

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

§ 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	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	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12	投资组合报告附注	63
§ 8	基金份额持有人信息	64
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2	期末上市基金前十名持有人	64
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	65
§ 9	开放式基金份额变动	65
§ 10	重大事件揭示	66
10.1	基金份额持有人大会决议	66
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4	基金投资策略的改变	66
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8	其他重大事件	68
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	69
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	69
§ 12	备查文件目录	69
12.1	备查文件目录	69
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 800ETF
场内简称	ZZ800ETF、中证 800ETF
基金主代码	515810
交易代码	515810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 8 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	143,908,843.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,509,067.19
本期利润	1,700,172.47
加权平均基金份额本期利润	0.0145
本期加权平均净值利润率	1.18%
本期基金份额净值增长率	1.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	28,086,305.17

期末可供分配基金份额利润	0.1952
期末基金资产净值	171,995,148.17
期末基金份额净值	1.1952
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.52%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

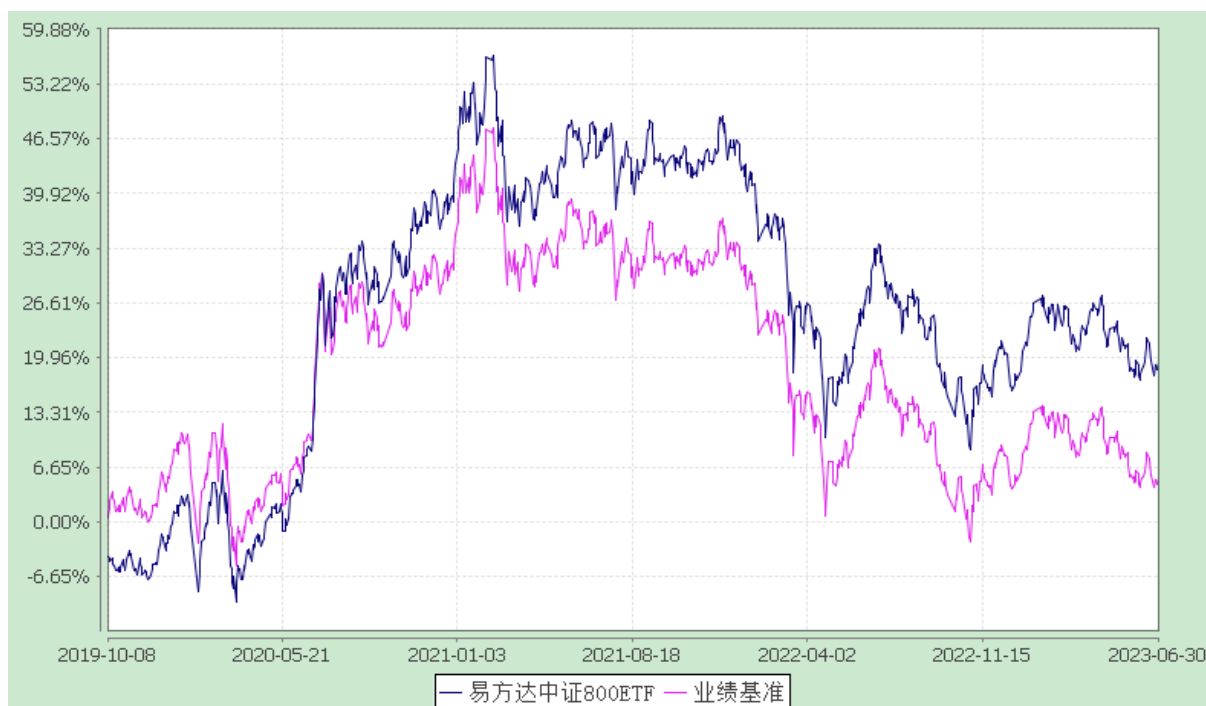
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.58%	0.86%	0.63%	0.86%	0.95%	0.00%
过去三个月	-3.83%	0.79%	-5.21%	0.80%	1.38%	-0.01%
过去六个月	1.65%	0.80%	0.02%	0.80%	1.63%	0.00%
过去一年	-10.21%	0.94%	-12.59%	0.95%	2.38%	-0.01%
过去三年	8.52%	1.16%	-5.48%	1.16%	14.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	19.52%	1.19%	5.33%	1.19%	14.19%	0.00%

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

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 10 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 19.52%，同期业绩比较基准收益率为 5.33%。

§ 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		
林伟斌	本基金的基金经理，易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证国有企业改革指数	2019-10-08	-	15 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量

	(LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达上证科创 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接的基金经理, 指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员				化策略部副总经理、指数投资部副总经理, 易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) 的基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理, 易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数 (LOF)、易方达中证万得并购重组指数 (LOF)、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达香港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行指数 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证 1000ETF、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接发起式、易方达中证长江保护主题 ETF 联接发起式的基金经理, 易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理助理	2019-10-08	-	16 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计, 易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员, 易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF(QDII)的基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 23 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 800 指数，该指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场中大市值公司的股票价格表现。报告期内，本基金主要采取完全复制法，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。

2023 年上半年，随着经济社会全面恢复常态化运行，稳增长、稳就业、稳物价政策效应逐步显现，市场需求逐步恢复，生产供给持续增加，就业物价总体稳定，经济运行整体回升向好。在经济复苏的大背景下，一季度 A 股市场总体呈现震荡上扬态势，中证 800 指数上涨 5.51%。二季度，受疫情放开支撑作用边际趋弱、市场主体预期不稳、经济恢复动力不足等因素影响，国内经济复苏节奏放缓。此外，国际政治经济形势错综复杂，世界经济复苏乏力，地缘政治摩擦风险，外部环境更趋复杂严峻。在上述背景下，投资者风险偏好下降，二季度 A 股市场总体呈现震荡下跌态势，中证

800 指数下跌 5.21%。本报告期，中证 800 指数小幅上涨 0.02%。从行业结构上看，中证 800 指数权重占比较大的行业为电力设备、食品饮料、银行、非银金融、电子、医药生物、计算机，其中电子、计算机行业总体表现较好，对指数收益贡献较大，而电力设备、食品饮料、银行、医药生物行业总体表现较为落后对指数走势形成拖累。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1952 元，本报告期份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 0.02%，年化跟踪误差 0.43%，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，尽管外部环境更趋复杂严峻，国内经济发展也面临压力，但我国经济长期向好基本面没有改变，韧性强、潜力大、活力足的特点也没有改变，支撑高质量发展的条件也没有改变。随着促进发展的积极因素累积增多，经济有望继续恢复向好。下半年影响股票市场走势的因素仍较为综合，内部因素主要包括增长预期边际调整及相应稳增长政策；外部因素主要关注全球地缘局势、海外主要国家增长预期及货币政策调整等，其中国内经济表现及政策应对较为关键。中证 800 指数是覆盖了大部分 A 股市值的代表性宽基指数，市值风格偏向于中大盘，行业分布相对均衡，指数表现与中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

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，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具

备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,838,964.11	3,632,197.72
结算备付金		859,020.65	1,143,028.20
存出保证金		579,895.40	703,065.26
交易性金融资产	6.4.7.2	166,715,206.73	132,186,573.45
其中：股票投资		166,715,206.73	132,186,573.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,719,737.11	42,091.95
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	-
资产总计		173,788,440.24	137,706,956.58
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,485,156.88	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,661.61	17,319.40

应付托管费		5,887.22	5,773.14
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	284,586.36	222,998.88
负债合计		1,793,292.07	246,091.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	143,908,843.00	116,908,843.00
未分配利润	6.4.7.8	28,086,305.17	20,552,022.16
净资产合计		171,995,148.17	137,460,865.16
负债和净资产总计		173,788,440.24	137,706,956.58

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1952 元，基金份额总额 143,908,843.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,071,341.38	-7,346,568.14
1.利息收入		15,841.66	15,693.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,841.66	15,693.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,794,993.35	-5,901,388.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	918,544.46	-6,398,428.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,671.23	61,652.32
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	216,391.97	-551,588.10
股利收益	6.4.7.14	1,649,385.69	986,975.84
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.15	-808,894.72	-1,289,270.54

填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	69,401.09	-171,602.67
减: 二、营业总支出		371,168.91	320,214.46
1. 管理人报酬		107,037.36	70,230.23
2. 托管费		35,679.16	23,410.03
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		779.92	0.01
8. 其他费用	6.4.7.18	227,672.47	226,574.19
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		1,700,172.47	-7,666,782.60
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		1,700,172.47	-7,666,782.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,700,172.47	-7,666,782.60

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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)	116,908,843.00	20,552,022.16	137,460,865.16
二、本期期初净资产 (基金净值)	116,908,843.00	20,552,022.16	137,460,865.16
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	27,000,000.00	7,534,283.01	34,534,283.01
(一)、综合收益总额	-	1,700,172.47	1,700,172.47
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以	27,000,000.00	5,834,110.54	32,834,110.54

