481.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,300.81	179,900.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	614,944.66	628,337.32
负债合计		1,212,547.08	3,426,743.58
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	1,903,598,733.26	1,146,081,454.62
未分配利润	7.4.7.8	143,038,920.26	356,877,126.95
净资产合计		2,046,637,653.52	1,502,958,581.57

负债和净资产总计		2,047,850,200.60	1,506,385,325.15
----------	--	-------------------------	-------------------------

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6977 元，基金份额总额 2,933,202,462.00 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-264,752,463.85	228,260,331.76
1.利息收入		4,440,931.24	2,404,078.43
其中：存款利息收入	7.4.7.9	591,300.82	540,793.51
债券利息收入		-	572.06
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		3,849,630.42	1,862,712.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-30,345,083.37	170,665,095.70
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-59,314,294.89	140,452,825.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,278,743.41	498,304.59
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-4,225,383.57	15,718,902.91

股利收益	7.4.7.14	31,915,851.68	13,995,062.86
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-238,349,114.50	53,739,163.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-499,197.22	1,451,994.22
减：二、营业总支出		4,535,328.39	4,213,555.67
1. 管理人报酬		2,816,895.44	1,693,661.11
2. 托管费		938,965.19	564,553.65
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		13,972.27	63,296.51
8. 其他费用	7.4.7.18	765,495.49	1,892,044.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-269,287,792.24	224,046,776.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-269,287,792.24	224,046,776.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-269,287,792.24	224,046,776.09

注：1.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

2.上表中以下本期数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：本年度报告利润表中“投资收益”项目对应品种的投资收益已扣减对应投资品种产生的交易费用。

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,146,081,454.62	356,877,126.95	1,502,958,581.57
二、本期期初净资产（基金净值）	1,146,081,454.62	356,877,126.95	1,502,958,581.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	757,517,278.64	-213,838,206.69	543,679,071.95
（一）、综合收益总额	-	-269,287,792.24	-269,287,792.24
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	757,517,278.64	55,449,585.55	812,966,864.19
其中：1.基金申购款	1,457,121,028.95	121,315,566.67	1,578,436,595.62
2.基金赎回款	-699,603,750.31	-65,865,981.12	-765,469,731.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,903,598,733.26	143,038,920.26	2,046,637,653.52
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	828,728,716.72	70,255,924.13	898,984,640.85
二、本期期初净资产（基金净值）	828,728,716.72	70,255,924.13	898,984,640.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	317,352,737.90	286,621,202.82	603,973,940.72
（一）、综合收益总额	-	224,046,776.09	224,046,776.09
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	317,352,737.90	62,574,426.73	379,927,164.63

(净值减少以“-”号填列)			
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
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,146,081,454.62	356,877,126.95	1,502,958,581.57

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：王永铿

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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净资产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，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额，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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及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则按直线法计算。

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。

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

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号), 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款, 金额分别为 49,287,676.08 元、25,426,182.63 元、12,209,530.45 元、35,927.23 元和 2,888,948.61 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款, 金额分别为 49,292,393.80 元、25,438,511.68 元、12,209,569.85 元、18,827.75 元和 2,888,948.61 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 1,416,537,060.15 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 1,416,537,073.46 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 2,372,580.19 元、184,444.54 元、61,481.50 元、64,185.62 元和 364,151.70 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 2,372,580.19 元、184,444.54 元、61,481.50 元、64,185.62 元和 364,151.70 元。

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利

息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	65,370,997.76	49,287,676.08
等于：本金	65,364,724.96	49,287,676.08
加：应计利息	6,272.80	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	65,370,997.76	49,287,676.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		2,096,318,638.79	-	1,947,211,820.19	-149,106,818.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,096,318,638.79	-	1,947,211,820.19	-149,106,818.60
项目	上年度末				
	2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	97,835,633.15	-	-	-
IC2303	31,381,673.15	-	-	-
IC2306	66,453,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	97,835,633.15	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2303	IC2303	26	30,546,880.00	-834,793.15
IC2306	IC2306	55	63,903,400.00	-2,550,560.00
合计	-	-	-	-3,385,353.15
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-3,385,353.15
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	35,927.23
其他应收款	24,318.19	-
待摊费用	-	-
合计	24,318.19	35,927.23

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	-	-
应付交易费用	77,104.02	64,185.62
其中：交易所市场	77,104.02	64,185.62
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	76,700.00	200,000.00
应付替代款	304,959.61	237,343.53
其他应付款	156,181.03	106,860.17

可退替代款	-	19,948.00
合计	614,944.66	628,337.32

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,765,965,150.00	1,146,081,454.62
本期申购	2,245,237,312.00	1,457,121,028.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,078,000,000.00	-699,603,750.31
本期末	2,933,202,462.00	1,903,598,733.26

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	934,977,388.84	-578,100,261.89	356,877,126.95
本期利润	-30,938,677.74	-238,349,114.50	-269,287,792.24
本期基金份额交易产生的变动数	615,547,236.90	-560,097,651.35	55,449,585.55
其中：基金申购款	1,174,443,219.62	-1,053,127,652.95	121,315,566.67
基金赎回款	-558,895,982.72	493,030,001.60	-65,865,981.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,519,585,948.00	-1,376,547,027.74	143,038,920.26

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	222,580.34	143,162.16
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	366,499.54	394,420.64
其他	2,220.94	3,210.71
合计	591,300.82	540,793.51

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-44,230,044.41	114,627,512.11
股票投资收益——赎回差价收入	-15,084,250.48	25,825,313.23
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	-59,314,294.89	140,452,825.34

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,108,840,655.56	894,917,103.62
减：卖出股票成本总额	1,151,400,630.58	780,289,591.51
减：交易费用	1,670,069.39	-
买卖股票差价收入	-44,230,044.41	114,627,512.11

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	764,698,131.43	834,937,906.90
减：现金支付赎回款总额	364,683,272.43	438,553,039.90
减：赎回股票成本总额	415,099,109.48	370,559,553.77
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-15,084,250.48	25,825,313.23

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月 31日	2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	854.19	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,277,889.22	498,304.59
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,278,743.41	498,304.59

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31 日	2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,208,300.87	4,671,004.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,929,276.13	4,172,064.45
减：应计利息总额	910.04	635.78
减：交易费用	225.48	-
买卖债券差价收入	1,277,889.22	498,304.59

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-4,225,383.57	15,718,902.91

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	31,915,851.68	13,995,062.86
其中：证券出借权益补偿收入	4,368,936.32	1,530,225.35

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	31,915,851.68	13,995,062.86

7.4.7.15 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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-231,855,841.35	52,209,073.41
——股票投资	-231,855,841.35	52,209,073.41
——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	-6,493,273.15	1,530,090.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-6,493,273.15	1,530,090.00
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	-238,349,114.50	53,739,163.41

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,157.40	8,909.61
基金申购费收入	499.75	2,748.63
替代损益收入	-500,854.37	1,440,335.98
合计	-499,197.22	1,451,994.22

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。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	76,700.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	563,379.09	338,732.30
存托服务费	632.87	-
银行汇划费	4,783.53	4,636.02
交易费用	-	1,348,676.08
合计	765,495.49	1,892,044.40

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
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（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. 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）自 2022 年 9 月 9 日起名称分别变更为珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）。

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	88,987.00	0.00%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2022年1月1日至2022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	53.39	0.02%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
-	-	-	-	-

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,816,895.44	1,693,661.11
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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日

	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的托管费	938,965.19	564,553.65

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

单位：人民币元

本期				
2022年1月1日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	1,746,970,906.00	981,225.62	35,162,759.00	5,793.41

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

单位：人民币元

本期										
2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	2022011300001024	蓝色光标	2022-01-13	568,276.00	54,800.00	14	2.50	552.49	0.00	0.00
广发证券	2022011300001025	网宿科技	2022-01-13	198,450.00	29,400.00	14	2.50	192.94	0.00	0.00

广发证 券	2022 0113 0000 1027	红日药 业	2022- 01-13	170,7 30.00	21,000.00	14	2.5 0	165.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1028	安科生 物	2022- 01-13	333,6 48.00	25,200.00	14	2.5 0	324.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1030	海新能 科	2022- 01-13	249,1 11.00	31,100.00	14	2.5 0	242.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1032	长盈精 密	2022- 01-13	316,3 50.00	18,500.00	14	2.5 0	307.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1034	华策影 视	2022- 01-13	167,8 32.00	25,200.00	14	2.5 0	163.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1037	特锐德	2022- 01-13	319,2 10.00	13,700.00	14	2.5 0	310.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1039	机器人	2022- 01-13	308,0 00.00	27,500.00	14	2.5 0	299.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1040	新宙邦	2022- 01-13	657,1 53.00	6,300.00	14	2.5 0	638.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1041	碧水源	2022- 01-13	348,0 00.00	48,000.00	14	2.5 0	338.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1043	东方国 信	2022- 01-13	194,5 54.00	17,800.00	14	2.5 0	189.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1044	汤臣倍 健	2022- 01-13	486,5 74.00	18,700.00	14	2.5 0	473.0 6	0.00	0.00
广发证	2022	长信科	2022-	603,7	54,100.00	14	2.5	586.9	0.00	0.00

券	0113 0000 1045	技	01-13	56.00			0	9		
广发证 券	2022 0113 0000 1046	光线传 媒	2022- 01-13	292,6 70.00	25,900.00	14	2.5 0	284.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1047	易华录	2022- 01-13	264,1 06.00	8,300.00	14	2.5 0	256.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1048	迪安诊 断	2022- 01-13	342,8 16.00	9,600.00	14	2.5 0	333.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1049	卫宁健 康	2022- 01-13	558,7 14.00	37,700.00	14	2.5 0	543.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1050	华宇软 件	2022- 01-13	229,2 99.00	18,300.00	14	2.5 0	222.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1051	开山股 份	2022- 01-13	131,2 08.00	7,700.00	14	2.5 0	127.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1054	国瓷材 料	2022- 01-13	730,6 56.00	17,700.00	14	2.5 0	710.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1055	利亚德	2022- 01-13	456,5 12.00	44,800.00	14	2.5 0	443.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1056	捷成股 份	2022- 01-13	265,1 36.00	45,400.00	14	2.5 0	257.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1070	掌趣科 技	2022- 01-13	282,3 96.00	60,600.00	14	2.5 0	274.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113	我武生 物	2022- 01-13	367,5 63.00	6,900.00	14	2.5 0	357.3 5	0.00	0.00

	0000 1072									
广发证 券	2022 0113 0000 1074	寒锐钴 业	2022- 01-13	329,8 68.00	4,200.00	14	2.5 0	320.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1075	万孚生 物	2022- 01-13	343,4 68.00	6,800.00	14	2.5 0	333.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1076	万达信 息	2022- 01-13	305,3 70.00	26,100.00	14	2.5 0	296.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1079	昆仑万 维	2022- 01-13	466,3 10.00	21,100.00	14	2.5 0	453.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1081	光环新 网	2022- 01-13	409,9 60.00	27,700.00	14	2.5 0	398.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1082	光威复 材	2022- 01-13	506,6 00.00	6,800.00	14	2.5 0	492.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1083	普利制 药	2022- 01-13	292,4 94.00	5,800.00	14	2.5 0	284.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1084	中际旭 创	2022- 01-13	476,2 56.00	12,300.00	14	2.5 0	463.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1085	迈克生 物	2022- 01-13	189,6 85.00	5,900.00	14	2.5 0	184.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0000 1092	南微医 学	2022- 01-13	214,4 40.00	1,200.00	14	2.5 0	208.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0114 0000	红日药 业	2022- 01-14	303,5 76.00	36,400.00	14	2.5 0	295.1 4	0.00	0.00

	0737									
广发证 券	2022 0127 0000 9147	安科生 物	2022- 01-27	261,0 72.00	25,200.00	14	2.5 0	253.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0567	网宿科 技	2022- 01-27	170,2 26.00	29,400.00	14	2.5 0	165.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0569	红日药 业	2022- 01-27	130,4 10.00	21,000.00	14	2.5 0	126.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0571	长盈精 密	2022- 01-27	272,1 35.00	18,500.00	14	2.5 0	264.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0573	东方国 信	2022- 01-27	193,4 86.00	17,800.00	14	2.5 0	188.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0575	华策影 视	2022- 01-27	147,6 72.00	25,200.00	14	2.5 0	143.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0577	汤臣倍 健	2022- 01-27	466,7 52.00	18,700.00	14	2.5 0	453.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0579	蓝色光 标	2022- 01-27	491,0 08.00	54,800.00	14	2.5 0	477.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0581	碧水源	2022- 01-27	316,3 20.00	48,000.00	14	2.5 0	307.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0583	海新能 科	2022- 01-27	241,3 36.00	31,100.00	14	2.5 0	234.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0585	长信科 技	2022- 01-27	562,6 40.00	54,100.00	14	2.5 0	547.0 1	0.00	0.00

广发证 券	2022 0127 0001 0587	光线传 媒	2022- 01-27	260,8 13.00	25,900.00	14	2.5 0	253.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0589	特锐德	2022- 01-27	274,0 00.00	13,700.00	14	2.5 0	266.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0591	国瓷材 料	2022- 01-27	717,0 27.00	17,700.00	14	2.5 0	697.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0593	机器人	2022- 01-27	275,2 75.00	27,500.00	14	2.5 0	267.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0595	易华录	2022- 01-27	239,6 21.00	8,300.00	14	2.5 0	232.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0597	迪安诊 断	2022- 01-27	277,2 48.00	9,600.00	14	2.5 0	269.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0599	新宙邦	2022- 01-27	611,1 63.00	6,300.00	14	2.5 0	594.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0601	华宇软 件	2022- 01-27	204,5 94.00	18,300.00	14	2.5 0	198.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0603	掌趣科 技	2022- 01-27	220,5 84.00	60,600.00	14	2.5 0	214.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0605	开山股 份	2022- 01-27	119,0 42.00	7,700.00	14	2.5 0	115.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0607	卫宁健 康	2022- 01-27	432,0 42.00	37,700.00	14	2.5 0	420.0 4	0.00	0.00
广发证	2022	捷成股	2022-	277,3	45,400.00	14	2.5	269.6	0.00	0.00

券	0127 0001 0609	份	01-27	94.00			0	9		
广发证 券	2022 0127 0001 0611	我武生 物	2022- 01-27	325,1 28.00	6,900.00	14	2.5 0	316.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0613	寒锐钻 业	2022- 01-27	301,2 24.00	4,200.00	14	2.5 0	292.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0615	利亚德	2022- 01-27	392,0 00.00	44,800.00	14	2.5 0	381.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0617	万孚生 物	2022- 01-27	250,5 12.00	6,800.00	14	2.5 0	243.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0619	光环新 网	2022- 01-27	372,2 88.00	27,700.00	14	2.5 0	361.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0621	万达信 息	2022- 01-27	307,9 80.00	26,100.00	14	2.5 0	299.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0623	普利制 药	2022- 01-27	274,2 82.00	5,800.00	14	2.5 0	266.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0625	昆仑万 维	2022- 01-27	403,2 21.00	21,100.00	14	2.5 0	392.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0627	中际旭 创	2022- 01-27	437,6 34.00	12,300.00	14	2.5 0	425.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127 0001 0629	迈克生 物	2022- 01-27	149,7 42.00	5,900.00	14	2.5 0	145.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0127	光威复 材	2022- 01-27	476,6 80.00	6,800.00	14	2.5 0	463.4 4	0.00	0.00

