

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77
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	77
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	77
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	77
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	77
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12	投资组合报告附注	77
§ 9	基金份额持有人信息	78
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2	期末上市基金前十名持有人	79
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
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	79
§ 10	开放式基金份额变动	80
§ 11	重大事件揭示	80
11.1	基金份额持有人大会决议	80
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	80
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4	基金投资策略的改变	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8	其他重大事件	83
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	85
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	85
§ 13	备查文件目录	85
13.1	备查文件目录	85
13.2	存放地点	85
13.3	查阅方式	85

§ 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	248,908,843.00 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； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620；519031	100033
法定代表人		刘晓艳	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	2,796,086.54	546,941.11	-17,832,493.39
本期利润	34,532,416.78	-15,636,210.19	-23,442,341.49
加权平均基金份额本期利润	0.1830	-0.1089	-0.2681
本期加权平均净值利润率	15.92%	-9.20%	-21.74%
本期基金份额净值增长率	17.39%	-6.62%	-19.64%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	71,899,608.98	17,341,037.34	20,552,022.16
期末可供分配基金份额利润	0.2889	0.0980	0.1758
期末基金资产净值	320,808,451.98	194,249,880.34	137,460,865.16
期末基金份额净值	1.2889	1.0980	1.1758
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	28.89%	9.80%	17.58%

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
过去三个月	-0.27%	1.77%	-1.62%	1.78%	1.35%	-0.01%
过去六个月	17.70%	1.72%	14.22%	1.72%	3.48%	0.00%
过去一年	17.39%	1.42%	12.20%	1.43%	5.19%	-0.01%
过去三年	-11.91%	1.20%	-20.87%	1.20%	8.96%	0.00%
过去五年	29.20%	1.23%	-1.22%	1.23%	30.42%	0.00%
自基金合同生效起至今	28.89%	1.21%	5.91%	1.21%	22.98%	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 2024 年 12 月 31 日)

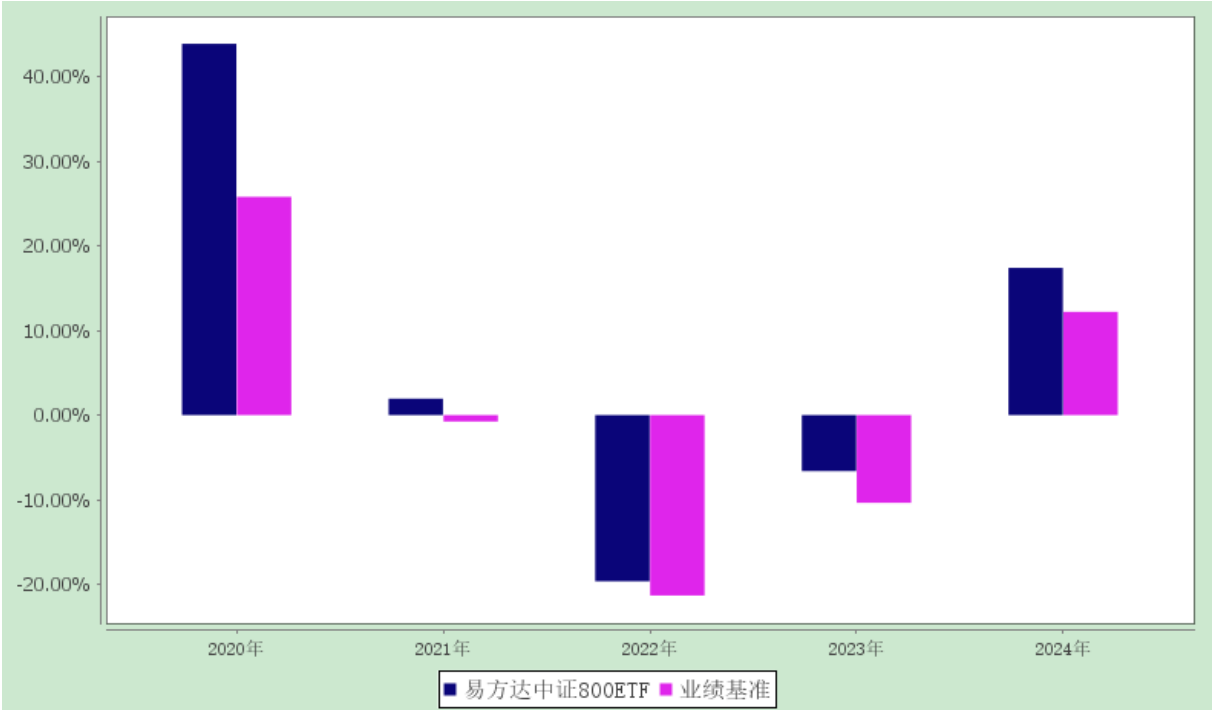


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 28.89%，同期业绩比较基准收益率为 5.91%。

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 800 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。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，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	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	2019-10-08	-	16 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

斌	利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达上证科创 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达纳斯达克 100ETF (QDII)、易方达中证 2000ETF、易方达 MSCI 美国 50ETF (QDII)、易方达中证红利低波动 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证 A50ETF 联接发起式的基金经理，指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员				司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 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)、易方达中证国有企业改革指数 (LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达中证 500 质量成长 ETF 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 ETF 联接 (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、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达创业板中盘 200ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达创业板成长 ETF、易方达创业板中盘 200ETF 联接的基金经理助理	2019-10-08	-	17 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、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 82 次，其中 73 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，9 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 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。

2024 年，我国经济与资本市场在复杂多变的内外部环境保持了稳步发展态势，呈现出一系列特点与变化。从经济运行情况来看，全年经济总体运行平稳，呈现稳中有进的格局。年初，国内存在有效需求不足的情况，部分领域风险隐患较多。然而，随着各项宏观政策逐步落实并发挥成效，经济内生动能得以修复，经济运行持续保持回升向好的态势。据国家统计局数据显示，2024 年全年国内生产总值约 134.91 万亿元，按不变价格计算，比上年增长 5.0%。

资本市场方面，年初受内外部因素综合作用，投资者风险偏好下降，A 股市场整体呈宽幅震荡走势。随着宏观政策持续发力并显效，市场情绪逐渐回暖，A 股市场迎来反弹。尽管外部环境复杂且不确定，国内经济复苏也面临诸多挑战，致使股市波动性增加，出现冲高回落再反弹且大幅震荡的情况，但政策的有力支持为资本市场的稳定发展筑牢了根基。三季度末，中国人民银行、中国证监会和国家金融监督管理总局协同出台了一系列政策措施，内容涉及降低存款准备金率和政策利率、下调存量房贷利率、统一房贷最低首付比例以及创新货币政策工具等。12 月召开的中共中央政治局会议和中央经济工作会议，明确了“稳住楼市股市”的政策目标，并制定了一系列具体举措以促进资本市场健康发展，强调吸引中长期资金入市对于增强市场活力、提升经济内生增长动力的必要性。

这些政策措施的实施,有助于增强资本市场信心,完善市场机制建设,推动资本市场长期稳定发展,进而为整体经济复苏提供助力。在上述政策与市场环境的共同作用下,A 股市场在 2024 年展现出较强的韧性,中证 800 指数全年上涨 12.20%。

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 1.2889 元,本报告期份额净值增长率为 17.39%,同期业绩比较基准收益率为 12.20%。年化跟踪误差 0.68%,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 2025 年,国内宏观经济于稳定基础上稳步迈向新的发展阶段。全球经济格局正处于持续的演变与调整进程中,这一态势在带来诸多不确定性因素的同时,也孕育着新的发展机遇。我国经济在经历前期波动后,展现出较强的适应性和韧性。在此期间,国内各项政策不断优化并精准施策,财政政策聚焦关键领域给予有力扶持,货币政策秉持灵活适度原则进行有效调节,供给侧结构性改革持续深入推进。这些因素相互协同,共同为经济增长注入全新动力,有力推动经济结构进一步优化升级。与此同时,庞大的内需市场潜力得以持续释放,消费升级与产业升级形成良性互动、相互促进的良好局面,成为支撑经济增长的重要力量。此外,科技创新的加速推进,在多个领域催生出新的经济增长点,为经济的长期稳定发展筑牢了坚实基础。

2025 年,证券市场走势受宏观经济形势、政策环境以及市场参与者预期等多方面因素的综合影响。宏观经济的稳定增长预期,为证券市场提供了坚实的基本面支撑。在政策层面,监管机构持续强化市场监管力度,积极优化市场环境,稳步推动资本市场改革,着力提升市场资源配置效率,以此增强市场的稳定性与吸引力。从行业视角分析,伴随经济结构调整的深入推进,新兴产业呈现出快速发展的良好态势,而传统产业在转型升级的进程中,也不断涌现出全新的投资机会。然而,不可忽视的是,全球经济形势的复杂变化以及地缘政治因素的干扰等不确定性因素,会对市场短期走势造成一定程度的波动。总体而言,证券市场在波动中将呈现出一定的发展态势,为投资者提供多元化的投资选择与机遇。中证 800 指数作为覆盖了大部分 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，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情况如下：

（1）持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续贯彻落实廉洁从业、执业操守和道德规范等规定。通过开展员工职业道德教育、合规谈话、合规培训和考试等多种形式引导员工珍惜职业声誉、依法履职、恪守职业道德，努力营造风清气正的公司及行业生态。

（2）通过实现风控系统全面升级，进一步提升投资合规的控制效能。合规及投研交等业务部门协同完善内部制度和流程，贯彻理性投资、价值投资、长期投资的理念，提升公司投资、研究、交易制度建设和内部管理规范。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，巩固控制基础，保护投资者利益。

（3）持续督促优化各类法律文件审核流程，提升基金产品材料质效；坚持以实质风险可测可控、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，保障公司各项业务稳妥有序开展，切实保护投资者合法权益。

（4）贯彻落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，强化对社交平台、自媒体账号、社群运营、公开言论等重点领域的管理，避免误导。坚持以投资者利益为核心，持续强化投资者适当性管理，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的合理性和科学性。持续结合业务实践，完善客户投诉处理制度及多元纠纷化解机制，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

（5）持续落实法律法规、自律规则、基金合同中信息披露相关规定，优化完善相关制度流程，明晰各部门和信披岗位的职责分工，强化培训与交流；加强公司级信息披露平台建设，积极探索智能审核系统，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化、智能化水平和合规风险控制能力，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