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	54,000,000.00	12,059,063.19	66,059,063.19
2.基金赎回款	-27,000,000.00	-6,224,952.65	-33,224,952.65
(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)	143,908,843.00	28,086,305.17	171,995,148.17
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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)	68,908,843.00	31,912,218.52	100,821,061.52
二、本期期初净资产(基金净值)	68,908,843.00	31,912,218.52	100,821,061.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	15,000,000.00	-4,130,514.77	10,869,485.23
(一)、综合收益总额	-	-7,666,782.60	-7,666,782.60
(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)	15,000,000.00	3,536,267.83	18,536,267.83
其中：1.基金申购款	78,000,000.00	21,299,904.29	99,299,904.29
2.基金赎回款	-63,000,000.00	-17,763,636.46	-80,763,636.46
(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)	83,908,843.00	27,781,703.75	111,690,546.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中

债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,838,964.11
等于: 本金	3,838,523.81
加: 应计利息	440.30
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	3,838,964.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		171,060,570.42	-	166,715,206.73	-4,345,363.69
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		171,060,570.42	-	166,715,206.73	-4,345,363.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,967,280.00	-	-	-
IC2309	3,741,000.00	-	-	-
IF2309	1,226,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,967,280.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IC2309	IC2309	3	3,582,000.00	-159,000.00
IF2309	IF2309	1	1,151,700.00	-74,580.00
合计	-	-	-	-233,580.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-233,580.00
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股指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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,917.19
其中：交易所市场	5,917.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	102,812.93
应付替代款	140,516.64
可退替代款	339.60
其他应付款	35,000.00
合计	284,586.36

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	116,908,843.00	116,908,843.00
本期申购	54,000,000.00	54,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-27,000,000.00	-27,000,000.00
本期末	143,908,843.00	143,908,843.00

6.4.7.8 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	50,355,093.81	-29,803,071.65	20,552,022.16
本期利润	2,509,067.19	-808,894.72	1,700,172.47
本期基金份额交易产生的变动数	12,115,643.07	-6,281,532.53	5,834,110.54
其中：基金申购款	23,989,481.58	-11,930,418.39	12,059,063.19
基金赎回款	-11,873,838.51	5,648,885.86	-6,224,952.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,979,804.07	-36,893,498.90	28,086,305.17

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,210.78
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	9,206.43
其他	424.45
合计	15,841.66

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	289,221.40
股票投资收益——赎回差价收入	629,323.06
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	918,544.46

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	30,951,878.95
减：卖出股票成本总额	30,615,791.74
减：交易费用	46,865.81
买卖股票差价收入	289,221.40

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	33,224,952.65
减：现金支付赎回款总额	14,343,161.65
减：赎回股票成本总额	18,252,467.94
减：交易费用	-
赎回差价收入	629,323.06

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	9.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,662.11
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	10,671.23

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,173.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	48,499.61
减：应计利息总额	9.64
减：交易费用	2.37
买卖债券差价收入	10,662.11

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	216,391.97

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,649,385.69
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,649,385.69

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-722,954.72
——股票投资	-722,954.72
——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	-85,940.00
——权证投资	-
——期货投资	-85,940.00
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	-808,894.72

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	69,401.09
合计	69,401.09

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入

(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
存托服务费	10.78
银行汇划费	465.00
其他	84,300.75
合计	227,672.47

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	14,668,418.52	19.44%	9,848,612.52	10.40%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	8,196.57	13.85%	18,766.44	3.98%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30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	2,648.89	30.06%	1,366.92	23.10%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	4,247.70	33.17%	3,620.00	41.93%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	107,037.36	70,230.23
其中：支付销售机构的客户维护费	892.09	1,148.82

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,679.16	23,410.03

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	98,954,462.00	68.7619%	61,802,743.00	52.8640%
广发证券股份有限公司	3,682,102.00	2.5586%	5,404,361.00	4.6227%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	3,838,964.11	6,210.78	3,480,684.52	6,626.90

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	600958	东方证券	配股	4,088	34,584.48

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券和托管人建设银行发行的 A 股建设银行。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 19,500 股（2022 年 12 月 31 日:16,000 股），占本基金净值比例为 0.17%(2022 年 12 月 31 日:0.18%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 44,900 股（2022 年 12 月 31 日:36,500 股），占本基金净值比例为 0.16%(2022 年 12 月 31 日:0.15%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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

301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	72	4,068.00	3,810.96	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	60	4,407.00	2,798.40	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	339	5,505.36	5,746.05	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	196	3,918.04	3,312.40	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	448	2,947.84	3,395.84	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	188	1,947.68	2,225.92	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	143	1,667.38	1,753.18	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	49	1,273.02	1,201.97	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	147	2,616.60	2,629.83	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	109	1,733.10	1,862.81	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	91	1,326.78	1,467.83	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	148	5,350.20	5,643.24	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	877	17,417.22	15,838.62	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	277	3,922.32	4,490.17	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股流通	12.10	12.07	433	5,239.30	5,226.31	-

				受限						
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	133	3,138.80	8,601.11	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	157	3,014.40	4,008.21	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	134	3,572.44	4,221.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	286	10,833.68	8,434.14	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	515	5,716.50	8,775.60	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	165	5,365.80	6,991.05	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	111	3,772.89	3,273.39	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	207	4,525.02	4,936.95	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	91	3,185.00	4,661.93	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	209	4,424.53	4,911.50	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	291	3,689.88	6,492.21	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	166	5,023.16	4,204.78	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	36	4,528.80	4,249.08	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	144	3,850.56	5,857.92	-
68859	新相	2023-0	6 个月	新股	11.18	14.59	343	3,834.	5,004.	-

3	微	5-25		流通受限				74	37	
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	393	4,197.24	4,849.62	-
688623	二元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	36	4,531.68	3,124.44	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	353	3,268.78	6,562.27	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	101	2,553.28	3,016.87	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	4,300	26,243.03	29,971.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投

资决策委员会、投资总监、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。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述

利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,838,964.11	-	-	-	3,838,964.11
结算备付金	859,020.65	-	-	-	859,020.65
存出保证金	579,895.40	-	-	-	579,895.40
交易性金融资产	-	-	-	166,715,206.73	166,715,206.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,719,737.11	1,719,737.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	5,277,880.16	-	-	168,510,560.08	173,788,440.24
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	-	-	-	1,485,156.88	1,485,156.88
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	17,661.61	17,661.61
应付托管费	-	-	-	5,887.22	5,887.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	284,586.36	284,586.36
负债总计	-	-	-	1,793,292.07	1,793,292.07

					7
利率敏感度缺口	5,277,880.16	-	-	166,717,268.01	171,995,148.17
上年度末 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	3,632,197.72	-	-	-	3,632,197.72
结算备付金	1,143,028.20	-	-	-	1,143,028.20
存出保证金	703,065.26	-	-	-	703,065.26
交易性金融资产	-	-	-	132,186,573.45	132,186,573.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	42,091.95	42,091.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,478,291.18	-	-	132,228,665.40	137,706,956.58
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	17,319.40	17,319.40
应付托管费	-	-	-	5,773.14	5,773.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	222,998.88	222,998.88

负债总计	-	-	-	246,091.42	246,091.42
利率敏感度缺口	5,478,291.18	-	-	131,982,573.98	137,460,865.16

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	166,715,206.73	96.93	132,186,573.45	96.16
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	166,715,206.73	96.93	132,186,573.45	96.16

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	8,330,250.50	6,598,002.50
	2.业绩比较基准下降 5%	-8,330,250.50	-6,598,002.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	166,521,655.76
第二层次	29,971.00
第三层次	163,579.97
合计	166,715,206.73

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	166,715,206.73	95.93
	其中：股票	166,715,206.73	95.93
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	4,697,984.76	2.70
8	其他各项资产	2,375,248.75	1.37
9	合计	173,788,440.24	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,698,287.00	0.99
B	采矿业	6,412,571.65	3.73
C	制造业	96,708,675.29	56.23

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,179,330.30	3.01
E	建筑业	3,439,352.59	2.00
F	批发和零售业	1,747,297.33	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,537,800.20	2.64
H	住宿和餐饮业	208,949.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,599,659.58	5.58
J	金融业	29,234,248.92	17.00
K	房地产业	2,446,542.83	1.42
L	租赁和商务服务业	1,678,689.80	0.98
M	科学研究和技术服务业	1,694,257.91	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	232,947.83	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	917,529.50	0.53
R	文化、体育和娱乐业	759,446.00	0.44
S	综合	219,621.00	0.13
	合计	166,715,206.73	96.93

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,200	7,102,200.00	4.13
2	300750	宁德时代	17,540	4,012,976.60	2.33
3	601318	中国平安	71,900	3,336,160.00	1.94
4	600036	招商银行	82,147	2,691,135.72	1.56
5	000858	五粮液	12,900	2,110,053.00	1.23
6	000333	美的集团	32,500	1,914,900.00	1.11
7	002594	比亚迪	5,900	1,523,793.00	0.89
8	601166	兴业银行	96,600	1,511,790.00	0.88
9	600900	长江电力	64,800	1,429,488.00	0.83
10	600276	恒瑞医药	29,690	1,422,151.00	0.83
11	600030	中信证券	64,660	1,278,974.80	0.74
12	601899	紫金矿业	109,300	1,242,741.00	0.72
13	300059	东方财富	84,228	1,196,037.60	0.70
14	600887	伊利股份	42,035	1,190,431.20	0.69