	0001 0631									
广发证 券	2022 0127 0001 0633	南微医 学	2022- 01-27	187,0 80.00	1,200.00	14	2.5 0	181.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0128 0002 0142	红日药 业	2022- 01-28	224,5 88.00	36,400.00	14	2.5 0	218.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3548	特锐德	2022- 02-10	288,5 22.00	13,700.00	14	2.5 0	280.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3550	安科生 物	2022- 02-10	267,6 24.00	25,200.00	14	2.5 0	260.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3552	机器人	2022- 02-10	283,5 25.00	27,500.00	14	2.5 0	275.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3554	网宿科 技	2022- 02-10	183,4 56.00	29,400.00	14	2.5 0	178.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3556	红日药 业	2022- 02-10	136,5 00.00	21,000.00	14	2.5 0	132.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3558	新宙邦	2022- 02-10	570,0 87.00	6,300.00	14	2.5 0	554.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3560	碧水源	2022- 02-10	333,6 00.00	48,000.00	14	2.5 0	324.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3562	蓝色光 标	2022- 02-10	480,0 48.00	54,800.00	14	2.5 0	466.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001	海新能 科	2022- 02-10	255,0 20.00	31,100.00	14	2.5 0	247.9 4	0.00	0.00

	3564									
广发证 券	2022 0210 0001 3566	华策影 视	2022- 02-10	152,9 64.00	25,200.00	14	2.5 0	148.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3568	长信科 技	2022- 02-10	541,0 00.00	54,100.00	14	2.5 0	525.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3570	汤臣倍 健	2022- 02-10	497,4 20.00	18,700.00	14	2.5 0	483.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3572	长盈精 密	2022- 02-10	234,9 50.00	18,500.00	14	2.5 0	228.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3574	东方国 信	2022- 02-10	228,1 96.00	17,800.00	14	2.5 0	221.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3866	易华录	2022- 02-10	221,6 10.00	8,300.00	14	2.5 0	215.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3868	万达信 息	2022- 02-10	331,9 92.00	26,100.00	14	2.5 0	322.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3870	华宇软 件	2022- 02-10	220,1 49.00	18,300.00	14	2.5 0	214.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3872	捷成股 份	2022- 02-10	308,2 66.00	45,400.00	14	2.5 0	299.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3874	迪安诊 断	2022- 02-10	281,2 80.00	9,600.00	14	2.5 0	273.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3876	国瓷材 料	2022- 02-10	718,0 89.00	17,700.00	14	2.5 0	698.1 4	0.00	0.00

广发证 券	2022 0210 0001 3878	光线传 媒	2022- 02-10	265,2 16.00	25,900.00	14	2.5 0	257.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3880	卫宁健 康	2022- 02-10	444,8 60.00	37,700.00	14	2.5 0	432.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3882	利亚德	2022- 02-10	407,6 80.00	44,800.00	14	2.5 0	396.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3884	万孚生 物	2022- 02-10	251,1 24.00	6,800.00	14	2.5 0	244.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3886	中际旭 创	2022- 02-10	450,6 72.00	12,300.00	14	2.5 0	438.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3888	掌趣科 技	2022- 02-10	250,2 78.00	60,600.00	14	2.5 0	243.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3890	开山股 份	2022- 02-10	129,9 76.00	7,700.00	14	2.5 0	126.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3892	我武生 物	2022- 02-10	304,4 97.00	6,900.00	14	2.5 0	296.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3894	普利制 药	2022- 02-10	260,0 72.00	5,800.00	14	2.5 0	252.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3896	寒锐钻 业	2022- 02-10	311,2 62.00	4,200.00	14	2.5 0	302.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3898	光环新 网	2022- 02-10	387,2 46.00	27,700.00	14	2.5 0	376.4 9	0.00	0.00
广发证	2022	光威复	2022-	475,9	6,800.00	14	2.5	462.7	0.00	0.00

券	0210 0001 3900	材	02-10	32.00			0	1		
广发证 券	2022 0210 0001 3902	昆仑万 维	2022- 02-10	403,8 54.00	21,100.00	14	2.5 0	392.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3904	迈克生 物	2022- 02-10	157,8 84.00	5,900.00	14	2.5 0	153.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0210 0001 3906	南微医 学	2022- 02-10	187,9 08.00	1,200.00	14	2.5 0	182.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0211 0001 8248	红日药 业	2022- 02-11	219,4 92.00	36,400.00	14	2.5 0	213.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0000 9939	蓝色光 标	2022- 02-24	425,2 48.00	54,800.00	14	2.5 0	413.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0000 9941	东方国 信	2022- 02-24	242,4 36.00	17,800.00	14	2.5 0	235.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0000 9943	红日药 业	2022- 02-24	146,5 80.00	21,000.00	14	2.5 0	142.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0187	长信科 技	2022- 02-24	521,5 24.00	54,100.00	14	2.5 0	507.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0189	长盈精 密	2022- 02-24	222,0 00.00	18,500.00	14	2.5 0	215.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0191	碧水源	2022- 02-24	318,7 20.00	48,000.00	14	2.5 0	309.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224	海新能 科	2022- 02-24	249,7 33.00	31,100.00	14	2.5 0	242.8 0	0.00	0.00

	0001 0193									
广发证 券	2022 0224 0001 0195	汤臣倍 健	2022- 02-24	451,7 92.00	18,700.00	14	2.5 0	439.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0197	万达信 息	2022- 02-24	327,5 55.00	26,100.00	14	2.5 0	318.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0199	华策影 视	2022- 02-24	139,8 60.00	25,200.00	14	2.5 0	135.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0201	易华录	2022- 02-24	229,6 61.00	8,300.00	14	2.5 0	223.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0203	捷成股 份	2022- 02-24	262,4 12.00	45,400.00	14	2.5 0	255.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0205	光线传 媒	2022- 02-24	239,5 75.00	25,900.00	14	2.5 0	232.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0207	迪安诊 断	2022- 02-24	281,7 60.00	9,600.00	14	2.5 0	273.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0209	利亚德	2022- 02-24	378,1 12.00	44,800.00	14	2.5 0	367.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0211	掌趣科 技	2022- 02-24	224,8 26.00	60,600.00	14	2.5 0	218.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0213	光环新 网	2022- 02-24	410,2 37.00	27,700.00	14	2.5 0	398.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001	中际旭 创	2022- 02-24	455,2 23.00	12,300.00	14	2.5 0	442.5 8	0.00	0.00

	0215									
广发证 券	2022 0224 0001 0217	我武生 物	2022- 02-24	299,4 60.00	6,900.00	14	2.5 0	291.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0219	昆仑万 维	2022- 02-24	363,5 53.00	21,100.00	14	2.5 0	353.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0221	卫宁健 康	2022- 02-24	418,8 47.00	37,700.00	14	2.5 0	407.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0223	开山股 份	2022- 02-24	120,7 36.00	7,700.00	14	2.5 0	117.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0225	华宇软 件	2022- 02-24	207,3 39.00	18,300.00	14	2.5 0	201.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0227	迈克生 物	2022- 02-24	151,3 35.00	5,900.00	14	2.5 0	147.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0229	万孚生 物	2022- 02-24	244,0 52.00	6,800.00	14	2.5 0	237.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0231	国瓷材 料	2022- 02-24	638,9 70.00	17,700.00	14	2.5 0	621.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0233	光威复 材	2022- 02-24	490,6 88.00	6,800.00	14	2.5 0	477.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0235	寒锐钴 业	2022- 02-24	319,6 20.00	4,200.00	14	2.5 0	310.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 0237	普利制 药	2022- 02-24	272,0 20.00	5,800.00	14	2.5 0	264.4 6	0.00	0.00

广发证 券	2022 0224 0001 0239	南微医 学	2022- 02-24	179,1 12.00	1,200.00	14	2.5 0	174.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 1067	安科生 物	2022- 02-24	265,8 60.00	25,200.00	14	2.5 0	258.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 1069	特锐德	2022- 02-24	286,3 30.00	13,700.00	14	2.5 0	278.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 1071	网宿科 技	2022- 02-24	205,8 00.00	29,400.00	14	2.5 0	200.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 1073	新宙邦	2022- 02-24	586,2 15.00	6,300.00	14	2.5 0	569.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0224 0001 1075	机器人	2022- 02-24	277,7 50.00	27,500.00	14	2.5 0	270.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0225 0001 7807	红日药 业	2022- 02-25	246,4 28.00	36,400.00	14	2.5 0	239.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1672	东方国 信	2022- 03-10	229,0 86.00	17,800.00	14	2.5 0	222.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1674	开山股 份	2022- 03-10	106,7 22.00	7,700.00	14	2.5 0	103.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1676	捷成股 份	2022- 03-10	249,7 00.00	45,400.00	14	2.5 0	242.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1678	新宙邦	2022- 03-10	532,9 80.00	6,300.00	14	2.5 0	518.1 8	0.00	0.00
广发证	2022	机器人	2022-	260,4	27,500.00	14	2.5	253.1	0.00	0.00

券	0310 0001 1680		03-10	25.00			0	9		
广发证 券	2022 0310 0001 1682	网宿科 技	2022- 03-10	182,8 68.00	29,400.00	14	2.5 0	177.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1684	华策影 视	2022- 03-10	129,0 24.00	25,200.00	14	2.5 0	125.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1686	万达信 息	2022- 03-10	289,7 10.00	26,100.00	14	2.5 0	281.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1688	蓝色光 标	2022- 03-10	427,4 40.00	54,800.00	14	2.5 0	415.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1690	中际旭 创	2022- 03-10	434,9 28.00	12,300.00	14	2.5 0	422.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1692	光线传 媒	2022- 03-10	224,0 35.00	25,900.00	14	2.5 0	217.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1694	南微医 学	2022- 03-10	161,2 44.00	1,200.00	14	2.5 0	156.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1696	普利制 药	2022- 03-10	275,2 10.00	5,800.00	14	2.5 0	267.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1698	长盈精 密	2022- 03-10	197,0 25.00	18,500.00	14	2.5 0	191.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1700	长信科 技	2022- 03-10	470,6 70.00	54,100.00	14	2.5 0	457.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310	寒锐钻 业	2022- 03-10	289,1 28.00	4,200.00	14	2.5 0	281.1 0	0.00	0.00

	0001 1702									
广发证 券	2022 0310 0001 1704	海新能 科	2022- 03-10	211,4 80.00	31,100.00	14	2.5 0	205.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1706	易华录	2022- 03-10	212,0 65.00	8,300.00	14	2.5 0	206.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1708	万孚生 物	2022- 03-10	338,6 40.00	6,800.00	14	2.5 0	329.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 1710	掌趣科 技	2022- 03-10	212,7 06.00	60,600.00	14	2.5 0	206.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2284	碧水源	2022- 03-10	291,3 60.00	48,000.00	14	2.5 0	283.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2286	红日药 业	2022- 03-10	128,7 30.00	21,000.00	14	2.5 0	125.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2288	特锐德	2022- 03-10	281,8 09.00	13,700.00	14	2.5 0	273.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2290	卫宁健 康	2022- 03-10	370,9 68.00	37,700.00	14	2.5 0	360.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2292	我武生 物	2022- 03-10	269,3 07.00	6,900.00	14	2.5 0	261.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2294	昆仑万 维	2022- 03-10	348,9 94.00	21,100.00	14	2.5 0	339.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001	迈克生 物	2022- 03-10	148,2 67.00	5,900.00	14	2.5 0	144.1 5	0.00	0.00

	2296									
广发证 券	2022 0310 0001 2556	华宇软 件	2022- 03-10	183,9 15.00	18,300.00	14	2.5 0	178.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2558	光威复 材	2022- 03-10	463,2 16.00	6,800.00	14	2.5 0	450.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2560	安科生 物	2022- 03-10	257,5 44.00	25,200.00	14	2.5 0	250.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2562	迪安诊 断	2022- 03-10	276,4 80.00	9,600.00	14	2.5 0	268.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2564	国瓷材 料	2022- 03-10	618,7 92.00	17,700.00	14	2.5 0	601.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2566	汤臣倍 健	2022- 03-10	418,1 32.00	18,700.00	14	2.5 0	406.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2568	光环新 网	2022- 03-10	400,5 42.00	27,700.00	14	2.5 0	389.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0310 0001 2570	利亚德	2022- 03-10	343,6 16.00	44,800.00	14	2.5 0	334.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0311 0001 6382	红日药 业	2022- 03-11	242,7 88.00	36,400.00	14	2.5 0	236.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 0303	安科生 物	2022- 03-24	256,7 88.00	25,200.00	14	2.5 0	249.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 0305	特锐德	2022- 03-24	264,4 10.00	13,700.00	14	2.5 0	257.0 7	0.00	0.00

广发证 券	2022 0324 0001 0307	普利制 药	2022- 03-24	256,3 60.00	5,800.00	14	2.5 0	249.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1869	寒锐钻 业	2022- 03-24	274,1 34.00	4,200.00	14	2.5 0	266.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1871	万孚生 物	2022- 03-24	334,3 56.00	6,800.00	14	2.5 0	325.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1951	光威复 材	2022- 03-24	418,6 08.00	6,800.00	14	2.5 0	406.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1953	迈克生 物	2022- 03-24	152,5 74.00	5,900.00	14	2.5 0	148.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1955	昆仑万 维	2022- 03-24	347,5 17.00	21,100.00	14	2.5 0	337.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1957	我武生 物	2022- 03-24	279,7 95.00	6,900.00	14	2.5 0	272.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1959	光环新 网	2022- 03-24	370,9 03.00	27,700.00	14	2.5 0	360.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1961	掌趣科 技	2022- 03-24	216,9 48.00	60,600.00	14	2.5 0	210.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1963	中际旭 创	2022- 03-24	414,5 10.00	12,300.00	14	2.5 0	403.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1965	华宇软 件	2022- 03-24	179,7 06.00	18,300.00	14	2.5 0	174.7 1	0.00	0.00
广发证	2022	利亚德	2022-	330,6	44,800.00	14	2.5	321.4	0.00	0.00

券	0324 0001 1967		03-24	24.00			0	4		
广发证 券	2022 0324 0001 1969	卫宁健 康	2022- 03-24	357,3 96.00	37,700.00	14	2.5 0	347.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1971	开山股 份	2022- 03-24	107,2 61.00	7,700.00	14	2.5 0	104.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1973	光线传 媒	2022- 03-24	206,4 23.00	25,900.00	14	2.5 0	200.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1975	捷成股 份	2022- 03-24	260,5 96.00	45,400.00	14	2.5 0	253.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1977	迪安诊 断	2022- 03-24	271,4 88.00	9,600.00	14	2.5 0	263.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1979	国瓷材 料	2022- 03-24	610,2 96.00	17,700.00	14	2.5 0	593.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1981	万达信 息	2022- 03-24	283,7 07.00	26,100.00	14	2.5 0	275.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1983	汤臣倍 健	2022- 03-24	406,7 25.00	18,700.00	14	2.5 0	395.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1985	华策影 视	2022- 03-24	125,2 44.00	25,200.00	14	2.5 0	121.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1987	长盈精 密	2022- 03-24	189,2 55.00	18,500.00	14	2.5 0	184.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324	长信科 技	2022- 03-24	462,0 14.00	54,100.00	14	2.5 0	449.1 8	0.00	0.00

	0001 1989									
广发证 券	2022 0324 0001 1991	海新能 科	2022- 03-24	203,7 05.00	31,100.00	14	2.5 0	198.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1993	碧水源	2022- 03-24	280,8 00.00	48,000.00	14	2.5 0	273.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1995	新宙邦	2022- 03-24	527,9 40.00	6,300.00	14	2.5 0	513.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1997	机器人	2022- 03-24	250,8 00.00	27,500.00	14	2.5 0	243.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 1999	网宿科 技	2022- 03-24	175,8 12.00	29,400.00	14	2.5 0	170.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 2001	南微医 学	2022- 03-24	159,2 40.00	1,200.00	14	2.5 0	154.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 2993	易华录	2022- 03-24	188,5 76.00	8,300.00	14	2.5 0	183.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 2995	东方国 信	2022- 03-24	197,9 36.00	17,800.00	14	2.5 0	192.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 2997	蓝色光 标	2022- 03-24	429,0 84.00	54,800.00	14	2.5 0	417.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0324 0001 2999	红日药 业	2022- 03-24	174,5 10.00	21,000.00	14	2.5 0	169.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0325 0001	红日药 业	2022- 03-25	284,2 84.00	36,400.00	14	2.5 0	276.3 9	0.00	0.00