（6）全面贯彻落实反洗钱“风险为本”的工作方法，持续修订完善反洗钱内控制度，建立健全客户尽职调查工作机制，加强洗钱风险识别管控，深入开展系统建设与数据治理，稳步提升反洗钱履职能力和工作水平。

(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、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查, 同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、信息技术管理审计、GIPS (全球投资业绩标准) 鉴证项目, 全方位审视公司内控机制和执行情况, 督促改进内外部检查发现问题, 进一步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, 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合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70013033_G256 号

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

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

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

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

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关

交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）中国注册会计师
赵雅 林亚小
北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
2025 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	6,123,999.85	7,297,188.50
结算备付金		2,452,183.08	1,310,761.16
存出保证金		1,145,057.38	1,048,431.75
交易性金融资产	7.4.7.2	306,760,471.58	185,235,919.54
其中：股票投资		306,760,471.58	185,232,419.43
基金投资		-	-
债券投资		-	3,500.11
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		21,166,503.11	1,380,359.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		337,648,215.00	196,272,660.10
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		13,538,149.17	1,294,055.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,733.64	24,244.48
应付托管费		12,244.54	8,081.50
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	7.4.7.6	3,252,635.67	696,398.06
负债合计		16,839,763.02	2,022,779.76
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	248,908,843.00	176,908,843.00
未分配利润	7.4.7.8	71,899,608.98	17,341,037.34
净资产合计		320,808,451.98	194,249,880.34
负债和净资产总计		337,648,215.00	196,272,660.10

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2889 元，基金份额总额 248,908,843.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		35,444,418.95	-14,828,899.23
1.利息收入		53,152.78	31,142.09
其中：存款利息收入	7.4.7.9	53,152.78	31,142.09
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,334,878.67	1,258,278.97
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,835,405.38	-1,862,096.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	4,486.61	20,729.50
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	-305,610.86	-397,966.17
股利收益	7.4.7.14	5,471,408.30	3,497,612.34
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	31,736,330.24	-16,183,151.30
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	320,057.26	64,831.01
减：二、营业总支出		912,002.17	807,310.96
1. 管理人报酬		324,997.91	254,318.47

2. 托管费		108,332.59	84,772.87
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		0.02	779.92
8. 其他费用	7.4.7.18	478,671.65	467,439.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,532,416.78	-15,636,210.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,532,416.78	-15,636,210.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,532,416.78	-15,636,210.19

7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	176,908,843.00	17,341,037.34	194,249,880.34
二、本期期初净资产	176,908,843.00	17,341,037.34	194,249,880.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	72,000,000.00	54,558,571.64	126,558,571.64
（一）、综合收益总额	-	34,532,416.78	34,532,416.78
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	72,000,000.00	20,026,154.86	92,026,154.86

其中：1.基金申购款	183,000,000.00	33,799,508.35	216,799,508.35
2.基金赎回款	-111,000,000.00	-13,773,353.49	-124,773,353.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	248,908,843.00	71,899,608.98	320,808,451.98
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	116,908,843.00	20,552,022.16	137,460,865.16
二、本期期初净资产	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）	60,000,000.00	-3,210,984.82	56,789,015.18
（一）、综合收益总额	-	-15,636,210.19	-15,636,210.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	60,000,000.00	12,425,225.37	72,425,225.37
其中：1.基金申购款	123,000,000.00	23,803,895.05	146,803,895.05
2.基金赎回款	-63,000,000.00	-11,378,669.68	-74,378,669.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	176,908,843.00	17,341,037.34	194,249,880.34

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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。

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

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

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权

益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定

的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的相关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公

允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，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）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

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

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

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

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

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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征增值税试点的通知》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附加。

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	6,123,999.85	7,297,188.50
等于：本金	6,123,399.53	7,296,503.54
加：应计利息	600.32	684.96
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	6,123,999.85	7,297,188.50

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		295,804,961.61	-	306,760,471.58	10,955,509.97
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		295,804,961.61	-	306,760,471.58	10,955,509.97
项目		上年度末			
		2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		205,041,519.70	-	185,232,419.43	-19,809,100.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,500.00	0.11	3,500.11	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,500.00	0.11	3,500.11	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		205,045,019.70	0.11	185,235,919.54	-19,809,100.27

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			
	2024 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	8,488,760.00	-	-	-
IC2503	882,080.00	-	-	-
IC2506	1,144,080.00	-	-	-
IF2503	2,928,960.00	-	-	-
IF2506	3,533,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,488,760.00	-	-	-
项目	上年度末			
	2023 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	8,679,160.00	-	-	-
IC2403	3,332,760.00	-	-	-
IC2406	3,247,360.00	-	-	-
IF2403	1,072,800.00	-	-	-
IF2406	1,026,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,679,160.00	-	-	-

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
IC2503	IC2503	1	1,135,080.00	253,000.00
IC2506	IC2506	1	1,116,840.00	-27,240.00
IF2503	IF2503	3	3,544,200.00	615,240.00
IF2506	IF2506	3	3,520,260.00	-13,380.00
合计	-	-	-	827,620.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	827,620.00
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。

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

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	8,858.20	5,325.19
其中：交易所市场	8,858.20	5,325.19
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	187,000.00	176,100.00
应付替代款	1,990,811.09	476,693.77
可退替代款	1,030,966.38	3,279.10
其他应付款	35,000.00	35,000.00
合计	3,252,635.67	696,398.06

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,908,843.00	176,908,843.00
本期申购	183,000,000.00	183,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-111,000,000.00	-111,000,000.00

本期末	248,908,843.00	248,908,843.00
-----	----------------	----------------

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	78,405,421.16	-61,064,383.82	17,341,037.34
本期期初	78,405,421.16	-61,064,383.82	17,341,037.34
本期利润	2,796,086.54	31,736,330.24	34,532,416.78
本期基金份额交易产生的变动数	32,036,690.04	-12,010,535.18	20,026,154.86
其中：基金申购款	79,169,090.84	-45,369,582.49	33,799,508.35
基金赎回款	-47,132,400.80	33,359,047.31	-13,773,353.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	113,238,197.74	-41,338,588.76	71,899,608.98

7.4.7.9存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	21,041.32	13,821.80
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	31,752.10	16,709.13
其他	359.36	611.16
合计	53,152.78	31,142.09

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-943,553.98	-1,558,447.39
股票投资收益——赎回差价收入	-891,851.40	-303,649.31
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	-1,835,405.38	-1,862,096.70

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	88,184,981.90	78,103,428.68
减：卖出股票成本总额	89,048,803.55	79,571,890.11
减：交易费用	79,732.33	89,985.96
买卖股票差价收入	-943,553.98	-1,558,447.39

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	124,773,353.49	74,378,669.68
减：现金支付赎回款总额	48,826,512.49	30,918,154.68
减：赎回股票成本总额	76,838,692.40	43,764,164.31
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-891,851.40	-303,649.31

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	6.68	14.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,479.93	20,714.96
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	4,486.61	20,729.50

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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	55,989.18	121,934.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,499.64	101,199.53
减：应计利息总额	7.37	15.03
减：交易费用	2.24	4.86
买卖债券差价收入	4,479.93	20,714.96

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

7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	-305,610.86	-397,966.17

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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,471,408.30	3,497,612.34
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	5,471,408.30	3,497,612.34

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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	30,764,610.24	-16,186,691.30

——股票投资	30,764,610.24	-16,186,691.30
——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	971,720.00	3,540.00
——权证投资	-	-
——期货投资	971,720.00	3,540.00
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	31,736,330.24	-16,183,151.30

7.4.7.16其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	320,057.26	64,831.01
合计	320,057.26	64,831.01

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

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	47,000.00	36,100.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
存托服务费	36.65	26.03
指数使用费	140,000.00	140,000.00
银行汇划费	1,635.00	1,313.67
其他	170,000.00	170,000.00
合计	478,671.65	467,439.70

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（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
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023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	24,693,178.78	11.38%	39,377,010.24	21.90%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	14,418.04	25.75%	49,383.48	40.50%

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			
	2024年1月1日至2024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	2,469.26	11.37%	1.45	0.02%
关联方名称	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023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	5,120.35	26.60%	1,730.30	32.49%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本报告期内本基金的佣金协议及服务范围发生变更。2024 年 7 月 1 日前，佣金协议的服务范

围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	324,997.91	254,318.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,567.09	1,509.92
应支付基金管理人的净管理费	322,430.82	252,808.55

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：

$$H=E\times0.15\%\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	108,332.59	84,772.87

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	154,307,655.00	61.9936%	100,743,355.00	56.9465%
广发证券股份有限公司	1,168,385.00	0.4694%	4,145,017.00	2.3430%

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	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	6,123,999.85	21,041.32	7,297,188.50	13,821.80

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

7.4.10.7本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2024 年 1 月 1 日至 2024 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
万联证券股份有限公司	837023	芭薇股份	新股网上发行	200	1,154.00
广发证券股份有限公司	920008	成电光信	新股网上发行	100	1,000.00
上年度可比期间					
2023 年 1 月 1 日至 2023 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
-	-	-	-	-	-

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券和托管人建设银行发行的 A 股建设银行。于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 33,200 股（2023 年 12 月 31 日:23,700 股），占本基金净值比例为 0.17%(2023 年 12 月 31 日:0.17%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 73,200 股（2023 年 12 月 31 日:53,900 股），占本基金净值比例为 0.20%(2023 年 12 月 31 日:0.18%)。

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（2024 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
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新股流通受限	6.88	24.84	781	5,373.28	19,400.04	-
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新股流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	203	5,379.50	8,521.94	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	262	5,557.02	9,560.38	-

