

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：二〇二四年八月三十日

§ 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 2024 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 2024 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 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	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
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	63
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	63
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	63
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	63

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12	投资组合报告附注	64
§ 8	基金份额持有人信息	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2	期末上市基金前十名持有人	65
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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情况	66
§ 9	开放式基金份额变动	66
§ 10	重大事件揭示	67
10.1	基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4	基金投资策略的改变	67
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
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	69
§ 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	70
12.1	备查文件目录	70
12.2	存放地点	70
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	179,908,843.00 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	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
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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,636,386.61
本期利润	748,059.75
加权平均基金份额本期利润	0.0041
本期加权平均净值利润率	0.37%
本期基金份额净值增长率	-0.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	17,110,391.59
期末可供分配基金份额利润	0.0951
期末基金资产净值	197,019,234.59
期末基金份额净值	1.0951
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	9.51%

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	-3.46%	0.56%	-4.23%	0.57%	0.77%	-0.01%
过去三个月	-1.98%	0.82%	-3.27%	0.83%	1.29%	-0.01%
过去六个月	-0.26%	1.03%	-1.76%	1.03%	1.50%	0.00%
过去一年	-8.38%	0.93%	-11.97%	0.93%	3.59%	0.00%
过去三年	-26.03%	1.03%	-32.41%	1.04%	6.38%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.51%	1.14%	-7.28%	1.14%	16.79%	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 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 9.51%，同期业绩比较基准收益率为 -7.28%。

§ 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、易方达上证科创 50 联接、易方达	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

	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				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 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 31 次，其中 26 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，5 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。

2024 年上半年，外部国际环境更趋复杂严峻和不确定，国内结构调整阵痛有所显现，影响经济增长的因素较以往更为复杂。在这种复杂局面下，我国经济顶住压力，运行总体平稳、结构不断升级，成绩来之不易。年初，受国内外经济形势复杂多变的影响，投资者的风险偏好有所降低，导致

股票市场波动加剧。随着国内经济复苏迹象逐渐显现和政策层面的积极支持，市场信心得到提振，推动了股票市场的逐步回升。但五月下旬至六月底，由于外部环境的复杂性和严峻性加剧，以及国内经济复苏过程中遇到的挑战，市场参与者表现出谨慎态度，股票市场呈现调整和波动的态势。上述背景下，A 股市场表现出宽幅震荡的特点，市场波动率维持在较高水平。2024 年上半年，中证 800 指数下跌 1.76%。行业结构上看，中证 800 指数权重占比较大的行业为银行、电子、非银金融、食品饮料、电力设备与医药生物，2024 年上半年，上述权重行业中仅银行获得正收益，其他行业均有不同程度下跌拖累指数表现。

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 1.0951 元，本报告期份额净值增长率为-0.26%，同期业绩比较基准收益率为-1.76%。年化跟踪误差 0.57%，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 2024 年下半年，国内宏观经济发展情况将面临多方面的挑战与机遇。外部环境的不确定性和复杂性依旧存在，诸如地缘政治冲突、国际金融市场的波动等因素，将对我国经济造成一定影响。同时，国内经济也面临着有效需求不足、部分行业产能过剩、社会预期偏弱等问题，这些都需要通过政策调整和市场机制的优化来逐步解决。然而，我国经济的长期向好趋势并未改变。我国经济的韧性、潜力和活力依然显著，这得益于庞大的国内市场、完善的产业链、持续的创新能力和政府的有效调控。随着政策的逐步发力，包括财政政策的积极作用、货币政策的适度宽松以及结构性改革的深化，预计将有效推动经济稳定增长。

影响下半年 A 股市场走势的因素较为错综复杂，其中投资者对经济增长预期的调整及稳增长政策的效果将是关键。外部因素如全球地缘政治局势、海外主要国家的经济增长预期以及货币政策的调整，也将对下半年 A 股市场产生一定影响。综合来看，随着国内宏观政策的逐步显效，以及市场对政策反应的逐步明朗，预计国民经济将保持持续回升的态势。这将为股市提供稳定的基本面支撑，实现更加稳健和可持续发展。

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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,129,458.41	7,297,188.50
结算备付金		1,314,884.10	1,310,761.16
存出保证金		971,475.53	1,048,431.75
交易性金融资产	6.4.7.2	188,882,444.37	185,235,919.54
其中：股票投资		188,874,443.88	185,232,419.43
基金投资		-	-
债券投资		8,000.49	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		5,508.60	1,380,359.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,409.12	-
资产总计		197,379,180.13	196,272,660.10
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		200,001.93	1,294,055.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,436.48	24,244.48
应付托管费		8,145.47	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	6.4.7.6	127,361.66	696,398.06
负债合计		359,945.54	2,022,779.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	179,908,843.00	176,908,843.00
未分配利润	6.4.7.8	17,110,391.59	17,341,037.34
净资产合计		197,019,234.59	194,249,880.34
负债和净资产总计		197,379,180.13	196,272,660.10

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0951 元，基金份额总额 179,908,843.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,182,580.29	2,071,341.38
1.利息收入		26,093.02	15,841.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,093.02	15,841.66
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）		-3,337,891.41	2,794,993.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,312,146.74	918,544.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,022.36	10,671.23
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	-234,759.20	216,391.97
股利收益	6.4.7.14	2,205,992.17	1,649,385.69
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,384,446.36	-808,894.72
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	109,932.32	69,401.09
减：二、营业总支出		434,520.54	371,168.91
1. 管理人报酬		151,190.29	107,037.36
2. 托管费		50,396.73	35,679.16
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
8. 其他费用	6.4.7.18	232,933.52	227,672.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		748,059.75	1,700,172.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		748,059.75	1,700,172.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		748,059.75	1,700,172.47

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	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）	3,000,000.00	-230,645.75	2,769,354.25
（一）、综合收益总额	-	748,059.75	748,059.75
（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）	3,000,000.00	-978,705.50	2,021,294.50
其中：1.基金申购款	93,000,000.00	8,988,710.78	101,988,710.78
2.基金赎回款	-90,000,000.00	-9,967,416.28	-99,967,416.28
（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	179,908,843.00	17,110,391.59	197,019,234.59
项目	上年度可比期间 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	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）	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净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	27,000,000.00	5,834,110.54	32,834,110.54
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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	143,908,843.00	28,086,305.17	171,995,148.17

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净资产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。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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,129,458.41
等于：本金	6,128,927.78
加：应计利息	530.63
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	6,129,458.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	204,050,657.79	-	188,874,443.88	-15,176,213.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	0.60		
	市场	7,999.89	8,000.49	-
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	7,999.89	0.60	8,000.49	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	204,058,657.68	0.60	188,882,444.37	-15,176,213.91

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 2024 年 6 月 30 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	8,271,620.00	-	-	-

IC2409	3,119,560.00	-	-	-
IC2412	3,052,600.00	-	-	-
IF2409	1,042,680.00	-	-	-
IF2412	1,056,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,271,620.00	-	-	-

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
IC2409	IC2409	3	2,925,120.00	-194,440.00
IC2412	IC2412	3	2,900,280.00	-152,320.00
IF2409	IF2409	1	1,027,080.00	-15,600.00
IF2412	IF2412	1	1,026,600.00	-30,180.00
合计	-	-	-	-392,540.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-392,540.00
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。

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 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	4,794.18
其中：交易所市场	4,794.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,567.48
其他应付款	35,000.00
合计	127,361.66

6.4.7.7 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 6 月 30 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	93,000,000.00	93,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-90,000,000.00	-90,000,000.00
本期末	179,908,843.00	179,908,843.00

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	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	-3,636,386.61	4,384,446.36	748,059.75
本期基金份额交易产生的变动数	1,523,631.50	-2,502,337.00	-978,705.50
其中：基金申购款	39,578,004.54	-30,589,293.76	8,988,710.78
基金赎回款	-38,054,373.04	28,086,956.76	-9,967,416.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,292,666.05	-59,182,274.46	17,110,391.59

6.4.7.9 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 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	15,570.55
其他	188.67

合计	26,093.02
----	-----------

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,291,895.96
股票投资收益——赎回差价收入	-1,020,250.78
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	-5,312,146.74

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	52,714,769.09
减：卖出股票成本总额	56,962,456.77
减：交易费用	44,208.28
买卖股票差价收入	-4,291,895.96

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 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	99,967,416.28
减：现金支付赎回款总额	39,121,575.28
减：赎回股票成本总额	61,866,091.78
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,020,250.78

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,020.30
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	3,022.36
----	----------