15	601012	隆基绿能	40,212	1,152,878.04	0.67
16	601398	工商银行	232,600	1,121,132.00	0.65
17	600309	万华化学	12,500	1,098,000.00	0.64
18	000651	格力电器	29,900	1,091,649.00	0.63
19	002475	立讯精密	32,899	1,067,572.55	0.62
20	601328	交通银行	182,400	1,057,920.00	0.62
21	002415	海康威视	31,100	1,029,721.00	0.60
22	000725	京东方 A	248,800	1,017,592.00	0.59
23	000568	泸州老窖	4,800	1,005,936.00	0.58
24	000063	中兴通讯	21,200	965,448.00	0.56
25	300760	迈瑞医疗	3,200	959,360.00	0.56
26	601816	京沪高铁	162,900	856,854.00	0.50
27	603259	药明康德	13,640	849,908.40	0.49
28	002230	科大讯飞	12,300	835,908.00	0.49
29	300274	阳光电源	6,900	804,747.00	0.47
30	600028	中国石化	126,200	802,632.00	0.47
31	601668	中国建筑	139,200	799,008.00	0.46
32	300124	汇川技术	12,350	792,993.50	0.46
33	002714	牧原股份	18,140	764,601.00	0.44
34	601288	农业银行	211,900	748,007.00	0.43
35	002352	顺丰控股	16,300	734,967.00	0.43
36	000001	平安银行	64,400	723,212.00	0.42
37	002129	TCL 中环	21,475	712,970.00	0.41
38	601888	中国中免	6,400	707,392.00	0.41
39	000792	盐湖股份	36,100	692,037.00	0.40
40	601088	中国神华	21,900	673,425.00	0.39
41	002142	宁波银行	26,340	666,402.00	0.39
42	601138	工业富联	26,400	665,280.00	0.39
43	688981	中芯国际	13,001	656,810.52	0.38
44	600031	三一重工	39,400	655,222.00	0.38
45	300498	温氏股份	34,860	639,681.00	0.37
46	000002	万科 A	45,200	633,704.00	0.37
47	600048	保利发展	47,700	621,531.00	0.36
48	600016	民生银行	164,800	618,000.00	0.36
49	600406	国电南瑞	26,662	615,892.20	0.36
50	600438	通威股份	17,900	614,149.00	0.36
51	600050	中国联通	126,600	607,680.00	0.35
52	600809	山西汾酒	3,280	607,029.60	0.35
53	600690	海尔智家	25,200	591,696.00	0.34
54	600837	海通证券	64,100	591,002.00	0.34
55	300308	中际旭创	4,000	589,800.00	0.34
56	601601	中国太保	22,700	589,746.00	0.34
57	601728	中国电信	103,100	580,453.00	0.34
58	600919	江苏银行	78,400	576,240.00	0.34

59	600089	特变电工	25,800	575,082.00	0.33
60	300015	爱尔眼科	30,950	574,122.50	0.33
61	688111	金山办公	1,196	564,775.12	0.33
62	600000	浦发银行	77,900	563,996.00	0.33
63	601857	中国石油	75,300	562,491.00	0.33
64	600941	中国移动	5,900	550,470.00	0.32
65	601988	中国银行	139,900	547,009.00	0.32
66	600436	片仔癀	1,900	544,084.00	0.32
67	002371	北方华创	1,700	540,005.00	0.31
68	603501	韦尔股份	5,435	532,847.40	0.31
69	002304	洋河股份	4,000	525,400.00	0.31
70	601766	中国中车	80,700	524,550.00	0.30
71	601390	中国中铁	68,200	516,956.00	0.30
72	603288	海天味业	10,912	511,227.20	0.30
73	600905	三峡能源	95,000	510,150.00	0.30
74	300014	亿纬锂能	8,203	496,281.50	0.29
75	600150	中国船舶	14,700	483,777.00	0.28
76	002466	天齐锂业	6,900	482,379.00	0.28
77	000938	紫光股份	15,080	480,298.00	0.28
78	601688	华泰证券	34,200	470,934.00	0.27
79	601225	陕西煤业	25,735	468,119.65	0.27
80	603986	兆易创新	4,396	467,075.00	0.27
81	002027	分众传媒	67,100	456,951.00	0.27
82	002460	赣锋锂业	7,480	455,980.80	0.27
83	601169	北京银行	98,200	454,666.00	0.26
84	002459	晶澳科技	10,856	452,695.20	0.26
85	000338	潍柴动力	36,000	448,560.00	0.26
86	600570	恒生电子	9,969	441,527.01	0.26
87	601985	中国核电	62,600	441,330.00	0.26
88	600104	上汽集团	31,003	439,312.51	0.26
89	688012	中微公司	2,754	430,863.30	0.25
90	002050	三花智控	14,200	429,692.00	0.25
91	000625	长安汽车	32,732	423,224.76	0.25
92	601211	国泰君安	30,000	419,700.00	0.24
93	002049	紫光国微	4,480	417,760.00	0.24
94	600111	北方稀土	16,800	402,864.00	0.23
95	603019	中科曙光	7,820	398,038.00	0.23
96	601919	中远海控	42,090	395,646.00	0.23
97	000100	TCL 科技	99,730	392,936.20	0.23
98	603799	华友钴业	8,540	392,071.40	0.23
99	002179	中航光电	8,460	383,661.00	0.22
100	601628	中国人寿	10,900	381,064.00	0.22
101	600585	海螺水泥	16,000	379,840.00	0.22
102	601229	上海银行	66,000	379,500.00	0.22

103	601818	光大银行	123,200	378,224.00	0.22
104	600009	上海机场	8,300	376,986.00	0.22
105	600660	福耀玻璃	10,500	376,425.00	0.22
106	002812	恩捷股份	3,900	375,765.00	0.22
107	600893	航发动力	8,860	374,423.60	0.22
108	002271	东方雨虹	13,400	365,284.00	0.21
109	601989	中国重工	75,700	364,874.00	0.21
110	601658	邮储银行	73,600	359,904.00	0.21
111	002555	三七互娱	10,100	352,288.00	0.20
112	300122	智飞生物	7,950	351,390.00	0.20
113	600958	东方证券	34,688	336,473.60	0.20
114	000977	浪潮信息	6,900	334,650.00	0.19
115	600019	宝钢股份	59,100	332,142.00	0.19
116	600999	招商证券	24,440	331,650.80	0.19
117	600760	中航沈飞	7,344	330,480.00	0.19
118	002709	天赐材料	7,740	318,810.60	0.19
119	300896	爱美客	700	311,465.00	0.18
120	688599	天合光能	7,251	308,965.11	0.18
121	688008	澜起科技	5,358	307,656.36	0.18
122	300316	晶盛机电	4,300	304,870.00	0.18
123	601186	中国铁建	30,600	301,410.00	0.18
124	688036	传音控股	2,046	300,762.00	0.17
125	600426	华鲁恒升	9,740	298,336.20	0.17
126	601360	三六零	23,500	294,690.00	0.17
127	601006	大秦铁路	39,500	293,485.00	0.17
128	600584	长电科技	9,400	292,998.00	0.17
129	601600	中国铝业	52,700	289,323.00	0.17
130	002410	广联达	8,840	287,211.60	0.17
131	000776	广发证券	19,500	286,845.00	0.17
132	000661	长春高新	2,100	286,230.00	0.17
133	002241	歌尔股份	15,900	282,225.00	0.16
134	600547	山东黄金	12,000	281,760.00	0.16
135	601939	建设银行	44,900	281,074.00	0.16
136	600588	用友网络	13,691	280,665.50	0.16
137	002920	德赛西威	1,800	280,458.00	0.16
138	601377	兴业证券	45,800	280,296.00	0.16
139	600745	闻泰科技	5,705	278,974.50	0.16
140	300142	沃森生物	10,500	277,725.00	0.16
141	000166	申万宏源	59,800	276,276.00	0.16
142	601009	南京银行	34,400	275,200.00	0.16
143	000596	古井贡酒	1,100	272,118.00	0.16
144	600010	包钢股份	150,700	269,753.00	0.16
145	600600	青岛啤酒	2,600	269,438.00	0.16
146	600011	华能国际	29,010	268,632.60	0.16