301608	博实 结	2024-07-25	6 个月	新股 流通 受限	44.50	65.38	129	5,740.50	8,434.02	-
301613	新铝 时代	2024-10-18	6 个月	新股 流通 受限	27.70	41.77	238	6,592.60	9,941.26	-
301617	博苑 股份	2024-12-03	6 个月	新股 流通 受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思 特	2024-11-26	6 个月	新股 流通 受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州 天脉	2024-10-17	6 个月	新股 流通 受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连 科技	2024-11-12	6 个月	新股 流通 受限	72.99	101.9 6	102	7,444.98	10,399.92	-
603072	天和 磁材	2024-12-24	1 个月以内	新股 流通 受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和 磁材	2024-12-24	6 个月	新股 流通 受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫 股份	2024-09-10	6 个月	新股 流通 受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力 股份	2024-12-17	6 个月	新股 流通 受限	20.32	28.13	234	4,754.88	6,582.42	-
603205	健尔 康	2024-10-29	6 个月	新股 流通 受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方 制药	2024-08-19	6 个月	新股 流通 受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦 股份	2024-06-28	6 个月	新股 流通 受限	18.65	22.61	110	2,051.50	2,487.10	-
603310	巍华 新材	2024-08-07	6 个月	新股 流通 受限	17.39	17.95	122	2,121.58	2,189.90	-
603350	安乃 达	2024-06-26	6 个月	新股 流通	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-

				受限						
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,044	11,745.00	30,735.36	-
688605	先锋精科	2024-12-04	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	463	12,538.04	22,663.85	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	329	6,270.74	11,047.82	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6 个月	新股流通受限	7.16	15.44	1,649	11,806.84	25,460.56	-

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
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	46,400	330,877.95	335,008.00	-

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 2024 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 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2024 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%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

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 2024年12月31日	上年度末 2023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企

业发行的债券。

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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	3,500.11
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	3,500.11

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、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024 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。

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 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,123,999.85	-	-	-	6,123,999.85
结算备付金	2,452,183.08	-	-	-	2,452,183.08
存出保证金	1,145,057.38	-	-	-	1,145,057.38
交易性金融资产	-	-	-	306,760,471.58	306,760,471.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	21,166,503.11	21,166,503.11

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,721,240.31	-	-	327,926,974.69	337,648,215.00
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	-	-	-	13,538,149.17	13,538,149.17
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	36,733.64	36,733.64
应付托管费	-	-	-	12,244.54	12,244.54
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	-	-	-	3,252,635.67	3,252,635.67
负债总计	-	-	-	16,839,763.02	16,839,763.02
利率敏感度缺口	9,721,240.31	-	-	311,087,211.67	320,808,451.98
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,297,188.50	-	-	-	7,297,188.50
结算备付金	1,310,761.16	-	-	-	1,310,761.16
存出保证金	1,048,431.75	-	-	-	1,048,431.75
交易性金融资产	-	-	3,500.11	185,232,419.43	185,235,919.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	1,380,359.15	1,380,359.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,656,381.41	-	3,500.11	186,612,778.58	196,272,660.10
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	-	-	-	1,294,055.72	1,294,055.72
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	24,244.48	24,244.48
应付托管费	-	-	-	8,081.50	8,081.50
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	-	-	-	696,398.06	696,398.06
负债总计	-	-	-	2,022,779.76	2,022,779.76
利率敏感度缺口	9,656,381.41	-	3,500.11	184,589,998.82	194,249,880.34

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，因此无重大外汇风险。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	306,760,471.58	95.62	185,232,419.43	95.36
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	306,760,471.58	95.62	185,232,419.43	95.36

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	15,330,037.54	9,259,963.38
	2.业绩比较基准下降 5%	-15,330,037.54	-9,259,963.38

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	306,024,413.01	184,758,170.44
第二层次	362,744.50	3,500.11
第三层次	373,314.07	474,248.99
合计	306,760,471.58	185,235,919.54

7.4.14.2.2 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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	474,248.99	474,248.99
当期购买	-	301,107.38	301,107.38
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	651,760.41	651,760.41
当期利得或损失总额	-	249,718.11	249,718.11
其中：计入损益的利得或损失	-	249,718.11	249,718.11
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	373,314.07	373,314.07
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	-	211,004.52	211,004.52

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	9,967.15	9,967.15
当期购买	-	496,745.06	496,745.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	176,665.94	176,665.94
当期利得或损失总额	-	144,202.72	144,202.72
其中：计入损益的利得或损失	-	144,202.72	144,202.72
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	474,248.99	474,248.99
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	-	120,020.39	120,020.39

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	373,314.07	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423—4.9648	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
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	474,248.99	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962—2.1988	负相关

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

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。

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	306,760,471.58	90.85
	其中：股票	306,760,471.58	90.85
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	8,576,182.93	2.54
8	其他各项资产	22,311,560.49	6.61
9	合计	337,648,215.00	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,646,684.20	0.83
B	采矿业	13,722,102.35	4.28
C	制造业	169,237,732.40	52.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,138,356.80	3.47
E	建筑业	5,463,582.20	1.70

F	批发和零售业	2,488,773.45	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	9,124,309.80	2.84
H	住宿和餐饮业	250,916.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,384,097.43	5.42
J	金融业	64,084,340.32	19.98
K	房地产业	2,954,549.78	0.92
L	租赁和商务服务业	2,607,785.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	2,747,883.96	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	384,210.79	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	189,720.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,130,512.90	0.35
R	文化、体育和娱乐业	1,020,887.20	0.32
S	综合	184,027.00	0.06
	合计	306,760,471.58	95.62

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,100	10,820,400.00	3.37
2	300750	宁德时代	30,040	7,990,640.00	2.49
3	601318	中国平安	120,500	6,344,325.00	1.98
4	600036	招商银行	135,747	5,334,857.10	1.66
5	000333	美的集团	55,200	4,152,144.00	1.29
6	600900	长江电力	134,600	3,977,430.00	1.24
7	300059	东方财富	143,428	3,703,310.96	1.15
8	600030	中信证券	110,760	3,230,869.20	1.01
9	000858	五粮液	22,100	3,094,884.00	0.96
10	601166	兴业银行	160,300	3,071,348.00	0.96
11	002594	比亚迪	10,000	2,826,600.00	0.88
12	601899	紫金矿业	184,100	2,783,592.00	0.87
13	601398	工商银行	382,200	2,644,824.00	0.82
14	002475	立讯精密	57,799	2,355,887.24	0.73
15	000651	格力电器	51,100	2,322,495.00	0.72

16	600276	恒瑞医药	50,090	2,299,131.00	0.72
17	600887	伊利股份	70,435	2,125,728.30	0.66
18	688981	中芯国际	22,175	2,098,198.50	0.65
19	601328	交通银行	258,600	2,009,322.00	0.63
20	601816	京沪高铁	324,300	1,997,688.00	0.62
21	601288	农业银行	349,300	1,865,262.00	0.58
22	000725	京东方 A	419,100	1,839,849.00	0.57
23	300760	迈瑞医疗	7,000	1,785,000.00	0.56
24	688041	海光信息	10,952	1,640,500.08	0.51
25	601088	中国神华	36,400	1,582,672.00	0.49
26	600919	江苏银行	160,800	1,579,056.00	0.49
27	603259	药明康德	28,140	1,548,825.60	0.48
28	600309	万华化学	21,100	1,505,485.00	0.47
29	000063	中兴通讯	36,700	1,482,680.00	0.46
30	300124	汇川技术	24,250	1,420,565.00	0.44
31	601668	中国建筑	226,700	1,360,200.00	0.42
32	688256	寒武纪	2,053	1,350,874.00	0.42
33	600000	浦发银行	129,200	1,329,468.00	0.41
34	002415	海康威视	42,300	1,298,610.00	0.40
35	601601	中国太保	38,100	1,298,448.00	0.40
36	000001	平安银行	110,600	1,294,020.00	0.40
37	601988	中国银行	230,000	1,267,300.00	0.40
38	002371	北方华创	3,200	1,251,200.00	0.39
39	300308	中际旭创	9,920	1,225,219.20	0.38
40	601728	中国电信	169,100	1,220,902.00	0.38
41	300274	阳光电源	16,320	1,204,905.60	0.38
42	002714	牧原股份	30,940	1,189,333.60	0.37
43	600690	海尔智家	41,500	1,181,505.00	0.37
44	600837	海通证券	105,000	1,167,600.00	0.36
45	603019	中科曙光	16,020	1,158,566.40	0.36
46	600941	中国移动	9,700	1,146,152.00	0.36
47	601127	赛力斯	8,500	1,133,815.00	0.35
48	601766	中国中车	133,900	1,122,082.00	0.35
49	600016	民生银行	270,500	1,117,165.00	0.35
50	002352	顺丰控股	27,700	1,116,310.00	0.35
51	601857	中国石油	124,800	1,115,712.00	0.35
52	600406	国电南瑞	44,162	1,113,765.64	0.35
53	601919	中远海控	71,790	1,112,745.00	0.35
54	600660	福耀玻璃	17,600	1,098,240.00	0.34
55	600031	三一重工	66,300	1,092,624.00	0.34
56	601985	中国核电	103,800	1,082,634.00	0.34
57	600104	上汽集团	51,903	1,077,506.28	0.34
58	000100	TCL 科技	213,030	1,071,540.90	0.33
59	600028	中国石化	159,100	1,062,788.00	0.33

60	601012	隆基绿能	66,712	1,048,045.52	0.33
61	000568	泸州老窖	8,300	1,039,160.00	0.32
62	002230	科大讯飞	21,200	1,024,384.00	0.32
63	600809	山西汾酒	5,480	1,009,470.80	0.31
64	601225	陕西煤业	43,035	1,000,994.10	0.31
65	300498	温氏股份	60,460	998,194.60	0.31
66	601229	上海银行	109,000	997,350.00	0.31
67	601169	北京银行	161,200	991,380.00	0.31
68	603501	韦尔股份	9,435	985,108.35	0.31
69	601688	华泰证券	56,000	985,040.00	0.31
70	601138	工业富联	43,900	943,850.00	0.29
71	600050	中国联通	175,200	930,312.00	0.29
72	300502	新易盛	8,000	924,640.00	0.29
73	601211	国泰君安	49,300	919,445.00	0.29
74	002142	宁波银行	37,540	912,597.40	0.28
75	688008	澜起科技	13,220	897,638.00	0.28
76	600150	中国船舶	24,400	877,424.00	0.27
77	603288	海天味业	18,512	849,700.80	0.26
78	000338	潍柴动力	61,500	842,550.00	0.26
79	688012	中微公司	4,285	810,550.60	0.25
80	002625	光启技术	16,900	807,820.00	0.25
81	002027	分众传媒	114,600	805,638.00	0.25
82	601818	光大银行	205,300	794,511.00	0.25
83	603986	兆易创新	7,396	789,892.80	0.25
84	600999	招商证券	40,740	780,578.40	0.24
85	601628	中国人寿	18,300	767,136.00	0.24
86	000625	长安汽车	55,932	747,251.52	0.23
87	000425	徐工机械	93,500	741,455.00	0.23
88	601390	中国中铁	114,300	730,377.00	0.23
89	600418	江淮汽车	19,300	723,750.00	0.23
90	002241	歌尔股份	27,900	720,099.00	0.22
91	600089	特变电工	56,340	717,771.60	0.22
92	000792	盐湖股份	43,400	714,364.00	0.22
93	000938	紫光股份	25,580	711,891.40	0.22
94	601888	中国中免	10,600	710,306.00	0.22
95	600048	保利发展	79,200	701,712.00	0.22
96	300015	爱尔眼科	52,950	701,587.50	0.22
97	600938	中国海油	23,500	693,485.00	0.22
98	601658	邮储银行	121,300	688,984.00	0.21
99	600905	三峡能源	157,300	687,401.00	0.21
100	688111	金山办公	2,396	686,190.44	0.21
101	601006	大秦铁路	101,100	685,458.00	0.21
102	600438	通威股份	30,500	674,355.00	0.21
103	600019	宝钢股份	95,800	670,600.00	0.21