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,522.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,499.95
减：应计利息总额	1.73
减：交易费用	0.62
买卖债券差价收入	3,020.30

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-234,759.20

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,205,992.17
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	2,205,992.17

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	4,632,886.36
——股票投资	4,632,886.36
——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	-248,440.00
——权证投资	-
——期货投资	-248,440.00
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	4,384,446.36

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	109,932.32
合计	109,932.32

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,950.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	15.16
指数使用费	70,000.00
银行汇划费	760.00
其他	84,535.36
合计	232,933.52

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	23,001,674.68	21.16%	14,668,418.52	19.44%

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	5,898.60	38.00%	8,196.57	13.85%

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 2024年1月1日至2024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	2,300.16	21.15%	1,983.65	41.38%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。本报告期及上年度可比期间该类佣金协议的服务范围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。

2.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。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	151,190.29	107,037.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	991.88	892.09
应支付基金管理人的净管理费	150,198.41	106,145.27

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,396.73	35,679.16

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 2024 年 6 月 30 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	119,838,955.00	66.6109%	100,743,355.00	56.9465%
广发证券股份有限公司	2,314,058.00	1.2862%	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。

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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	6,129,458.41	10,333.80	3,838,964.11	6,210.78

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					
2024年1月1日至2024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
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
上年度可比期间					
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
-	-	-	-	-	-

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

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 2024 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 24,200 股（2023 年 12 月 31 日:23,700 股），占本基金净值比例为 0.15%(2023 年 12 月 31 日:0.17%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 55,100 股（2023 年 12 月 31 日:53,900 股），占本基金净值比例为 0.21%(2023 年 12 月 31 日:0.18%)。

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（2024 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
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	163	2,834.57	3,357.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	187	3,259.41	6,462.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	414	6,690.24	13,359.78	-
30153	骏鼎	2024-0	6 个月	新股	55.82	91.24	150	5,972.	13,686	-

8	达	3-13		流通受限				74	.00	
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	485	5,761.80	9,205.30	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	550	4,895.00	9,333.50	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	132	5,933.40	8,702.76	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	285	6,193.05	7,199.10	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	427	30,072.93	80,280.27	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	264	4,276.80	4,213.44	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	89	1,893.92	2,624.61	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月以内	新股流通受限	18.65	18.65	984	18,351.60	18,351.60	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	110	2,051.50	2,051.50	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	73	2,118.46	1,851.28	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	31	2,246.26	2,109.86	-

603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	107	2,782.00	4,011.43	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	134	2,570.12	3,036.44	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月以内	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	55	2,099.90	2,139.50	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	89	2,078.15	2,236.57	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	307	6,956.62	4,878.23	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	241	4,786.26	10,244.91	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	77	6,695.92	13,469.61	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	363	5,695.47	6,820.77	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024-06-17	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	80	8,000.00	8,000.49	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2024 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 2024 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 2024 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%(2023 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 2024年6月30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 2024年6月30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

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 2024年6月30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

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	8,000.49	3,500.11
未评级	0.00	0.00
合计	8,000.49	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 2024年6月30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

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 2024年6月30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

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 2024 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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,129,458.41	-	-	-	6,129,458.41
结算备付金	1,314,884.10	-	-	-	1,314,884.10
存出保证金	971,475.53	-	-	-	971,475.53
交易性金融资产	-	-	8,000.49	188,874,443.88	188,882,444.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	5,508.60	5,508.60
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	8,415,818.04	-	8,000.49	188,955,361.60	197,379,180.13
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	-	-	-	200,001.93	200,001.93
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	24,436.48	24,436.48
应付托管费	-	-	-	8,145.47	8,145.47
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	-	-	-	127,361.66	127,361.66
负债总计	-	-	-	359,945.54	359,945.54
利率敏感度缺口	8,415,818.04	-	8,000.49	188,595,416.06	197,019,234.59
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。

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，因此无重大外汇风险。

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 2024 年 6 月 30 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	188,874,443.88	95.87	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	188,874,443.88	95.87	185,232,419.43	95.36

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	9,367,259.63	9,259,963.38
	2.业绩比较基准下降 5%	-9,367,259.63	-9,259,963.38

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	188,574,104.42
第二层次	50,012.15
第三层次	258,327.80
合计	188,882,444.37

6.4.14.2 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	188,874,443.88	95.69
	其中：股票	188,874,443.88	95.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,000.49	0.00
	其中：债券	8,000.49	0.00
	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	7,444,342.51	3.77
8	其他各项资产	1,052,393.25	0.53
9	合计	197,379,180.13	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	2,113,441.20	1.07
B	采矿业	10,902,171.45	5.53
C	制造业	103,410,290.46	52.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,383,609.30	4.26
E	建筑业	3,705,006.60	1.88
F	批发和零售业	1,305,835.54	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	6,336,572.10	3.22
H	住宿和餐饮业	136,349.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,654,668.99	4.90
J	金融业	36,446,111.25	18.50
K	房地产业	1,835,411.63	0.93
L	租赁和商务服务业	1,495,596.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	1,502,040.38	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	203,285.58	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,195.00	0.02
Q	卫生和社会工作	667,084.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	654,151.40	0.33
S	综合	74,624.00	0.04
	合计	188,874,443.88	95.87

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	5,200	7,630,428.00	3.87
2	300750	宁德时代	21,640	3,895,849.20	1.98
3	601318	中国平安	88,100	3,643,816.00	1.85
4	600036	招商银行	101,547	3,471,891.93	1.76
5	600900	长江电力	100,200	2,897,784.00	1.47
6	000333	美的集团	40,000	2,580,000.00	1.31
7	601899	紫金矿业	135,000	2,371,950.00	1.20
8	601166	兴业银行	119,300	2,102,066.00	1.07
9	000858	五粮液	15,900	2,035,836.00	1.03
10	002594	比亚迪	7,400	1,851,850.00	0.94
11	601328	交通银行	224,200	1,674,774.00	0.85
12	601398	工商银行	286,000	1,630,200.00	0.83
13	002475	立讯精密	40,999	1,611,670.69	0.82
14	300760	迈瑞医疗	5,000	1,454,550.00	0.74
15	600030	中信证券	79,660	1,452,201.80	0.74
16	000651	格力电器	36,800	1,443,296.00	0.73
17	600276	恒瑞医药	36,390	1,399,559.40	0.71
18	600887	伊利股份	51,935	1,342,000.40	0.68
19	600309	万华化学	15,400	1,245,244.00	0.63
20	000725	京东方 A	301,500	1,233,135.00	0.63
21	601088	中国神华	27,000	1,197,990.00	0.61
22	601288	农业银行	260,500	1,135,780.00	0.58
23	300059	东方财富	103,028	1,087,975.68	0.55
24	601816	京沪高铁	200,900	1,078,833.00	0.55
25	300308	中际旭创	7,320	1,009,281.60	0.51
26	002714	牧原股份	22,440	978,384.00	0.50
27	601857	中国石油	92,800	957,696.00	0.49
28	002415	海康威视	30,500	942,755.00	0.48
29	601138	工业富联	33,500	917,900.00	0.47
30	601668	中国建筑	170,600	905,886.00	0.46
31	600919	江苏银行	119,800	890,114.00	0.45
32	600690	海尔智家	31,000	879,780.00	0.45
33	300498	温氏股份	43,560	863,359.20	0.44
34	000568	泸州老窖	6,000	860,940.00	0.44
35	600809	山西汾酒	3,980	839,302.40	0.43
36	002371	北方华创	2,600	831,714.00	0.42
37	601985	中国核电	77,300	824,018.00	0.42

