

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年年度报告

2025 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：二〇二六年三月三十一日

§ 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 2026 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 2025 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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	79
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	79
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	79
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	79
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12	投资组合报告附注	80
§ 9	基金份额持有人信息	81
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2	期末上市基金前十名持有人	81
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
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	82
§ 10	开放式基金份额变动	82
§ 11	重大事件揭示	83
11.1	基金份额持有人大会决议	83
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	83
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4	基金投资策略的改变	83
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	83
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8	其他重大事件	86
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	88
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	88
§ 13	备查文件目录	89
13.1	备查文件目录	89
13.2	存放地点	89
13.3	查阅方式	89

§ 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	368,908,843.00 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		广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；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		510627；510623；519031	100033
法定代表人		吴欣荣	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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	40,257,339.92	2,796,086.54	546,941.11
本期利润	79,688,802.79	34,532,416.78	-15,636,210.19
加权平均基金份额本期利润	0.3468	0.1830	-0.1089
本期加权平均净值利润率	24.39%	15.92%	-9.20%
本期基金份额净值增长率	26.53%	17.39%	-6.62%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	229,391,895.45	71,899,608.98	17,341,037.34
期末可供分配基金份额利润	0.6218	0.2889	0.0980
期末基金资产净值	601,657,761.63	320,808,451.98	194,249,880.34
期末基金份额净值	1.6309	1.2889	1.0980
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	63.09%	28.89%	9.80%

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

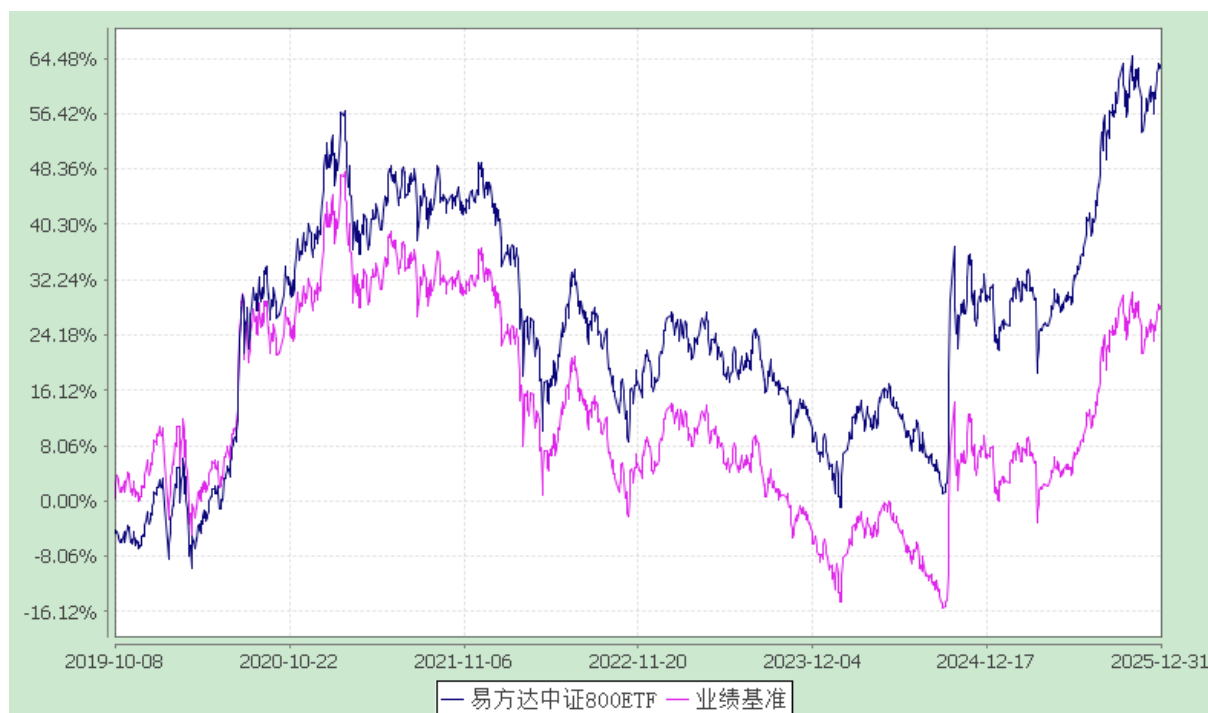
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.13%	1.01%	0.02%	1.01%	1.11%	0.00%
过去六个月	22.73%	0.96%	19.85%	0.96%	2.88%	0.00%
过去一年	26.53%	1.03%	20.89%	1.02%	5.64%	0.01%
过去三年	38.71%	1.12%	21.57%	1.12%	17.14%	0.00%
过去五年	13.64%	1.14%	-5.07%	1.14%	18.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	63.09%	1.18%	28.03%	1.18%	35.06%	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