104	300014	亿纬锂能	14,103	659,174.22	0.21
105	600584	长电科技	15,900	649,674.00	0.20
106	600436	片仔癀	3,000	643,500.00	0.20
107	601939	建设银行	73,200	643,428.00	0.20
108	601600	中国铝业	87,400	642,390.00	0.20
109	600585	海螺水泥	26,800	637,304.00	0.20
110	601009	南京银行	59,400	632,610.00	0.20
111	300033	同花顺	2,200	632,500.00	0.20
112	000977	浪潮信息	12,100	627,748.00	0.20
113	600760	中航沈飞	12,344	626,087.68	0.20
114	600893	航发动力	14,860	615,947.00	0.19
115	601989	中国重工	125,500	603,655.00	0.19
116	600958	东方证券	57,088	602,849.28	0.19
117	002463	沪电股份	15,200	602,680.00	0.19
118	600111	北方稀土	28,400	602,648.00	0.19
119	002050	三花智控	25,100	590,101.00	0.18
120	000538	云南白药	9,820	588,709.00	0.18
121	300408	三环集团	15,200	585,352.00	0.18
122	600926	杭州银行	39,500	577,095.00	0.18
123	002304	洋河股份	6,900	576,357.00	0.18
124	002179	中航光电	14,560	572,208.00	0.18
125	600015	华夏银行	70,400	563,904.00	0.18
126	000002	万科 A	77,100	559,746.00	0.17
127	000166	申万宏源	101,900	545,165.00	0.17
128	600886	国投电力	32,500	540,150.00	0.17
129	000776	广发证券	33,200	538,172.00	0.17
130	605499	东鹏饮料	2,100	521,892.00	0.16
131	688271	联影医疗	4,119	520,641.60	0.16
132	603993	洛阳钼业	78,100	519,365.00	0.16
133	601669	中国电建	94,900	518,154.00	0.16
134	002028	思源电气	7,100	516,170.00	0.16
135	000988	华工科技	11,900	515,270.00	0.16
136	300433	蓝思科技	22,600	494,940.00	0.15
137	002049	紫光国微	7,680	494,361.60	0.15
138	601916	浙商银行	164,600	478,986.00	0.15
139	600009	上海机场	13,900	474,685.00	0.15
140	601377	兴业证券	75,100	470,126.00	0.15
141	600570	恒生电子	16,769	469,364.31	0.15
142	600010	宝钢股份	250,500	465,930.00	0.15
143	601186	中国铁建	50,700	464,919.00	0.14
144	601838	成都银行	27,100	463,681.00	0.14
145	600547	山东黄金	20,400	461,652.00	0.14
146	002460	赣锋锂业	13,080	457,930.80	0.14
147	002384	东山精密	15,500	452,600.00	0.14

148	002311	海大集团	9,200	451,260.00	0.14
149	603799	华友钴业	15,340	448,848.40	0.14
150	600795	国电电力	98,000	448,840.00	0.14
151	601995	中金公司	13,300	448,077.00	0.14
152	601336	新华保险	9,000	447,300.00	0.14
153	601901	方正证券	53,600	446,488.00	0.14
154	300339	润和软件	8,900	445,267.00	0.14
155	000768	中航西飞	15,700	443,368.00	0.14
156	688036	传音控股	4,651	441,845.00	0.14
157	002422	科伦药业	14,600	436,978.00	0.14
158	001979	招商蛇口	40,800	417,792.00	0.13
159	601800	中国交建	39,500	412,775.00	0.13
160	300782	卓胜微	4,600	412,620.00	0.13
161	600989	宝丰能源	24,300	409,212.00	0.13
162	300442	润泽科技	7,800	405,288.00	0.13
163	000157	中联重科	56,000	404,880.00	0.13
164	600415	小商品城	30,100	403,641.00	0.13
165	601360	三六零	38,900	402,615.00	0.13
166	600839	四川长虹	41,600	401,440.00	0.13
167	002466	天齐锂业	12,100	399,300.00	0.12
168	002797	第一创业	47,500	396,625.00	0.12
169	301236	软通动力	6,600	387,486.00	0.12
170	601788	光大证券	21,300	385,743.00	0.12
171	600066	宇通客车	14,600	385,148.00	0.12
172	600029	南方航空	59,300	384,857.00	0.12
173	002340	格林美	58,600	382,658.00	0.12
174	600489	中金黄金	31,800	382,554.00	0.12
175	600487	亨通光电	22,200	382,284.00	0.12
176	002001	新和成	17,276	379,553.72	0.12
177	600115	中国东航	94,300	377,200.00	0.12
178	600674	川投能源	21,800	376,050.00	0.12
179	601633	长城汽车	14,200	373,886.00	0.12
180	603369	今世缘	8,200	370,886.00	0.12
181	601878	浙商证券	30,300	370,872.00	0.12
182	300207	欣旺达	16,600	370,346.00	0.12
183	601689	拓普集团	7,555	370,195.00	0.12
184	003816	中国广核	89,500	369,635.00	0.12
185	002648	卫星化学	19,580	367,908.20	0.11
186	002156	通富微电	12,400	366,420.00	0.11
187	601066	中信建投	14,200	365,650.00	0.11
188	300418	昆仑万维	9,500	365,560.00	0.11
189	002736	国信证券	32,400	362,880.00	0.11
190	300122	智飞生物	13,750	361,625.00	0.11
191	000786	北新建材	11,900	360,689.00	0.11

192	002236	大华股份	22,500	360,000.00	0.11
193	600346	恒力石化	23,400	359,190.00	0.11
194	601881	中国银河	23,500	357,905.00	0.11
195	600160	巨化股份	14,800	356,976.00	0.11
196	600745	闻泰科技	9,205	356,969.90	0.11
197	600426	华鲁恒升	16,440	355,268.40	0.11
198	600196	复星医药	14,100	350,385.00	0.11
199	002966	苏州银行	43,160	350,027.60	0.11
200	002273	水晶光电	15,700	348,854.00	0.11
201	002601	龙佰集团	19,400	342,798.00	0.11
202	002185	华天科技	29,300	340,173.00	0.11
203	300832	新产业	4,800	340,080.00	0.11
204	600600	青岛啤酒	4,200	339,864.00	0.11
205	601555	东吴证券	43,468	339,050.40	0.11
206	000423	东阿阿胶	5,400	338,688.00	0.11
207	601162	天风证券	75,510	338,284.80	0.11
208	600460	士兰微	13,000	338,260.00	0.11
209	688126	沪硅产业	17,876	336,426.32	0.10
210	000963	华东医药	9,700	335,620.00	0.10
211	002252	上海莱士	46,400	335,008.00	0.10
212	300347	泰格医药	6,100	333,182.00	0.10
213	601117	中国化学	40,100	332,429.00	0.10
214	600372	中航机载	26,900	331,677.00	0.10
215	600011	华能国际	48,710	329,766.70	0.10
216	601021	春秋航空	5,700	328,719.00	0.10
217	601111	中国国航	41,500	328,265.00	0.10
218	002129	TCL 中环	36,875	327,081.25	0.10
219	601100	恒立液压	6,196	326,962.92	0.10
220	601868	中国能建	142,520	326,370.80	0.10
221	603392	万泰生物	4,600	324,116.00	0.10
222	688169	石头科技	1,477	323,891.33	0.10
223	001965	招商公路	23,200	323,640.00	0.10
224	002202	金风科技	31,300	323,329.00	0.10
225	600183	生益科技	13,400	322,270.00	0.10
226	000066	中国长城	22,100	321,997.00	0.10
227	601933	永辉超市	50,400	319,536.00	0.10
228	688777	中控技术	6,422	318,980.74	0.10
229	600096	云天化	14,300	318,890.00	0.10
230	000661	长春高新	3,200	318,208.00	0.10
231	000807	云铝股份	23,500	317,955.00	0.10
232	688223	晶科能源	44,603	317,127.33	0.10
233	000895	双汇发展	12,200	316,712.00	0.10
234	601099	太平洋	74,300	316,518.00	0.10
235	002493	荣盛石化	34,900	315,845.00	0.10