38	600406	国电南瑞	32,962	822,731.52	0.42
39	601225	陕西煤业	31,735	817,810.95	0.42
40	601919	中远海控	52,590	814,619.10	0.41
41	603259	药明康德	20,740	812,800.60	0.41
42	000001	平安银行	79,500	806,925.00	0.41
43	600031	三一重工	48,700	803,550.00	0.41
44	601988	中国银行	172,900	798,798.00	0.41
45	600941	中国移动	7,400	795,500.00	0.40
46	600000	浦发银行	96,200	791,726.00	0.40
47	300124	汇川技术	15,350	787,455.00	0.40
48	601728	中国电信	127,300	782,895.00	0.40
49	601601	中国太保	28,100	782,866.00	0.40
50	000792	盐湖股份	44,500	776,525.00	0.39
51	600028	中国石化	119,300	753,976.00	0.38
52	601766	中国中车	99,700	748,747.00	0.38
53	688981	中芯国际	16,231	748,249.10	0.38
54	600150	中国船舶	18,300	744,993.00	0.38
55	300274	阳光电源	11,920	739,397.60	0.38
56	600050	中国联通	156,500	735,550.00	0.37
57	000338	潍柴动力	44,500	722,680.00	0.37
58	000063	中兴通讯	25,800	721,626.00	0.37
59	002352	顺丰控股	20,100	717,369.00	0.36
60	601169	北京银行	119,700	699,048.00	0.35
61	601012	隆基绿能	49,712	696,962.24	0.35
62	603501	韦尔股份	6,935	689,130.95	0.35
63	600837	海通证券	79,200	677,952.00	0.34
64	000100	TCL 科技	154,030	665,409.60	0.34
65	600016	民生银行	174,600	661,734.00	0.34
66	002230	科大讯飞	15,000	644,250.00	0.33
67	600660	福耀玻璃	13,100	627,490.00	0.32
68	601229	上海银行	81,500	591,690.00	0.30
69	002142	宁波银行	26,640	587,678.40	0.30
70	600089	特变电工	41,340	573,385.80	0.29
71	600938	中国海油	17,200	567,600.00	0.29
72	601390	中国中铁	84,300	549,636.00	0.28
73	300502	新易盛	5,200	548,860.00	0.28
74	000625	长安汽车	40,732	547,030.76	0.28
75	688041	海光信息	7,718	542,729.76	0.28
76	603986	兆易创新	5,496	525,527.52	0.27
77	601688	华泰证券	41,900	519,141.00	0.26
78	600104	上汽集团	37,403	518,405.58	0.26
79	600436	片仔癀	2,500	517,925.00	0.26
80	601006	大秦铁路	72,100	516,236.00	0.26
81	600048	保利发展	58,800	515,088.00	0.26

82	600905	三峡能源	117,400	511,864.00	0.26
83	688012	中微公司	3,570	504,298.20	0.26
84	002027	分众传媒	83,000	502,980.00	0.26
85	601888	中国中免	7,900	493,671.00	0.25
86	601211	国泰君安	36,400	493,220.00	0.25
87	603993	洛阳钼业	57,900	492,150.00	0.25
88	603019	中科曙光	11,820	490,530.00	0.25
89	601600	中国铝业	64,100	489,083.00	0.25
90	601818	光大银行	152,300	482,791.00	0.25
91	600019	宝钢股份	72,600	482,790.00	0.25
92	603288	海天味业	13,612	469,205.64	0.24
93	601989	中国重工	93,600	461,448.00	0.23
94	601658	邮储银行	91,000	461,370.00	0.23
95	600585	海螺水泥	19,400	457,646.00	0.23
96	688111	金山办公	1,996	454,090.00	0.23
97	600886	国投电力	24,400	445,056.00	0.23
98	600795	国电电力	73,200	438,468.00	0.22
99	601009	南京银行	41,800	434,302.00	0.22
100	688008	澜起科技	7,584	433,501.44	0.22
101	600438	通威股份	22,200	424,242.00	0.22
102	601628	中国人寿	13,600	422,280.00	0.21
103	600999	招商证券	30,340	422,029.40	0.21
104	000938	紫光股份	18,680	417,498.00	0.21
105	000425	徐工机械	58,100	415,415.00	0.21
106	600547	山东黄金	14,900	407,962.00	0.21
107	601939	建设银行	55,100	407,740.00	0.21
108	300014	亿纬锂能	10,103	403,311.76	0.20
109	600893	航发动力	10,960	400,588.00	0.20
110	601669	中国电建	71,200	398,008.00	0.20
111	300015	爱尔眼科	38,350	395,772.00	0.20
112	002304	洋河股份	4,900	395,626.00	0.20
113	002179	中航光电	10,260	390,393.00	0.20
114	000002	万科 A	55,900	387,387.00	0.20
115	600926	杭州银行	29,200	381,060.00	0.19
116	002241	歌尔股份	19,500	380,445.00	0.19
117	000538	云南白药	7,320	374,418.00	0.19
118	600584	长电科技	11,700	371,007.00	0.19
119	600760	中航沈飞	9,144	366,674.40	0.19
120	600111	北方稀土	20,800	357,760.00	0.18
121	600489	中金黄金	23,800	352,240.00	0.18
122	002050	三花智控	18,300	349,164.00	0.18
123	600011	华能国际	36,010	346,416.20	0.18
124	002252	上海莱士	43,700	341,734.00	0.17
125	601916	浙商银行	123,700	341,412.00	0.17

126	600015	华夏银行	52,200	334,080.00	0.17
127	600009	上海机场	10,200	328,950.00	0.17
128	688256	寒武纪	1,653	328,401.51	0.17
129	600958	东方证券	42,988	326,708.80	0.17
130	601186	中国铁建	37,800	323,946.00	0.16
131	600426	华鲁恒升	12,140	323,409.60	0.16
132	300408	三环集团	11,000	321,090.00	0.16
133	002311	海大集团	6,800	319,940.00	0.16
134	000166	申万宏源	73,900	318,509.00	0.16
135	000157	中联重科	40,700	312,576.00	0.16
136	600989	宝丰能源	18,000	311,940.00	0.16
137	601901	方正证券	40,000	309,200.00	0.16
138	000977	浪潮信息	8,300	301,871.00	0.15
139	002028	思源电气	4,500	301,050.00	0.15
140	300433	蓝思科技	16,400	299,300.00	0.15
141	003816	中国广核	64,400	298,172.00	0.15
142	000776	广发证券	24,200	294,514.00	0.15
143	600674	川投能源	15,700	294,375.00	0.15
144	002049	紫光国微	5,580	293,508.00	0.15
145	688271	联影医疗	2,656	291,363.20	0.15
146	688036	传音控股	3,784	289,627.36	0.15
147	002001	新和成	15,076	289,459.20	0.15
148	601377	兴业证券	56,700	286,902.00	0.15
149	601111	中国国航	38,200	281,916.00	0.14
150	600115	中国东航	70,100	281,101.00	0.14
151	300122	智飞生物	9,850	276,095.50	0.14
152	000596	古井贡酒	1,300	274,391.00	0.14
153	000768	中航西飞	11,400	273,942.00	0.14
154	601058	赛轮轮胎	19,300	270,200.00	0.14
155	002460	赣锋锂业	9,380	268,737.00	0.14
156	001979	招商蛇口	29,700	261,063.00	0.13
157	600029	南方航空	44,300	260,927.00	0.13
158	600010	包钢股份	186,200	260,680.00	0.13
159	601800	中国交建	29,100	260,154.00	0.13
160	601633	长城汽车	10,200	258,060.00	0.13
161	002466	天齐锂业	8,600	257,226.00	0.13
162	600188	兖矿能源	11,250	255,712.50	0.13
163	002601	龙佰集团	13,600	252,552.00	0.13
164	002236	大华股份	16,200	250,452.00	0.13
165	600066	宇通客车	9,700	250,260.00	0.13
166	603799	华友钴业	11,240	248,741.20	0.13
167	601117	中国化学	30,000	247,200.00	0.13
168	002648	卫星化学	13,680	245,966.40	0.12
169	688169	石头科技	625	245,375.00	0.12