147	001979	招商蛇口	20,600	268,418.00	0.16
148	300450	先导智能	7,300	264,041.00	0.15
149	600196	复星医药	8,500	262,650.00	0.15
150	601669	中国电建	45,700	262,318.00	0.15
151	300408	三环集团	8,900	261,215.00	0.15
152	600085	同仁堂	4,500	259,020.00	0.15
153	300782	卓胜微	2,680	258,968.40	0.15
154	601800	中国交建	23,400	255,294.00	0.15
155	002311	海大集团	5,400	252,936.00	0.15
156	603659	璞泰来	6,565	250,914.30	0.15
157	000733	振华科技	2,600	249,210.00	0.14
158	603993	洛阳钼业	46,700	248,911.00	0.14
159	600886	国投电力	19,600	247,940.00	0.14
160	000538	云南白药	4,720	247,705.60	0.14
161	000963	华东医药	5,700	247,209.00	0.14
162	000768	中航西飞	9,200	246,100.00	0.14
163	300033	同花顺	1,400	245,392.00	0.14
164	601689	拓普集团	3,000	242,100.00	0.14
165	600845	宝信软件	4,686	238,095.66	0.14
166	002252	上海莱士	31,300	235,063.00	0.14
167	002493	荣盛石化	20,000	232,800.00	0.14
168	000988	华工科技	6,100	231,861.00	0.13
169	601100	恒立液压	3,596	231,330.68	0.13
170	688256	寒武纪	1,227	230,676.00	0.13
171	600926	杭州银行	19,500	229,125.00	0.13
172	600015	华夏银行	42,000	227,220.00	0.13
173	600795	国电电力	59,200	226,736.00	0.13
174	600176	中国巨石	16,001	226,574.16	0.13
175	300347	泰格医药	3,500	225,890.00	0.13
176	600732	爱旭股份	7,320	225,090.00	0.13
177	002180	纳思达	6,500	222,625.00	0.13
178	603369	今世缘	4,200	221,760.00	0.13
179	000157	中联重科	32,800	221,400.00	0.13
180	600674	川投能源	14,700	221,235.00	0.13
181	002340	格林美	31,700	219,047.00	0.13
182	002384	东山精密	8,400	217,560.00	0.13
183	002422	科伦药业	7,300	216,664.00	0.13
184	600115	中国东航	45,400	216,104.00	0.13
185	600029	南方航空	35,800	215,874.00	0.13
186	002236	大华股份	10,900	215,275.00	0.13
187	000425	徐工机械	31,400	212,578.00	0.12
188	601066	中信建投	8,600	208,120.00	0.12
189	000301	东方盛虹	17,600	208,032.00	0.12
190	600372	中航电子	13,700	207,966.00	0.12

191	601788	光大证券	13,000	206,570.00	0.12
192	601633	长城汽车	8,200	206,394.00	0.12
193	300418	昆仑万维	5,100	205,428.00	0.12
194	601995	中金公司	5,700	202,464.00	0.12
195	300496	中科创达	2,100	202,335.00	0.12
196	601336	新华保险	5,500	202,235.00	0.12
197	601868	中国能建	86,120	201,520.80	0.12
198	600346	恒力石化	14,000	200,620.00	0.12
199	601117	中国化学	24,100	199,548.00	0.12
200	601877	正泰电器	7,200	199,080.00	0.12
201	300012	华测检测	10,200	198,900.00	0.12
202	002074	国轩高科	7,100	196,102.00	0.11
203	600157	永泰能源	137,000	194,540.00	0.11
204	002202	金风科技	18,300	194,346.00	0.11
205	600741	华域汽车	10,400	191,984.00	0.11
206	600079	人福医药	7,100	191,274.00	0.11
207	300724	捷佳伟创	1,700	190,995.00	0.11
208	002001	新和成	12,376	190,590.40	0.11
209	601111	中国国航	23,100	190,344.00	0.11
210	601618	中国中冶	47,400	188,178.00	0.11
211	688126	沪硅产业	8,977	187,619.30	0.11
212	002841	视源股份	2,800	187,152.00	0.11
213	688223	晶科能源	13,230	186,013.80	0.11
214	600489	中金黄金	17,800	183,874.00	0.11
215	300003	乐普医疗	8,100	183,141.00	0.11
216	600989	宝丰能源	14,500	182,845.00	0.11
217	603806	福斯特	4,899	182,193.81	0.11
218	603260	合盛硅业	2,600	182,052.00	0.11
219	002821	凯莱英	1,540	181,504.40	0.11
220	300454	深信服	1,600	181,200.00	0.11
221	600188	兖矿能源	6,000	179,520.00	0.10
222	601838	成都银行	14,700	179,487.00	0.10
223	600487	亨通光电	12,200	178,852.00	0.10
224	002738	中矿资源	3,500	178,290.00	0.10
225	002028	思源电气	3,800	177,536.00	0.10
226	688396	华润微	3,360	176,097.60	0.10
227	601615	明阳智能	10,400	175,552.00	0.10
228	600536	中国软件	3,740	175,331.20	0.10
229	601901	方正证券	26,700	174,618.00	0.10
230	300661	圣邦股份	2,125	174,526.25	0.10
231	688777	中控技术	2,778	174,402.84	0.10
232	000876	新希望	14,900	174,032.00	0.10
233	603392	万泰生物	2,595	173,268.15	0.10
234	601058	赛轮轮胎	15,100	171,989.00	0.10

235	601555	东吴证券	24,668	171,195.92	0.10
236	600765	中航重机	6,440	170,724.40	0.10
237	600039	四川路桥	17,380	170,497.80	0.10
238	600460	士兰微	5,600	169,512.00	0.10
239	000895	双汇发展	6,900	168,981.00	0.10
240	300413	芒果超媒	4,900	167,629.00	0.10
241	002463	沪电股份	8,000	167,520.00	0.10
242	600233	圆通速递	11,500	167,440.00	0.10
243	300037	新宙邦	3,220	167,085.80	0.10
244	002736	国信证券	19,000	165,870.00	0.10
245	601607	上海医药	7,400	165,834.00	0.10
246	002648	卫星化学	11,080	165,756.80	0.10
247	688303	大全能源	4,080	165,036.00	0.10
248	000066	中国长城	11,900	164,577.00	0.10
249	605117	德业股份	1,100	164,505.00	0.10
250	000786	北新建材	6,700	164,217.00	0.10
251	002007	华兰生物	7,280	163,144.80	0.09
252	000807	云铝股份	12,800	162,944.00	0.09
253	003816	中国广核	52,200	162,342.00	0.09
254	600885	宏发股份	5,080	161,798.00	0.09
255	300999	金龙鱼	4,000	159,960.00	0.09
256	300207	欣旺达	9,800	159,936.00	0.09
257	300751	迈为股份	932	157,862.16	0.09
258	600482	中国动力	6,700	157,048.00	0.09
259	300769	德方纳米	1,420	156,526.60	0.09
260	300433	蓝思科技	13,200	155,232.00	0.09
261	002601	龙佰集团	9,400	155,100.00	0.09
262	000423	东阿阿胶	2,900	155,005.00	0.09
263	000009	中国宝安	12,700	153,289.00	0.09
264	300759	康龙化成	4,000	153,120.00	0.09
265	601238	广汽集团	14,600	152,132.00	0.09
266	600383	金地集团	21,000	151,410.00	0.09
267	300146	汤臣倍健	6,300	151,074.00	0.09
268	600352	浙江龙盛	16,100	150,535.00	0.09
269	601021	春秋航空	2,600	149,422.00	0.09
270	002156	通富微电	6,600	149,160.00	0.09
271	300058	蓝色光标	15,400	148,918.00	0.09
272	600132	重庆啤酒	1,600	147,456.00	0.09
273	603444	吉比特	300	147,333.00	0.09
274	600332	白云山	4,600	146,648.00	0.09
275	002966	苏州银行	22,360	146,458.00	0.09
276	002185	华天科技	15,800	145,360.00	0.08
277	601108	财通证券	20,020	144,944.80	0.08
278	688099	晶晨股份	1,717	144,777.44	0.08

279	600415	小商品城	16,900	144,157.00	0.08
280	300223	北京君正	1,600	141,296.00	0.08
281	002624	完美世界	8,350	141,031.50	0.08
282	600027	华电国际	21,000	140,490.00	0.08
283	600219	南山铝业	46,500	140,430.00	0.08
284	002625	光启技术	9,200	140,392.00	0.08
285	300144	宋城演艺	11,280	139,872.00	0.08
286	600109	国金证券	16,100	139,587.00	0.08
287	000783	长江证券	23,900	138,620.00	0.08
288	600875	东方电气	7,400	138,010.00	0.08
289	601233	桐昆股份	10,400	137,800.00	0.08
290	600298	安琪酵母	3,800	137,598.00	0.08
291	601077	渝农商行	38,200	137,138.00	0.08
292	600161	天坛生物	5,024	136,401.60	0.08
293	600418	江淮汽车	10,800	135,972.00	0.08
294	600988	赤峰黄金	10,100	135,946.00	0.08
295	300568	星源材质	7,900	135,801.00	0.08
296	600763	通策医疗	1,400	135,604.00	0.08
297	000983	山西焦煤	14,900	135,590.00	0.08
298	600096	云天化	7,900	134,853.00	0.08
299	002385	大北农	20,400	134,640.00	0.08
300	300285	国瓷材料	4,900	134,260.00	0.08
301	002008	大族激光	5,100	133,620.00	0.08
302	002223	鱼跃医疗	3,700	133,163.00	0.08
303	002407	多氟多	6,680	132,664.80	0.08
304	600754	锦江酒店	3,100	131,254.00	0.08
305	000630	铜陵有色	45,400	131,206.00	0.08
306	600362	江西铜业	6,900	130,962.00	0.08
307	601865	福莱特	3,400	130,934.00	0.08
308	300073	当升科技	2,600	130,858.00	0.08
309	601699	潞安环能	8,000	130,560.00	0.08
310	300390	天华新能	3,640	130,312.00	0.08
311	300763	锦浪科技	1,250	130,125.00	0.08
312	000723	美锦能源	17,200	129,688.00	0.08
313	603290	斯达半导	600	129,120.00	0.08
314	600862	中航高科	5,100	129,081.00	0.08
315	002756	永兴材料	2,060	128,976.60	0.07
316	300024	机器人	7,700	128,359.00	0.07
317	603882	金域医学	1,700	128,350.00	0.07
318	603589	口子窖	2,600	128,310.00	0.07
319	300604	长川科技	2,700	128,223.00	0.07
320	300395	菲利华	2,600	127,920.00	0.07
321	600918	中泰证券	18,500	127,835.00	0.07
322	601878	浙商证券	12,900	127,452.00	0.07