236	300759	康龙化成	12,200	313,540.00	0.10
237	600085	同仁堂	7,700	312,543.00	0.10
238	601998	中信银行	44,600	311,308.00	0.10
239	002459	晶澳科技	22,556	310,145.00	0.10
240	600482	中国动力	12,600	308,322.00	0.10
241	002920	德赛西威	2,800	308,308.00	0.10
242	600741	华域汽车	17,400	306,414.00	0.10
243	600536	中国软件	6,540	305,352.60	0.10
244	002180	纳思达	10,800	304,236.00	0.09
245	600176	中国巨石	26,701	304,124.39	0.09
246	600352	浙江龙盛	29,400	302,526.00	0.09
247	600079	人福医药	12,900	301,602.00	0.09
248	300394	天孚通信	3,300	301,488.00	0.09
249	002709	天赐材料	15,240	300,532.80	0.09
250	600219	南山铝业	76,400	298,724.00	0.09
251	002281	光迅科技	5,700	297,369.00	0.09
252	300017	网宿科技	28,100	297,017.00	0.09
253	601108	财通证券	36,120	295,100.40	0.09
254	300476	胜宏科技	7,000	294,630.00	0.09
255	601168	西部矿业	18,300	294,081.00	0.09
256	002078	太阳纸业	19,500	289,965.00	0.09
257	002938	鹏鼎控股	7,900	288,192.00	0.09
258	002271	东方雨虹	22,200	288,156.00	0.09
259	002738	中矿资源	8,100	287,550.00	0.09
260	600885	宏发股份	8,980	285,743.60	0.09
261	600988	赤峰黄金	18,300	285,663.00	0.09
262	601877	正泰电器	12,200	285,602.00	0.09
263	600515	海南机场	75,400	285,012.00	0.09
264	300896	爱美客	1,560	284,700.00	0.09
265	000975	山金国际	18,500	284,345.00	0.09
266	600188	兖矿能源	20,025	283,754.25	0.09
267	002138	顺络电子	9,000	283,320.00	0.09
268	000630	铜陵有色	86,700	280,041.00	0.09
269	000596	古井贡酒	1,600	277,280.00	0.09
270	600845	宝信软件	9,463	276,887.38	0.09
271	600233	圆通速递	19,500	276,705.00	0.09
272	002085	万丰奥威	14,600	276,670.00	0.09
273	300496	中科创达	4,600	273,976.00	0.09
274	601319	中国人保	35,800	272,796.00	0.09
275	002517	恺英网络	20,000	272,200.00	0.08
276	601577	长沙银行	30,600	272,034.00	0.08
277	300661	圣邦股份	3,325	271,918.50	0.08
278	600161	天坛生物	13,229	271,194.50	0.08
279	002555	三七互娱	17,300	270,572.00	0.08

280	300136	信维通信	10,600	269,664.00	0.08
281	000999	华润三九	6,050	268,257.00	0.08
282	300058	蓝色光标	28,900	268,192.00	0.08
283	600879	航天电子	29,900	267,904.00	0.08
284	002074	国轩高科	12,600	267,372.00	0.08
285	301269	华大九天	2,200	266,420.00	0.08
286	601607	上海医药	12,600	264,600.00	0.08
287	000983	山西焦煤	32,000	263,680.00	0.08
288	002353	杰瑞股份	7,100	262,629.00	0.08
289	002444	巨星科技	8,100	262,035.00	0.08
290	601618	中国中冶	78,800	260,040.00	0.08
291	300002	神州泰岳	22,400	259,616.00	0.08
292	300024	机器人	14,400	258,480.00	0.08
293	000783	长江证券	37,800	257,796.00	0.08
294	002916	深南电路	2,060	257,500.00	0.08
295	603606	东方电缆	4,900	257,495.00	0.08
296	601615	明阳智能	20,400	257,244.00	0.08
297	300450	先导智能	12,800	256,256.00	0.08
298	002195	岩山科技	64,200	254,874.00	0.08
299	002128	电投能源	13,000	254,540.00	0.08
300	688396	华润微	5,368	253,315.92	0.08
301	600109	国金证券	28,900	252,297.00	0.08
302	002223	鱼跃医疗	6,900	251,781.00	0.08
303	601128	常熟银行	33,210	251,399.70	0.08
304	000728	国元证券	29,840	249,462.40	0.08
305	301358	湖南裕能	5,500	249,260.00	0.08
306	002532	天山铝业	31,600	248,692.00	0.08
307	002673	西部证券	30,500	248,575.00	0.08
308	002465	海格通信	22,600	248,148.00	0.08
309	600023	浙能电力	43,800	247,908.00	0.08
310	300474	景嘉微	2,650	247,748.50	0.08
311	000301	东方盛虹	30,100	247,121.00	0.08
312	002595	豪迈科技	4,900	245,931.00	0.08
313	688120	华海清科	1,506	245,462.94	0.08
314	600298	安琪酵母	6,800	245,140.00	0.08
315	601898	中煤能源	20,100	244,818.00	0.08
316	000408	藏格矿业	8,800	244,024.00	0.08
317	300012	华测检测	19,600	243,628.00	0.08
318	689009	九号公司	5,122	243,295.00	0.08
319	600362	江西铜业	11,700	241,488.00	0.08
320	600588	用友网络	22,491	241,328.43	0.08
321	600765	中航重机	11,740	240,317.80	0.07
322	601567	三星医疗	7,800	239,928.00	0.07
323	300803	指南针	2,500	239,875.00	0.07

324	603260	合盛硅业	4,300	238,908.00	0.07
325	688599	天合光能	12,292	237,235.60	0.07
326	601198	东兴证券	21,500	236,715.00	0.07
327	688469	芯联集成	46,136	236,677.68	0.07
328	300383	光环新网	16,200	236,358.00	0.07
329	300316	晶盛机电	7,400	236,060.00	0.07
330	002472	双环传动	7,700	235,774.00	0.07
331	300604	长川科技	5,300	233,889.00	0.07
332	688099	晶晨股份	3,401	233,580.68	0.07
333	600895	张江高科	8,700	233,160.00	0.07
334	300037	新宙邦	6,220	232,876.80	0.07
335	000831	中国稀土	8,300	232,815.00	0.07
336	002008	大族激光	9,300	232,500.00	0.07
337	600862	中航高科	9,200	232,392.00	0.07
338	300699	光威复材	6,700	232,155.00	0.07
339	300223	北京君正	3,400	231,880.00	0.07
340	603893	瑞芯微	2,100	231,126.00	0.07
341	601872	招商轮船	35,980	230,631.80	0.07
342	300395	菲利华	6,100	229,421.00	0.07
343	300628	亿联网络	5,920	228,512.00	0.07
344	000876	新希望	25,300	227,194.00	0.07
345	601238	广汽集团	24,200	226,028.00	0.07
346	300413	芒果超媒	8,400	225,876.00	0.07
347	603160	汇顶科技	2,800	225,512.00	0.07
348	601233	桐昆股份	19,100	225,380.00	0.07
349	300999	金龙鱼	6,900	225,009.00	0.07
350	603596	伯特利	5,040	224,733.60	0.07
351	000400	许继电气	8,100	222,993.00	0.07
352	600177	雅戈尔	24,968	222,215.20	0.07
353	600332	白云山	7,800	221,676.00	0.07
354	600803	新奥股份	10,200	221,136.00	0.07
355	688249	晶合集成	9,421	219,886.14	0.07
356	600873	梅花生物	21,800	218,654.00	0.07
357	000750	国海证券	51,080	218,622.40	0.07
358	300054	鼎龙股份	8,400	218,568.00	0.07
359	002261	拓维信息	11,900	217,889.00	0.07
360	002436	兴森科技	19,600	217,756.00	0.07
361	688213	思特威	2,797	217,382.84	0.07
362	605117	德业股份	2,560	217,088.00	0.07
363	002007	华兰生物	12,780	215,343.00	0.07
364	300114	中航电测	3,000	215,340.00	0.07
365	300142	沃森生物	17,800	215,024.00	0.07
366	002812	恩捷股份	6,700	214,333.00	0.07
367	000009	中国宝安	23,400	214,110.00	0.07

368	600039	四川路桥	29,380	213,886.40	0.07
369	688072	拓荆科技	1,391	213,754.97	0.07
370	603296	华勤技术	3,000	212,850.00	0.07
371	688047	龙芯中科	1,603	212,044.84	0.07
372	600061	国投资本	28,104	211,342.08	0.07
373	600027	华电国际	37,500	210,375.00	0.07
374	300866	安克创新	2,150	209,926.00	0.07
375	600153	建发股份	19,800	208,296.00	0.06
376	601990	南京证券	24,000	207,840.00	0.06
377	600398	海澜之家	27,700	207,750.00	0.06
378	688617	惠泰医疗	557	207,387.81	0.06
379	600369	西南证券	43,600	203,612.00	0.06
380	603605	珀莱雅	2,400	203,280.00	0.06
381	600642	申能股份	21,400	203,086.00	0.06
382	300919	中伟股份	5,620	202,994.40	0.06
383	688472	阿特斯	16,146	202,793.76	0.06
384	000733	振华科技	4,800	202,416.00	0.06
385	600143	金发科技	23,312	201,415.68	0.06
386	300073	当升科技	5,000	201,400.00	0.06
387	002294	信立泰	6,500	201,045.00	0.06
388	600549	厦门钨业	10,400	200,408.00	0.06
389	601696	中银证券	17,900	199,764.00	0.06
390	000617	中油资本	28,900	199,121.00	0.06
391	600918	中泰证券	30,300	199,071.00	0.06
392	600875	东方电气	12,500	198,625.00	0.06
393	603087	甘李药业	4,500	198,450.00	0.06
394	000932	华菱钢铁	47,000	196,460.00	0.06
395	000021	深科技	10,300	196,318.00	0.06
396	000034	神州数码	5,600	196,280.00	0.06
397	601216	君正集团	37,300	196,198.00	0.06
398	002432	九安医疗	4,800	195,744.00	0.06
399	000738	航发控制	8,800	195,712.00	0.06
400	002558	巨人网络	15,400	195,426.00	0.06
401	601699	潞安环能	13,600	195,296.00	0.06
402	000878	云南铜业	15,900	193,821.00	0.06
403	688122	西部超导	4,493	192,390.26	0.06
404	600497	驰宏锌锗	34,400	191,608.00	0.06
405	000729	燕京啤酒	15,900	191,436.00	0.06
406	600025	华能水电	20,100	191,151.00	0.06
407	600529	山东药玻	7,400	190,698.00	0.06
408	603659	璞泰来	11,965	190,363.15	0.06
409	601997	贵阳银行	31,700	190,200.00	0.06
410	002607	中公教育	55,800	189,720.00	0.06
411	002841	视源股份	5,100	188,241.00	0.06