	5080									
广发证 券	2022 0407 0001 4302	南微医 学	2022- 04-07	143,6 52.00	1,200.00	14	2.5 0	139.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4304	寒锐钴 业	2022- 04-07	256,4 10.00	4,200.00	14	2.5 0	249.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4306	普利制 药	2022- 04-07	250,7 34.00	5,800.00	14	2.5 0	243.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4308	迈克生 物	2022- 04-07	138,8 86.00	5,900.00	14	2.5 0	135.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4310	新宙邦	2022- 04-07	510,3 00.00	6,300.00	14	2.5 0	496.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4312	万孚生 物	2022- 04-07	323,0 00.00	6,800.00	14	2.5 0	314.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4314	光威复 材	2022- 04-07	372,6 40.00	6,800.00	14	2.5 0	362.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4316	我武生 物	2022- 04-07	253,2 99.00	6,900.00	14	2.5 0	246.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4318	开山股 份	2022- 04-07	102,4 10.00	7,700.00	14	2.5 0	99.57	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4320	易华录	2022- 04-07	164,4 23.00	8,300.00	14	2.5 0	159.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4322	迪安诊 断	2022- 04-07	268,0 32.00	9,600.00	14	2.5 0	260.5 9	0.00	0.00

广发证 券	2022 0407 0001 4324	中际旭 创	2022- 04-07	370,4 76.00	12,300.00	14	2.5 0	360.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4326	特锐德	2022- 04-07	244,2 71.00	13,700.00	14	2.5 0	237.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4328	国瓷材 料	2022- 04-07	591,3 57.00	17,700.00	14	2.5 0	574.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4330	东方国 信	2022- 04-07	189,3 92.00	17,800.00	14	2.5 0	184.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4332	华宇软 件	2022- 04-07	172,0 20.00	18,300.00	14	2.5 0	167.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4334	长盈精 密	2022- 04-07	171,3 10.00	18,500.00	14	2.5 0	166.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4336	汤臣倍 健	2022- 04-07	392,7 00.00	18,700.00	14	2.5 0	381.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4338	红日药 业	2022- 04-07	171,7 80.00	21,000.00	14	2.5 0	167.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4340	昆仑万 维	2022- 04-07	357,6 45.00	21,100.00	14	2.5 0	347.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4342	华策影 视	2022- 04-07	126,5 04.00	25,200.00	14	2.5 0	122.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4344	安科生 物	2022- 04-07	236,8 80.00	25,200.00	14	2.5 0	230.3 0	0.00	0.00
广发证	2022	光线传	2022-	201,7	25,900.00	14	2.5	196.1	0.00	0.00

券	0407 0001 4346	媒	04-07	61.00			0	6		
广发证 券	2022 0407 0001 4348	万达信 息	2022- 04-07	267,7 86.00	26,100.00	14	2.5 0	260.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4350	机器人	2022- 04-07	247,2 25.00	27,500.00	14	2.5 0	240.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4352	光环新 网	2022- 04-07	363,4 24.00	27,700.00	14	2.5 0	353.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4354	网宿科 技	2022- 04-07	168,1 68.00	29,400.00	14	2.5 0	163.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4356	海新能 科	2022- 04-07	198,7 29.00	31,100.00	14	2.5 0	193.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4358	卫宁健 康	2022- 04-07	337,7 92.00	37,700.00	14	2.5 0	328.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4360	利亚德	2022- 04-07	308,6 72.00	44,800.00	14	2.5 0	300.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4362	捷成股 份	2022- 04-07	279,2 10.00	45,400.00	14	2.5 0	271.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4364	碧水源	2022- 04-07	286,0 80.00	48,000.00	14	2.5 0	278.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407 0001 4366	长信科 技	2022- 04-07	408,4 55.00	54,100.00	14	2.5 0	397.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0407	蓝色光 标	2022- 04-07	489,9 12.00	54,800.00	14	2.5 0	476.3 0	0.00	0.00

	0001 4368									
广发证 券	2022 0407 0001 4370	掌趣科 技	2022- 04-07	224,8 26.00	60,600.00	14	2.5 0	218.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0408 0001 7191	红日药 业	2022- 04-08	286,1 04.00	36,400.00	14	2.5 0	278.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2125	华策影 视	2022- 04-21	116,9 28.00	25,200.00	14	2.5 0	113.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2127	安科生 物	2022- 04-21	212,4 36.00	25,200.00	14	2.5 0	206.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2129	昆仑万 维	2022- 04-21	306,7 94.00	21,100.00	14	2.5 0	298.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2131	新宙邦	2022- 04-21	426,7 62.00	6,300.00	14	2.5 0	414.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2133	南微医 学	2022- 04-21	135,9 24.00	1,200.00	14	2.5 0	132.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2135	光环新 网	2022- 04-21	305,5 31.00	27,700.00	14	2.5 0	297.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2137	光线传 媒	2022- 04-21	199,6 89.00	25,900.00	14	2.5 0	194.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2139	我武生 物	2022- 04-21	233,9 79.00	6,900.00	14	2.5 0	227.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001	万孚生 物	2022- 04-21	312,8 00.00	6,800.00	14	2.5 0	304.1 1	0.00	0.00

	2141									
广发证 券	2022 0421 0001 2143	光威复 材	2022- 04-21	321,7 76.00	6,800.00	14	2.5 0	312.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2145	利亚德	2022- 04-21	282,6 88.00	44,800.00	14	2.5 0	274.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2147	机器人	2022- 04-21	234,8 50.00	27,500.00	14	2.5 0	228.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2149	长信科 技	2022- 04-21	359,7 65.00	54,100.00	14	2.5 0	349.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2151	东方国 信	2022- 04-21	161,6 24.00	17,800.00	14	2.5 0	157.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2153	长盈精 密	2022- 04-21	151,5 15.00	18,500.00	14	2.5 0	147.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2155	海新能 科	2022- 04-21	172,6 05.00	31,100.00	14	2.5 0	167.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2157	华宇软 件	2022- 04-21	155,3 67.00	18,300.00	14	2.5 0	151.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2159	中际旭 创	2022- 04-21	362,9 73.00	12,300.00	14	2.5 0	352.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2161	汤臣倍 健	2022- 04-21	377,7 40.00	18,700.00	14	2.5 0	367.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 2163	碧水源	2022- 04-21	239,0 40.00	48,000.00	14	2.5 0	232.4 0	0.00	0.00

广发证 券	2022 0421 0001 2165	蓝色光 标	2022- 04-21	346,8 84.00	54,800.00	14	2.5 0	337.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3553	特锐德	2022- 04-21	210,9 80.00	13,700.00	14	2.5 0	205.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3565	网宿科 技	2022- 04-21	151,4 10.00	29,400.00	14	2.5 0	147.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3567	迈克生 物	2022- 04-21	120,6 55.00	5,900.00	14	2.5 0	117.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3569	寒锐钴 业	2022- 04-21	233,7 72.00	4,200.00	14	2.5 0	227.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3573	开山股 份	2022- 04-21	106,6 45.00	7,700.00	14	2.5 0	103.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3575	易华录	2022- 04-21	141,5 15.00	8,300.00	14	2.5 0	137.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3577	捷成股 份	2022- 04-21	216,1 04.00	45,400.00	14	2.5 0	210.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3579	卫宁健 康	2022- 04-21	298,9 61.00	37,700.00	14	2.5 0	290.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3581	万达信 息	2022- 04-21	234,3 78.00	26,100.00	14	2.5 0	227.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3583	红日药 业	2022- 04-21	126,8 40.00	21,000.00	14	2.5 0	123.3 2	0.00	0.00
广发证	2022	普利制	2022-	153,9	5,800.00	14	2.5	149.6	0.00	0.00

券	0421 0001 3585	药	04-21	32.00			0	6		
广发证 券	2022 0421 0001 3587	掌趣科 技	2022- 04-21	200,5 86.00	60,600.00	14	2.5 0	195.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3589	迪安诊 断	2022- 04-21	274,3 68.00	9,600.00	14	2.5 0	266.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0001 3591	国瓷材 料	2022- 04-21	540,2 04.00	17,700.00	14	2.5 0	525.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0422 0001 4404	红日药 业	2022- 04-22	212,5 76.00	36,400.00	14	2.5 0	206.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0197	光威复 材	2022- 05-05	345,2 36.00	6,800.00	14	2.5 0	335.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0199	普利制 药	2022- 05-05	155,0 92.00	5,800.00	14	2.5 0	150.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0201	寒锐钻 业	2022- 05-05	216,3 42.00	4,200.00	14	2.5 0	210.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0205	万孚生 物	2022- 05-05	310,2 84.00	6,800.00	14	2.5 0	301.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0211	易华录	2022- 05-05	122,0 93.00	8,300.00	14	2.5 0	118.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0213	卫宁健 康	2022- 05-05	304,9 93.00	37,700.00	14	2.5 0	296.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505	光线传 媒	2022- 05-05	181,3 00.00	25,900.00	14	2.5 0	176.2 6	0.00	0.00

	0006 0215									
广发证 券	2022 0505 0006 0217	捷成股 份	2022- 05-05	219,7 36.00	45,400.00	14	2.5 0	213.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0219	东方国 信	2022- 05-05	148,8 08.00	17,800.00	14	2.5 0	144.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0221	万达信 息	2022- 05-05	213,4 98.00	26,100.00	14	2.5 0	207.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0223	迪安诊 断	2022- 05-05	340,8 00.00	9,600.00	14	2.5 0	331.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 0225	汤臣倍 健	2022- 05-05	378,6 75.00	18,700.00	14	2.5 0	368.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5307	昆仑万 维	2022- 05-05	307,4 27.00	21,100.00	14	2.5 0	298.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5309	光环新 网	2022- 05-05	266,4 74.00	27,700.00	14	2.5 0	259.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5311	迈克生 物	2022- 05-05	114,9 91.00	5,900.00	14	2.5 0	111.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5315	我武生 物	2022- 05-05	281,5 20.00	6,900.00	14	2.5 0	273.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5319	中际旭 创	2022- 05-05	392,4 93.00	12,300.00	14	2.5 0	381.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006	掌趣科 技	2022- 05-05	184,2 24.00	60,600.00	14	2.5 0	179.1 1	0.00	0.00

	5323									
广发证 券	2022 0505 0006 5327	利亚德	2022- 05-05	268,8 00.00	44,800.00	14	2.5 0	261.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5329	华宇软 件	2022- 05-05	124,4 40.00	18,300.00	14	2.5 0	120.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5331	国瓷材 料	2022- 05-05	571,5 33.00	17,700.00	14	2.5 0	555.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5333	开山股 份	2022- 05-05	105,1 05.00	7,700.00	14	2.5 0	102.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5471	长盈精 密	2022- 05-05	143,5 60.00	18,500.00	14	2.5 0	139.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5473	海新能 科	2022- 05-05	132,1 75.00	31,100.00	14	2.5 0	128.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5475	华策影 视	2022- 05-05	108,3 60.00	25,200.00	14	2.5 0	105.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5477	长信科 技	2022- 05-05	328,3 87.00	54,100.00	14	2.5 0	319.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3821	碧水源	2022- 05-05	222,2 40.00	48,000.00	14	2.5 0	216.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3825	蓝色光 标	2022- 05-05	312,3 60.00	54,800.00	14	2.5 0	303.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3827	红日药 业	2022- 05-05	124,3 20.00	21,000.00	14	2.5 0	120.8 7	0.00	0.00

广发证 券	2022 0505 0007 3829	新宙邦	2022- 05-05	424,9 35.00	6,300.00	14	2.5 0	413.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3831	机器人	2022- 05-05	210,6 50.00	27,500.00	14	2.5 0	204.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3833	安科生 物	2022- 05-05	223,0 20.00	25,200.00	14	2.5 0	216.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3835	特锐德	2022- 05-05	189,0 60.00	13,700.00	14	2.5 0	183.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3837	网宿科 技	2022- 05-05	142,0 02.00	29,400.00	14	2.5 0	138.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3839	南微医 学	2022- 05-05	115,9 20.00	1,200.00	14	2.5 0	112.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0506 0001 8097	红日药 业	2022- 05-06	217,3 08.00	36,400.00	14	2.5 0	211.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0000 1201	思瑞浦	2022- 05-09	995,9 52.00	2,400.00	7	2.5 0	484.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0000 1203	杭可科 技	2022- 05-09	415,1 96.00	9,200.00	7	2.5 0	201.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0000 1205	圣湘生 物	2022- 05-09	410,9 56.00	9,100.00	7	2.5 0	199.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0000 1207	凯赛生 物	2022- 05-09	868,9 65.00	9,500.00	7	2.5 0	422.4 1	0.00	0.00
广发证	2022	南微医	2022-	168,3	1,800.00	7	2.5	81.81	0.00	0.00

券	0509 0000 1209	学	05-09	00.00			0			
广发证 券	2022 0509 0000 1211	柏楚电 子	2022- 05-09	598,0 00.00	2,300.00	7	2.5 0	290.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 3623	杭可科 技	2022- 05-16	475,4 56.00	9,200.00	7	2.5 0	231.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 3625	思瑞浦	2022- 05-16	1,191 ,264. 00	2,400.00	7	2.5 0	579.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 3627	南微医 学	2022- 05-16	171,5 40.00	1,800.00	7	2.5 0	83.39	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 3629	凯赛生 物	2022- 05-16	921,3 10.00	9,500.00	7	2.5 0	447.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 3631	柏楚电 子	2022- 05-16	637,6 06.00	2,300.00	7	2.5 0	309.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 3633	圣湘生 物	2022- 05-16	402,2 20.00	9,100.00	7	2.5 0	195.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1459	光威复 材	2022- 05-19	375,9 04.00	6,800.00	7	2.5 0	182.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1461	普利制 药	2022- 05-19	156,1 36.00	5,800.00	7	2.5 0	75.90	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1463	寒锐钻 业	2022- 05-19	227,8 50.00	4,200.00	7	2.5 0	110.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519	万孚生 物	2022- 05-19	278,1 88.00	6,800.00	7	2.5 0	135.2 3	0.00	0.00

	0004 1465									
广发证 券	2022 0519 0004 1467	光环新 网	2022- 05-19	267,5 82.00	27,700.00	7	2.5 0	130.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1469	昆仑万 维	2022- 05-19	310,5 92.00	21,100.00	7	2.5 0	150.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1471	掌趣科 技	2022- 05-19	183,6 18.00	60,600.00	7	2.5 0	89.26	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1473	中际旭 创	2022- 05-19	383,5 14.00	12,300.00	7	2.5 0	186.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1475	我武生 物	2022- 05-19	294,6 30.00	6,900.00	7	2.5 0	143.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1477	利亚德	2022- 05-19	276,4 16.00	44,800.00	7	2.5 0	134.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1479	国瓷材 料	2022- 05-19	587,2 86.00	17,700.00	7	2.5 0	285.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1481	华宇软 件	2022- 05-19	124,9 89.00	18,300.00	7	2.5 0	60.76	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1483	开山股 份	2022- 05-19	105,1 05.00	7,700.00	7	2.5 0	51.09	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1485	光线传 媒	2022- 05-19	184,4 08.00	25,900.00	7	2.5 0	89.64	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004	迪安诊 断	2022- 05-19	310,7 52.00	9,600.00	7	2.5 0	151.0 6	0.00	0.00