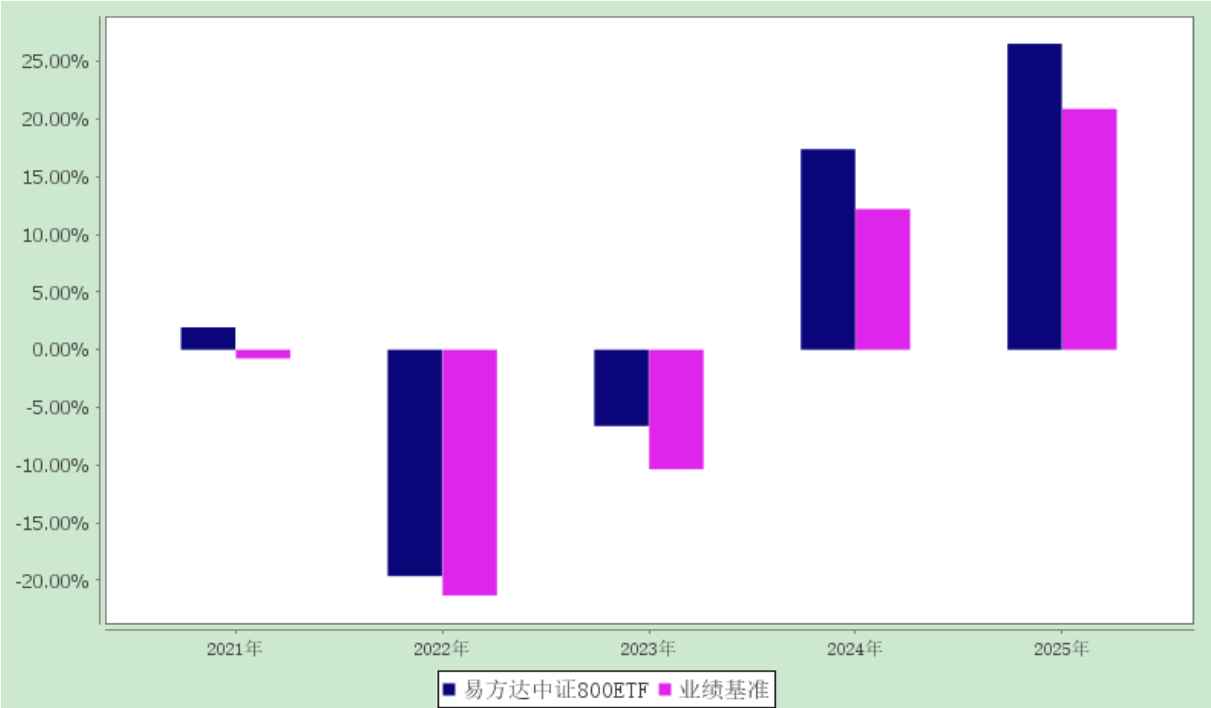
较

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 2025 年 12 月 31 日)



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 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（自 2019 年 10 月 21	2019-10-08	2025-05-10	17 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	日至 2025 年 05 月 09 日)、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接、易方达上证科创板 50ETF、易方达上证科创 50ETF 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 (自 2023 年 09 月 13 日至 2025 年 05 月 09 日)、易方达 MSCI 美国 50ETF (QDII)、易方达中证红利低波动 ETF (自 2023 年 12 月 06 日至 2025 年 05 月 09 日)、易方达中证 A50ETF、易方达中证 A50ETF 联接发起式、易方达伊塔乌巴西 IBOVESPA ETF (QDII) 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) (自 2017 年 07 月 18 日至 2025 年 12 月 23 日)、易方达中证万得并购重组指数 (LOF) (自 2017 年 07 月 18 日至 2025 年 11 月 28 日)、易方达上证中盘 ETF 联接 (自 2018 年 08 月 11 日至 2025 年 12 月 23 日)、易方达香港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF (自 2018 年 08 月 11 日至 2025 年 12 月 23 日)、易方达中证 800ETF 联接、易方达中证国企一带一路 ETF 联接、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 (自 2021 年 11 月 26 日至 2025 年 04 月 02 日)、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 (自 2023 年 04 月 11 日至 2025 年 04 月 02 日)、易方达中证港股通消费主题	2019-10-08	-	18 年	硕士, 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。