412	600909	华安证券	31,040	188,102.40	0.06
413	600018	上港集团	30,600	187,272.00	0.06
414	688525	佰维存储	3,017	186,963.49	0.06
415	601799	星宇股份	1,400	186,872.00	0.06
416	002850	科达利	1,900	185,592.00	0.06
417	002064	华峰化学	22,600	184,868.00	0.06
418	600673	东阳光	16,300	184,027.00	0.06
419	688521	芯原股份	3,503	183,662.29	0.06
420	000997	新大陆	9,200	183,540.00	0.06
421	002065	东华软件	25,200	182,952.00	0.06
422	600118	中国卫星	6,700	182,910.00	0.06
423	002318	久立特材	7,800	182,598.00	0.06
424	600141	兴发集团	8,400	182,280.00	0.06
425	300001	特锐德	8,300	182,185.00	0.06
426	000623	吉林敖东	10,500	181,335.00	0.06
427	002739	万达电影	14,900	180,886.00	0.06
428	688009	中国通号	28,531	178,604.06	0.06
429	601456	国联证券	13,200	178,464.00	0.06
430	600155	华创云信	24,100	178,340.00	0.06
431	002821	凯莱英	2,340	178,050.60	0.06
432	300724	捷佳伟创	2,800	176,988.00	0.06
433	002410	广联达	15,040	176,870.40	0.06
434	600026	中远海能	15,200	176,320.00	0.05
435	601665	齐鲁银行	31,500	176,085.00	0.05
436	002984	森麒麟	7,100	175,086.00	0.05
437	000513	丽珠集团	4,600	174,800.00	0.05
438	600637	东方明珠	22,400	173,824.00	0.05
439	603806	福斯特	11,739	173,737.20	0.05
440	600704	物产中大	34,200	173,052.00	0.05
440	601179	中国西电	22,800	173,052.00	0.05
442	002568	百润股份	6,160	172,541.60	0.05
443	600820	隧道股份	23,900	171,841.00	0.05
444	600060	海信视像	8,600	171,484.00	0.05
445	603345	安井食品	2,100	171,108.00	0.05
446	600312	平高电气	8,900	170,880.00	0.05
447	603179	新泉股份	4,000	170,800.00	0.05
448	002262	恩华药业	7,000	170,450.00	0.05
449	600580	卧龙电驱	9,900	170,181.00	0.05
450	300003	乐普医疗	15,000	170,100.00	0.05
451	600521	华海药业	9,500	169,765.00	0.05
452	002385	大北农	39,200	169,736.00	0.05
453	600699	均胜电子	10,800	169,236.00	0.05
454	688002	睿创微纳	3,586	168,577.86	0.05
455	002409	雅克科技	2,900	168,055.00	0.05

456	688361	中科飞测	1,919	168,008.45	0.05
457	601666	平煤股份	16,700	167,334.00	0.05
458	603568	伟明环保	7,733	167,264.79	0.05
459	300529	健帆生物	5,700	167,238.00	0.05
460	000683	远兴能源	29,800	166,582.00	0.05
461	600563	法拉电子	1,400	166,488.00	0.05
462	002152	广电运通	14,200	165,572.00	0.05
463	002407	多氟多	13,780	165,360.00	0.05
464	603589	口子窖	4,200	164,808.00	0.05
465	002044	美年健康	35,900	164,781.00	0.05
466	000039	中集集团	21,200	164,724.00	0.05
467	600392	盛和资源	15,900	163,452.00	0.05
468	300144	宋城演艺	17,580	163,318.20	0.05
469	603939	益丰药房	6,760	163,118.80	0.05
470	600008	首创环保	49,350	161,868.00	0.05
471	601865	福莱特	8,200	161,458.00	0.05
472	603338	浙江鼎力	2,500	161,300.00	0.05
473	600316	洪都航空	5,000	160,600.00	0.05
474	603979	金诚信	4,400	159,720.00	0.05
475	002624	完美世界	15,450	159,598.50	0.05
476	000426	兴业银锡	14,300	159,016.00	0.05
477	000921	海信家电	5,500	158,950.00	0.05
478	688303	大全能源	6,525	157,513.50	0.05
479	000723	美锦能源	34,900	157,399.00	0.05
480	603816	顾家家居	5,700	157,206.00	0.05
481	600390	五矿资本	24,300	156,735.00	0.05
482	300251	光线传媒	16,500	155,760.00	0.05
482	601717	郑煤机	12,000	155,760.00	0.05
484	000703	恒逸石化	24,790	155,681.20	0.05
485	000830	鲁西化工	13,300	155,477.00	0.05
486	300390	天华新能	6,740	155,357.00	0.05
487	601000	唐山港	32,900	154,959.00	0.05
488	002958	青农商行	50,900	154,736.00	0.05
489	600863	内蒙华电	35,700	154,581.00	0.05
490	601059	信达证券	10,300	154,294.00	0.05
491	600170	上海建工	58,200	154,230.00	0.05
492	600872	中炬高新	7,000	154,140.00	0.05
493	688506	百利天恒	802	153,767.46	0.05
494	600816	建元信托	43,900	153,650.00	0.05
495	002500	山西证券	24,290	152,541.20	0.05
496	000629	钒钛股份	52,900	152,352.00	0.05
497	600498	烽火通信	7,800	151,788.00	0.05
498	300285	国瓷材料	8,900	151,656.00	0.05
499	000960	锡业股份	10,800	151,524.00	0.05

500	600132	重庆啤酒	2,400	151,248.00	0.05
501	605358	立昂微	6,100	151,097.00	0.05
502	300751	迈为股份	1,432	150,574.80	0.05
503	600511	国药股份	4,400	150,568.00	0.05
504	600516	方大炭素	30,960	149,536.80	0.05
505	000893	亚钾国际	7,400	149,184.00	0.05
506	688180	君实生物	5,452	149,003.16	0.05
507	002603	以岭药业	9,300	148,893.00	0.05
508	002203	海亮股份	13,800	148,350.00	0.05
509	000591	太阳能	31,100	148,036.00	0.05
510	688188	柏楚电子	760	147,630.00	0.05
511	002939	长城证券	18,000	147,600.00	0.05
512	002414	高德红外	19,837	147,388.91	0.05
513	600998	九州通	28,687	146,877.44	0.05
514	002429	兆驰股份	25,400	146,812.00	0.05
515	000636	风华高科	10,200	146,370.00	0.05
516	002155	湖南黄金	9,300	146,289.00	0.05
517	002926	华西证券	17,600	146,256.00	0.05
518	002683	广东宏大	5,500	145,640.00	0.05
519	300763	锦浪科技	2,376	145,102.32	0.05
520	300146	汤臣倍健	12,000	144,600.00	0.05
521	601966	玲珑轮胎	8,000	144,320.00	0.04
522	300373	扬杰科技	3,300	143,616.00	0.04
523	600348	华阳股份	20,200	143,218.00	0.04
524	603927	中科软	6,580	142,786.00	0.04
525	600754	锦江酒店	5,300	142,358.00	0.04
526	603129	春风动力	900	141,363.00	0.04
527	603077	和邦生物	69,200	141,168.00	0.04
528	600380	健康元	12,500	140,875.00	0.04
529	601698	中国卫通	6,900	140,760.00	0.04
530	600486	扬农化工	2,430	140,624.10	0.04
531	600325	华发股份	24,400	140,544.00	0.04
532	300212	易华录	6,000	140,400.00	0.04
533	600021	上海电力	15,300	140,301.00	0.04
534	600535	天士力	9,700	140,262.00	0.04
535	300748	金力永磁	7,820	139,821.60	0.04
536	000060	中金岭南	29,800	139,762.00	0.04
537	600763	通策医疗	3,141	139,460.40	0.04
538	600208	衢州发展	46,900	138,824.00	0.04
539	688052	纳芯微	1,065	138,769.50	0.04
540	000998	隆平高科	12,400	138,508.00	0.04
541	603195	公牛集团	1,953	137,178.72	0.04
542	600859	王府井	8,900	137,149.00	0.04
543	600655	豫园股份	21,300	136,959.00	0.04

544	300677	英科医疗	5,400	136,512.00	0.04
544	600970	中材国际	14,400	136,512.00	0.04
546	603899	晨光股份	4,500	136,125.00	0.04
547	000708	中信特钢	11,900	135,779.00	0.04
548	300765	新诺威	5,100	135,609.00	0.04
549	002423	中粮资本	10,100	135,239.00	0.04
550	300558	贝达药业	2,500	134,825.00	0.04
551	688578	艾力斯	2,249	134,715.10	0.04
552	601016	节能风电	42,490	134,693.30	0.04
553	603000	人民网	6,100	134,444.00	0.04
554	000519	中兵红箭	9,300	134,385.00	0.04
555	601136	首创证券	6,100	134,200.00	0.04
556	600166	福田汽车	52,800	132,528.00	0.04
557	600901	江苏金租	25,280	131,961.60	0.04
558	300601	康泰生物	7,660	131,369.00	0.04
559	600583	海油工程	24,000	131,280.00	0.04
560	688772	珠海冠宇	8,161	131,228.88	0.04
561	002025	航天电器	2,700	131,112.00	0.04
562	002373	千方科技	12,900	130,806.00	0.04
563	603156	养元饮品	5,700	130,188.00	0.04
564	603885	吉祥航空	9,500	130,150.00	0.04
565	601236	红塔证券	15,320	130,066.80	0.04
566	002439	启明星辰	8,200	129,724.00	0.04
567	600707	彩虹股份	15,600	128,232.00	0.04
568	600566	济川药业	4,400	127,952.00	0.04
569	002507	涪陵榨菜	9,040	127,735.20	0.04
570	600004	白云机场	13,300	127,680.00	0.04
571	000598	兴蓉环境	16,800	127,512.00	0.04
572	000050	深天马 A	14,100	127,323.00	0.04
573	600038	中直股份	3,300	127,248.00	0.04
574	600282	南钢股份	27,100	127,099.00	0.04
575	002430	杭氧股份	5,800	126,440.00	0.04
576	000563	陕国投 A	35,300	125,668.00	0.04
577	603833	欧派家居	1,822	125,608.68	0.04
578	688385	复旦微电	3,261	125,189.79	0.04
579	002368	太极股份	5,280	125,030.40	0.04
580	600131	国网信通	6,600	124,806.00	0.04
581	002831	裕同科技	4,600	124,660.00	0.04
582	600546	山煤国际	10,500	124,215.00	0.04
583	688187	时代电气	2,592	124,208.64	0.04
584	300070	碧水源	24,500	123,970.00	0.04
585	600867	通化东宝	15,300	123,318.00	0.04
586	002244	滨江集团	14,300	123,123.00	0.04
587	601001	晋控煤业	9,000	123,030.00	0.04