170	000786	北新建材	8,200	243,212.00	0.12
171	600346	恒力石化	17,300	241,335.00	0.12
172	603369	今世缘	5,200	240,240.00	0.12
173	002493	荣盛石化	24,800	239,568.00	0.12
174	002340	格林美	37,500	238,875.00	0.12
175	000661	长春高新	2,600	238,602.00	0.12
176	601838	成都银行	15,700	238,483.00	0.12
177	000983	山西焦煤	23,000	237,130.00	0.12
178	601788	光大证券	16,100	235,382.00	0.12
179	600161	天坛生物	9,629	234,947.60	0.12
180	600023	浙能电力	33,000	234,630.00	0.12
181	600372	中航机载	19,600	234,612.00	0.12
182	000933	神火股份	11,500	232,645.00	0.12
183	600196	复星医药	10,500	232,470.00	0.12
184	300782	卓胜微	2,980	231,665.20	0.12
185	688223	晶科能源	32,594	231,417.40	0.12
186	000807	云铝股份	17,100	231,021.00	0.12
187	601021	春秋航空	4,100	230,953.00	0.12
188	002129	TCL 中环	26,575	229,873.75	0.12
189	601077	渝农商行	45,300	227,406.00	0.12
190	002938	鹏鼎控股	5,700	226,632.00	0.12
191	601872	招商轮船	26,780	226,291.00	0.11
192	300418	昆仑万维	7,000	225,680.00	0.11
193	601868	中国能建	106,420	225,610.40	0.11
194	600845	宝信软件	7,063	225,521.59	0.11
195	601360	三六零	29,300	225,024.00	0.11
196	600570	恒生电子	12,469	220,202.54	0.11
197	600219	南山铝业	57,600	219,456.00	0.11
198	600176	中国巨石	19,801	218,801.05	0.11
199	000988	华工科技	7,300	218,489.00	0.11
200	600233	圆通速递	13,900	217,535.00	0.11
201	300661	圣邦股份	2,625	217,297.50	0.11
202	300896	爱美客	1,260	216,846.00	0.11
203	605499	东鹏饮料	1,000	215,750.00	0.11
204	600085	同仁堂	5,600	213,976.00	0.11
205	300394	天孚通信	2,400	212,208.00	0.11
206	601168	西部矿业	11,800	211,810.00	0.11
207	002180	纳思达	8,000	211,360.00	0.11
208	600741	华域汽车	12,900	211,302.00	0.11
209	600600	青岛啤酒	2,900	211,033.00	0.11
210	601995	中金公司	7,100	210,231.00	0.11
211	601689	拓普集团	3,900	209,079.00	0.11
212	002384	东山精密	10,000	207,000.00	0.11
213	601066	中信建投	10,700	205,868.00	0.10

214	002736	国信证券	23,600	205,084.00	0.10
215	601100	恒立液压	4,396	204,765.68	0.10
216	000895	双汇发展	8,600	204,422.00	0.10
217	600418	江淮汽车	12,900	204,336.00	0.10
218	600183	生益科技	9,700	204,282.00	0.10
219	601336	新华保险	6,800	204,204.00	0.10
220	300347	泰格医药	4,200	204,120.00	0.10
221	603392	万泰生物	3,095	203,898.60	0.10
222	600362	江西铜业	8,600	203,648.00	0.10
223	002271	东方雨虹	16,500	203,610.00	0.10
224	600745	闻泰科技	7,105	200,716.25	0.10
225	000630	铜陵有色	55,600	200,716.00	0.10
226	000423	东阿阿胶	3,200	200,320.00	0.10
227	002920	德赛西威	2,300	200,307.00	0.10
228	001965	招商公路	16,800	199,248.00	0.10
229	600988	赤峰黄金	12,100	197,714.00	0.10
230	000963	华东医药	7,100	197,451.00	0.10
231	601233	桐昆股份	12,300	196,308.00	0.10
232	600027	华电国际	27,900	193,626.00	0.10
233	601881	中国银河	17,800	193,308.00	0.10
234	002625	光启技术	11,000	190,850.00	0.10
235	601898	中煤能源	15,100	188,448.00	0.10
236	300033	同花顺	1,800	186,660.00	0.09
237	688126	沪硅产业	13,399	185,040.19	0.09
238	600096	云天化	9,400	182,548.00	0.09
239	601618	中国中冶	58,500	181,350.00	0.09
240	002459	晶澳科技	16,056	179,827.20	0.09
241	601699	潞安环能	9,900	179,487.00	0.09
242	000400	许继电气	5,200	178,932.00	0.09
243	601567	三星医疗	5,100	178,500.00	0.09
244	600026	中远海能	11,400	177,954.00	0.09
245	000999	华润三九	4,150	176,707.00	0.09
246	600515	海南机场	56,200	176,468.00	0.09
247	601607	上海医药	9,200	175,812.00	0.09
248	002916	深南电路	1,660	175,578.20	0.09
249	300832	新产业	2,600	175,344.00	0.09
250	688617	惠泰医疗	384	175,142.40	0.09
251	002128	电投能源	8,300	175,130.00	0.09
252	002156	通富微电	7,800	174,642.00	0.09
253	688777	中控技术	4,607	173,683.90	0.09
254	601555	东吴证券	29,368	173,271.20	0.09
255	002273	水晶光电	10,200	173,196.00	0.09
256	000301	东方盛虹	21,700	172,949.00	0.09
257	601878	浙商证券	15,900	170,448.00	0.09

258	002078	太阳纸业	12,200	170,190.00	0.09
259	600332	白云山	5,800	170,114.00	0.09
260	000876	新希望	18,600	170,004.00	0.09
261	600875	东方电气	9,200	169,740.00	0.09
262	601877	正泰电器	8,900	169,634.00	0.09
263	002074	国轩高科	8,800	168,520.00	0.09
264	600885	宏发股份	6,080	168,294.40	0.09
265	600588	用友网络	16,791	167,910.00	0.09
266	600039	四川路桥	21,280	167,899.20	0.09
267	002709	天赐材料	9,540	167,522.40	0.09
268	601128	常熟银行	22,110	167,372.70	0.08
269	600415	小商品城	22,400	166,208.00	0.08
270	002555	三七互娱	12,700	165,735.00	0.08
271	002223	鱼跃医疗	4,400	165,440.00	0.08
272	300207	欣旺达	10,900	165,353.00	0.08
273	600352	浙江龙盛	19,100	164,069.00	0.08
274	601998	中信银行	24,300	162,810.00	0.08
275	002138	顺络电子	5,900	162,014.00	0.08
276	600398	海澜之家	17,300	159,852.00	0.08
277	600025	华能水电	14,800	159,544.00	0.08
278	002532	天山铝业	19,600	158,956.00	0.08
279	600803	新奥股份	7,600	158,080.00	0.08
280	002353	杰瑞股份	4,500	157,860.00	0.08
281	601108	财通证券	23,820	157,450.20	0.08
282	000408	藏格矿业	6,500	156,455.00	0.08
283	600765	中航重机	7,640	155,856.00	0.08
284	300628	亿联网络	4,220	155,169.40	0.08
285	300316	晶盛机电	5,400	155,142.00	0.08
286	688396	华润微	4,108	153,803.52	0.08
287	002185	华天科技	18,800	153,220.00	0.08
288	600879	航天电子	19,700	153,069.00	0.08
289	002966	苏州银行	20,360	152,700.00	0.08
290	002812	恩捷股份	4,800	151,920.00	0.08
291	300450	先导智能	9,100	151,333.00	0.08
292	600873	梅花生物	15,100	151,302.00	0.08
293	688599	天合光能	8,933	151,146.36	0.08
294	002517	恺英网络	15,700	149,935.00	0.08
295	601577	长沙银行	18,300	149,694.00	0.08
296	300223	北京君正	2,700	149,688.00	0.08
297	300142	沃森生物	13,100	149,078.00	0.08
298	301236	软通动力	4,200	147,882.00	0.08
299	603979	金诚信	2,900	146,537.00	0.07
300	603606	东方电缆	3,000	146,430.00	0.07
301	605117	德业股份	1,960	145,706.40	0.07

302	600177	雅戈尔	20,368	145,020.16	0.07
303	002738	中矿资源	5,400	144,720.00	0.07
304	600079	人福医药	8,400	144,228.00	0.07
305	600109	国金证券	19,100	144,205.00	0.07
306	300003	乐普医疗	9,700	143,948.00	0.07
307	002007	华兰生物	9,080	143,373.20	0.07
308	600460	士兰微	8,100	141,831.00	0.07
309	300017	网宿科技	17,900	141,410.00	0.07
310	600060	海信视像	5,700	141,018.00	0.07
311	688120	华海清科	742	140,668.36	0.07
312	688099	晶晨股份	2,369	140,529.08	0.07
313	601238	广汽集团	18,100	140,094.00	0.07
314	600497	驰宏锌锗	26,100	139,374.00	0.07
315	300136	信维通信	7,000	137,060.00	0.07
316	300496	中科创达	3,000	136,770.00	0.07
317	300759	康龙化成	7,300	135,634.00	0.07
318	603260	合盛硅业	2,900	135,459.00	0.07
319	601319	中国人保	26,300	135,445.00	0.07
320	300751	迈为股份	1,132	135,251.36	0.07
321	689009	九号公司	3,674	135,239.94	0.07
322	002202	金风科技	20,100	135,072.00	0.07
323	601799	星宇股份	1,200	134,448.00	0.07
324	000932	华菱钢铁	30,300	134,229.00	0.07
325	002739	万达电影	11,100	134,199.00	0.07
326	300999	金龙鱼	4,900	134,015.00	0.07
327	600985	淮北矿业	8,000	133,920.00	0.07
328	000733	振华科技	3,200	132,896.00	0.07
329	600536	中国软件	4,440	132,844.80	0.07
330	000683	远兴能源	19,200	132,672.00	0.07
331	002465	海格通信	12,800	132,608.00	0.07
332	600348	华阳股份	13,300	132,468.00	0.07
333	600018	上港集团	22,900	132,362.00	0.07
334	301269	华大九天	1,700	130,985.00	0.07
335	002444	巨星科技	5,300	130,910.00	0.07
336	002281	光迅科技	3,500	130,795.00	0.07
337	603160	汇顶科技	1,900	130,625.00	0.07
338	000009	中国宝安	15,100	129,860.00	0.07
339	600918	中泰证券	22,900	129,843.00	0.07
340	000878	云南铜业	10,300	128,338.00	0.07
341	002821	凯莱英	1,940	127,652.00	0.06
342	300413	芒果超媒	6,100	127,490.00	0.06
343	603195	公牛集团	1,653	127,479.36	0.06
344	688009	中国通号	21,214	127,284.00	0.06
345	002436	兴森科技	12,300	126,936.00	0.06