ETF 的基金经理，易方达中证港股通消费主题 ETF（自 2022 年 03 月 25 日至 2025 年 04 月 10 日）、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、易方达创业板成长 ETF 联接发起式、易方达中证国资央企 50ETF、易方达中证金融科技主题 ETF、易方达中证国资央企 50ETF 联接发起式的基金经理助理				
---	--	--	--	--

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 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、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 94 次，其中 80 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，14 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。

2025 年，面对国内外经济环境的复杂变化，我国宏观政策保持连续稳定，为经济平稳运行和高质量发展提供了有力支撑。国民经济顶压前行，运行总体平稳、发展向新向优。年内，工业生产增

长较快，结构持续向优，装备制造业和高技术制造业增长态势良好，新质生产力加快发展，对经济稳定运行发挥了支撑作用。国内需求不断释放，消费市场保持平稳增长，投资结构持续优化，外贸亦展现出较强韧性。货币政策方面，全年保持适度宽松的基调，持续发力、适时加力，为经济稳中向好创造了适宜的货币金融环境。中国人民银行在 2025 年第四季度的货币政策委员会例会中指出，要继续实施适度宽松的货币政策，加大逆周期和跨周期调节力度，并提出要探索用好相关金融工具的常态化制度安排，以维护资本市场稳定。

在宏观基本面与政策环境的共同作用下，2025 年 A 股市场整体运行平稳。主要指数在全年呈现上涨格局，市场交投活跃度高于上年同期。投资者的关注点与产业升级方向较为契合，科技创新、高端制造等代表新质生产力的领域获得较多市场关注。监管部门在年内持续深化资本市场改革，着力优化市场生态，推动投资端改革并完善基础制度，为市场的稳健发展奠定了坚实基础。总体来看，全年股票市场的运行反映了经济结构转型的内在逻辑，在政策与基本面的共振下实现了平稳健康发展。2025 年，中证 800 指数上涨 20.89%。

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 1.6309 元，本报告期份额净值增长率为 26.53%，同期业绩比较基准收益率为 20.89%。年化跟踪误差 0.53%，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 2026 年，作为“十五五”规划建议提出后的开局之年，国内宏观经济预计将在宏观政策的有力支持下，朝着结构持续优化、新动能持续增强的方向发展。政策层面将围绕扩大内需与做强国内大循环这一核心，推动相关战略实施方案落地，并对设备更新、消费品以旧换新等具体措施进行延续和优化。同时，政策着力点将坚定围绕实体经济，通过推动产业升级与培育新兴产业来构建现代化产业体系。货币政策方面，中国人民银行指出，将继续实施好适度宽松的货币政策，促进经济稳增长和物价合理回升，保持流动性合理充裕。整体政策组合旨在推动经济实现质的有效提升和量的合理增长，为中长期高质量发展奠定基础。

在此背景下，国内股票市场的运行预计将继续受到宏观经济基本面、政策导向及国内外复杂环境等多重因素的共同影响。宏观经济的平稳修复与产业结构的持续优化，有望为市场提供基础性支撑。预期稳健的货币政策与持续深化的资本市场改革将协同发力，致力于提升市场内在稳定性与长期吸引力。从市场结构看，经济转型升级的深化可能进一步映射至各产业领域上市公司的差异化表

现中。同时，需关注全球经济复苏节奏、地缘政治等外部不确定性因素可能带来的阶段性波动。总体而言，市场在复杂环境中预计将继续展现其韧性，其演进过程将更为紧密地契合经济高质量发展的长期方向。

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，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，通过严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪偏离，追求跟踪误差的最小化，力求为投资者提供有效的指数投资工具。

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，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，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，保障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）坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