323	601162	天风证券	42,710	127,275.80	0.07
324	002497	雅化集团	7,100	126,238.00	0.07
325	600705	中航产融	32,700	125,241.00	0.07
326	603688	石英股份	1,100	125,224.00	0.07
327	601872	招商轮船	21,580	124,948.20	0.07
328	000933	神火股份	9,600	124,800.00	0.07
329	002240	盛新锂能	3,900	124,293.00	0.07
330	601168	西部矿业	11,800	124,018.00	0.07
331	002409	雅克科技	1,700	123,896.00	0.07
332	601319	中国人保	21,200	123,808.00	0.07
333	002439	启明星辰	4,100	122,016.00	0.07
334	601998	中信银行	20,400	121,992.00	0.07
335	600061	国投资本	17,104	121,780.48	0.07
336	000932	华菱钢铁	25,500	121,635.00	0.07
337	300474	景嘉微	1,350	121,486.50	0.07
338	000617	中油资本	16,800	121,464.00	0.07
339	600066	宇通客车	8,200	120,868.00	0.07
340	300628	亿联网络	3,420	119,939.40	0.07
341	000069	华侨城 A	27,200	119,680.00	0.07
342	002600	领益智造	17,300	119,543.00	0.07
343	603596	伯特利	1,500	118,890.00	0.07
344	000975	银泰黄金	10,160	118,872.00	0.07
345	600060	海信视像	4,800	118,800.00	0.07
346	002568	百润股份	3,260	118,501.00	0.07
347	300136	信维通信	5,900	118,472.00	0.07
348	002797	第一创业	20,700	118,404.00	0.07
349	603816	顾家家居	3,100	118,265.00	0.07
350	002465	海格通信	11,400	117,876.00	0.07
351	000408	藏格矿业	5,200	117,364.00	0.07
352	002138	顺络电子	4,900	117,159.00	0.07
353	603833	欧派家居	1,222	117,067.60	0.07
354	603486	科沃斯	1,500	116,655.00	0.07
355	603899	晨光股份	2,600	116,064.00	0.07
356	600803	新奥股份	6,100	115,778.00	0.07
357	601128	常熟银行	16,900	115,258.00	0.07
358	688567	孚能科技	5,326	114,988.34	0.07
359	603939	益丰药房	3,100	114,700.00	0.07
360	300253	卫宁健康	10,600	114,692.00	0.07
361	000591	太阳能	16,900	114,582.00	0.07
362	600160	巨化股份	8,300	114,374.00	0.07
363	000021	深科技	5,700	113,943.00	0.07
364	600839	四川长虹	22,500	113,625.00	0.07
365	600884	杉杉股份	7,500	113,550.00	0.07
366	600873	梅花生物	12,700	113,411.00	0.07

367	688536	思瑞浦	520	113,360.00	0.07
368	300601	康泰生物	4,460	113,239.40	0.07
369	600879	航天电子	13,300	112,917.00	0.07
370	000683	远兴能源	15,700	112,883.00	0.07
371	300832	新产业	1,900	112,100.00	0.07
372	002938	鹏鼎控股	4,600	111,734.00	0.06
373	601799	星宇股份	900	111,240.00	0.06
374	300699	光威复材	3,600	111,060.00	0.06
375	600183	生益科技	7,800	110,760.00	0.06
376	600392	盛和资源	8,600	110,682.00	0.06
377	601990	南京证券	13,500	110,430.00	0.06
378	002368	太极股份	2,680	110,335.60	0.06
379	600497	驰宏锌锗	21,900	109,938.00	0.06
380	600563	法拉电子	800	109,840.00	0.06
381	688363	华熙生物	1,226	109,310.16	0.06
382	002294	信立泰	3,500	109,165.00	0.06
383	002078	太阳纸业	10,200	109,038.00	0.06
384	688005	容百科技	2,009	108,526.18	0.06
385	000729	燕京啤酒	8,700	108,489.00	0.06
386	600177	雅戈尔	17,068	107,699.08	0.06
387	601696	中银证券	10,100	107,666.00	0.06
388	300118	东方日升	4,200	107,646.00	0.06
389	600516	方大炭素	17,360	107,632.00	0.06
390	300017	网宿科技	15,100	107,361.00	0.06
391	000831	中国稀土	3,600	106,560.00	0.06
392	002430	杭氧股份	3,100	106,516.00	0.06
393	600642	申能股份	15,200	106,248.00	0.06
394	002850	科达利	800	105,800.00	0.06
395	688521	芯原股份	1,471	105,794.32	0.06
396	000728	国元证券	16,140	105,232.80	0.06
397	300866	安克创新	1,200	105,000.00	0.06
398	002673	西部证券	16,500	104,775.00	0.06
399	000708	中信特钢	6,600	104,544.00	0.06
400	600141	兴发集团	4,700	104,434.00	0.06
401	000513	丽珠集团	2,683	104,395.53	0.06
402	600118	中国卫星	3,700	104,377.00	0.06
403	000629	钒钛股份	26,400	103,224.00	0.06
404	002268	电科网安	3,700	103,119.00	0.06
405	002532	天山铝业	17,200	103,028.00	0.06
406	600170	上海建工	38,300	103,027.00	0.06
407	601898	中煤能源	12,200	102,968.00	0.06
408	002273	水晶光电	8,600	102,684.00	0.06
409	002916	深南电路	1,360	102,503.20	0.06
410	600325	华发股份	10,400	102,440.00	0.06

411	300919	中伟股份	1,700	102,425.00	0.06
412	600699	均胜电子	5,800	102,312.00	0.06
413	002025	航天电器	1,600	102,080.00	0.06
414	688390	固德威	610	101,784.60	0.06
415	002195	二三四五	35,200	101,728.00	0.06
416	002739	万达电影	8,100	101,574.00	0.06
417	600511	国药股份	2,600	101,010.00	0.06
418	002372	伟星新材	4,900	100,646.00	0.06
419	600166	福田汽车	29,600	100,640.00	0.06
420	600143	金发科技	11,512	100,499.76	0.06
421	600153	建发股份	9,200	100,372.00	0.06
422	603927	中科软	2,600	100,256.00	0.06
423	000738	航发控制	4,100	100,040.00	0.06
424	601966	玲珑轮胎	4,500	99,990.00	0.06
425	601881	中国银河	8,600	99,846.00	0.06
426	000998	隆平高科	6,500	99,775.00	0.06
427	300595	欧普康视	3,300	99,627.00	0.06
428	600521	华海药业	5,400	99,414.00	0.06
429	603000	人民网	3,400	99,280.00	0.06
430	000400	许继电气	4,300	99,115.00	0.06
431	600549	厦门钨业	5,200	98,956.00	0.06
432	600637	东方明珠	12,600	98,532.00	0.06
433	600399	抚顺特钢	9,600	97,920.00	0.06
434	600481	双良节能	7,000	97,860.00	0.06
435	600018	上港集团	18,500	97,125.00	0.06
436	603185	弘元绿能	1,300	96,915.00	0.06
437	002065	东华软件	13,700	96,722.00	0.06
438	603517	绝味食品	2,600	96,590.00	0.06
439	002281	光迅科技	2,600	96,434.00	0.06
440	002444	巨星科技	4,400	96,272.00	0.06
441	601198	东兴证券	12,000	96,240.00	0.06
442	601577	长沙银行	12,400	96,224.00	0.06
443	600486	扬农化工	1,100	96,162.00	0.06
444	002131	利欧股份	41,600	95,680.00	0.06
445	688169	石头科技	298	95,562.64	0.06
446	002353	杰瑞股份	3,800	95,494.00	0.06
447	300682	朗新科技	4,100	95,448.00	0.06
448	600499	科达制造	8,400	95,424.00	0.06
449	600704	物产中大	19,300	95,342.00	0.06
450	600859	王府井	4,800	94,992.00	0.06
451	300383	光环新网	8,800	94,600.00	0.06
452	000997	新大陆	5,000	94,500.00	0.05
453	688002	睿创微纳	2,109	94,483.20	0.05
454	600271	航天信息	6,900	94,461.00	0.05