	1487									
广发证 券	2022 0519 0004 1489	卫宁健 康	2022- 05-19	311,7 79.00	37,700.00	7	2.5 0	151.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1491	易华录	2022- 05-19	127,5 71.00	8,300.00	7	2.5 0	62.01	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1493	捷成股 份	2022- 05-19	222,4 60.00	45,400.00	7	2.5 0	108.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1495	汤臣倍 健	2022- 05-19	356,4 22.00	18,700.00	7	2.5 0	173.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3281	华策影 视	2022- 05-19	108,1 08.00	25,200.00	7	2.5 0	52.55	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3283	万达信 息	2022- 05-19	219,5 01.00	26,100.00	7	2.5 0	106.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3285	海新能 科	2022- 05-19	144,6 15.00	31,100.00	7	2.5 0	70.30	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3287	长盈精 密	2022- 05-19	156,6 95.00	18,500.00	7	2.5 0	76.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3289	东方国 信	2022- 05-19	152,5 46.00	17,800.00	7	2.5 0	74.15	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3291	碧水源	2022- 05-19	230,4 00.00	48,000.00	7	2.5 0	112.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3293	长信科 技	2022- 05-19	359,7 65.00	54,100.00	7	2.5 0	174.8 9	0.00	0.00

广发证 券	2022 0519 0004 3295	蓝色光 标	2022- 05-19	318,3 88.00	54,800.00	7	2.5 0	154.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3297	新宙邦	2022- 05-19	269,1 36.00	6,300.00	7	2.5 0	130.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3299	网宿科 技	2022- 05-19	150,5 28.00	29,400.00	7	2.5 0	73.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3301	机器人	2022- 05-19	214,5 00.00	27,500.00	7	2.5 0	104.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3303	红日药 业	2022- 05-19	122,2 20.00	21,000.00	7	2.5 0	59.41	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3305	安科生 物	2022- 05-19	227,3 04.00	25,200.00	7	2.5 0	110.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 3307	特锐德	2022- 05-19	204,5 41.00	13,700.00	7	2.5 0	99.43	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0005 2663	迈克生 物	2022- 05-19	110,0 94.00	5,900.00	7	2.5 0	53.52	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0005 2665	南微医 学	2022- 05-19	109,5 60.00	1,200.00	7	2.5 0	53.26	0.00	0.00
广发证 券	2022 0523 0000 7193	柏楚电 子	2022- 05-23	650,0 72.00	2,300.00	7	2.5 0	316.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0523 0000 7955	圣湘生 物	2022- 05-23	465,9 20.00	9,100.00	7	2.5 0	226.4 9	0.00	0.00
广发证	2022	南微医	2022-	185,9	1,800.00	7	2.5	90.41	0.00	0.00

券	0523 0000 7959	学	05-23	94.00			0			
广发证 券	2022 0523 0000 7961	杭可科 技	2022- 05-23	525,4 12.00	9,200.00	7	2.5 0	255.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8678	特锐德	2022- 05-26	159,8 83.00	10,100.00	7	2.5 0	77.72	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8680	海新能 科	2022- 05-26	101,4 20.00	22,000.00	7	2.5 0	49.30	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8682	万达信 息	2022- 05-26	156,2 28.00	18,800.00	7	2.5 0	75.94	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8684	普利制 药	2022- 05-26	110,3 72.00	4,100.00	7	2.5 0	53.65	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8686	寒锐钴 业	2022- 05-26	222,6 00.00	4,200.00	7	2.5 0	108.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8688	安科生 物	2022- 05-26	157,6 99.00	17,900.00	7	2.5 0	76.66	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8690	中际旭 创	2022- 05-26	268,4 82.00	8,700.00	7	2.5 0	130.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8692	利亚德	2022- 05-26	194,8 80.00	32,000.00	7	2.5 0	94.73	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8694	长信科 技	2022- 05-26	245,5 28.00	37,600.00	7	2.5 0	119.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526	光线传 媒	2022- 05-26	140,6 16.00	18,600.00	7	2.5 0	68.36	0.00	0.00

	0000 8696									
广发证 券	2022 0526 0000 8698	我武生 物	2022- 05-26	213,3 04.00	5,200.00	7	2.5 0	103.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8700	红日药 业	2022- 05-26	118,8 60.00	21,000.00	7	2.5 0	57.78	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8702	网宿科 技	2022- 05-26	89,56 2.00	17,700.00	7	2.5 0	43.54	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8706	汤臣倍 健	2022- 05-26	251,7 24.00	13,200.00	7	2.5 0	122.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8708	万孚生 物	2022- 05-26	195,9 50.00	5,000.00	7	2.5 0	95.25	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8712	光环新 网	2022- 05-26	182,4 10.00	18,500.00	7	2.5 0	88.67	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8716	迈克生 物	2022- 05-26	110,6 25.00	5,900.00	7	2.5 0	53.78	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8718	卫宁健 康	2022- 05-26	225,3 88.00	26,800.00	7	2.5 0	109.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8720	昆仑万 维	2022- 05-26	200,7 90.00	13,800.00	7	2.5 0	97.61	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8726	迪安诊 断	2022- 05-26	187,2 60.00	6,000.00	7	2.5 0	91.03	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000	光威复 材	2022- 05-26	268,4 00.00	5,000.00	7	2.5 0	130.4 7	0.00	0.00

	8728									
广发证 券	2022 0526 0000 8730	蓝色光 标	2022- 05-26	245,7 60.00	38,400.00	7	2.5 0	119.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8732	易华录	2022- 05-26	105,4 68.00	6,600.00	7	2.5 0	51.27	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8734	新宙邦	2022- 05-26	248,7 24.00	6,300.00	7	2.5 0	120.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8736	碧水源	2022- 05-26	160,5 06.00	33,300.00	7	2.5 0	78.02	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8738	长盈精 密	2022- 05-26	111,0 20.00	13,000.00	7	2.5 0	53.97	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8740	机器人	2022- 05-26	145,1 76.00	18,400.00	7	2.5 0	70.57	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8742	南微医 学	2022- 05-26	113,8 20.00	1,200.00	7	2.5 0	55.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 8744	国瓷材 料	2022- 05-26	394,3 04.00	12,200.00	7	2.5 0	191.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 3940	圣湘生 物	2022- 05-30	431,4 31.00	9,100.00	7	2.5 0	209.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 3942	柏楚电 子	2022- 05-30	486,2 66.00	2,300.00	7	2.5 0	236.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 3944	南微医 学	2022- 05-30	171,6 30.00	1,800.00	7	2.5 0	83.43	0.00	0.00

广发证 券	2022 0530 0000 3946	杭可科 技	2022- 05-30	516,1 20.00	9,200.00	7	2.5 0	250.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6284	利亚德	2022- 06-02	204,4 80.00	32,000.00	7	2.5 0	99.40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6290	网宿科 技	2022- 06-02	89,43 6.00	17,400.00	7	2.5 0	43.48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6292	蓝色光 标	2022- 06-02	234,2 40.00	38,400.00	7	2.5 0	113.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6300	我武生 物	2022- 06-02	238,4 20.00	5,200.00	7	2.5 0	115.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6302	红日药 业	2022- 06-02	113,8 20.00	21,000.00	7	2.5 0	55.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6308	新宙邦	2022- 06-02	262,0 17.00	6,300.00	7	2.5 0	127.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6312	长信科 技	2022- 06-02	265,8 32.00	37,600.00	7	2.5 0	129.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6316	光威复 材	2022- 06-02	282,9 50.00	5,000.00	7	2.5 0	137.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6318	碧水源	2022- 06-02	161,5 05.00	33,300.00	7	2.5 0	78.51	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6324	特锐德	2022- 06-02	167,9 63.00	10,100.00	7	2.5 0	81.65	0.00	0.00
广发证	2022	汤臣倍	2022-	260,0	13,200.00	7	2.5	126.4	0.00	0.00

券	0602 0001 6330	健	06-02	40.00			0	1		
广发证 券	2022 0602 0001 6334	光线传 媒	2022- 06-02	149,1 72.00	18,600.00	7	2.5 0	72.51	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6338	普利制 药	2022- 06-02	111,2 74.00	4,100.00	7	2.5 0	54.09	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6340	寒锐钻 业	2022- 06-02	231,6 72.00	4,200.00	7	2.5 0	112.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6346	迪安诊 断	2022- 06-02	176,0 40.00	6,000.00	7	2.5 0	85.58	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6348	南微医 学	2022- 06-02	134,4 00.00	1,200.00	7	2.5 0	65.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6354	迈克生 物	2022- 06-02	113,2 21.00	5,900.00	7	2.5 0	55.04	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6356	卫宁健 康	2022- 06-02	229,4 08.00	26,800.00	7	2.5 0	111.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6362	机器人	2022- 06-02	154,7 44.00	18,400.00	7	2.5 0	75.22	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6370	安科生 物	2022- 06-02	159,6 68.00	17,900.00	7	2.5 0	77.62	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6374	海新能 科	2022- 06-02	103,8 40.00	22,000.00	7	2.5 0	50.48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602	光环新 网	2022- 06-02	185,3 70.00	18,500.00	7	2.5 0	90.11	0.00	0.00

	0001 6376									
广发证 券	2022 0602 0001 6380	昆仑万 维	2022- 06-02	206,0 34.00	13,800.00	7	2.5 0	100.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6384	中际旭 创	2022- 06-02	288,5 79.00	8,700.00	7	2.5 0	140.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 6388	万孚生 物	2022- 06-02	195,1 50.00	5,000.00	7	2.5 0	94.86	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 7044	国瓷材 料	2022- 06-02	439,2 00.00	12,200.00	7	2.5 0	213.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 7050	长盈精 密	2022- 06-02	129,6 10.00	13,000.00	7	2.5 0	63.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 9330	万达信 息	2022- 06-02	167,8 84.00	18,800.00	7	2.5 0	81.61	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 9334	易华录	2022- 06-02	107,3 15.00	6,500.00	7	2.5 0	52.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 1876	柏楚电 子	2022- 06-06	522,5 14.00	2,300.00	7	2.5 0	254.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 1880	杭可科 技	2022- 06-06	597,2 40.00	9,000.00	7	2.5 0	290.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 3176	圣湘生 物	2022- 06-06	301,9 38.00	9,100.00	7	2.5 0	146.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001	南微医 学	2022- 06-06	209,3 40.00	1,800.00	7	2.5 0	101.7 6	0.00	0.00

	3182									
广发证 券	2022 0609 0000 5481	特锐德	2022- 06-09	162,9 13.00	10,100.00	7	2.5 0	79.19	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5497	易华录	2022- 06-09	102,4 38.00	6,300.00	7	2.5 0	49.80	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5501	利亚德	2022- 06-09	196,1 60.00	32,000.00	7	2.5 0	95.36	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5511	光环新 网	2022- 06-09	182,2 25.00	18,500.00	7	2.5 0	88.58	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5531	安科生 物	2022- 06-09	160,5 63.00	17,900.00	7	2.5 0	78.05	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5541	国瓷材 料	2022- 06-09	456,2 80.00	12,200.00	7	2.5 0	221.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5583	网宿科 技	2022- 06-09	67,80 4.00	13,400.00	7	2.5 0	32.96	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5693	寒锐钴 业	2022- 06-09	211,1 28.00	3,800.00	7	2.5 0	102.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5707	迈克生 物	2022- 06-09	109,7 40.00	5,900.00	7	2.5 0	53.35	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5711	碧水源	2022- 06-09	159,1 74.00	33,300.00	7	2.5 0	77.38	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5729	汤臣倍 健	2022- 06-09	257,9 28.00	13,200.00	7	2.5 0	125.3 8	0.00	0.00

广发证 券	2022 0609 0000 5811	光线传 媒	2022- 06-09	161,8 20.00	18,600.00	7	2.5 0	78.66	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 5819	新宙邦	2022- 06-09	268,0 02.00	6,300.00	7	2.5 0	130.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 7953	迪安诊 断	2022- 06-09	174,5 40.00	6,000.00	7	2.5 0	84.85	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8209	我武生 物	2022- 06-09	235,5 60.00	5,200.00	7	2.5 0	114.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8213	红日药 业	2022- 06-09	122,2 20.00	21,000.00	7	2.5 0	59.41	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8215	长盈精 密	2022- 06-09	121,1 60.00	13,000.00	7	2.5 0	58.90	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8225	蓝色光 标	2022- 06-09	239,6 16.00	38,400.00	7	2.5 0	116.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8251	万达信 息	2022- 06-09	171,2 68.00	18,800.00	7	2.5 0	83.26	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8253	卫宁健 康	2022- 06-09	226,1 92.00	26,800.00	7	2.5 0	109.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8261	机器人	2022- 06-09	149,0 40.00	18,400.00	7	2.5 0	72.45	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8289	光威复 材	2022- 06-09	274,5 50.00	5,000.00	7	2.5 0	133.4 6	0.00	0.00
广发证	2022	南微医	2022-	140,2	1,200.00	7	2.5	68.20	0.00	0.00

券	0609 0000 8293	学	06-09	92.00			0			
广发证 券	2022 0609 0000 8321	昆仑万 维	2022- 06-09	205,4 82.00	13,800.00	7	2.5 0	99.89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8329	长信科 技	2022- 06-09	252,6 72.00	37,600.00	7	2.5 0	122.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0001 0457	海新能 科	2022- 06-09	100,7 60.00	22,000.00	7	2.5 0	48.98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0001 0461	普利制 药	2022- 06-09	109,8 80.00	4,100.00	7	2.5 0	53.41	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0001 9711	杭可科 技	2022- 06-13	647,1 00.00	9,000.00	7	2.5 0	314.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0001 9897	圣湘生 物	2022- 06-13	285,6 49.00	9,100.00	7	2.5 0	138.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 0857	南微医 学	2022- 06-13	137,7 34.00	1,700.00	7	2.5 0	66.95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 1255	柏楚电 子	2022- 06-13	482,4 48.00	2,300.00	7	2.5 0	234.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0000 0766	万孚生 物	2022- 12-07	436,4 03.00	9,700.00	14	2.5 0	424.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0000 0768	易华录	2022- 12-07	325,8 50.00	13,300.00	14	2.5 0	316.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1221	万孚生 物	2022- 12-21	354,1 47.00	9,700.00	14	2.5 0	245.9 4	309,139.00	245.94

	0002 0885									
广发证 券	2022 1221 0002 0887	易华录	2022- 12-21	263,7 39.00	13,300.00	14	2.5 0	183.1 5	271,453.00	183.15
广发证 券	2022 1228 0000 1490	纳微科 技	2022- 12-28	646,6 00.00	12,200.00	14	3.2 0	172.4 3	631,594.00	172.43
广发证 券	2022 1228 0000 1494	复旦微 电	2022- 12-28	1,426 ,698. 00	20,100.00	14	3.2 0	380.4 5	1,403,181.0 0	380.45
广发证 券	2022 1228 0000 1501	派能科 技	2022- 12-28	2,175 ,600. 00	7,000.00	14	3.2 0	580.1 6	2,209,550.0 0	580.16
广发证 券	2022 1228 0000 1506	固德威	2022- 12-28	1,039 ,500. 00	3,300.00	14	3.2 0	277.2 0	1,066,197.0 0	277.20
广发证 券	2022 1228 0000 1550	万达信 息	2022- 12-28	760,2 64.00	90,400.00	14	3.2 0	202.7 4	762,072.00	202.74
广发证 券	2022 1228 0000 1572	星源材 质	2022- 12-28	1,696 ,500. 00	78,000.00	14	3.2 0	452.4 0	1,658,280.0 0	452.40
广发证 券	2022 1228 0000 1648	易事特	2022- 12-28	463,0 38.00	67,400.00	14	3.2 0	123.4 8	460,342.00	123.48
广发证 券	2022 1228 0000 1850	杭可科 技	2022- 12-28	408,9 40.00	9,200.00	14	3.2 0	109.0 5	402,684.00	109.05
广发证 券	2022 1228 0000 1956	易华录	2022- 12-28	221,8 70.00	11,000.00	14	3.2 0	59.17	224,510.00	59.17
广发证 券	2022 1228 0000	捷佳伟 创	2022- 12-28	1,007 ,688. 00	8,800.00	14	3.2 0	268.7 2	1,003,376.0 0	268.72