（2）通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

（3）持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更好服务广大投资者财富管理需求。

（4）严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，

妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，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) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(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年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、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程序和技术，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合规守信情况声明

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（2026）审字第 70013033_G274 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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和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。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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

2026 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	16,611,235.91	6,123,999.85
结算备付金		4,188,892.85	2,452,183.08
存出保证金		2,738,930.55	1,145,057.38

交易性金融资产	7.4.7.2	578,866,046.30	306,760,471.58
其中：股票投资		578,848,046.06	306,760,471.58
基金投资		-	-
债券投资		18,000.24	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		209,446.75	21,166,503.11
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		602,614,552.36	337,648,215.00
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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		586,525.35	13,538,149.17
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		74,821.29	36,733.64
应付托管费		24,940.43	12,244.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		34,778.93	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	235,724.73	3,252,635.67
负债合计		956,790.73	16,839,763.02
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	368,908,843.00	248,908,843.00
未分配利润	7.4.7.8	232,748,918.63	71,899,608.98
净资产合计		601,657,761.63	320,808,451.98
负债和净资产总计		602,614,552.36	337,648,215.00

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6309 元，基金份额总额 368,908,843.00 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		80,708,171.42	35,444,418.95
1.利息收入		59,092.52	53,152.78
其中：存款利息收入	7.4.7.9	59,092.52	53,152.78
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）		41,008,519.70	3,334,878.67
其中：股票投资收益	7.4.7.10	31,137,336.96	-1,835,405.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	203,560.91	4,486.61
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	2,733,921.47	-305,610.86
股利收益	7.4.7.14	6,933,700.36	5,471,408.30
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	39,431,462.87	31,736,330.24
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	209,096.33	320,057.26
减：二、营业总支出		1,019,368.63	912,002.17
1. 管理人报酬		488,175.85	324,997.91
2. 托管费		162,725.35	108,332.59
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		9,846.79	0.02
8. 其他费用	7.4.7.18	358,620.64	478,671.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,688,802.79	34,532,416.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,688,802.79	34,532,416.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,688,802.79	34,532,416.78

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	248,908,843.00	71,899,608.98	320,808,451.98

产			
二、本期期初净资产	248,908,843.00	71,899,608.98	320,808,451.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	120,000,000.00	160,849,309.65	280,849,309.65
（一）、综合收益总额	-	79,688,802.79	79,688,802.79
（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）	120,000,000.00	81,160,506.86	201,160,506.86
其中：1.基金申购款	294,000,000.00	149,347,339.17	443,347,339.17
2.基金赎回款	-174,000,000.00	-68,186,832.31	-242,186,832.31
（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	368,908,843.00	232,748,918.63	601,657,761.63
项目	上年度可比期间 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	-111,000,000.00	-13,773,353.49	-124,773,353.49

款			
(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

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：吴欣荣，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。

7.4.4.4 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有关过去事项、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。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	16,611,235.91	6,123,999.85
等于：本金	16,609,804.97	6,123,399.53
加：应计利息	1,430.94	600.32
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	16,611,235.91	6,123,999.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		528,327,473.22	-	578,848,046.06	50,520,572.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,999.96	0.28	18,000.24	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,999.96	0.28	18,000.24	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		528,345,473.18	0.28	578,866,046.30	50,520,572.84
项目		上年度末 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

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 2025 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	21,734,780.00	-	-	-
IC2603	5,500,280.00	-	-	-
IF2603	16,234,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	21,734,780.00	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-

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
IC2603	IC2603	4	5,893,280.00	393,000.00
IF2603	IF2603	12	16,535,520.00	301,020.00
合计	-	-	-	694,020.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	694,020.00
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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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	30,622.23	8,858.20
其中：交易所市场	30,622.23	8,858.20
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	185,400.00	187,000.00
可退替代款	19,702.50	1,030,966.38
其他应付款	-	35,000.00
应付替代款	-	1,990,811.09

合计	235,724.73	3,252,635.67
----	------------	--------------

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	248,908,843.00	248,908,843.00
本期申购	294,000,000.00	294,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-174,000,000.00	-174,000,000.00
本期末	368,908,843.00	368,908,843.00