455	002373	千方科技	6,900	94,116.00	0.05
456	600021	上海电力	8,700	93,699.00	0.05
457	300487	蓝晓科技	1,500	93,630.00	0.05
458	000877	天山股份	11,500	93,610.00	0.05
459	300001	特锐德	4,500	93,510.00	0.05
460	689009	九号公司	2,532	93,304.20	0.05
461	000960	锡业股份	6,000	93,300.00	0.05
462	688220	翱捷科技	1,232	92,880.48	0.05
463	688009	中国通号	15,963	92,585.40	0.05
464	603077	和邦生物	38,100	92,583.00	0.05
465	601997	贵阳银行	17,900	92,364.00	0.05
466	601216	君正集团	22,400	91,840.00	0.05
467	300088	长信科技	15,200	91,656.00	0.05
468	002432	九安医疗	2,600	91,546.00	0.05
469	600380	健康元	7,200	91,512.00	0.05
470	000623	吉林敖东	5,700	91,428.00	0.05
471	002595	豪迈科技	2,600	91,338.00	0.05
472	300438	鹏辉能源	1,900	91,276.00	0.05
473	002056	横店东磁	5,000	91,050.00	0.05
474	002120	韵达股份	9,500	90,820.00	0.05
475	000703	恒逸石化	13,390	90,784.20	0.05
476	002064	华峰化学	13,200	90,552.00	0.05
477	002507	涪陵榨菜	4,940	90,451.40	0.05
478	688561	奇安信	1,744	90,356.64	0.05
479	002152	广电运通	7,700	90,244.00	0.05
480	300676	华大基因	1,500	89,985.00	0.05
481	600529	山东药玻	3,300	89,826.00	0.05
482	600867	通化东宝	8,600	89,784.00	0.05
483	600498	烽火通信	4,400	89,628.00	0.05
484	002203	海亮股份	7,400	88,874.00	0.05
485	600998	九州通	8,544	88,686.72	0.05
486	600348	华阳股份	11,200	88,592.00	0.05
487	002299	圣农发展	4,600	88,090.00	0.05
488	002414	高德红外	11,337	88,088.49	0.05
489	601016	节能风电	23,990	88,043.30	0.05
490	603712	七一二	2,900	87,609.00	0.05
491	600739	辽宁成大	6,650	87,447.50	0.05
492	600546	山煤国际	6,000	86,820.00	0.05
493	300212	易华录	2,600	86,398.00	0.05
494	600025	华能水电	12,000	85,560.00	0.05
495	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.05
496	601155	新城控股	5,898	84,990.18	0.05
497	002506	协鑫集成	28,900	84,677.00	0.05
498	601636	旗滨集团	9,800	84,476.00	0.05

499	600970	中材国际	6,600	84,150.00	0.05
500	002080	中材科技	4,100	84,132.00	0.05
501	603338	浙江鼎力	1,500	84,015.00	0.05
502	002531	天顺风能	5,500	83,765.00	0.05
503	603737	三棵树	1,280	83,737.60	0.05
504	600863	内蒙华电	20,100	83,415.00	0.05
505	603885	吉祥航空	5,400	83,322.00	0.05
506	002092	中泰化学	12,800	82,560.00	0.05
507	002683	广东宏大	2,800	82,432.00	0.05
508	600655	豫园股份	12,000	82,320.00	0.05
509	300182	捷成股份	13,000	82,030.00	0.05
510	600580	卧龙电驱	5,600	81,816.00	0.05
511	000878	云南铜业	7,400	81,770.00	0.05
512	300296	利亚德	12,500	81,625.00	0.05
513	600528	中铁工业	8,200	81,016.00	0.05
514	600909	华安证券	17,340	80,977.80	0.05
515	300748	金力永磁	2,700	80,784.00	0.05
516	600820	隧道股份	13,400	80,534.00	0.05
517	000893	亚钾国际	3,500	80,290.00	0.05
518	002192	融捷股份	1,200	80,196.00	0.05
519	688772	珠海冠宇	3,966	79,914.90	0.05
520	600535	天士力	5,500	79,805.00	0.05
521	002926	华西证券	9,600	79,776.00	0.05
522	002939	长城证券	9,800	79,674.00	0.05
523	300244	迪安诊断	3,100	79,453.00	0.05
524	688301	奕瑞科技	280	79,080.40	0.05
525	000547	航天发展	7,900	79,000.00	0.05
526	000750	国海证券	23,580	78,993.00	0.05
527	603233	大参林	2,812	78,764.12	0.05
528	688385	复旦微电	1,568	78,556.80	0.05
529	000039	中集集团	11,400	78,546.00	0.05
530	600416	湘电股份	4,100	78,269.00	0.05
531	600258	首旅酒店	4,100	77,695.00	0.05
532	600008	首创环保	26,950	77,616.00	0.05
533	600606	绿地控股	27,908	76,747.00	0.04
534	603456	九洲药业	2,800	76,664.00	0.04
535	603156	养元饮品	3,100	76,570.00	0.04
536	000060	中金岭南	16,100	76,475.00	0.04
537	600329	达仁堂	1,700	76,313.00	0.04
538	603195	公牛集团	792	76,079.52	0.04
539	002429	兆驰股份	13,800	75,900.00	0.04
540	002508	老板电器	3,000	75,870.00	0.04
541	600566	济川药业	2,600	75,504.00	0.04
542	601991	大唐发电	22,800	75,468.00	0.04

543	600315	上海家化	2,600	75,426.00	0.04
544	688188	柏楚电子	400	75,424.00	0.04
545	000970	中科三环	5,875	75,317.50	0.04
546	000830	鲁西化工	7,100	74,976.00	0.04
547	600369	西南证券	20,500	74,825.00	0.04
548	002557	洽洽食品	1,800	74,790.00	0.04
549	600435	北方导航	6,500	74,685.00	0.04
550	603160	汇顶科技	1,600	74,000.00	0.04
551	600390	五矿资本	13,700	73,706.00	0.04
552	600398	海澜之家	10,700	73,616.00	0.04
553	002500	山西证券	13,190	73,600.20	0.04
554	002936	郑州银行	31,744	73,011.20	0.04
555	603893	瑞芯微	1,000	72,850.00	0.04
556	002128	电投能源	5,500	72,710.00	0.04
557	601880	辽港股份	46,400	72,384.00	0.04
558	300009	安科生物	7,216	72,160.00	0.04
559	300558	贝达药业	1,500	72,045.00	0.04
560	600038	中直股份	1,800	71,676.00	0.04
561	603658	安图生物	1,380	71,387.40	0.04
562	300070	碧水源	13,300	71,288.00	0.04
563	688065	凯赛生物	1,145	71,287.70	0.04
564	300957	贝泰妮	800	71,104.00	0.04
565	300026	红日药业	13,000	70,460.00	0.04
566	688516	奥特维	373	70,273.20	0.04
567	603858	步长制药	3,400	70,006.00	0.04
568	000050	深天马 A	7,600	69,768.00	0.04
569	601717	郑煤机	5,600	69,720.00	0.04
570	300529	健帆生物	3,000	69,540.00	0.04
571	688187	时代电气	1,659	69,445.74	0.04
572	002153	石基信息	4,940	69,160.00	0.04
573	600985	淮北矿业	6,000	69,120.00	0.04
574	600848	上海临港	5,767	68,915.65	0.04
575	603228	景旺电子	2,660	68,229.00	0.04
576	601179	中国西电	12,600	68,166.00	0.04
577	002690	美亚光电	2,640	67,980.00	0.04
578	002572	索菲亚	3,900	67,938.00	0.04
579	002244	滨江集团	7,700	67,914.00	0.04
580	688779	长远锂科	6,003	67,653.81	0.04
581	002408	齐翔腾达	10,580	67,394.60	0.04
582	601456	国联证券	7,400	67,340.00	0.04
583	603127	昭衍新药	1,640	67,076.00	0.04
584	002266	浙富控股	16,200	66,906.00	0.04
585	600673	东阳光	9,200	66,332.00	0.04
586	601958	金钼股份	5,900	65,785.00	0.04