588	600483	福能股份	12,300	122,631.00	0.04
589	002120	韵达股份	16,300	122,576.00	0.04
590	603228	景旺电子	4,400	122,496.00	0.04
591	300567	精测电子	1,900	122,170.00	0.04
592	600737	中粮糖业	11,900	121,499.00	0.04
593	002756	永兴材料	3,200	120,704.00	0.04
594	601918	新集能源	16,800	120,624.00	0.04
595	000818	航锦科技	6,300	120,330.00	0.04
596	601611	中国核建	13,300	120,232.00	0.04
597	601098	中南传媒	8,000	120,080.00	0.04
598	002508	老板电器	5,600	120,008.00	0.04
599	300118	东方日升	10,000	119,800.00	0.04
600	300487	蓝晓科技	2,500	119,675.00	0.04
601	300595	欧普康视	6,300	119,385.00	0.04
602	688278	特宝生物	1,626	119,299.62	0.04
603	601231	环旭电子	7,200	118,800.00	0.04
604	601155	新城控股	9,898	118,380.08	0.04
605	000987	越秀资本	16,860	118,357.20	0.04
606	601156	东航物流	7,000	118,090.00	0.04
607	300979	华利集团	1,500	117,975.00	0.04
608	002056	横店东磁	9,100	117,936.00	0.04
609	300009	安科生物	13,516	116,778.24	0.04
610	601991	大唐发电	40,900	116,565.00	0.04
611	688065	凯赛生物	3,003	116,516.40	0.04
612	000887	中鼎股份	8,800	115,456.00	0.04
613	601866	中远海发	44,200	115,362.00	0.04
614	002572	索菲亚	6,700	115,106.00	0.04
615	600598	北大荒	7,800	115,050.00	0.04
616	688220	翱捷科技	2,123	114,833.07	0.04
617	600435	北方导航	11,700	114,192.00	0.04
618	600416	湘电股份	10,100	114,029.00	0.04
619	002670	国盛金控	8,700	113,883.00	0.04
620	600129	太极集团	4,600	113,712.00	0.04
621	002653	海思科	3,400	113,050.00	0.04
622	002240	盛新锂能	8,200	112,996.00	0.04
623	000958	电投产融	18,000	112,140.00	0.03
624	600271	航天信息	12,300	112,053.00	0.03
625	000403	派林生物	5,300	111,989.00	0.03
626	301308	江波龙	1,300	111,800.00	0.03
627	600685	中船防务	4,700	111,390.00	0.03
628	688017	绿的谐波	1,030	111,301.80	0.03
629	000883	湖北能源	22,300	111,054.00	0.03
630	000739	普洛药业	6,800	110,568.00	0.03
631	002268	电科网安	6,800	110,500.00	0.03

632	600582	天地科技	17,800	110,004.00	0.03
633	000155	川能动力	10,200	108,936.00	0.03
634	600755	厦门国贸	16,400	108,896.00	0.03
635	600258	首旅酒店	7,400	108,558.00	0.03
636	603486	科沃斯	2,300	108,100.00	0.03
637	603298	杭叉集团	6,000	107,340.00	0.03
638	688005	容百科技	3,399	107,238.45	0.03
639	603529	爱玛科技	2,600	106,652.00	0.03
640	603290	斯达半导	1,180	105,987.60	0.03
641	000778	新兴铸管	27,600	105,984.00	0.03
642	688538	和辉光电	45,278	105,044.96	0.03
643	300676	华大基因	2,500	104,925.00	0.03
644	600517	国网英大	19,000	104,690.00	0.03
645	600995	南网储能	10,300	104,236.00	0.03
646	000027	深圳能源	16,060	104,068.80	0.03
647	600848	上海临港	10,267	103,696.70	0.03
648	000709	河钢股份	46,900	103,649.00	0.03
649	601958	金钼股份	10,300	103,618.00	0.03
650	688363	华熙生物	2,020	103,100.80	0.03
651	000785	居然智家	28,800	102,816.00	0.03
652	002299	圣农发展	7,100	102,808.00	0.03
653	601118	海南橡胶	19,000	102,790.00	0.03
654	600739	辽宁成大	9,850	101,947.50	0.03
655	688567	孚能科技	8,729	101,256.40	0.03
656	603712	七一二	5,200	101,244.00	0.03
657	600906	财达证券	14,200	100,820.00	0.03
658	600499	科达制造	12,800	99,840.00	0.03
659	603658	安图生物	2,280	99,499.20	0.03
660	002080	中材科技	7,600	99,408.00	0.03
661	601928	凤凰传媒	8,600	99,244.00	0.03
662	600528	中铁工业	12,300	99,138.00	0.03
663	601808	中海油服	6,500	99,125.00	0.03
664	300888	稳健医疗	2,340	98,467.20	0.03
665	601636	旗滨集团	17,500	98,175.00	0.03
666	300573	兴齐眼药	1,400	97,692.00	0.03
667	600606	绿地控股	46,500	97,650.00	0.03
668	000032	深桑达 A	5,500	97,020.00	0.03
669	600373	中文传媒	7,700	96,635.00	0.03
670	601399	国机重装	31,300	96,404.00	0.03
671	603858	步长制药	6,100	96,380.00	0.03
672	002487	大金重工	4,700	96,303.00	0.03
673	600378	昊华科技	3,300	95,403.00	0.03
674	688114	华大智造	2,034	95,170.86	0.03
675	600062	华润双鹤	4,800	95,040.00	0.03

676	600968	海油发展	22,200	94,794.00	0.03
677	600884	杉杉股份	12,700	94,615.00	0.03
678	003031	中瓷电子	1,800	94,302.00	0.03
679	600977	中国电影	8,100	94,041.00	0.03
680	002266	浙富控股	29,800	92,976.00	0.03
681	000559	万向钱潮	15,000	92,250.00	0.03
682	002372	伟星新材	7,300	92,199.00	0.03
683	600959	江苏有线	27,500	92,125.00	0.03
684	603379	三美股份	2,400	92,112.00	0.03
685	603728	鸣志电器	1,700	91,800.00	0.03
686	600095	湘财股份	12,700	91,440.00	0.03
687	601598	中国外运	17,000	90,950.00	0.03
688	600056	中国医药	8,180	90,798.00	0.03
689	600871	石化油服	44,400	90,576.00	0.03
690	301301	川宁生物	7,600	90,136.00	0.03
691	002557	洽洽食品	3,100	90,055.00	0.03
692	600801	华新水泥	7,400	89,540.00	0.03
693	600329	达仁堂	2,900	89,320.00	0.03
694	601212	白银有色	32,100	89,238.00	0.03
695	000825	太钢不锈	25,600	89,088.00	0.03
696	601608	中信重工	21,100	88,620.00	0.03
697	688387	信科移动	14,869	88,619.24	0.03
698	603737	三棵树	2,080	88,608.00	0.03
699	002019	亿帆医药	8,200	87,904.00	0.03
700	000800	一汽解放	10,700	87,740.00	0.03
701	603444	吉比特	400	87,536.00	0.03
702	600377	宁沪高速	5,700	87,267.00	0.03
703	601106	中国一重	29,900	87,009.00	0.03
704	688536	思瑞浦	928	85,840.00	0.03
705	688297	中无人机	2,126	85,635.28	0.03
706	688234	天岳先进	1,663	85,145.60	0.03
707	603456	九洲药业	6,200	84,816.00	0.03
708	603650	彤程新材	2,400	83,928.00	0.03
709	600663	陆家嘴	8,500	83,640.00	0.03
710	600808	马钢股份	26,900	83,121.00	0.03
711	601965	中国汽研	4,700	82,814.00	0.03
712	688082	盛美上海	818	81,800.00	0.03
713	002408	齐翔腾达	16,080	80,882.40	0.03
714	600500	中化国际	19,800	79,596.00	0.02
715	600925	苏能股份	15,000	79,500.00	0.02
716	600764	中国海防	2,800	79,296.00	0.02
717	688778	厦钨新能	1,735	79,185.40	0.02
718	603688	石英股份	2,750	79,007.50	0.02
719	001227	兰州银行	32,100	78,966.00	0.02

720	000937	冀中能源	12,400	78,368.00	0.02
721	601019	山东出版	6,900	78,315.00	0.02
722	603233	大参林	5,200	78,312.00	0.02
723	002531	天顺风能	9,900	78,309.00	0.02
724	001286	陕西能源	8,400	77,952.00	0.02
725	600350	山东高速	7,500	77,100.00	0.02
726	600578	京能电力	21,900	77,088.00	0.02
727	603882	金域医学	2,800	77,084.00	0.02
728	002867	周大生	5,300	77,009.00	0.02
729	688425	铁建重工	17,394	76,533.60	0.02
730	688349	三一重能	2,476	76,458.88	0.02
731	603185	弘元绿能	4,656	75,660.00	0.02
732	688563	航材股份	1,349	75,328.16	0.02
733	600098	广州发展	11,700	75,114.00	0.02
734	603225	新凤鸣	6,700	74,571.00	0.02
735	603556	海兴电力	2,000	73,980.00	0.02
736	603707	健友股份	5,560	73,781.20	0.02
737	603883	老百姓	4,483	73,386.71	0.02
738	300957	贝泰妮	1,700	72,573.00	0.02
739	688561	奇安信	2,704	72,548.32	0.02
740	601568	北元集团	17,160	72,072.00	0.02
741	000967	盈峰环境	14,500	72,065.00	0.02
742	600688	上海石化	23,800	71,876.00	0.02
743	688390	固德威	1,749	71,534.10	0.02
744	600612	老凤祥	1,300	70,551.00	0.02
745	600126	杭钢股份	14,700	70,266.00	0.02
746	688301	奕瑞科技	721	68,905.97	0.02
747	688516	奥特维	1,563	67,693.53	0.02
748	003022	联泓新科	4,900	67,473.00	0.02
749	600339	中油工程	18,700	66,946.00	0.02
750	600720	中交设计	7,500	66,450.00	0.02
751	000898	鞍钢股份	27,600	66,240.00	0.02
752	601139	深圳燃气	9,300	65,658.00	0.02
753	000401	冀东水泥	12,500	65,375.00	0.02
754	002153	石基信息	9,140	65,259.60	0.02
755	002690	美亚光电	4,400	65,208.00	0.02
756	002608	江苏国信	8,500	65,195.00	0.02
757	601992	金隅集团	36,400	64,792.00	0.02
758	000537	中绿电	7,100	64,752.00	0.02
759	600295	鄂尔多斯	6,600	64,416.00	0.02
760	688032	禾迈股份	566	63,754.24	0.02
761	002563	森马服饰	9,000	63,180.00	0.02
762	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.02
763	300140	节能环保	10,200	61,098.00	0.02