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	113,238,197.74	-41,338,588.76	71,899,608.98
本期期初	113,238,197.74	-41,338,588.76	71,899,608.98
本期利润	40,257,339.92	39,431,462.87	79,688,802.79
本期基金份额交易产生的变动数	75,896,357.79	5,264,149.07	81,160,506.86
其中：基金申购款	164,650,137.24	-15,302,798.07	149,347,339.17
基金赎回款	-88,753,779.45	20,566,947.14	-68,186,832.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,391,895.45	3,357,023.18	232,748,918.63

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	23,975.26	21,041.32
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	34,985.36	31,752.10
其他	131.90	359.36
合计	59,092.52	53,152.78

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	23,799,933.99	-943,553.98
股票投资收益——赎回差价收入	7,337,402.97	-891,851.40
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	31,137,336.96	-1,835,405.38

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	263,078,293.94	88,184,981.90
减：卖出股票成本总额	239,053,229.65	89,048,803.55
减：交易费用	225,130.30	79,732.33
买卖股票差价收入	23,799,933.99	-943,553.98

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	242,186,832.31	124,773,353.49
减：现金支付赎回款总额	98,225,160.31	48,826,512.49
减：赎回股票成本总额	136,624,269.03	76,838,692.40
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	7,337,402.97	-891,851.40

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	27.26	6.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	203,533.65	4,479.93
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	203,560.91	4,486.61

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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,715,777.77	55,989.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,410,381.13	51,499.64
减：应计利息总额	100,643.83	7.37
减：交易费用	1,219.16	2.24
买卖债券差价收入	203,533.65	4,479.93

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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	2,733,921.47	-305,610.86

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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日

股票投资产生的股利收益	6,933,700.36	5,471,408.30
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	6,933,700.36	5,471,408.30

7.4.7.15公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	39,565,062.87	30,764,610.24
——股票投资	39,565,062.87	30,764,610.24
——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	-133,600.00	971,720.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-133,600.00	971,720.00
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	39,431,462.87	31,736,330.24

7.4.7.16其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	209,096.33	320,057.26
合计	209,096.33	320,057.26

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	45,400.00	47,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
存托服务费	56.72	36.65
指数使用费	20,662.86	140,000.00
银行汇划费	2,501.06	1,635.00
其他	170,000.00	170,000.00
合计	358,620.64	478,671.65

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
易方达财富管理基金销售（广州）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
易方达资产管理（新加坡）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	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024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	188,429.00	0.03%	24,693,178.78	11.38%

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	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024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%

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 2025年1月1日至2025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	18.83	0.03%	11.79	0.04%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

2.2024 年 7 月 1 日前，本基金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，本基金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 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	488,175.85	324,997.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,742.24	2,567.09
应支付基金管理人的净管理费	481,433.61	322,430.82

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	162,725.35	108,332.59

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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	89,330,127.00	24.2147%	154,307,655.00	61.9936%
广发证券股份有限公司	5,062,645.00	1.3723%	1,168,385.00	0.4694%

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	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024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	16,611,235.91	23,975.26	6,123,999.85	21,041.32

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	001396	誉帆科技	新股发行	688	15,335.52
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

广发证券股份有限公司	688795	摩尔线程	新股发行	2,039	233,016.92
广发证券股份有限公司	688805	健信超导	新股发行	2,643	49,106.94
上年度可比期间					
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	新股发行	200	1,154.00
广发证券股份有限公司	920008	成电光信	新股发行	100	1,000.00

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 2025 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 49,100 股（2024 年 12 月 31 日：33,200 股），占本基金净值比例为 0.18%（2024 年 12 月 31 日：0.17%）；持有建设银行发行的 A 股建设银行 141,000 股（2024 年 12 月 31 日：73,200 股），占本基金净值比例为 0.22%（2024 年 12 月 31 日：0.20%）。

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（2025 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
001221	悍高	2025-07-23	6 个月	新股	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-

	集团			流通受限						
001233	海安集团	2025-11-18	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	246	11,808.00	12,762.48	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	1,503	26,888.67	68,176.08	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6 个月	新股流通受限	42.28	56.08	92	3,889.76	5,159.36	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	844	5,781.40	10,879.16	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6 个月	新股流通受限	13.75	18.53	958	13,172.50	17,751.74	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6 个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6 个月	新股流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025-09-18	6 个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025-07-16	6 个月	新股流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025-08-05	6 个月	新股流通受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网数字	2025-11-11	6 个月	新股流通受限	5.69	14.21	1,420	8,079.80	20,178.20	-
301656	联合动力	2025-09-17	6 个月	新股流通受限	12.48	25.46	2,339	29,190.72	59,550.94	-