346	002008	大族激光	6,100	126,880.00	0.06
347	002409	雅克科技	2,000	125,820.00	0.06
348	600298	安琪酵母	4,500	125,685.00	0.06
349	603806	福斯特	8,539	125,523.30	0.06
350	002797	第一创业	24,600	125,214.00	0.06
351	000039	中集集团	13,500	125,010.00	0.06
352	300054	鼎龙股份	5,500	124,740.00	0.06
353	601865	福莱特	6,200	124,620.00	0.06
354	601615	明阳智能	13,200	124,608.00	0.06
355	000066	中国长城	14,200	124,250.00	0.06
356	600529	山东药玻	4,900	124,166.00	0.06
357	688122	西部超导	3,233	123,888.56	0.06
358	601990	南京证券	16,100	123,648.00	0.06
359	300474	景嘉微	1,950	123,298.50	0.06
360	300012	华测检测	12,200	122,732.00	0.06
361	603659	璞泰来	8,665	122,436.45	0.06
362	002673	西部证券	19,700	121,943.00	0.06
363	300919	中伟股份	3,920	121,480.80	0.06
364	600839	四川长虹	27,000	121,230.00	0.06
365	601666	平煤股份	10,800	120,960.00	0.06
366	688525	佰维存储	1,883	120,794.45	0.06
367	601179	中国西电	15,000	120,600.00	0.06
368	600642	申能股份	13,600	120,088.00	0.06
369	300395	菲利华	3,900	119,925.00	0.06
370	603816	顾家家居	3,700	119,473.00	0.06
371	600061	国投资本	21,104	119,237.60	0.06
372	000831	中国稀土	4,700	119,145.00	0.06
373	601717	郑煤机	8,000	118,400.00	0.06
374	603596	伯特利	3,040	118,256.00	0.06
375	002432	九安医疗	2,900	117,566.00	0.06
376	000728	国元证券	19,240	116,594.40	0.06
377	000738	航发控制	5,800	116,406.00	0.06
378	300002	神州泰岳	14,300	116,116.00	0.06
379	600132	重庆啤酒	1,900	115,330.00	0.06
380	600038	中直股份	2,800	115,108.00	0.06
381	000617	中油资本	20,800	114,816.00	0.06
382	600862	中航高科	6,100	114,558.00	0.06
383	688180	君实生物	3,942	114,515.10	0.06
384	002595	豪迈科技	3,000	114,510.00	0.06
385	000703	恒逸石化	16,090	114,078.10	0.06
386	601198	东兴证券	14,200	113,032.00	0.06
387	000783	长江证券	23,400	113,022.00	0.06
388	601997	贵阳银行	21,400	112,778.00	0.06
389	601059	信达证券	7,900	112,259.00	0.06

390	300037	新宙邦	3,920	111,955.20	0.06
391	603345	安井食品	1,500	111,465.00	0.06
392	000708	中信特钢	8,200	111,274.00	0.06
393	600863	内蒙华电	23,900	110,896.00	0.06
394	600521	华海药业	6,500	110,825.00	0.06
395	601162	天风证券	50,710	110,547.80	0.06
396	002155	湖南黄金	6,100	110,410.00	0.06
397	002472	双环传动	5,000	110,100.00	0.06
398	000960	锡业股份	7,100	109,979.00	0.06
399	601696	中银证券	12,100	109,868.00	0.06
400	000921	海信家电	3,400	109,616.00	0.06
401	603939	益丰药房	4,460	109,493.00	0.06
402	002294	信立泰	4,100	109,183.00	0.06
403	600141	兴发集团	5,700	108,756.00	0.06
403	603338	浙江鼎力	1,800	108,756.00	0.06
405	300001	特锐德	5,400	108,648.00	0.06
406	002407	多氟多	8,880	108,602.40	0.06
407	002984	森麒麟	4,500	108,405.00	0.06
408	300724	捷佳伟创	2,000	108,020.00	0.05
409	600549	厦门钨业	6,200	106,950.00	0.05
410	002850	科达利	1,400	106,932.00	0.05
411	300699	光威复材	4,300	106,769.00	0.05
412	603589	口子窖	2,700	105,813.00	0.05
413	600546	山煤国际	7,200	105,264.00	0.05
414	600699	均胜电子	7,100	105,222.00	0.05
415	600820	隧道股份	16,100	105,133.00	0.05
416	002195	岩山科技	41,800	104,918.00	0.05
417	002410	广联达	10,940	104,805.20	0.05
418	002064	华峰化学	14,600	104,682.00	0.05
419	600369	西南证券	29,200	104,536.00	0.05
420	002262	恩华药业	4,400	104,456.00	0.05
421	600872	中炬高新	4,600	104,374.00	0.05
422	002603	以岭药业	6,800	104,244.00	0.05
423	000513	丽珠集团	2,800	104,188.00	0.05
424	301358	湖南裕能	3,300	103,818.00	0.05
425	300285	国瓷材料	5,800	103,530.00	0.05
426	600895	张江高科	5,600	103,488.00	0.05
427	002841	视源股份	3,500	103,355.00	0.05
428	688188	柏楚电子	560	103,348.00	0.05
429	300866	安克创新	1,450	103,254.50	0.05
430	300073	当升科技	3,000	102,930.00	0.05
431	688303	大全能源	5,044	102,847.16	0.05
432	000021	深科技	6,800	102,816.00	0.05
433	002756	永兴材料	2,860	102,330.80	0.05

434	603087	甘李药业	2,200	101,904.00	0.05
435	600021	上海电力	10,300	101,867.00	0.05
436	601000	唐山港	21,600	101,520.00	0.05
437	300454	深信服	2,000	101,060.00	0.05
438	300442	润泽科技	4,200	100,590.00	0.05
439	300146	汤臣倍健	7,400	100,270.00	0.05
440	300058	蓝色光标	18,300	99,552.00	0.05
441	600704	物产中大	22,900	99,386.00	0.05
442	601966	玲珑轮胎	5,400	99,198.00	0.05
443	000830	鲁西化工	8,500	98,515.00	0.05
444	688187	时代电气	1,992	98,364.96	0.05
445	600153	建发股份	11,000	98,230.00	0.05
446	603179	新泉股份	2,500	98,100.00	0.05
447	300529	健帆生物	3,600	97,956.00	0.05
448	600118	中国卫星	4,400	97,812.00	0.05
449	600486	扬农化工	1,730	97,658.50	0.05
450	600155	华创云信	16,500	97,515.00	0.05
451	603899	晨光股份	3,100	96,968.00	0.05
452	688065	凯赛生物	2,127	96,544.53	0.05
453	000623	吉林敖东	7,200	96,480.00	0.05
454	601156	东航物流	4,700	95,645.00	0.05
455	002558	巨人网络	10,100	95,344.00	0.05
456	002152	广电运通	9,100	95,186.00	0.05
457	600583	海油工程	16,100	95,151.00	0.05
458	300114	中航电测	2,100	95,025.00	0.05
459	000591	太阳能	20,000	94,200.00	0.05
460	600970	中材国际	7,800	94,068.00	0.05
461	002385	大北农	24,300	93,555.00	0.05
462	002439	启明星辰	5,400	93,204.00	0.05
463	600380	健康元	8,300	92,711.00	0.05
464	605358	立昂微	4,000	92,560.00	0.05
465	688363	华熙生物	1,620	91,643.40	0.05
466	600637	东方明珠	15,000	91,200.00	0.05
467	300677	英科医疗	3,400	91,154.00	0.05
468	601216	君正集团	24,700	91,143.00	0.05
469	000729	燕京啤酒	10,300	90,949.00	0.05
470	600998	九州通	18,587	90,704.56	0.05
471	600143	金发科技	13,712	90,636.32	0.05
472	300251	光线传媒	10,700	89,987.00	0.05
473	000519	中兵红箭	6,100	89,487.00	0.05
474	300373	扬杰科技	2,300	89,470.00	0.05
475	600511	国药股份	2,900	89,291.00	0.05
476	600566	济川药业	2,800	88,788.00	0.05
477	600392	盛和资源	10,300	88,786.00	0.05