	2042									
广发证 券	2022 1229 0000 1004	光线传 媒	2022- 12-29	272,9 60.00	32,000.00	14	3.2 0	48.53	277,120.00	48.53

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,139,713,885.00	72.9480%	1,355,824,540.00	76.7753%
广发证券股份有限公司	6,676,954.00	0.2276%	1,714,451.00	0.0971%

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	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021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	65,370,997.76	222,580.34	49,287,676.08	143,162.16

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下 发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下 发行	2,849	102,507.02
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下 发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下 发行	488	10,677.44
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下 发行	12,000	109,920.00
上年度可比期间 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
广发证券股份有限公司	301038	深水规院	新股网下 发行	2,660	17,768.80
广发证券股份有限公司	605090	九丰能源	新股网下 发行	1,090	37,681.30

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（2022 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	受限期	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
301132	满坤科技	2022-08-03	6 个月	新股流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新股流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新股流通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022-06-30	6 个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6 个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6 个月	新股流通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301276	嘉曼	2022-09-01	6 个月	新股	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-

	服饰			流通受限						
301277	新天地	2022-11-09	6 个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6 个月	新股流通受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6 个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6 个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6 个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301297	富乐德	2022-12-23	6 个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6 个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6 个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-

301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022-09-02	6 个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301359	东南电子	2022-11-02	6 个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022-11-08	6 个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6 个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新股流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688376	美埃科技	2022-11-10	6 个月	新股流通受限	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-

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
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	2023-01-10	56.88	60,600	3,627,259.96	3,228,768.00	-
600038	中直股份	2022-12-26	重大事项停牌	46.41	2023-01-10	51.05	89,300	4,378,242.48	4,144,413.00	-

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 2022 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 2022 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	000027	深圳能源	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	6.36	116,200.00	739,032.00
2	000031	大悦城	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	3.76	78,500.00	295,160.00
3	000050	深天马 A	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	8.66	74,800.00	647,768.00
4	000062	深圳华强	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	12.21	23,900.00	291,819.00
5	000089	深圳机场	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	7.86	62,400.00	490,464.00
6	000156	华数传媒	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.49	10,000.00	74,900.00
7	000400	许继电气	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	19.97	49,400.00	986,518.00
8	000513	丽珠集团	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	32.48	22,900.00	743,792.00
9	000537	广宇发展	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	13.23	42,500.00	562,275.00
10	000553	安道麦 A	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	9.05	26,500.00	239,825.00
11	000559	万向钱潮	2023 年 1 月 11 日	4.87	80,700.00	393,009.00

			-2023 年 1 月 12 日			
12	000563	陕国投 A	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	3.03	121,100.00	366,933.00
13	000591	太阳能	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.33	178,500.00	1,308,405.00
14	000629	钒钛股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	4.73	36,900.00	174,537.00
15	000630	铜陵有色	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	3.12	450,300.00	1,404,936.00
16	000636	风华高科	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	14.83	44,600.00	661,418.00
17	000656	金科股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	1.91	261,100.00	498,701.00
18	000729	燕京啤酒	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	10.62	86,100.00	914,382.00
19	000739	普洛药业	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	21.54	13,100.00	282,174.00
20	000831	中国稀土	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	32.88	44,800.00	1,473,024.00
21	000878	云南铜业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	11.75	73,400.00	862,450.00
22	000883	湖北能源	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	4.20	120,000.00	504,000.00
23	000887	中鼎股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	14.47	48,300.00	698,901.00
24	000937	冀中能源	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	6.36	64,800.00	412,128.00
25	000961	中南建设	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	2.19	145,600.00	318,864.00
26	000970	中科三环	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	13.64	74,000.00	1,009,360.00
27	000975	银泰黄金	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	11.04	59,100.00	652,464.00
28	000990	诚志股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	8.80	30,400.00	267,520.00
29	000997	新大陆	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	13.01	10,000.00	130,100.00
30	000998	隆平高科	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	16.07	64,400.00	1,034,908.00
31	000999	华润三九	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	46.81	20,000.00	936,200.00
32	001872	招商港口	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	14.36	10,600.00	152,216.00
33	001914	招商积余	2023 年 1 月 11 日	15.38	32,200.00	495,236.00

			-2023 年 1 月 11 日			
34	002002	鸿达兴业	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	3.24	62,600.00	202,824.00
35	002019	亿帆医药	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	12.25	44,700.00	547,575.00
36	002028	思源电气	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	38.22	37,400.00	1,429,428.00
37	002030	达安基因	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	15.56	48,500.00	754,660.00
38	002048	宁波华翔	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	13.90	10,000.00	139,000.00
39	002078	太阳纸业	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	11.52	98,500.00	1,134,720.00
40	002092	中泰化学	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.46	153,800.00	1,147,348.00
41	002124	天邦食品	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	6.11	32,600.00	199,186.00
42	002131	利欧股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	1.77	128,800.00	227,976.00
43	002152	广电运通	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	9.94	75,800.00	753,452.00
44	002155	湖南黄金	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	12.95	51,400.00	665,630.00
45	002156	通富微电	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	16.48	69,100.00	1,138,768.00
46	002183	怡亚通	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	6.43	110,000.00	707,300.00
47	002185	华天科技	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	8.29	10,000.00	82,900.00
48	002191	劲嘉股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.23	78,300.00	566,109.00
49	002195	二三四五	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	2.01	349,900.00	703,299.00
50	002203	海亮股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	11.30	39,600.00	447,480.00
51	002212	天融信	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	9.99	67,500.00	674,325.00
52	002221	东华能源	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	7.63	33,800.00	257,894.00
53	002223	鱼跃医疗	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	31.86	36,600.00	1,166,076.00
54	002281	光迅科技	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	15.72	25,600.00	402,432.00
55	002294	信立泰	2023 年 1 月 11 日	32.85	27,600.00	906,660.00

			-2023 年 1 月 12 日			
56	002299	圣农发展	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	23.69	15,000.00	355,350.00
57	002326	永太科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	21.83	46,700.00	1,019,461.00
58	002340	格林美	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	7.43	313,900.00	2,332,277.00
59	002353	杰瑞股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	27.91	36,200.00	1,010,342.00
60	002368	太极股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	28.13	30,800.00	866,404.00
61	002385	大北农	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	8.90	230,400.00	2,050,560.00
62	002396	星网锐捷	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	19.16	10,000.00	191,600.00
63	002408	齐翔腾达	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	7.04	104,200.00	733,568.00
64	002422	科伦药业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	26.61	86,300.00	2,296,443.00
65	002430	杭氧股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	39.36	24,000.00	944,640.00
66	002434	万里扬	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	8.05	59,500.00	478,975.00
67	002439	启明星辰	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	26.08	38,800.00	1,011,904.00
68	002444	巨星科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	18.98	54,900.00	1,042,002.00
69	002468	申通快递	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	10.33	46,800.00	483,444.00
70	002497	雅化集团	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	23.25	70,400.00	1,636,800.00
71	002505	鹏都农牧	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	2.58	117,500.00	303,150.00
72	002506	协鑫集成	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	2.91	36,000.00	104,760.00
73	002507	涪陵榨菜	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 12 日	25.77	37,900.00	976,683.00
74	002508	老板电器	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	27.76	24,400.00	677,344.00
75	002511	中顺洁柔	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	13.74	34,700.00	476,778.00
76	002531	天顺风能	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	15.13	68,600.00	1,037,918.00
77	002532	天山铝业	2023 年 1 月 13 日	7.72	51,400.00	396,808.00

			-2023 年 1 月 13 日			
78	002563	森马服饰	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	5.24	49,400.00	258,856.00
79	002572	索菲亚	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	18.16	35,400.00	642,864.00
80	002603	以岭药业	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	29.96	63,500.00	1,902,460.00
81	002624	完美世界	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	12.72	83,000.00	1,055,760.00
82	002625	光启技术	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	17.02	43,700.00	743,774.00
83	002701	奥瑞金	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	5.05	22,000.00	111,100.00
84	002705	新宝股份	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	16.65	16,200.00	269,730.00
85	002738	中矿资源	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	66.66	20,000.00	1,333,200.00
86	002739	万达电影	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	14.00	66,600.00	932,400.00
87	002745	木林森	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	8.11	54,400.00	441,184.00
88	002831	裕同科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	33.07	20,000.00	661,400.00
89	002936	郑州银行	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	2.35	391,400.00	919,790.00
90	002939	长城证券	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	8.28	73,900.00	611,892.00
91	002948	青岛银行	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	3.36	107,800.00	362,208.00
92	002958	青农商行	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	2.89	237,700.00	686,953.00
93	003035	南网能源	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	5.67	26,000.00	147,420.00
94	300003	乐普医疗	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	22.97	80,400.00	1,846,788.00
95	300024	机器人	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	8.98	94,400.00	847,712.00
96	300026	红日药业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	5.68	160,000.00	908,800.00
97	300058	蓝色光标	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	5.05	137,100.00	692,355.00
98	300073	当升科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	56.40	12,700.00	716,280.00
99	300088	长信科技	2023 年 1 月 12 日	5.97	149,400.00	891,918.00

			-2023 年 1 月 12 日			
100	300115	长盈精密	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	10.33	51,200.00	528,896.00
101	300168	万达信息	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	8.43	90,400.00	762,072.00
102	300182	捷成股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	4.47	125,900.00	562,773.00
103	300212	易华录	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	20.41	30,400.00	620,464.00
104	300251	光线传媒	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	8.66	33,100.00	286,646.00
105	300257	开山股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	15.00	30,200.00	453,000.00
106	300296	利亚德	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	5.66	123,200.00	697,312.00
107	300308	中际旭创	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	27.03	34,200.00	924,426.00
108	300357	我武生物	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	55.10	10,200.00	562,020.00
109	300373	扬杰科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	52.60	18,000.00	946,800.00
110	300376	易事特	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 11 日	6.83	88,300.00	603,089.00
111	300390	天华超净	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	55.88	24,200.00	1,352,296.00
112	300463	迈克生物	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	17.30	26,100.00	451,530.00
113	300482	万孚生物	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	31.87	20,300.00	646,961.00
114	300568	星源材质	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	21.26	78,000.00	1,658,280.00
115	300618	寒锐钴业	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	40.05	1,100.00	44,055.00
116	300630	普利制药	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	24.66	19,700.00	485,802.00
117	300677	英科医疗	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	21.03	20,500.00	431,115.00
118	300682	朗新科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	21.98	40,400.00	887,992.00
119	300699	光威复材	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	72.25	12,200.00	881,450.00
120	300724	捷佳伟创	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	114.02	21,200.00	2,417,224.00
121	300776	帝尔激光	2023 年 1 月 10 日	126.0	1,600.00	201,600.00

			-2023 年 1 月 10 日	0		
122	300866	安克创新	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	59.27	1,900.00	112,613.00
123	300888	稳健医疗	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	71.50	7,800.00	557,700.00
124	301029	怡合达	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 12 日	65.74	5,800.00	381,292.00
125	600006	东风汽车	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	5.58	48,700.00	271,746.00
126	600008	首创环保	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	2.83	248,000.00	701,840.00
127	600021	上海电力	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	10.01	68,600.00	686,686.00
128	600026	中远海能	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	12.05	103,300.00	1,244,765.00
129	600056	中国医药	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	17.23	56,800.00	978,664.00
130	600062	华润双鹤	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	17.89	31,700.00	567,113.00
131	600066	宇通客车	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	7.51	14,800.00	111,148.00
132	600079	人福医药	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	23.89	69,600.00	1,662,744.00
133	600095	湘财股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.56	65,200.00	492,912.00
134	600109	国金证券	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	8.70	12,000.00	104,400.00
135	600118	中国卫星	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	21.55	36,000.00	775,800.00
136	600143	金发科技	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	9.69	11,500.00	111,435.00
137	600155	华创阳安	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	6.50	86,000.00	559,000.00
138	600161	天坛生物	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	23.73	34,200.00	811,566.00
139	600166	福田汽车	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	2.81	359,700.00	1,010,757.00
140	600171	上海贝岭	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	17.43	34,700.00	604,821.00
141	600177	雅戈尔	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	6.33	169,200.00	1,071,036.00
142	600258	首旅酒店	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	24.80	51,000.00	1,264,800.00
143	600299	安迪苏	2023 年 1 月 11 日	8.26	15,700.00	129,682.00

			-2023 年 1 月 11 日			
144	600315	上海家化	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	31.85	25,800.00	821,730.00
145	600316	洪都航空	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	25.19	24,400.00	614,636.00
146	600329	达仁堂	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	29.10	21,800.00	634,380.00
147	600339	中油工程	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	2.98	76,800.00	228,864.00
148	600352	浙江龙盛	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	9.90	20,000.00	198,000.00
149	600372	中航电子	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	15.97	54,600.00	871,962.00
150	600376	首开股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	5.69	37,700.00	214,513.00
151	600378	昊华科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	42.91	10,000.00	429,100.00
152	600380	健康元	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	11.29	88,000.00	993,520.00
153	600390	五矿资本	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	5.08	52,000.00	264,160.00
154	600392	盛和资源	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	14.00	85,400.00	1,195,600.00
155	600409	三友化工	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	6.61	75,400.00	498,394.00
156	600415	小商品城	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	5.24	208,800.00	1,094,112.00
157	600418	江淮汽车	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	13.13	86,800.00	1,139,684.00
158	600435	北方导航	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	11.60	63,500.00	736,600.00
159	600487	亨通光电	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	15.06	11,700.00	176,202.00
160	600500	中化国际	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	6.61	87,500.00	578,375.00
161	600507	方大特钢	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	6.02	10,000.00	60,200.00
162	600511	国药股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	27.90	22,900.00	638,910.00
163	600516	方大炭素	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	6.12	173,800.00	1,063,656.00
164	600521	华海药业	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	21.86	45,300.00	990,258.00
165	600528	中铁工业	2023 年 1 月 12 日	7.63	23,800.00	181,594.00

			-2023 年 1 月 12 日			
166	600529	山东药玻	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	28.40	32,300.00	917,320.00
167	600535	天士力	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	10.76	54,800.00	589,648.00
168	600536	中国软件	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	58.33	30,100.00	1,755,733.00
169	600546	山煤国际	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 11 日	14.49	75,400.00	1,092,546.00
170	600556	天下秀	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	6.74	68,800.00	463,712.00
171	600566	济川药业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	27.22	28,000.00	762,160.00
172	600567	山鹰国际	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	2.48	245,900.00	609,832.00
173	600580	卧龙电驱	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	12.46	53,600.00	667,856.00
174	600582	天地科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	5.20	91,400.00	475,280.00
175	600623	华谊集团	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	6.32	16,700.00	105,544.00
176	600648	外高桥	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	11.95	22,700.00	271,265.00
177	600655	豫园股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	7.61	78,300.00	595,863.00
178	600663	陆家嘴	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 13 日	9.74	68,200.00	664,268.00
179	600673	东阳光	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	8.69	91,800.00	797,742.00
180	600705	中航产融	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	3.28	23,200.00	76,096.00
181	600707	彩虹股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	4.14	109,200.00	452,088.00
182	600728	佳都科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	5.28	107,100.00	565,488.00
183	600737	中粮糖业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	6.94	65,100.00	451,794.00
184	600739	辽宁成大	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	12.59	65,200.00	820,868.00
185	600755	厦门国贸	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	7.14	10,000.00	71,400.00
186	600801	华新水泥	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	14.82	10,000.00	148,200.00
187	600839	四川长虹	2023 年 1 月 13 日	2.64	117,000.00	308,880.00