301667	纳百川	2025-12-10	6 个月	新股 流通 受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6 个月	新股 流通 受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股 流通 受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025-10-09	6 个月	新股 流通 受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025-10-30	6 个月	新股 流通 受限	46.68	55.66	93	4,341.24	5,176.38	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6 个月	新股 流通 受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6 个月	新股 流通 受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025-07-16	6 个月	新股 流通 受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月	新股 流通 受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025-08-27	6 个月	新股 流通 受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6 个月	新股 流通 受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025-07-30	6 个月	新股 流通 受限	23.60	40.16	119	2,808.40	4,779.04	-
603418	友升股份	2025-09-16	6 个月	新股 流通 受限	46.36	59.06	93	4,311.48	5,492.58	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6 个月	新股 流通 受限	8.45	24.28	1,206	10,190.70	29,281.68	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股 流通	17.78	25.13	7,932	141,030.96	199,331.16	-

				受限						
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股 流通 受限	8.62	18.39	15,242	131,386.04	280,300.38	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股 流通 受限	83.06	117.0 7	1,160	96,349.60	135,801.20	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股 流通 受限	114.28	416.0 2	1,428	163,191.84	594,076.56	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6 个月	新股 流通 受限	26.68	42.25	372	9,924.96	15,717.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股 流通 受限	104.66	399.4 0	1,065	111,462.90	425,361.00	-
688805	健信超导	2025-12-17	6 个月	新股 流通 受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6 个月	新股 流通 受限	51.66	135.5 6	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	新股 流通 受限	85.09	203.3 1	153	13,018.77	31,106.43	-
000100	TCL 科技	2025-08-15	6 个月	非公开发 行流通 受限	4.21	4.44	16,784	70,660.64	74,520.96	-
300059	东方财富	2025-07-25	6 个月	询价 转让 流通 受限	21.66	22.89	8,555	185,301.30	195,823.95	-
300059	东方财富	2025-10-20	6 个月	询价 转让 流通 受限	24.40	22.42	46,000	1,122,400.00	1,031,320.0 0	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	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

118063	金 05 转债	2025-12-26	1 个月内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.0 0	180	18,000.00	18,000.24	-
--------	------------	------------	--------------	----------------	--------	------------	-----	-----------	-----------	---

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
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项 停牌	78.81	2026-01-15	86.69	11,780	905,008.76	928,381.80	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项 停牌	272.72	2026-01-05	278.00	7,729	1,710,276.43	2,107,852.88	-

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 2025 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 2025 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 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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%(2024 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 2025年12月31日	上年度末 2024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 2025年12月31日	上年度末 2024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 2025年12月31日	上年度末 2024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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	18,000.24	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	18,000.24	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、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 2025年12月31日	上年度末 2024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	上年度末
--------	-----	------

	2025年12月31日	2024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 2025 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 2025 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	16,611,235.91	-	-	-	16,611,235.91
结算备付金	4,188,892.85	-	-	-	4,188,892.85
存出保证金	2,738,930.55	-	-	-	2,738,930.55
交易性金融资产	-	-	18,000.24	578,848,046.06	578,866,046.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	209,446.75	209,446.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,539,059.31	-	18,000.24	579,057,492.81	602,614,552.36
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	-	-	-	586,525.35	586,525.35

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	74,821.29	74,821.29
应付托管费	-	-	-	24,940.43	24,940.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	34,778.93	34,778.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	235,724.73	235,724.73
负债总计	-	-	-	956,790.73	956,790.73
利率敏感度缺口	23,539,059.31	-	18,000.24	578,100,702.08	601,657,761.63
上年度末					
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

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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	578,848,046.06	96.21	306,760,471.58	95.62
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	578,848,046.06	96.21	306,760,471.58	95.62

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，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。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	28,846,692.21	15,330,037.54
	2.业绩比较基准下降 5%	-28,846,692.21	-15,330,037.54

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	572,428,059.76	306,024,413.01
第二层次	3,054,234.92	362,744.50
第三层次	3,383,751.62	373,314.07
合计	578,866,046.30	306,760,471.58