478	300383	光环新网	10,500	88,725.00	0.05
479	300024	机器人	9,100	88,634.00	0.04
480	600516	方大炭素	20,560	88,613.60	0.04
481	000818	航锦科技	4,000	88,320.00	0.04
482	002025	航天电器	1,900	88,122.00	0.04
483	000636	风华高科	6,700	87,502.00	0.04
484	601665	齐鲁银行	17,800	87,398.00	0.04
485	002958	青农商行	32,600	87,368.00	0.04
486	000723	美锦能源	18,300	87,108.00	0.04
487	002044	美年健康	23,000	86,940.00	0.04
488	600909	华安证券	20,640	86,894.40	0.04
489	300144	宋城演艺	10,780	86,563.40	0.04
490	000883	湖北能源	14,400	86,544.00	0.04
491	600763	通策医疗	1,600	86,480.00	0.04
492	600008	首创环保	32,150	86,162.00	0.04
493	600282	南钢股份	17,200	85,656.00	0.04
494	600867	通化东宝	10,200	85,374.00	0.04
495	000629	钒钛股份	34,100	85,250.00	0.04
496	601016	节能风电	28,490	85,185.10	0.04
497	300088	长信科技	18,100	85,070.00	0.04
498	603486	科沃斯	1,800	84,924.00	0.04
499	688213	思特威	1,750	84,875.00	0.04
500	603290	斯达半导	980	84,387.80	0.04
501	601808	中海油服	4,900	84,280.00	0.04
502	600129	太极集团	2,900	83,868.00	0.04
503	000997	新大陆	6,000	83,460.00	0.04
504	601933	永辉超市	33,600	83,328.00	0.04
505	601456	国联证券	8,600	82,904.00	0.04
506	600498	烽火通信	5,200	82,680.00	0.04
506	600582	天地科技	12,000	82,680.00	0.04
508	600732	爱旭股份	9,120	82,536.00	0.04
509	600004	白云机场	8,700	82,476.00	0.04
510	002430	杭氧股份	3,700	82,325.00	0.04
511	002120	韵达股份	10,600	82,044.00	0.04
512	000750	国海证券	28,180	82,003.80	0.04
513	603000	人民网	4,100	81,959.00	0.04
514	600535	天士力	6,500	81,770.00	0.04
515	601991	大唐发电	27,100	81,571.00	0.04
516	000060	中金岭南	19,200	81,408.00	0.04
517	600580	卧龙电驱	6,700	81,405.00	0.04
518	603156	养元饮品	3,800	80,826.00	0.04
519	002261	拓维信息	7,300	80,811.00	0.04
520	600170	上海建工	37,500	80,625.00	0.04
521	301589	诺瓦星云	427	80,280.27	0.04

522	600499	科达制造	9,500	80,085.00	0.04
523	300118	东方日升	6,600	79,860.00	0.04
524	002429	兆驰股份	16,500	79,365.00	0.04
525	600166	福田汽车	35,200	79,200.00	0.04
526	300567	精测电子	1,400	79,114.00	0.04
527	000598	兴蓉环境	10,500	78,960.00	0.04
528	603568	伟明环保	3,833	78,883.14	0.04
529	601231	环旭电子	4,900	78,645.00	0.04
530	002939	长城证券	11,700	78,390.00	0.04
531	300765	新诺威	3,100	78,213.00	0.04
532	600325	华发股份	12,000	78,000.00	0.04
533	600816	建元信托	28,700	77,777.00	0.04
534	000893	亚钾国际	4,800	77,568.00	0.04
535	300601	康泰生物	4,960	77,425.60	0.04
536	603658	安图生物	1,680	77,397.60	0.04
537	002508	老板电器	3,500	77,350.00	0.04
538	300568	星源材质	9,400	77,080.00	0.04
539	000998	隆平高科	7,800	76,674.00	0.04
540	688114	华大智造	1,617	76,661.97	0.04
541	000027	深圳能源	10,460	76,358.00	0.04
542	603228	景旺电子	2,400	76,320.00	0.04
543	603833	欧派家居	1,422	76,162.32	0.04
544	600754	锦江酒店	3,300	75,834.00	0.04
545	002497	雅化集团	8,500	75,820.00	0.04
546	002926	华西证券	11,500	75,785.00	0.04
547	600737	中粮糖业	7,900	75,761.00	0.04
548	002624	完美世界	9,950	75,620.00	0.04
549	601636	旗滨集团	11,700	75,465.00	0.04
550	300487	蓝晓科技	1,800	75,168.00	0.04
551	300253	卫宁健康	12,700	74,930.00	0.04
552	601866	中远海发	29,000	74,820.00	0.04
553	603077	和邦生物	45,300	74,745.00	0.04
554	603298	杭叉集团	3,800	74,632.00	0.04
555	600673	东阳光	10,600	74,624.00	0.04
556	601236	红塔证券	11,620	74,600.40	0.04
557	300390	天华新能	4,340	74,561.20	0.04
558	688385	复旦微电	2,367	74,276.46	0.04
559	600131	国网信通	4,400	74,228.00	0.04
560	002500	山西证券	15,790	74,213.00	0.04
561	600373	中文传媒	5,000	74,200.00	0.04
562	002065	东华软件	16,400	74,128.00	0.04
563	002368	太极股份	3,280	73,964.00	0.04
564	002299	圣农发展	5,400	73,656.00	0.04
565	600655	豫园股份	14,300	73,645.00	0.04

566	300009	安科生物	8,616	73,580.64	0.04
567	002056	横店东磁	5,900	73,573.00	0.04
568	600483	福能股份	6,300	73,458.00	0.04
569	601698	中国卫通	5,200	73,268.00	0.04
570	002414	高德红外	12,437	73,253.93	0.04
571	300979	华利集团	1,200	73,020.00	0.04
572	300763	锦浪科技	1,750	72,870.00	0.04
572	601958	金钼股份	7,000	72,870.00	0.04
574	300803	指南针	2,000	72,820.00	0.04
575	601611	中国核建	8,900	72,001.00	0.04
576	002831	裕同科技	2,800	71,652.00	0.04
577	002507	涪陵榨菜	5,840	71,540.00	0.04
578	600707	彩虹股份	10,500	71,505.00	0.04
579	688002	睿创微纳	2,545	71,183.65	0.04
580	603893	瑞芯微	1,200	71,004.00	0.04
581	000887	中鼎股份	5,800	70,992.00	0.04
582	300604	长川科技	2,600	70,642.00	0.04
583	002653	海思科	2,300	70,610.00	0.04
584	603885	吉祥航空	6,400	70,336.00	0.04
585	002203	海亮股份	8,800	70,224.00	0.04
586	688772	珠海冠宇	4,698	70,000.20	0.04
587	600755	厦门国贸	9,700	69,549.00	0.04
588	688521	芯原股份	2,571	68,774.25	0.03
589	600563	法拉电子	900	68,562.00	0.03
590	002683	广东宏大	3,400	68,442.00	0.03
591	603927	中科软	3,780	68,380.20	0.03
592	688052	纳芯微	665	68,348.70	0.03
593	688017	绿的谐波	830	68,143.00	0.03
594	600859	王府井	5,800	68,092.00	0.03
595	601880	辽港股份	55,200	67,896.00	0.03
596	002372	伟星新材	4,400	67,848.00	0.03
597	601212	白银有色	24,300	67,554.00	0.03
598	600884	杉杉股份	8,300	67,396.00	0.03
599	600801	华新水泥	4,900	67,375.00	0.03
600	600435	北方导航	7,800	67,236.00	0.03
601	002019	亿帆医药	5,400	66,744.00	0.03
602	600995	南网储能	6,900	66,654.00	0.03
603	300070	碧水源	15,900	66,621.00	0.03
604	300296	利亚德	14,800	66,600.00	0.03
605	600416	湘电股份	6,700	66,598.00	0.03
606	002506	协鑫集成	34,300	66,542.00	0.03
607	600739	辽宁成大	7,950	66,541.50	0.03
608	603379	三美股份	1,700	66,538.00	0.03
609	600390	五矿资本	16,400	66,420.00	0.03