764	600299	安迪苏	4,700	58,985.00	0.02
765	600032	浙江新能	7,800	57,720.00	0.02
766	601228	广州港	16,300	55,257.00	0.02
767	003035	南网能源	13,200	55,176.00	0.02
768	688248	南网科技	1,706	54,745.54	0.02
769	688331	荣昌生物	1,780	53,595.80	0.02
770	600928	西安银行	14,800	53,428.00	0.02
771	600361	创新新材	13,800	53,268.00	0.02
772	000959	首钢股份	17,400	53,070.00	0.02
773	688281	华秦科技	562	52,322.20	0.02
774	301165	锐捷网络	700	50,540.00	0.02
775	603786	科博达	800	49,440.00	0.02
776	600007	中国国贸	2,000	48,920.00	0.02
777	301267	华夏眼科	2,500	47,600.00	0.01
778	688172	燕东微	2,367	47,458.35	0.01
779	001203	大中矿业	5,400	46,764.00	0.01
780	688520	神州细胞	1,260	45,649.80	0.01
781	688475	萤石网络	1,492	45,043.48	0.01
782	603056	德邦股份	3,100	44,423.00	0.01
783	000539	粤电力 A	9,800	44,394.00	0.01
784	601061	中信金属	6,000	43,560.00	0.01
785	002945	华林证券	2,700	41,391.00	0.01
786	688375	国博电子	817	40,327.12	0.01
787	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.01
788	301498	乖宝宠物	500	39,160.00	0.01
789	603826	坤彩科技	2,000	38,500.00	0.01
790	600927	永安期货	2,900	38,251.00	0.01
791	688819	天能股份	1,280	34,841.60	0.01
792	601858	中国科传	1,600	32,608.00	0.01
793	601158	重庆水务	6,400	31,360.00	0.01
794	688449	联芸科技	1,044	30,735.36	0.01
795	688276	百克生物	1,196	30,031.56	0.01
796	688153	唯捷创芯	888	29,712.48	0.01
797	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
798	688750	金天钛业	1,649	25,460.56	0.01
799	001289	龙源电力	1,500	23,565.00	0.01
800	603341	龙旗科技	500	23,375.00	0.01
801	600956	新天绿能	3,100	23,374.00	0.01
802	688708	佳驰科技	463	22,663.85	0.01
803	603868	飞科电器	500	20,760.00	0.01
804	688295	中复神鹰	980	19,531.40	0.01
805	301522	上大股份	781	19,400.04	0.01
806	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
807	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00

808	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
809	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
810	688710	益诺思	329	11,047.82	0.00
811	301631	壹连科技	102	10,399.92	0.00
812	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
813	301613	新铝时代	238	9,941.26	0.00
814	301606	绿联科技	262	9,560.38	0.00
815	301603	乔锋智能	203	8,521.94	0.00
816	301608	博实结	129	8,434.02	0.00
817	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
818	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
819	603194	中力股份	234	6,582.42	0.00
820	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
821	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
822	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
823	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
824	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
825	603285	键邦股份	110	2,487.10	0.00
826	603310	巍华新材	122	2,189.90	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,462,917.40	2.81
2	000333	美的集团	3,026,081.00	1.56
3	000858	五粮液	2,727,534.60	1.40
4	300059	东方财富	2,196,740.00	1.13
5	000651	格力电器	1,849,569.00	0.95
6	300760	迈瑞医疗	1,832,587.00	0.94
7	002594	比亚迪	1,799,173.00	0.93
8	002475	立讯精密	1,645,241.00	0.85
9	000725	京东方 A	1,456,789.00	0.75
10	300124	汇川技术	1,287,210.00	0.66
11	300274	阳光电源	1,156,832.00	0.60
12	002415	海康威视	1,092,678.00	0.56
13	002714	牧原股份	1,031,389.00	0.53
14	601127	赛力斯	1,021,704.00	0.53
15	002352	顺丰控股	1,017,307.00	0.52
16	000568	泸州老窖	995,527.00	0.51

17	000001	平安银行	993,222.00	0.51
18	300308	中际旭创	960,400.00	0.49
19	300498	温氏股份	950,638.00	0.49
20	000063	中兴通讯	948,030.00	0.49

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	300750	宁德时代	3,182,782.00	1.64
2	000333	美的集团	1,876,114.00	0.97
3	000858	五粮液	1,791,059.00	0.92
4	300760	迈瑞医疗	1,251,060.00	0.64
5	000651	格力电器	1,201,132.08	0.62
6	300059	东方财富	1,100,225.00	0.57
7	002594	比亚迪	1,031,564.00	0.53
8	600519	贵州茅台	928,236.00	0.48
9	002475	立讯精密	925,692.00	0.48
10	000725	京东方 A	925,599.00	0.48
11	300124	汇川技术	835,494.00	0.43
12	000792	盐湖股份	820,649.00	0.42
13	300274	阳光电源	806,584.00	0.42
14	002415	海康威视	698,681.00	0.36
15	002352	顺丰控股	680,292.00	0.35
16	000568	泸州老窖	676,824.00	0.35
17	002714	牧原股份	657,857.00	0.34
18	002142	宁波银行	644,127.00	0.33
19	300308	中际旭创	624,637.00	0.32
20	300498	温氏股份	621,908.00	0.32

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	131,533,956.04
卖出股票收入（成交）总额	88,184,981.90

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中信证券股份有限公司在本报告期内被中国证券监督管理委员会立案调查，在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

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

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调

查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,145,057.38
2	应收清算款	21,166,503.11
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	-
8	其他	-
9	合计	22,311,560.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
1,427	174,428.0 6	210,050,59 8.00	84.39%	38,858,245. 00	15.61%	154,307,65 5.00	61.99%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“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	平安资管－中国银行－平安资产夏荷18号资产管理产品	23,037,400.00	9.26%
2	张招兴	5,000,000.00	2.01%
3	招商银行股份有限公司－广发养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	3,904,000.00	1.57%
4	安徽省伍号职业年金计划－交通银行	3,894,700.00	1.56%
5	招商证券股份有限公司	3,705,805.00	1.49%
6	中银基金－中国邮储－中银基金－战略基础 1 号集合资产管理计划	2,474,100.00	0.99%
7	上海惠澄资产管理有限公司－惠澄曲盈一号私募证券投资基金	2,139,400.00	0.86%
8	张晓林	2,036,400.00	0.82%
9	东方证券股份有限公司	2,031,861.00	0.82%
10	中国铁路南昌局集团有限公司企业年金计划－中国建设银行股份有限公司	1,739,500.00	0.70%
11	中国建设银行股份有限公司－易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	154,307,655.00	61.99%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 10 月 8 日)基金份额总额	887,908,843.00
本报告期期初基金份额总额	176,908,843.00
本报告期基金总申购份额	183,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	111,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	248,908,843.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 8 月 28 日发布公告，自 2024 年 8 月 26 日起陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员；本基金管理人于 2024 年 10 月 21 日发布公告，自 2024 年 10 月 20 日起关秀霞女士不再担任公司副总经理级高级管理人员。

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金已连续 6 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 47,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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	管理人；高级管理人员

受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-26
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	责令改正并暂停受理 ETF 公募基金产品注册申请三个月；出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度机制不完善，规定执行不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成并恢复 ETF 基金产品注册
其他	/

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，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。

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	
长江证券	3	74,994.95	0.03%	14.92	0.07%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	374,017.09	0.17%	37.39	0.17%	-
光大证券	2	2,246,310.67	1.03%	224.68	1.03%	-
广发证券	3	24,693,178.78	11.38%	2,469.26	11.37%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	0	84,314,710.55	38.85%	8,432.29	38.84%	-
华泰证券	2	14,771,730.90	6.81%	1,477.15	6.80%	-
平安证券	2	36,035.00	0.02%	3.59	0.02%	-
申万宏源	4	56,180,090.25	25.89%	5,618.99	25.88%	-
兴业证券	2	1,648,656.49	0.76%	164.85	0.76%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	292,689.81	0.13%	29.28	0.13%	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	697,497.32	0.32%	69.78	0.32%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	17,032,355.57	7.85%	1,703.18	7.84%	-

中信证券	2	14,674,057.45	6.76%	1,467.54	6.76%	-
------	---	---------------	-------	----------	-------	---

注：a）本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司、华创证券有限责任公司，新增交易单元的证券公司为长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

b）本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金交易单元的选择标准有调整，调整后的标准如下：

1）财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，采取规范化的方式提供专业化的服务，在业内具有良好的声誉；

2）具有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力；

3）具有较突出的综合及专项服务能力和服务意愿；

4）佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c）本报告期内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。

d）本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，报告的主要内容是报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	14,418.04	25.75%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	9,624.00	17.19%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	31,947.14	57.06%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储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	2024-03-11
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤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	2024-04-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
6	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	2024-04-23
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源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	2024-04-30
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华宝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	2024-07-11
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第	中国证券报	2024-07-18

	2 季度报告提示性公告		
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加民生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	2024-07-23
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华鑫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	2024-08-07
12	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	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	2024-08-23
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国联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	2024-08-23
14	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	2024-08-28
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证券报	2024-08-30
16	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加爱建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	2024-09-06
17	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	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	2024-10-09
18	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	2024-10-21
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-10-25
20	易方达基金管理有限公司关于易方达私募基金管理有限公司股东变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-11-02
21	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加大同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	2024-11-25
22	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国新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	2024-12-06
23	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中原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	2024-12-06
24	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加西南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	2024-12-13

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司－易方达中证800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2024 年 01 月 01 日~2024 年 12 月 31 日	100,743,355.00	141,809,600.00	88,245,300.00	154,307,655.00	61.99 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；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。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日