			-2023 年 1 月 13 日			
188	600859	王府井	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	28.14	54,000.00	1,519,560.00
189	600871	石化油服	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	1.98	247,900.00	490,842.00
190	600906	财达证券	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	7.57	79,000.00	598,030.00
191	600917	重庆燃气	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.96	23,900.00	190,244.00
192	600970	中材国际	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	8.52	15,600.00	132,912.00
193	600988	赤峰黄金	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	18.05	81,100.00	1,463,855.00
194	600998	九州通	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	13.04	30,400.00	396,416.00
195	601016	节能风电	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	3.81	238,100.00	907,161.00
196	601058	赛轮轮胎	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	10.02	10,000.00	100,200.00
197	601077	渝农商行	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	3.53	26,700.00	94,251.00
198	601139	深圳燃气	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	6.54	20,000.00	130,800.00
199	601156	东航物流	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	15.26	24,900.00	379,974.00
200	601158	重庆水务	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	5.13	35,000.00	179,550.00
201	601162	天风证券	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	2.87	74,700.00	214,389.00
202	601168	西部矿业	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	10.20	16,500.00	168,300.00
203	601228	广州港	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	3.15	64,300.00	202,545.00
204	601298	青岛港	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	5.61	42,700.00	239,547.00
205	601456	国联证券	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	11.25	10,000.00	112,500.00
206	601607	上海医药	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	17.83	67,600.00	1,205,308.00
207	601611	中国核建	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	7.60	48,400.00	367,840.00
208	601636	旗滨集团	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	11.39	98,400.00	1,120,776.00
209	601699	潞安环能	2023 年 1 月 13 日	16.85	10,000.00	168,500.00

			-2023 年 1 月 13 日			
210	601717	郑煤机	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	11.16	55,500.00	619,380.00
211	601778	晶科科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	5.50	132,200.00	727,100.00
212	601828	美凯龙	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	4.69	66,000.00	309,540.00
213	601866	中远海发	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	2.42	241,500.00	584,430.00
214	601880	辽港股份	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	1.62	39,200.00	63,504.00
215	601928	凤凰传媒	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	7.92	30,100.00	238,392.00
216	601958	金钼股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	11.55	59,100.00	682,605.00
217	601969	海南矿业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.41	46,400.00	343,824.00
218	601990	南京证券	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	7.93	10,000.00	79,300.00
219	603000	人民网	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	16.87	42,000.00	708,540.00
220	603156	养元饮品	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	22.27	12,800.00	285,056.00
221	603218	日月股份	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	20.30	36,000.00	730,800.00
222	603225	新凤鸣	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	10.88	20,100.00	218,688.00
223	603233	大参林	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	39.60	14,500.00	574,200.00
224	603379	三美股份	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	28.46	10,000.00	284,600.00
225	603456	九洲药业	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	42.43	32,300.00	1,370,489.00
226	603517	绝味食品	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	61.09	27,800.00	1,698,302.00
227	603596	伯特利	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	79.80	10,000.00	798,000.00
228	603606	东方电缆	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	67.83	15,200.00	1,031,016.00
229	603613	国联股份	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	88.44	21,200.00	1,874,928.00
230	603638	艾迪精密	2023 年 1 月 13 日 -2023 年 1 月 13 日	14.92	10,000.00	149,200.00
231	603816	顾家家居	2023 年 1 月 12 日	42.71	17,600.00	751,696.00

			-2023 年 1 月 12 日			
232	603858	步长制药	2023 年 1 月 9 日 -2023 年 1 月 11 日	21.01	35,300.00	741,653.00
233	603866	桃李面包	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	15.40	40,600.00	625,240.00
234	603883	老百姓	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	40.47	17,800.00	720,366.00
235	603885	吉祥航空	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	16.18	50,500.00	817,090.00
236	603939	益丰药房	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	63.84	21,900.00	1,398,096.00
237	605358	立昂微	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	42.60	19,400.00	826,440.00
238	688006	杭可科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	43.77	9,200.00	402,684.00
239	688029	南微医学	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	82.13	7,100.00	583,123.00
240	688063	派能科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	315.65	7,000.00	2,209,550.00
241	688088	虹软科技	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	22.51	12,300.00	276,873.00
242	688185	康希诺	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	146.02	1,000.00	146,020.00
243	688188	柏楚电子	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	217.08	2,000.00	434,160.00
244	688301	奕瑞科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	457.88	2,400.00	1,098,912.00
245	688385	复旦微电	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	69.81	20,100.00	1,403,181.00
246	688390	固德威	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	323.09	4,500.00	1,453,905.00
247	688567	孚能科技	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	27.03	5,300.00	143,259.00
248	688690	纳微科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 11 日	51.77	12,200.00	631,594.00
249	688772	珠海冠宇	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 12 日	18.64	6,800.00	126,752.00
合计	-	-	-	-	15,400,100.00	167,142,860.00

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对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 2022 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 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.01%)。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	116,012.55
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	116,012.55

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	上年度末
--------	-----	------

	2022年12月31日	2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2022 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(净资产)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，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 2022 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	65,370,997.76	-	-	-	65,370,997.76
结算备付金	21,624,131.54	-	-	-	21,624,131.54
存出保证金	13,611,095.42	-	-	-	13,611,095.42
交易性金融资产	-	-	-	1,947,211,820.19	1,947,211,820.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,837.50	7,837.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	24,318.19	24,318.19
资产总计	100,606,224.72	-	-	1,947,243,975.88	2,047,850,200.60
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	239,424.77	239,424.77
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	266,907.63	266,907.63
应付托管费	-	-	-	88,969.21	88,969.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,300.81	2,300.81
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	614,944.66	614,944.66
负债总计	-	-	-	1,212,547.08	1,212,547.08
利率敏感度缺口	100,606,224.72	-	-	1,946,031,428.80	2,046,637,653.52
上年度末					
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

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	1,947,211,820.19	95.14	1,416,421,060.91	94.24
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	1,947,211,820.19	95.14	1,416,421,060.91	94.24

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	97,327,089.01	70,681,397.66
2.业绩比较基准下降 5%	-97,327,089.01	-70,681,397.66	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,939,014,824.89	1,410,220,998.31
第二层次	7,373,181.00	6,316,061.84
第三层次	823,814.30	-
合计	1,947,211,820.19	1,416,537,060.15

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	2,639,562.11	2,639,562.11
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,795,403.67	1,795,403.67
当期利得或损失总额	-	-20,344.14	-20,344.14
其中：计入损益的利得或损失	-	-20,344.14	-20,344.14
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	823,814.30	823,814.30
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	83,778.24	83,778.24
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	823,814.30	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,947,211,820.19	95.09
	其中：股票	1,947,211,820.19	95.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	86,995,129.30	4.25
8	其他各项资产	13,643,251.11	0.67
9	合计	2,047,850,200.60	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 167,142,860.00 元，占净值比例 8.17%。

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	18,609,288.57	0.91
B	采矿业	85,444,628.56	4.17
C	制造业	1,184,440,537.33	57.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,095,006.41	3.18
E	建筑业	17,271,947.00	0.84
F	批发和零售业	82,634,138.94	4.04
G	交通运输、仓储和邮政业	43,358,539.90	2.12
H	住宿和餐饮业	5,088,612.80	0.25

I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,565,808.11	6.82
J	金融业	169,336,946.49	8.27
K	房地产业	40,079,016.86	1.96
L	租赁和商务服务业	22,659,656.60	1.11
M	科学研究和技术服务业	21,393,678.25	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	10,916,042.57	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,961,605.20	0.19
R	文化、体育和娱乐业	25,729,005.20	1.26
S	综合	11,627,361.40	0.57
	合计	1,947,211,820.19	95.14

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	1,569,500	11,661,385.00	0.57
2	300012	华测检测	513,700	11,455,510.00	0.56
3	600157	永泰能源	6,789,900	10,388,547.00	0.51
4	002384	东山精密	418,200	10,342,086.00	0.51
5	300724	捷佳伟创	85,200	9,714,504.00	0.47
6	688777	中控技术	106,573	9,680,025.59	0.47
7	603613	国联股份	106,670	9,433,894.80	0.46
8	688122	西部超导	99,622	9,433,207.18	0.46
9	300003	乐普医疗	402,300	9,240,831.00	0.45
10	002422	科伦药业	346,500	9,220,365.00	0.45
11	600487	亨通光电	603,300	9,085,698.00	0.44
12	688063	派能科技	28,550	9,011,807.50	0.44
13	002385	大北农	1,012,500	9,011,250.00	0.44
14	603345	安井食品	54,000	8,741,520.00	0.43
15	002966	苏州银行	1,120,580	8,718,112.40	0.43
16	603606	东方电缆	126,100	8,553,363.00	0.42
17	600885	宏发股份	255,021	8,520,251.61	0.42
18	600765	中航重机	270,048	8,395,792.32	0.41
19	600079	人福医药	349,400	8,347,166.00	0.41
20	600096	云天化	392,700	8,262,408.00	0.40

21	002497	雅化集团	352,293	8,190,812.25	0.40
22	601555	东吴证券	1,224,200	7,994,026.00	0.39
23	600352	浙江龙盛	795,500	7,875,450.00	0.38
24	002625	光启技术	461,000	7,846,220.00	0.38
25	002407	多氟多	234,300	7,806,876.00	0.38
26	002603	以岭药业	255,380	7,651,184.80	0.37
27	000009	中国宝安	630,680	7,624,921.20	0.37
28	601058	赛轮轮胎	748,927	7,504,248.54	0.37
29	002738	中矿资源	112,100	7,472,586.00	0.37
30	601233	桐昆股份	516,000	7,456,200.00	0.36
31	600988	赤峰黄金	406,800	7,342,740.00	0.36
32	688390	固德威	22,598	7,301,187.82	0.36
33	600489	中金黄金	889,000	7,280,910.00	0.36
34	603688	石英股份	55,400	7,275,128.00	0.36
35	603605	珀莱雅	43,320	7,255,233.60	0.35
36	600298	安琪酵母	159,500	7,212,590.00	0.35
37	002028	思源电气	187,350	7,160,517.00	0.35
38	300146	汤臣倍健	311,800	7,115,276.00	0.35
39	601108	财通证券	993,537	7,073,983.44	0.35
40	000807	云铝股份	635,929	7,071,530.48	0.35
41	600536	中国软件	121,080	7,062,596.40	0.35
42	603939	益丰药房	110,260	7,038,998.40	0.34
43	000630	铜陵有色	2,251,800	7,025,616.00	0.34
44	600418	江淮汽车	534,099	7,012,719.87	0.34
45	300144	宋城演艺	479,400	6,999,240.00	0.34
46	300073	当升科技	123,900	6,987,960.00	0.34
47	300037	新宙邦	158,980	6,910,860.60	0.34
48	600141	兴发集团	237,988	6,901,652.00	0.34
49	600399	抚顺特钢	482,100	6,898,851.00	0.34
50	300699	光威复材	95,100	6,870,975.00	0.34
51	600859	王府井	242,951	6,836,641.14	0.33
52	603517	绝味食品	111,600	6,817,644.00	0.33
53	300285	国瓷材料	245,600	6,771,192.00	0.33
54	300390	天华超净	121,100	6,767,068.00	0.33
55	601077	渝农商行	1,892,000	6,678,760.00	0.33
56	300568	星源材质	313,100	6,656,506.00	0.33
57	600873	梅花生物	650,900	6,626,162.00	0.32
58	600563	法拉电子	41,342	6,609,758.96	0.32
59	002185	华天科技	783,600	6,496,044.00	0.32
60	603456	九洲药业	153,100	6,496,033.00	0.32
61	002138	顺络电子	246,600	6,455,988.00	0.32
62	603816	顾家家居	150,900	6,444,939.00	0.31
63	600160	巨化股份	412,460	6,397,254.60	0.31
64	603589	口子窖	110,049	6,346,525.83	0.31

65	601128	常熟银行	837,660	6,324,333.00	0.31
66	000783	长江证券	1,183,100	6,305,923.00	0.31
67	688099	晶晨股份	88,901	6,268,409.51	0.31
68	600153	建发股份	459,200	6,268,080.00	0.31
69	002192	融捷股份	63,600	6,226,440.00	0.30
70	000629	钒钛股份	1,314,400	6,217,112.00	0.30
71	605358	立昂微	145,000	6,177,000.00	0.30
72	300357	我武生物	112,050	6,173,955.00	0.30
73	601699	潞安环能	365,700	6,162,045.00	0.30
74	601162	天风证券	2,118,700	6,080,669.00	0.30
75	000683	远兴能源	774,700	6,073,648.00	0.30
76	601607	上海医药	339,621	6,055,442.43	0.30
77	603596	伯特利	75,300	6,008,940.00	0.29
78	688567	孚能科技	222,114	6,003,741.42	0.29
79	600392	盛和资源	428,683	6,001,562.00	0.29
80	002568	百润股份	160,600	6,000,016.00	0.29
81	600161	天坛生物	251,900	5,977,587.00	0.29
82	000932	华菱钢铁	1,266,880	5,954,336.00	0.29
83	600521	华海药业	272,100	5,948,106.00	0.29
84	601168	西部矿业	582,540	5,941,908.00	0.29
85	600109	国金证券	682,800	5,940,360.00	0.29
86	600499	科达制造	417,000	5,925,570.00	0.29
87	600486	扬农化工	57,000	5,922,300.00	0.29
88	000831	中国稀土	179,900	5,915,112.00	0.29
89	600027	华电国际	996,700	5,860,596.00	0.29
90	002223	鱼跃医疗	183,900	5,859,054.00	0.29
91	000975	银泰黄金	525,364	5,800,018.56	0.28
92	002797	第一创业	1,027,400	5,784,262.00	0.28
93	603077	和邦生物	1,889,390	5,743,745.60	0.28
94	600862	中航高科	255,520	5,695,540.80	0.28
95	002078	太阳纸业	492,620	5,674,982.40	0.28
96	688385	复旦微电	81,119	5,662,917.39	0.28
97	000999	华润三九	120,820	5,655,584.20	0.28
98	601636	旗滨集团	492,000	5,603,880.00	0.27
99	002294	信立泰	170,400	5,597,640.00	0.27
100	601872	招商轮船	993,300	5,552,547.00	0.27
101	002268	卫士通	181,020	5,526,540.60	0.27
102	600497	驰宏锌锗	1,089,200	5,511,352.00	0.27
103	600143	金发科技	568,400	5,507,796.00	0.27
104	002025	航天电器	83,100	5,505,375.00	0.27
105	002532	天山铝业	710,900	5,488,148.00	0.27
106	002299	圣农发展	228,013	5,401,627.97	0.26
107	300253	卫宁健康	525,200	5,399,056.00	0.26
108	601696	中银证券	509,600	5,386,472.00	0.26