610	002487	大金重工	2,900	66,352.00	0.03
611	002244	滨江集团	9,100	66,066.00	0.03
612	002572	索菲亚	4,300	65,919.00	0.03
613	601155	新城控股	7,398	65,620.26	0.03
614	000050	深天马 A	9,000	65,520.00	0.03
615	603225	新凤鸣	4,200	65,478.00	0.03
616	300748	金力永磁	5,020	65,059.20	0.03
617	002568	百润股份	3,860	64,963.80	0.03
618	600598	北大荒	5,200	64,948.00	0.03
619	600329	达仁堂	2,000	64,780.00	0.03
620	600399	抚顺特钢	11,500	64,745.00	0.03
620	601598	中国外运	11,500	64,745.00	0.03
622	601098	中南传媒	5,200	64,584.00	0.03
623	688390	固德威	1,149	64,481.88	0.03
624	603712	七一二	3,500	63,665.00	0.03
625	600848	上海临港	6,967	63,469.37	0.03
626	001286	陕西能源	5,500	63,415.00	0.03
627	002080	中材科技	4,900	63,210.00	0.03
628	002240	盛新锂能	4,700	63,074.00	0.03
629	300957	贝泰妮	1,300	62,816.00	0.03
630	300595	欧普康视	4,000	62,720.00	0.03
631	002268	电科网安	4,400	62,612.00	0.03
632	600901	江苏金租	12,380	62,519.00	0.03
633	603858	步长制药	4,100	62,115.00	0.03
634	603883	老百姓	3,383	62,111.88	0.03
635	000563	陕国投 A	22,400	61,600.00	0.03
636	600968	海油发展	14,900	61,388.00	0.03
637	601928	凤凰传媒	5,600	61,376.00	0.03
638	601399	国机重装	23,700	61,146.00	0.03
639	002373	千方科技	6,700	60,769.00	0.03
640	600062	华润双鹤	3,100	60,698.00	0.03
641	000778	新兴铸管	17,400	60,552.00	0.03
642	600258	首旅酒店	4,900	60,515.00	0.03
643	002936	郑州银行	34,918	60,408.14	0.03
644	600271	航天信息	8,200	60,352.00	0.03
645	601019	山东出版	5,100	60,282.00	0.03
646	688538	和辉光电	30,360	60,112.80	0.03
647	688301	奕瑞科技	521	60,034.83	0.03
648	600528	中铁工业	8,200	60,024.00	0.03
649	688331	荣昌生物	1,380	59,616.00	0.03
650	300676	华大基因	1,700	59,517.00	0.03
651	688234	天岳先进	1,263	59,259.96	0.03
652	002557	洽洽食品	2,100	59,199.00	0.03
653	000709	河钢股份	30,300	58,782.00	0.03

654	000800	一汽解放	7,500	58,725.00	0.03
655	300558	贝达药业	1,800	58,590.00	0.03
656	000739	普洛药业	4,300	58,351.00	0.03
657	600612	老凤祥	1,000	58,190.00	0.03
658	000155	川能动力	5,400	58,158.00	0.03
659	002408	齐翔腾达	10,380	58,128.00	0.03
660	002531	天顺风能	6,500	58,110.00	0.03
661	600977	中国电影	5,400	58,104.00	0.03
662	688005	容百科技	2,490	57,967.20	0.03
663	600959	江苏有线	21,900	57,816.00	0.03
664	603688	石英股份	1,950	57,739.50	0.03
665	000825	太钢不锈	16,700	56,446.00	0.03
666	601118	海南橡胶	12,400	56,420.00	0.03
667	603728	鸣志电器	1,400	56,322.00	0.03
668	601965	中国汽研	3,300	55,737.00	0.03
669	300212	易华录	3,300	55,539.00	0.03
670	600056	中国医药	5,480	55,457.60	0.03
671	000032	深桑达 A	3,700	55,426.00	0.03
672	600098	广州发展	8,600	55,040.00	0.03
673	600517	国网英大	12,700	54,991.00	0.03
674	600378	昊华科技	1,900	54,910.00	0.03
675	603456	九洲药业	4,000	54,880.00	0.03
676	688220	翱捷科技	1,459	54,654.14	0.03
677	600906	财达证券	9,500	54,435.00	0.03
678	603882	金域医学	2,000	54,380.00	0.03
679	000987	越秀资本	10,960	54,361.60	0.03
680	688200	华峰测控	589	54,040.75	0.03
681	688567	孚能科技	5,626	54,009.60	0.03
682	603737	三棵树	1,480	53,679.60	0.03
683	002266	浙富控股	19,200	53,568.00	0.03
684	600578	京能电力	16,500	53,460.00	0.03
685	603444	吉比特	300	53,403.00	0.03
686	600316	洪都航空	3,200	53,216.00	0.03
687	600925	苏能股份	10,500	53,025.00	0.03
688	000937	冀中能源	7,900	52,930.00	0.03
689	688082	盛美上海	618	52,227.18	0.03
690	600871	石化油服	29,800	51,852.00	0.03
691	688536	思瑞浦	520	50,861.20	0.03
692	688297	中无人机	1,526	50,403.78	0.03
693	603650	彤程新材	1,700	50,235.00	0.03
694	002423	中粮资本	6,700	50,183.00	0.03
695	688561	奇安信	2,104	49,696.48	0.03
696	300438	鹏辉能源	2,700	49,518.00	0.03
697	001227	兰州银行	20,800	49,504.00	0.03

698	603529	爱玛科技	1,800	49,194.00	0.02
699	600208	新湖中宝	31,100	49,138.00	0.02
700	601608	中信重工	12,800	48,768.00	0.02
701	601298	青岛港	5,100	48,756.00	0.02
702	688516	奥特维	1,163	48,625.03	0.02
703	603233	大参林	3,400	48,620.00	0.02
704	002607	中公教育	31,500	48,195.00	0.02
705	600663	陆家嘴	5,400	47,628.00	0.02
706	600377	宁沪高速	3,700	46,620.00	0.02
707	601106	中国一重	20,100	46,431.00	0.02
708	003031	中瓷电子	1,000	46,240.00	0.02
709	600500	中化国际	13,200	46,068.00	0.02
710	688063	派能科技	1,148	45,587.08	0.02
711	000785	居然之家	18,500	44,955.00	0.02
712	603517	绝味食品	2,900	44,660.00	0.02
713	600967	内蒙一机	6,200	44,640.00	0.02
714	002690	美亚光电	2,700	44,550.00	0.02
715	300357	我武生物	2,200	44,484.00	0.02
716	600350	山东高速	5,000	44,250.00	0.02
717	688475	萤石网络	1,292	44,070.12	0.02
718	002670	国盛金控	5,200	44,044.00	0.02
719	601568	北元集团	11,860	44,000.60	0.02
720	301267	华夏眼科	2,100	43,512.00	0.02
721	000559	万向钱潮	9,700	43,262.00	0.02
722	300776	帝尔激光	940	43,202.40	0.02
723	000958	电投产融	11,800	43,188.00	0.02
724	600361	创新新材	10,700	43,121.00	0.02
725	002867	周大生	3,300	43,098.00	0.02
726	600827	百联股份	5,800	42,804.00	0.02
727	600315	上海家化	2,400	42,672.00	0.02
728	002608	江苏国信	5,500	42,625.00	0.02
729	688425	铁建重工	11,578	42,607.04	0.02
730	603707	健友股份	3,560	42,292.80	0.02
731	000156	华数传媒	6,700	42,076.00	0.02
732	688032	禾迈股份	366	42,009.48	0.02
733	601992	金隅集团	30,500	41,785.00	0.02
734	688349	三一重能	1,676	41,631.84	0.02
735	600032	浙江新能	5,700	41,496.00	0.02
736	300888	稳健医疗	1,640	41,492.00	0.02
737	003022	联泓新科	3,000	41,130.00	0.02
738	300682	朗新集团	4,800	40,848.00	0.02
739	600126	杭钢股份	9,900	40,689.00	0.02
740	603826	坤彩科技	1,400	40,558.00	0.02
741	688029	南微医学	657	40,444.92	0.02