587	002019	亿帆医药	4,500	65,700.00	0.04
588	600827	百联股份	4,900	65,513.00	0.04
589	003035	南网能源	9,200	65,504.00	0.04
590	600895	张江高科	4,700	65,424.00	0.04
591	600667	太极实业	9,000	65,340.00	0.04
592	603267	鸿远电子	1,000	65,300.00	0.04
593	002958	青农商行	24,000	65,280.00	0.04
594	688538	和辉光电	25,611	65,051.94	0.04
595	600208	新湖中宝	26,200	64,976.00	0.04
596	300373	扬杰科技	1,600	64,912.00	0.04
597	601666	平煤股份	8,600	64,844.00	0.04
598	000155	川能动力	4,500	64,800.00	0.04
599	600282	南钢股份	19,000	64,030.00	0.04
600	300357	我武生物	1,900	63,897.00	0.04
601	601000	唐山港	18,100	63,893.00	0.04
602	600171	上海贝岭	3,500	63,875.00	0.04
603	000739	普洛药业	3,600	63,864.00	0.04
604	300677	英科医疗	2,900	63,800.00	0.04
605	600755	厦门国贸	8,200	63,468.00	0.04
606	002831	裕同科技	2,600	63,414.00	0.04
607	600316	洪都航空	2,700	63,315.00	0.04
608	002670	国盛金控	7,200	63,216.00	0.04
609	000887	中鼎股份	4,800	62,832.00	0.04
610	688116	天奈科技	1,370	62,677.50	0.04
611	002155	湖南黄金	5,100	62,220.00	0.04
612	600959	江苏有线	18,300	61,854.00	0.04
613	601231	环旭电子	4,100	61,336.00	0.04
614	603218	日月股份	3,200	60,768.00	0.04
615	600131	国网信通	3,000	60,570.00	0.04
616	300115	长盈精密	5,080	60,502.80	0.04
617	600517	国网英大	10,600	60,420.00	0.04
618	000778	新兴铸管	14,800	60,384.00	0.04
619	000598	兴蓉环境	11,100	60,273.00	0.04
620	601866	中远海发	24,400	60,268.00	0.04
621	600378	昊华科技	1,600	60,224.00	0.04
622	300888	稳健医疗	1,440	60,004.80	0.03
623	002030	达安基因	5,976	59,580.72	0.03
624	688200	华峰测控	389	59,517.00	0.03
625	600056	中国医药	4,580	59,448.40	0.03
626	603026	胜华新材	1,000	59,250.00	0.03
627	300363	博腾股份	2,000	59,180.00	0.03
628	300251	光线传媒	7,300	59,057.00	0.03
629	600582	天地科技	10,100	58,883.00	0.03
630	002221	东华能源	6,800	58,820.00	0.03

631	600598	北大荒	4,400	58,652.00	0.03
632	002487	大金重工	1,900	58,596.00	0.03
633	000987	越秀资本	9,160	58,166.00	0.03
634	002249	大洋电机	10,200	58,140.00	0.03
635	002326	永太科技	3,800	58,102.00	0.03
636	601005	重庆钢铁	41,300	57,820.00	0.03
637	000027	深圳能源	8,760	57,728.40	0.03
638	000709	河钢股份	25,500	57,630.00	0.03
639	600906	财达证券	8,000	57,600.00	0.03
640	002183	怡亚通	11,200	57,120.00	0.03
641	601106	中国一重	16,900	56,784.00	0.03
642	601992	金隅集团	25,700	56,026.00	0.03
643	002518	科士达	1,400	56,014.00	0.03
644	600373	中文传媒	4,200	55,944.00	0.03
645	601698	中国卫通	2,800	55,664.00	0.03
646	000883	湖北能源	12,200	55,632.00	0.03
647	600718	东软集团	5,200	55,432.00	0.03
648	601665	齐鲁银行	14,000	54,880.00	0.03
649	603568	伟明环保	3,133	54,858.83	0.03
650	002511	中顺洁柔	4,900	54,635.00	0.03
651	300776	帝尔激光	840	54,516.00	0.03
652	601778	晶科科技	11,000	54,340.00	0.03
653	000825	太钢不锈	14,000	54,180.00	0.03
654	601808	中海油服	3,900	54,132.00	0.03
655	688029	南微医学	657	53,584.92	0.03
656	601928	凤凰传媒	4,700	53,580.00	0.03
657	600663	陆家嘴	5,400	53,298.00	0.03
658	600737	中粮糖业	6,600	53,130.00	0.03
659	002985	北摩高科	1,202	53,032.24	0.03
660	600967	内蒙一机	5,200	52,520.00	0.03
661	600155	华创云信	8,400	52,248.00	0.03
662	600297	广汇汽车	25,000	52,000.00	0.03
663	603225	新凤鸣	4,700	51,935.00	0.03
664	600801	华新水泥	4,200	51,870.00	0.03
664	605499	东鹏饮料	300	51,870.00	0.03
666	002791	坚朗五金	800	51,768.00	0.03
667	603638	艾迪精密	2,500	51,300.00	0.03
668	000800	一汽解放	6,100	51,057.00	0.03
669	601098	中南传媒	4,400	51,040.00	0.03
670	002468	申通快递	4,700	50,854.00	0.03
671	603883	老百姓	1,702	50,804.70	0.03
672	000012	南玻 A	8,500	50,660.00	0.03
673	001227	兰州银行	17,500	50,050.00	0.03
674	002032	苏泊尔	1,000	50,000.00	0.03

675	688778	厦钨新能	1,010	49,995.00	0.03
676	688276	百克生物	796	49,829.60	0.03
677	300482	万孚生物	1,870	49,798.10	0.03
678	600871	石化油服	25,100	49,698.00	0.03
679	002745	木林森	5,400	49,680.00	0.03
680	603866	桃李面包	4,876	49,345.12	0.03
681	600500	中化国际	8,800	48,928.00	0.03
682	000581	威孚高科	3,100	48,825.00	0.03
683	300979	华利集团	1,000	48,740.00	0.03
684	000156	华数传媒	5,600	48,720.00	0.03
685	000401	冀东水泥	6,600	48,642.00	0.03
686	688208	道通科技	1,598	48,435.38	0.03
687	603529	爱玛科技	1,500	48,330.00	0.03
688	002867	周大生	2,700	48,006.00	0.03
689	688520	神州细胞	843	47,831.82	0.03
690	300861	美畅股份	1,100	47,707.00	0.03
691	601118	海南橡胶	10,600	47,488.00	0.03
692	002250	联化科技	4,500	47,070.00	0.03
693	600022	山东钢铁	33,000	46,860.00	0.03
694	601611	中国核建	5,500	46,475.00	0.03
695	601236	红塔证券	6,220	46,339.00	0.03
696	688690	纳微科技	1,190	46,231.50	0.03
697	000930	中粮科技	5,700	46,170.00	0.03
698	688082	盛美上海	418	46,147.20	0.03
699	000785	居然之家	12,100	46,101.00	0.03
700	002010	传化智联	8,600	45,752.00	0.03
701	600062	华润双鹤	2,600	45,292.00	0.03
702	601608	中信重工	10,700	45,047.00	0.03
703	300850	新强联	1,200	44,856.00	0.03
704	002423	中粮资本	5,600	44,800.00	0.03
705	601598	中国外运	9,600	44,736.00	0.03
706	000559	万向钱潮	8,200	44,690.00	0.03
707	301029	怡合达	1,000	44,680.00	0.03
708	002505	鹏都农牧	23,600	44,604.00	0.03
709	000089	深圳机场	6,400	44,480.00	0.03
710	600782	新钢股份	11,800	43,778.00	0.03
711	002081	金螳螂	9,700	43,747.00	0.03
712	600597	光明乳业	4,200	43,680.00	0.03
713	600259	广晟有色	1,200	43,368.00	0.03
714	688006	杭可科技	1,422	43,328.34	0.03
715	688107	安路科技	778	43,093.42	0.03
716	600901	江苏金租	10,280	42,456.40	0.02
717	000958	电投产融	9,800	42,434.00	0.02
718	300618	寒锐钴业	1,300	42,133.00	0.02

719	000937	冀中能源	6,600	42,108.00	0.02
720	600409	三友化工	7,700	41,965.00	0.02
721	600707	彩虹股份	8,800	41,888.00	0.02
722	600339	中油工程	10,200	41,514.00	0.02
723	603707	健友股份	3,060	41,310.00	0.02
724	000898	鞍钢股份	14,800	41,144.00	0.02
725	002761	浙江建投	2,700	40,986.00	0.02
726	000537	广宇发展	3,500	40,845.00	0.02
727	688281	华秦科技	201	40,702.50	0.02
728	601187	厦门银行	8,100	40,662.00	0.02
729	001914	招商积余	2,700	40,635.00	0.02
730	600095	湘财股份	5,200	40,560.00	0.02
731	000415	渤海租赁	19,100	40,110.00	0.02
732	603826	坤彩科技	800	40,000.00	0.02
733	000967	盈峰环境	7,900	39,895.00	0.02
734	601718	际华集团	13,400	39,798.00	0.02
735	600507	方大特钢	8,591	39,776.33	0.02
736	300257	开山股份	2,600	39,442.00	0.02
737	600167	联美控股	5,600	39,032.00	0.02
738	601156	东航物流	3,000	39,000.00	0.02
739	601568	北元集团	7,360	38,787.20	0.02
740	000563	陕国投 A	12,600	38,430.00	0.02
741	600968	海油发展	12,500	38,375.00	0.02
742	600808	马钢股份	14,900	38,293.00	0.02
743	688185	康希诺	458	37,327.00	0.02
744	600195	中牧股份	3,136	36,628.48	0.02
745	603650	彤程新材	1,100	36,080.00	0.02
746	002705	新宝股份	2,000	36,060.00	0.02
747	600126	杭钢股份	8,300	36,022.00	0.02
748	600764	中国海防	1,300	35,386.00	0.02
749	002925	盈趣科技	1,820	35,308.00	0.02
750	603379	三美股份	1,500	35,265.00	0.02
751	002608	江苏国信	4,600	34,822.00	0.02
752	300442	润泽科技	1,100	33,836.00	0.02
753	000402	金融街	7,400	33,448.00	0.02
754	000959	首钢股份	9,500	33,250.00	0.02
755	603786	科博达	500	32,850.00	0.02
756	688052	纳芯微	204	32,307.48	0.02
757	601828	美凯龙	6,720	32,188.80	0.02
758	688819	天能股份	873	32,161.32	0.02
759	002110	三钢闽光	7,600	32,072.00	0.02
760	001203	大中矿业	2,800	31,108.00	0.02
761	002653	海思科	1,300	30,680.00	0.02
762	688234	天岳先进	414	30,611.16	0.02