109	600177	雅戈尔	848,700	5,372,271.00	0.26
110	601990	南京证券	675,900	5,359,887.00	0.26
111	002439	启明星辰	203,800	5,315,104.00	0.26
112	600705	中航产融	1,619,400	5,311,632.00	0.26
113	002624	完美世界	415,150	5,280,708.00	0.26
114	603737	三棵树	46,200	5,258,946.00	0.26
115	000591	太阳能	716,900	5,254,877.00	0.26
116	600348	华阳股份	367,530	5,237,302.50	0.26
117	000998	隆平高科	322,200	5,177,754.00	0.25
118	000738	航发控制	201,000	5,153,640.00	0.25
119	688301	奕瑞科技	11,213	5,134,208.44	0.25
120	600026	中远海能	424,890	5,119,924.50	0.25
121	600258	首旅酒店	205,186	5,088,612.80	0.25
122	600549	厦门钨业	260,200	5,086,910.00	0.25
123	002850	科达利	42,800	5,085,068.00	0.25
124	000728	国元证券	800,300	5,065,899.00	0.25
125	600482	中国动力	330,302	5,050,317.58	0.25
126	000988	华工科技	307,300	5,042,793.00	0.25
127	000519	中兵红箭	255,450	5,017,038.00	0.25
128	002273	水晶光电	425,147	5,012,483.13	0.24
129	002673	西部证券	819,600	4,991,364.00	0.24
130	300604	长川科技	110,800	4,939,464.00	0.24
131	601997	贵阳银行	894,020	4,908,169.80	0.24
132	002507	涪陵榨菜	189,900	4,893,723.00	0.24
133	300136	信维通信	295,700	4,882,007.00	0.24
134	300832	新产业	96,100	4,818,454.00	0.24
135	300363	博腾股份	116,400	4,754,940.00	0.23
136	002092	中泰化学	635,960	4,744,261.60	0.23
137	002430	杭氧股份	120,400	4,738,944.00	0.23
138	000703	恒逸石化	672,200	4,725,566.00	0.23
139	600325	华发股份	517,779	4,691,077.74	0.23
140	002030	达安基因	300,249	4,671,874.44	0.23
141	002739	万达电影	333,200	4,664,800.00	0.23
142	002056	横店东磁	248,740	4,661,387.60	0.23
143	002557	洽洽食品	93,000	4,650,000.00	0.23
144	300308	中际旭创	171,401	4,632,969.03	0.23
145	600529	山东药玻	162,400	4,612,160.00	0.23
146	603233	大参林	116,040	4,595,184.00	0.22
147	601666	平煤股份	424,700	4,591,007.00	0.22
148	600704	物产中大	952,500	4,581,525.00	0.22
149	000729	燕京啤酒	430,790	4,574,989.80	0.22
150	601198	东兴证券	592,600	4,574,872.00	0.22
151	002465	海格通信	563,400	4,574,808.00	0.22
152	002156	通富微电	277,500	4,573,200.00	0.22

153	601016	节能风电	1,194,865	4,552,435.65	0.22
154	600655	豫园股份	595,800	4,534,038.00	0.22
155	600879	航天电子	664,840	4,520,912.00	0.22
156	300088	长信科技	750,210	4,478,753.70	0.22
157	603658	安图生物	71,810	4,441,448.50	0.22
158	002409	雅克科技	87,300	4,397,301.00	0.21
159	002080	中材科技	205,100	4,395,293.00	0.21
160	600415	小商品城	838,300	4,392,692.00	0.21
161	600546	山煤国际	302,900	4,389,021.00	0.21
162	688116	天奈科技	56,891	4,388,571.74	0.21
163	002353	杰瑞股份	157,050	4,383,265.50	0.21
164	000830	鲁西化工	352,071	4,362,159.69	0.21
165	002683	广东宏大	160,300	4,321,688.00	0.21
166	603267	鸿远电子	42,700	4,319,532.00	0.21
167	000878	云南铜业	367,440	4,317,420.00	0.21
168	000960	锡业股份	305,940	4,313,754.00	0.21
169	000400	许继电气	215,680	4,307,129.60	0.21
170	600516	方大炭素	698,000	4,271,760.00	0.21
171	000623	吉林敖东	284,400	4,263,156.00	0.21
172	600170	上海建工	1,632,800	4,245,280.00	0.21
173	603160	汇顶科技	84,100	4,221,820.00	0.21
174	002444	巨星科技	220,450	4,184,141.00	0.20
175	002531	天顺风能	275,500	4,168,315.00	0.20
176	300418	昆仑万维	289,000	4,164,490.00	0.20
177	600637	东方明珠	626,224	4,164,389.60	0.20
178	300017	网宿科技	745,400	4,159,332.00	0.20
179	601577	长沙银行	614,600	4,154,696.00	0.20
180	002372	伟星新材	194,680	4,154,471.20	0.20
181	600038	中直股份	89,300	4,144,413.00	0.20
182	603444	吉比特	13,222	4,136,370.48	0.20
183	600166	福田汽车	1,467,590	4,123,927.90	0.20
184	300373	扬杰科技	78,400	4,123,840.00	0.20
185	600739	辽宁成大	327,400	4,121,966.00	0.20
186	603712	七一二	118,000	4,120,560.00	0.20
187	600642	申能股份	750,500	4,120,245.00	0.20
188	600699	均胜电子	292,660	4,111,873.00	0.20
189	601456	国联证券	365,100	4,107,375.00	0.20
190	002326	永太科技	187,565	4,094,543.95	0.20
191	002203	海亮股份	360,700	4,075,910.00	0.20
192	688002	睿创微纳	109,317	4,065,499.23	0.20
193	000970	中科三环	297,211	4,053,958.04	0.20
194	002508	老板电器	145,200	4,030,752.00	0.20
195	603127	昭衍新药	68,940	4,026,785.40	0.20
196	000155	川能动力	225,500	4,022,920.00	0.20

197	603026	胜华新材	43,400	4,005,820.00	0.20
198	600673	东阳光	460,580	4,002,440.20	0.20
199	689009	九号公司	131,017	3,994,708.33	0.20
200	600380	健康元	353,600	3,992,144.00	0.20
201	000039	中集集团	562,928	3,963,013.12	0.19
202	600909	华安证券	861,348	3,953,587.32	0.19
203	600056	中国医药	228,610	3,938,950.30	0.19
204	300676	华大基因	76,000	3,928,440.00	0.19
205	600867	通化东宝	426,600	3,916,188.00	0.19
206	600118	中国卫星	180,700	3,894,085.00	0.19
207	600985	淮北矿业	303,300	3,882,240.00	0.19
208	002065	东华软件	685,600	3,880,496.00	0.19
209	000739	普洛药业	180,100	3,879,354.00	0.19
210	000750	国海证券	1,164,830	3,878,883.90	0.19
211	300244	迪安诊断	153,400	3,854,942.00	0.19
212	300058	蓝色光标	761,220	3,844,161.00	0.19
213	600008	首创环保	1,346,100	3,809,463.00	0.19
214	600369	西南证券	1,015,400	3,807,750.00	0.19
215	688009	中国通号	790,501	3,786,499.79	0.19
216	300474	景嘉微	69,150	3,773,515.50	0.18
217	002152	广电运通	379,430	3,771,534.20	0.18
218	600372	中航电子	235,900	3,767,323.00	0.18
219	002831	裕同科技	113,740	3,761,381.80	0.18
220	300558	贝达药业	76,300	3,759,301.00	0.18
221	600998	九州通	286,378	3,734,369.12	0.18
222	601880	辽港股份	2,301,670	3,728,705.40	0.18
223	000513	丽珠集团	114,686	3,725,001.28	0.18
224	000027	深圳能源	581,496	3,698,314.56	0.18
225	600435	北方导航	318,560	3,695,296.00	0.18
226	002936	郑州银行	1,571,685	3,693,459.75	0.18
227	300866	安克创新	62,300	3,692,521.00	0.18
228	000547	航天发展	392,071	3,681,546.69	0.18
229	000636	风华高科	247,616	3,672,145.28	0.18
230	002408	齐翔腾达	521,363	3,670,395.52	0.18
231	300070	碧水源	775,200	3,666,696.00	0.18
232	002131	利欧股份	2,064,230	3,653,687.10	0.18
233	300026	红日药业	642,710	3,650,592.80	0.18
234	002506	协鑫集成	1,251,700	3,642,447.00	0.18
235	002926	华西证券	481,300	3,624,189.00	0.18
236	603883	老百姓	89,439	3,619,596.33	0.18
237	002212	天融信	362,200	3,618,378.00	0.18
238	600378	昊华科技	83,600	3,587,276.00	0.18
239	300383	光环新网	439,600	3,587,136.00	0.18
240	002183	怡亚通	555,620	3,572,636.60	0.17

241	300682	朗新科技	162,200	3,565,156.00	0.17
242	603858	步长制药	169,100	3,552,791.00	0.17
243	002572	索菲亚	195,200	3,544,832.00	0.17
244	600820	隧道股份	672,500	3,544,075.00	0.17
245	600271	航天信息	339,900	3,538,359.00	0.17
246	603893	瑞芯微	51,200	3,523,072.00	0.17
247	002195	二三四五	1,749,582	3,516,659.82	0.17
248	600580	卧龙电驱	281,280	3,504,748.80	0.17
249	300296	利亚德	618,500	3,500,710.00	0.17
250	002250	联化科技	225,750	3,499,125.00	0.17
251	000887	中鼎股份	241,510	3,494,649.70	0.17
252	600390	五矿资本	687,200	3,490,976.00	0.17
253	002500	山西证券	658,190	3,488,407.00	0.17
254	600848	上海临港	292,600	3,487,792.00	0.17
255	002368	太极股份	123,983	3,487,641.79	0.17
256	600863	内蒙华电	997,410	3,480,960.90	0.17
257	688779	长远锂科	236,485	3,450,316.15	0.17
258	600021	上海电力	344,400	3,447,444.00	0.17
259	603156	养元饮品	154,800	3,447,396.00	0.17
260	002958	青农商行	1,188,500	3,434,765.00	0.17
261	688538	和辉光电	1,275,638	3,418,709.84	0.17
262	601958	金铂股份	295,800	3,416,490.00	0.17
263	300024	机器人	379,000	3,403,420.00	0.17
264	300001	特锐德	222,650	3,386,506.50	0.17
265	600755	厦门国贸	470,831	3,361,733.34	0.16
266	002244	滨江集团	380,320	3,358,225.60	0.16
267	688521	芯原股份	76,131	3,355,093.17	0.16
268	300009	安科生物	358,040	3,351,254.40	0.16
269	688256	寒武纪	61,322	3,345,728.32	0.16
270	600208	新湖中宝	1,313,900	3,337,306.00	0.16
271	002155	湖南黄金	257,210	3,330,869.50	0.16
272	600316	洪都航空	131,520	3,312,988.80	0.16
273	002511	中顺洁柔	240,800	3,308,592.00	0.16
274	600315	上海家化	103,720	3,303,482.00	0.16
275	603885	吉祥航空	203,000	3,284,540.00	0.16
276	000997	新大陆	252,410	3,283,854.10	0.16
277	000060	中金岭南	799,700	3,278,770.00	0.16
278	601231	环旭电子	202,000	3,278,460.00	0.16
279	300776	帝尔激光	26,000	3,276,000.00	0.16
280	000050	深天马 A	375,600	3,252,696.00	0.16
281	600060	海信视像	239,900	3,248,246.00	0.16
282	601005	重庆钢铁	2,048,791	3,237,089.78	0.16
283	601992	金隅集团	1,274,300	3,236,722.00	0.16
284	300850	新强联	60,600	3,228,768.00	0.16

285	603927	中科软	108,860	3,223,344.60	0.16
286	600511	国药股份	115,290	3,216,591.00	0.16
287	603218	日月股份	156,800	3,183,040.00	0.16
288	601717	郑煤机	281,606	3,142,722.96	0.15
289	600528	中铁工业	407,276	3,107,515.88	0.15
290	300251	光线传媒	358,700	3,106,342.00	0.15
291	600201	生物股份	342,519	3,086,096.19	0.15
292	600801	华新水泥	208,068	3,083,567.76	0.15
293	688185	康希诺	21,067	3,076,203.34	0.15
294	600566	济川药业	112,700	3,067,694.00	0.15
295	002939	长城证券	369,900	3,062,772.00	0.15
296	300168	万达信息	363,000	3,060,090.00	0.15
297	000021	深科技	286,210	3,059,584.90	0.15
298	600066	宇通客车	405,900	3,048,309.00	0.15
299	600171	上海贝岭	174,150	3,035,434.50	0.15
300	000825	太钢不锈	700,900	3,027,888.00	0.15
301	002373	千方科技	338,180	3,016,565.60	0.15
302	600906	财达证券	396,600	3,002,262.00	0.15
303	600598	北大荒	217,310	2,990,185.60	0.15
304	600839	四川长虹	1,128,520	2,979,292.80	0.15
305	600827	百联股份	245,276	2,972,745.12	0.15
306	300677	英科医疗	141,300	2,971,539.00	0.15
307	600282	南钢股份	941,800	2,966,670.00	0.14
308	600535	天士力	275,018	2,959,193.68	0.14
309	600970	中材国际	346,300	2,950,476.00	0.14
310	601866	中远海发	1,211,454	2,931,718.68	0.14
311	688188	柏楚电子	13,465	2,922,982.20	0.14
312	601665	齐鲁银行	700,100	2,919,417.00	0.14
313	601778	晶科科技	530,800	2,919,400.00	0.14
314	600500	中化国际	439,347	2,904,083.67	0.14
315	002128	电投能源	235,100	2,901,134.00	0.14
316	300861	美畅股份	58,800	2,890,608.00	0.14
317	601179	中国西电	626,700	2,889,087.00	0.14
318	002127	南极电商	600,400	2,887,924.00	0.14
319	002153	石基信息	192,520	2,885,874.80	0.14
320	603568	伟明环保	155,429	2,880,099.37	0.14
321	000930	中粮科技	342,187	2,860,683.32	0.14
322	600498	烽火通信	217,600	2,859,264.00	0.14
323	000709	河钢股份	1,263,700	2,855,962.00	0.14
324	603000	人民网	169,050	2,851,873.50	0.14
325	002595	豪迈科技	122,300	2,831,245.00	0.14
326	000012	南玻 A	419,743	2,816,475.53	0.14
327	300182	捷成股份	629,660	2,814,580.20	0.14
328	600398	海澜之家	528,185	2,799,380.50	0.14

329	300888	稳健医疗	39,100	2,795,650.00	0.14
330	002701	奥瑞金	550,530	2,780,176.50	0.14
331	000987	越秀资本	459,985	2,755,310.15	0.13
332	002019	亿帆医药	224,780	2,753,555.00	0.13
333	002985	北摩高科	61,023	2,752,137.30	0.13
334	002124	天邦食品	449,700	2,747,667.00	0.13
335	002396	星网锐捷	142,807	2,736,182.12	0.13
336	600959	江苏有线	916,950	2,723,341.50	0.13
337	000581	威孚高科	153,450	2,720,668.50	0.13
338	600663	陆家嘴	277,500	2,702,850.00	0.13
339	600895	张江高科	236,800	2,685,312.00	0.13
340	603707	健友股份	148,466	2,678,326.64	0.13
341	000598	兴蓉环境	547,610	2,677,812.90	0.13
342	000401	冀东水泥	325,170	2,676,149.10	0.13
343	000778	新兴铸管	731,640	2,670,486.00	0.13
344	300618	寒锐钴业	66,400	2,659,320.00	0.13
345	300115	长盈精密	257,080	2,655,636.40	0.13
346	600582	天地科技	506,130	2,631,876.00	0.13
347	002670	国盛金控	354,895	2,629,771.95	0.13
348	688208	道通科技	83,348	2,629,629.40	0.13
349	002249	大洋电机	509,030	2,606,233.60	0.13
350	600718	东软集团	261,840	2,605,308.00	0.13
351	600297	广汇汽车	1,239,300	2,602,530.00	0.13
352	300482	万孚生物	81,550	2,598,998.50	0.13
353	002690	美亚光电	107,938	2,579,718.20	0.13
354	600507	方大特钢	427,752	2,575,067.04	0.13
355	002266	浙富控股	656,450	2,566,719.50	0.13
356	688690	纳微科技	49,463	2,560,699.51	0.13
357	600329	达仁堂	87,690	2,551,779.00	0.12
358	603225	新凤鸣	233,882	2,544,636.16	0.12
359	600517	国网英大	524,400	2,538,096.00	0.12
360	000883	湖北能源	602,400	2,530,080.00	0.12
361	002505	鹏都农牧	974,150	2,513,307.00	0.12
362	603866	桃李面包	163,041	2,510,831.40	0.12
363	600409	三友化工	378,500	2,501,885.00	0.12
364	000656	金科股份	1,305,500	2,493,505.00	0.12
365	300212	易华录	122,120	2,492,469.20	0.12
366	600259	广晟有色	61,800	2,484,360.00	0.12
367	601000	唐山港	905,599	2,481,341.26	0.12
368	600022	山东钢铁	1,672,606	2,475,456.88	0.12
369	002002	鸿达兴业	763,215	2,472,816.60	0.12
370	600871	石化油服	1,244,200	2,463,516.00	0.12
371	000089	深圳机场	313,371	2,463,096.06	0.12
372	601106	中国一重	838,300	2,456,219.00	0.12