742	000967	盈峰环境	9,300	39,339.00	0.02
743	000537	中绿电	4,100	39,073.00	0.02
744	603218	日月股份	3,800	39,026.00	0.02
745	600481	双良节能	8,300	38,761.00	0.02
746	688248	南网科技	1,306	38,696.78	0.02
747	603296	华勤技术	700	38,661.00	0.02
748	603786	科博达	600	38,490.00	0.02
749	603127	昭衍新药	2,900	38,483.00	0.02
750	002865	钧达股份	1,000	38,380.00	0.02
751	600339	中油工程	12,200	38,064.00	0.02
752	600095	湘财股份	6,200	36,952.00	0.02
753	000898	鞍钢股份	17,400	36,888.00	0.02
754	600808	马钢股份	17,700	35,754.00	0.02
755	688778	厦钨新能	1,135	35,457.40	0.02
756	003035	南网能源	7,800	34,320.00	0.02
757	002563	森马服饰	5,900	34,279.00	0.02
758	002153	石基信息	5,940	34,036.20	0.02
759	688520	神州细胞	860	33,841.00	0.02
760	601228	广州港	11,000	33,550.00	0.02
761	603185	弘元绿能	1,956	33,428.04	0.02
762	000539	粤电力 A	6,500	33,020.00	0.02
763	688779	长远锂科	7,097	32,859.11	0.02
764	001203	大中矿业	3,400	32,674.00	0.02
765	000401	冀东水泥	7,900	32,074.00	0.02
766	600928	西安银行	9,800	32,046.00	0.02
767	688172	燕东微	1,967	31,826.06	0.02
768	000959	首钢股份	11,400	31,008.00	0.02
769	001872	招商港口	1,600	30,800.00	0.02
770	688281	华秦科技	362	30,161.84	0.02
771	002518	科士达	1,700	30,090.00	0.02
772	688006	杭可科技	1,716	29,944.20	0.02
773	603305	旭升集团	2,800	29,568.00	0.02
774	600764	中国海防	1,500	29,445.00	0.01
775	600299	安迪苏	3,000	29,100.00	0.01
776	603056	德邦股份	2,200	28,820.00	0.01
777	601139	深圳燃气	4,200	28,056.00	0.01
778	688107	安路科技	1,052	26,741.84	0.01
779	603317	天味食品	2,274	25,946.34	0.01
780	300861	美畅股份	1,300	25,155.00	0.01
781	601858	中国科传	1,300	24,856.00	0.01
782	688387	信科移动	4,775	24,066.00	0.01
783	301029	怡合达	1,200	23,592.00	0.01
784	002791	坚朗五金	900	23,283.00	0.01
785	688276	百克生物	796	22,582.52	0.01

786	600927	永安期货	2,000	22,300.00	0.01
787	000031	大悦城	9,400	21,996.00	0.01
788	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
789	600956	新天绿能	2,600	21,242.00	0.01
790	688819	天能股份	880	20,996.80	0.01
791	001289	龙源电力	1,200	20,700.00	0.01
792	688348	昱能科技	349	20,591.00	0.01
793	601828	美凯龙	8,020	20,451.00	0.01
794	603285	键邦股份	1,094	20,403.10	0.01
795	601158	重庆水务	4,200	20,160.00	0.01
796	688295	中复神鹰	980	19,894.00	0.01
797	688375	国博电子	280	19,779.20	0.01
798	002945	华林证券	1,900	18,962.00	0.01
799	688153	唯捷创芯	488	18,056.00	0.01
800	301165	锐捷网络	600	17,904.00	0.01
801	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.01
802	688692	达梦数据	77	13,469.61	0.01
803	301536	星辰科技	414	13,359.78	0.01
804	603868	飞科电器	300	11,520.00	0.01
805	688691	灿芯股份	241	10,244.91	0.01
806	301566	达利凯普	550	9,333.50	0.00
807	301565	中仑新材	485	9,205.30	0.00
808	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
809	301580	爱迪特	132	8,702.76	0.00
810	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
811	301587	中瑞股份	285	7,199.10	0.00
812	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
813	688709	成都华微	363	6,820.77	0.00
814	001389	广合科技	187	6,462.72	0.00
815	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
816	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
817	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
818	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
819	688584	上海合晶	307	4,878.23	0.00
820	601033	永兴股份	264	4,213.44	0.00
821	603341	龙旗科技	107	4,011.43	0.00
822	001359	平安电工	163	3,357.80	0.00
823	603344	星德胜	134	3,036.44	0.00
824	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
825	603082	北自科技	89	2,624.61	0.00
826	603381	永臻股份	89	2,236.57	0.00
827	603375	盛景微	55	2,139.50	0.00
828	603325	博隆技术	31	2,109.86	0.00
829	603312	西典新能	73	1,851.28	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	2,278,620.40	1.17
2	000333	美的集团	1,419,977.00	0.73
3	000858	五粮液	1,360,349.00	0.70
4	300760	迈瑞医疗	960,448.00	0.49
5	000651	格力电器	866,091.00	0.45
6	300059	东方财富	749,355.00	0.39
7	002594	比亚迪	704,987.00	0.36
8	000725	京东方 A	695,860.00	0.36
9	002475	立讯精密	647,956.00	0.33
10	300274	阳光电源	626,298.00	0.32
11	600900	长江电力	580,376.00	0.30
12	300124	汇川技术	574,636.00	0.30
13	000568	泸州老窖	545,644.00	0.28
14	002714	牧原股份	517,475.00	0.27
15	002415	海康威视	517,220.00	0.27
16	300498	温氏股份	497,819.00	0.26
17	002352	顺丰控股	496,685.00	0.26
18	600519	贵州茅台	483,957.00	0.25
19	000001	平安银行	457,118.00	0.24
20	300308	中际旭创	451,020.00	0.23

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	2,250,997.00	1.16
2	000333	美的集团	1,403,349.00	0.72
3	000858	五粮液	1,361,782.00	0.70
4	300760	迈瑞医疗	937,768.00	0.48
5	000651	格力电器	864,701.08	0.45
6	300059	东方财富	731,826.00	0.38
7	002594	比亚迪	706,299.00	0.36
8	000725	京东方 A	693,506.00	0.36
9	300124	汇川技术	675,072.00	0.35
10	300274	阳光电源	651,525.00	0.34

11	002475	立讯精密	622,944.00	0.32
12	000568	泸州老窖	551,444.00	0.28
13	002142	宁波银行	524,378.00	0.27
14	002463	沪电股份	519,210.00	0.27
15	002714	牧原股份	505,036.00	0.26
16	002415	海康威视	496,204.00	0.26
17	300308	中际旭创	484,230.00	0.25
18	002352	顺丰控股	482,580.00	0.25
19	300498	温氏股份	478,713.00	0.25
20	002422	科伦药业	477,866.00	0.25

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	57,175,668.36
卖出股票收入（成交）总额	52,714,769.09

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,000.49	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,000.49	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113685	升 24 转债	80	8,000.49	0.00

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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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,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、国家金融监督管理总局深圳监管局、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	971,475.53
2	应收清算款	5,508.60
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	75,409.12
8	其他	-
9	合计	1,052,393.25

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—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
1,307	137,650.2 2	143,995,733 .00	80.04%	35,913,110. 00	19.96%	119,838,95 5.00	66.61%

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

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	2.78%
2	招商证券股份有限公司	4,576,639.00	2.54%
3	东方证券股份有限公司	3,489,573.00	1.94%
4	国泰君安证券股份有限公司	2,889,040.00	1.61%
5	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	1.38%
6	中国烟草总公司四川省公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	2,434,900.00	1.35%
7	广发证券股份有限公司	2,314,058.00	1.29%
8	陕西中烟工业有限责任公司企业年金计划—中国银行股份有限公司	1,795,600.00	1.00%

9	李强	1,368,600.00	0.76%
10	晋能控股山西电力股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,159,000.00	0.64%
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	119,838,955.00	66.61%

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	176,908,843.00
本报告期基金总申购份额	93,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	90,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	179,908,843.00

§ 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	14,830.00	0.01%	8.90	0.08%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	23,001,674.68	21.16%	2,300.16	21.15%	-
华创证券	2	84,314,710.55	77.57%	8,432.29	77.52%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	1,366,010.15	1.26%	136.60	1.26%	-
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。本报告期内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	5,898.60	38.00%	-	-	-	-
华创证券	9,624.00	62.00%	-	-	-	-
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 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

§ 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	2024 年 01 月 01 日~2024 年 06 月 30 日	100,743,355.00	80,658,200.00	61,562,600.00	119,838,955.00	66.61%
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。

§ 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

二〇二四年八月三十日