763	002563	森马服饰	4,900	30,478.00	0.02
764	600377	宁沪高速	3,100	30,473.00	0.02
765	601298	青岛港	4,300	29,971.00	0.02
766	002399	海普瑞	2,600	29,822.00	0.02
767	601228	广州港	9,200	29,716.00	0.02
768	688289	圣湘生物	1,733	29,183.72	0.02
769	000031	大悦城	7,900	28,914.00	0.02
770	600928	西安银行	8,200	28,864.00	0.02
771	600623	华谊集团	4,600	28,658.00	0.02
772	600995	南网储能	2,600	28,626.00	0.02
773	603056	德邦股份	1,800	27,756.00	0.02
774	600927	永安期货	1,700	27,642.00	0.02
775	603317	天味食品	1,874	27,379.14	0.02
776	600350	山东高速	4,200	26,754.00	0.02
777	601139	深圳燃气	3,600	26,244.00	0.02
778	601869	长飞光纤	700	25,907.00	0.02
779	601136	首创证券	1,800	25,506.00	0.01
780	601969	海南矿业	3,800	25,004.00	0.01
781	000869	张裕 A	800	24,528.00	0.01
782	001872	招商港口	1,400	24,178.00	0.01
783	688105	诺唯赞	778	23,721.22	0.01
784	000553	安道麦 A	2,700	22,788.00	0.01
785	001289	龙源电力	1,000	22,500.00	0.01
786	002945	华林证券	1,600	21,888.00	0.01
787	600299	安迪苏	2,600	20,722.00	0.01
788	601158	重庆水务	3,600	20,016.00	0.01
789	603868	飞科电器	300	18,927.00	0.01
790	688295	中复神鹰	500	18,340.00	0.01
791	603355	莱克电气	660	16,770.60	0.01
792	600032	浙江新能	1,300	16,328.00	0.01
793	688249	晶合集成	877	15,838.62	0.01
794	600956	新天绿能	1,800	15,696.00	0.01
795	688248	南网科技	408	15,663.12	0.01
796	300741	华宝股份	700	14,994.00	0.01
797	002901	大博医疗	300	9,324.00	0.01
798	688472	阿特斯	515	8,775.60	0.01
799	688361	中科飞测	133	8,601.11	0.01
800	688443	智翔金泰	286	8,434.14	0.00
801	688478	晶升股份	165	6,991.05	0.00
802	688629	华丰科技	353	6,562.27	0.00
803	688562	航天软件	291	6,492.21	0.00
804	688582	芯动联科	144	5,857.92	0.00
805	301408	华人健康	339	5,746.05	0.00
806	688146	中船特气	148	5,643.24	0.00

807	688352	硕中科技	433	5,226.31	0.00
808	688593	新相微	343	5,004.37	0.00
809	688523	航天环宇	207	4,936.95	0.00
810	688552	航天南湖	209	4,911.50	0.00
811	688620	安凯微	393	4,849.62	0.00
812	688535	华海诚科	91	4,661.93	0.00
813	688334	西高院	277	4,490.17	0.00
814	688581	安杰思	36	4,249.08	0.00
815	688433	华曙高科	134	4,221.00	0.00
816	688570	天玛智控	166	4,204.78	0.00
817	688429	时创能源	157	4,008.21	0.00
818	301157	华塑科技	72	3,810.96	0.00
819	601061	中信金属	448	3,395.84	0.00
820	301439	泓淋电力	196	3,312.40	0.00
821	688479	友车科技	111	3,273.39	0.00
822	688623	二元科技	36	3,124.44	0.00
823	688631	莱斯信息	101	3,016.87	0.00
824	301345	涛涛车业	60	2,798.40	0.00
825	603135	中重科技	147	2,629.83	0.00
826	601065	江盐集团	188	2,225.92	0.00
827	603137	恒尚节能	109	1,862.81	0.00
828	601133	柏诚股份	143	1,753.18	0.00
829	603172	万丰股份	91	1,467.83	0.00
830	603125	常青科技	49	1,201.97	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,800,689.00	1.31
2	000858	五粮液	1,109,286.00	0.81
3	000333	美的集团	778,674.00	0.57
4	300760	迈瑞医疗	620,551.20	0.45
5	002594	比亚迪	591,728.00	0.43
6	300059	东方财富	584,088.00	0.42
7	000651	格力电器	500,682.00	0.36
8	002415	海康威视	492,478.00	0.36
9	000568	泸州老窖	463,873.00	0.34
10	300274	阳光电源	462,510.00	0.34
11	000725	京东方 A	433,203.00	0.32

12	002475	立讯精密	410,478.00	0.30
13	002352	顺丰控股	399,503.00	0.29
14	300124	汇川技术	385,515.00	0.28
15	002230	科大讯飞	379,515.00	0.28
16	000063	中兴通讯	356,101.02	0.26
17	002714	牧原股份	346,382.00	0.25
18	000001	平安银行	336,087.00	0.24
19	600519	贵州茅台	331,859.00	0.24
20	000792	盐湖股份	324,159.00	0.24

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	1,011,548.20	0.74
2	000858	五粮液	665,377.00	0.48
3	600519	贵州茅台	508,038.00	0.37
4	300760	迈瑞医疗	463,941.00	0.34
5	000333	美的集团	418,548.00	0.30
6	300059	东方财富	361,696.00	0.26
7	300274	阳光电源	312,282.00	0.23
8	002594	比亚迪	311,286.00	0.23
9	002415	海康威视	307,347.00	0.22
10	000651	格力电器	299,206.00	0.22
11	000568	泸州老窖	276,472.00	0.20
12	000725	京东方 A	251,861.00	0.18
13	002352	顺丰控股	251,251.00	0.18
14	300124	汇川技术	241,615.00	0.18
15	002602	世纪华通	237,379.20	0.17
16	600900	长江电力	231,652.00	0.17
17	002475	立讯精密	227,436.00	0.17
18	002230	科大讯飞	220,270.00	0.16
19	002466	天齐锂业	210,878.00	0.15
20	002304	洋河股份	200,354.00	0.15

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	46,575,411.08
卖出股票收入（成交）总额	30,951,878.95

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚。中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	579,895.40
2	应收清算款	1,719,737.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	2,375,248.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有限公司一易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
930	154,740.6 9	117,896,634 .00	81.92%	26,012,209. 00	18.08%	98,954,462. 00	68.76%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行股份有限公司一易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张招兴	5,000,000.00	3.47%
2	广发证券股份有限公司	3,682,102.00	2.56%
3	方正证券股份有限公司	2,995,336.00	2.08%
4	中信证券股份有限公司	2,802,108.00	1.95%
5	邓玉良	2,213,600.00	1.54%
6	招商证券股份有限公司	1,887,228.00	1.31%
7	广东南海农村商业银行股份有限公司一 开放式净值型理财	1,644,200.00	1.14%
8	东方证券股份有限公司	1,378,191.00	0.96%
9	国泰君安证券股份有限公司	1,132,071.00	0.79%

10	华泰证券股份有限公司	1,050,033.00	0.73%
11	中国建设银行股份有限公司一易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	98,954,462.00	68.76%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 8 日）基金份额总额	887,908,843.00
本报告期期初基金份额总额	116,908,843.00
本报告期基金总申购份额	54,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	27,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	143,908,843.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成

其他	/
----	---

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	14,668,418.52	19.44%	2,648.89	30.06%	-
华创证券	2	60,453,810.34	80.12%	6,046.34	68.60%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	328,096.00	0.43%	118.14	1.34%	-
招商证券	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。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	8,196.57	13.85%	-	-	-	-
华创证券	50,977.16	86.15%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东海证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加长城证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方财富证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-27
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2023-05-26

		电子披露网站	
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司—易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2023 年 01 月 01 日~2023 年 06 月 30 日	61,802,743.00	74,301,900.00	37,150,181.00	98,954,462.00	68.76%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日