373	600567	山鹰国际	987,600	2,449,248.00	0.12
374	000785	居然之家	598,800	2,449,092.00	0.12
375	600064	南京高科	370,212	2,447,101.32	0.12
376	300376	易事特	354,970	2,424,445.10	0.12
377	002468	申通快递	234,100	2,418,253.00	0.12
378	002429	兆驰股份	691,900	2,414,731.00	0.12
379	600216	浙江医药	206,450	2,413,400.50	0.12
380	600782	新钢股份	584,600	2,391,014.00	0.12
381	688029	南微医学	28,767	2,362,633.71	0.12
382	002081	金螳螂	486,800	2,360,980.00	0.12
383	601333	广深铁路	1,036,400	2,352,628.00	0.11
384	601718	际华集团	805,400	2,343,714.00	0.11
385	600667	太极实业	450,600	2,325,096.00	0.11
386	601187	厦门银行	403,200	2,310,336.00	0.11
387	601118	海南橡胶	523,300	2,292,054.00	0.11
388	002010	传化智联	428,400	2,287,656.00	0.11
389	600062	华润双鹤	127,524	2,281,404.36	0.11
390	002191	劲嘉股份	314,640	2,274,847.20	0.11
391	600728	佳都科技	430,200	2,271,456.00	0.11
392	600737	中粮糖业	326,971	2,269,178.74	0.11
393	600597	光明乳业	210,680	2,266,916.80	0.11
394	300463	迈克生物	131,000	2,266,300.00	0.11
395	000540	中天金融	1,498,500	2,262,735.00	0.11
396	000537	广宇发展	170,800	2,259,684.00	0.11
397	600155	华创阳安	345,648	2,246,712.00	0.11
398	600376	首开股份	394,100	2,242,429.00	0.11
399	601156	东航物流	145,700	2,223,382.00	0.11
400	002745	木林森	272,220	2,207,704.20	0.11
401	002221	东华能源	289,040	2,205,375.20	0.11
402	600131	国网信通	147,200	2,202,112.00	0.11
403	601098	中南传媒	219,600	2,191,608.00	0.11
404	300072	海新能科	502,600	2,191,336.00	0.11
405	002416	爱施德	227,268	2,154,500.64	0.11
406	600967	内蒙一机	260,544	2,152,093.44	0.11
407	600126	杭钢股份	516,200	2,131,906.00	0.10
408	603379	三美股份	74,700	2,125,962.00	0.10
409	000156	华数传媒	283,200	2,121,168.00	0.10
410	601991	大唐发电	757,600	2,113,704.00	0.10
411	603228	景旺电子	103,600	2,096,864.00	0.10
412	002048	宁波华翔	149,390	2,076,521.00	0.10
413	600808	马钢股份	738,740	2,075,859.40	0.10
414	601568	北元集团	364,220	2,065,127.40	0.10
415	000937	冀中能源	324,200	2,061,912.00	0.10
416	002423	中粮资本	281,700	2,016,972.00	0.10

417	002281	光迅科技	128,300	2,016,876.00	0.10
418	600901	江苏租赁	365,200	2,001,296.00	0.10
419	001914	招商积余	129,600	1,993,248.00	0.10
420	688289	圣湘生物	90,349	1,983,160.55	0.10
421	600373	中文传媒	207,100	1,981,947.00	0.10
422	600095	湘财股份	261,800	1,979,208.00	0.10
423	300630	普利制药	80,118	1,975,709.88	0.10
424	003035	南网能源	347,400	1,969,758.00	0.10
425	000559	万向钱潮	403,800	1,966,506.00	0.10
426	603056	德邦股份	94,200	1,962,186.00	0.10
427	000898	鞍钢股份	732,700	1,956,309.00	0.10
428	301029	怡合达	29,500	1,939,330.00	0.09
429	002434	万里扬	240,850	1,938,842.50	0.09
430	603317	天味食品	69,936	1,921,841.28	0.09
431	000402	金融街	365,400	1,918,350.00	0.09
432	000563	陕国投 A	625,106	1,894,071.18	0.09
433	002867	周大生	134,000	1,880,020.00	0.09
434	600556	天下秀	276,300	1,862,262.00	0.09
435	601608	中信重工	530,600	1,851,794.00	0.09
436	601598	中国外运	481,800	1,850,112.00	0.09
437	601928	凤凰传媒	233,500	1,849,320.00	0.09
438	601611	中国核建	242,900	1,846,040.00	0.09
439	300257	开山股份	121,490	1,822,350.00	0.09
440	600707	彩虹股份	438,800	1,816,632.00	0.09
441	600195	中牧股份	156,173	1,814,730.26	0.09
442	002948	青岛银行	539,210	1,811,745.60	0.09
443	000959	首钢股份	477,900	1,801,683.00	0.09
444	001203	大中矿业	138,500	1,790,805.00	0.09
445	600968	海油发展	621,400	1,789,632.00	0.09
446	600167	联美控股	279,770	1,768,146.40	0.09
447	000967	盈峰环境	388,600	1,764,244.00	0.09
448	002110	三钢闽光	374,600	1,760,620.00	0.09
449	603650	彤程新材	54,800	1,689,484.00	0.08
450	002705	新宝股份	101,100	1,683,315.00	0.08
451	000415	渤海租赁	756,000	1,670,760.00	0.08
452	000990	诚志股份	185,760	1,634,688.00	0.08
453	688006	杭可科技	37,226	1,629,382.02	0.08
454	300869	康泰医学	49,300	1,605,701.00	0.08
455	002925	盈趣科技	95,687	1,580,749.24	0.08
456	600307	酒钢宏兴	956,970	1,579,000.50	0.08
457	601828	美凯龙	331,500	1,554,735.00	0.08
458	002242	九阳股份	93,790	1,545,659.20	0.08
459	603638	艾迪精密	102,780	1,533,477.60	0.07
460	688819	天能股份	41,636	1,529,706.64	0.07

461	600339	中油工程	512,030	1,525,849.40	0.07
462	600764	中国海防	65,300	1,499,288.00	0.07
463	000031	大悦城	392,920	1,477,379.20	0.07
464	002399	海普瑞	114,400	1,470,040.00	0.07
465	002653	海思科	65,900	1,466,275.00	0.07
466	600623	华谊集团	231,000	1,459,920.00	0.07
467	002146	荣盛发展	664,400	1,441,748.00	0.07
468	600928	西安银行	407,400	1,434,048.00	0.07
469	688088	虹软科技	62,108	1,398,051.08	0.07
470	601969	海南矿业	186,560	1,382,409.60	0.07
471	600648	外高桥	114,290	1,365,765.50	0.07
472	600006	东风汽车	244,611	1,364,929.38	0.07
473	603719	良品铺子	36,800	1,356,816.00	0.07
474	600787	中储股份	267,500	1,329,475.00	0.06
475	002563	森马服饰	247,100	1,294,804.00	0.06
476	000961	中南建设	584,600	1,280,274.00	0.06
477	000869	张裕 A	41,600	1,257,984.00	0.06
478	600377	宁沪高速	151,700	1,246,974.00	0.06
479	601869	长飞光纤	37,300	1,217,099.00	0.06
480	000553	安道麦 A	133,100	1,204,555.00	0.06
481	601298	青岛港	214,200	1,201,662.00	0.06
482	600350	山东高速	206,500	1,174,985.00	0.06
483	000062	深圳华强	95,902	1,170,963.42	0.06
484	601139	深圳燃气	175,900	1,150,386.00	0.06
485	002945	华林证券	82,600	1,088,668.00	0.05
486	001872	招商港口	71,000	1,019,560.00	0.05
487	601228	广州港	323,000	1,017,450.00	0.05
488	600299	安迪苏	123,000	1,015,980.00	0.05
489	603868	飞科电器	14,667	987,529.11	0.05
490	603355	莱克电气	35,102	984,260.08	0.05
491	601158	重庆水务	176,100	903,393.00	0.04
492	600956	新天绿能	93,300	899,412.00	0.04
493	300741	华宝股份	37,700	887,081.00	0.04
494	603786	科博达	12,400	816,292.00	0.04
495	600927	永安期货	49,100	791,492.00	0.04
496	600917	重庆燃气	96,100	764,956.00	0.04
497	600032	浙江新能	63,700	731,913.00	0.04
498	001227	兰州银行	191,500	721,955.00	0.04
499	688772	珠海冠宇	34,392	641,066.88	0.03
500	002901	大博医疗	17,900	609,137.00	0.03
501	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.01
502	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.01
503	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
504	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00

505	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
506	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
507	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
508	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
509	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
510	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
511	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
512	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
513	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
514	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
515	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
516	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
517	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
518	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
519	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
520	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
521	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
522	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
523	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
524	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
525	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
526	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
527	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
528	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
529	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
530	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
531	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
532	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
533	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
534	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
535	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
536	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
537	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
538	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
539	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
540	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
541	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
542	301316	慧博云通	359	5,140.88	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	002340	格林美	19,811,363.72	1.32
2	300012	华测检测	13,812,406.00	0.92
3	002497	雅化集团	13,202,853.65	0.88
4	002240	盛新锂能	12,549,007.29	0.83
5	300769	德方纳米	11,619,800.27	0.77
6	002407	多氟多	11,533,941.25	0.77
7	600096	云天化	11,471,084.00	0.76
8	002756	永兴材料	10,656,823.16	0.71
9	300390	天华超净	10,608,052.00	0.71
10	300073	当升科技	10,516,559.95	0.70
11	688063	派能科技	9,894,895.00	0.66
12	300003	乐普医疗	9,617,848.17	0.64
13	002180	纳思达	8,988,697.96	0.60
14	002738	中矿资源	8,780,671.00	0.58
15	688180	君实生物	8,740,900.38	0.58
16	002625	光启技术	8,508,266.12	0.57
17	603606	东方电缆	8,483,790.00	0.56
18	000783	长江证券	8,245,506.00	0.55
19	601058	赛轮轮胎	8,109,741.78	0.54
20	600352	浙江龙盛	8,040,414.00	0.53

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	002180	纳思达	17,169,314.16	1.14
2	600256	广汇能源	16,614,871.00	1.11
3	000733	振华科技	16,522,410.39	1.10
4	600522	中天科技	15,335,589.13	1.02
5	002340	格林美	15,249,334.50	1.01
6	601615	明阳智能	14,287,765.00	0.95
7	000983	山西焦煤	12,622,245.89	0.84
8	000723	美锦能源	11,677,647.63	0.78
9	600188	兖矿能源	11,340,346.00	0.75
10	688005	容百科技	11,298,732.54	0.75
11	300751	迈为股份	10,650,744.00	0.71
12	600732	爱旭股份	10,600,904.00	0.71

13	600233	圆通速递	10,312,306.00	0.69
14	002240	盛新锂能	9,751,465.63	0.65
15	601117	中国化学	9,662,440.00	0.64
16	002013	中航机电	9,024,535.00	0.60
17	300769	德方纳米	8,823,303.37	0.59
18	002756	永兴材料	8,686,190.44	0.58
19	300763	锦浪科技	8,566,183.50	0.57
20	601689	拓普集团	8,552,734.42	0.57

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	1,516,884,604.13
卖出股票收入（成交）总额	1,108,840,655.56

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

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	13,611,095.42
2	应收清算款	7,837.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	24,318.19
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,643,251.11

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	300724	捷佳伟创	2,417,224.00	0.12	转融通流通受限
2	002340	格林美	2,332,277.00	0.11	转融通流通受限
3	002422	科伦药业	2,296,443.00	0.11	转融通流通受限

4	603613	国联股份	1,874,928.00	0.09	转融通流通受限
5	300003	乐普医疗	1,846,788.00	0.09	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)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有 限公司—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
24,758	118,474.9 4	2,308,933,9 89.00	78.72%	624,268,473 .00	21.28%	2,139,713, 885.00	72.95%

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	中国人寿保险股份有限公司	72,800,000.00	2.48%
2	中信证券股份有限公司	13,581,272.00	0.46%
3	佛山市中科睿盈科技研究有限公司	12,013,400.00	0.41%
4	中信建投证券股份有限公司	11,919,259.00	0.41%
5	东方证券股份有限公司	10,766,126.00	0.37%
6	招商证券股份有限公司	7,965,108.00	0.27%
7	谢州鹏	6,800,000.00	0.23%
8	广发证券股份有限公司	6,676,954.00	0.23%
9	陶立永	5,728,600.00	0.20%
10	华泰证券股份有限公司	5,530,308.00	0.19%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达	2,139,713,885.00	72.95%

中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金		
----------------------------------	--	--

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	1,765,965,150.00
本报告期基金总申购份额	2,245,237,312.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,078,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,933,202,462.00

注：期末基金总份额包含场外份额 237,312 份；总申购份额包含场外总申购份额 1,237,312 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 1,000,000 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 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022

年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 8 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 76,700.00 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1,115,286,183.26	43.01%	111,546.73	43.01%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	88,987.00	0.00%	53.39	0.02%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
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	664,078,956.57	25.61%	66,414.50	25.61%	-
中信建投	3	813,354,400.10	31.37%	81,335.58	31.36%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。北京高华证券有限责任公司更名为高盛高华证券有限责任公司。

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

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	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-

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	2,034,499.58	24.79%	-	-	-	-
中信建投	6,173,758.21	75.21%	-	-	-	-
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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	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	2022-01-07
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-21
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加天风证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2022-01-26
5	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江阴标榜汽车零部件股份有限公司首次公开发行股票的公告	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	2022-02-12
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-30
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华安证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2022-04-01
8	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	2022-04-11
9	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	2022-04-21
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第	上海证券报	2022-04-22

	1 季度报告提示性公告		
11	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	2022-05-13
12	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	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	2022-05-14
13	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购昆山亚香香料股份有限公司首次公开发行股票的公告	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	2022-06-16
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加财达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	2022-06-16
15	易方达基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	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	2022-06-18
16	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2022-07-07
17	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-07-20
18	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	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	2022-08-18
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	上海证券报	2022-08-30
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2022-09-21
21	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-10-26
22	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	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	2022-12-17
23	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国金证券为一级交易商的公告	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	2022-12-21
24	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2022-12-23

§ 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	2022 年 01 月 01 日~2022 年 12 月 31 日	1,355,824,540.00	1,554,000,000.00	770,110,655.00	2,139,713,885.00	72.95%
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

二〇二三年三月三十日