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	373,314.07	373,314.07
当期购买	-	2,380,422.86	2,380,422.86
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	894,603.09	894,603.09
当期利得或损失总额	-	1,524,617.78	1,524,617.78
其中：计入损益的利得或损失	-	1,524,617.78	1,524,617.78
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	3,383,751.62	3,383,751.62
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	-	1,157,218.27	1,157,218.27
项目	上年度可比期间 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

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	3,383,751.62	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.18—3.0323	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	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

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	578,848,046.06	96.06
	其中：股票	578,848,046.06	96.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,000.24	0.00
	其中：债券	18,000.24	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	20,800,128.76	3.45
8	其他各项资产	2,948,377.30	0.49
9	合计	602,614,552.36	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	4,535,227.00	0.75
B	采矿业	31,385,328.13	5.22
C	制造业	341,859,532.49	56.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,533,807.30	2.75
E	建筑业	7,526,739.00	1.25
F	批发和零售业	3,300,790.08	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	14,706,899.60	2.44
H	住宿和餐饮业	192,052.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,142,722.00	5.34
J	金融业	107,745,766.62	17.91
K	房地产业	3,380,571.00	0.56
L	租赁和商务服务业	5,460,756.80	0.91
M	科学研究和技术服务业	5,777,554.39	0.96

N	水利、环境和公共设施管理业	679,429.84	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	224,954.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,337,327.61	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,497,838.20	0.25
S	综合	560,750.00	0.09
	合计	578,848,046.06	96.21

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	300750	宁德时代	44,040	16,174,130.40	2.69
2	600519	贵州茅台	10,400	14,322,672.00	2.38
3	601318	中国平安	177,300	12,127,320.00	2.02
4	300308	中际旭创	18,520	11,297,200.00	1.88
5	601899	紫金矿业	274,000	9,444,780.00	1.57
6	600036	招商银行	205,947	8,670,368.70	1.44
7	300502	新易盛	16,500	7,109,520.00	1.18
8	000333	美的集团	81,900	6,400,485.00	1.06
9	601166	兴业银行	281,700	5,932,602.00	0.99
10	600900	长江电力	203,500	5,533,165.00	0.92
11	300059	东方财富	211,983	4,876,324.99	0.81
12	002475	立讯精密	84,799	4,808,951.29	0.80
13	688256	寒武纪	3,508	4,755,269.40	0.79
14	600030	中信证券	162,360	4,661,355.60	0.77
15	600276	恒瑞医药	74,290	4,425,455.30	0.74
16	002594	比亚迪	45,200	4,416,944.00	0.73
17	601398	工商银行	538,300	4,268,719.00	0.71
18	300274	阳光电源	24,120	4,125,484.80	0.69
19	601138	工业富联	66,100	4,101,505.00	0.68
20	688981	中芯国际	33,304	4,090,730.32	0.68
21	601211	国泰海通	188,020	3,863,811.00	0.64
22	603259	药明康德	41,140	3,728,929.60	0.62
23	601288	农业银行	478,000	3,671,040.00	0.61
24	688041	海光信息	15,468	3,471,173.88	0.58
25	000858	五粮液	32,300	3,421,862.00	0.57
26	002371	北方华创	7,245	3,326,034.60	0.55
27	601328	交通银行	443,800	3,217,550.00	0.53

28	600887	伊利股份	105,235	3,009,721.00	0.50
29	000651	格力电器	74,600	3,000,412.00	0.50
30	300476	胜宏科技	10,100	2,904,558.00	0.48
31	603993	洛阳钼业	145,200	2,904,000.00	0.48
32	600000	浦发银行	221,600	2,756,704.00	0.46
33	000725	京东方 A	610,900	2,571,889.00	0.43
34	600919	江苏银行	244,200	2,539,680.00	0.42
35	601816	京沪高铁	488,400	2,515,260.00	0.42
36	600150	中国船舶	75,162	2,499,888.12	0.42
37	600309	万华化学	31,200	2,392,416.00	0.40
38	601601	中国太保	56,900	2,384,679.00	0.40
39	603986	兆易创新	11,096	2,377,318.00	0.40
40	300124	汇川技术	31,450	2,369,128.50	0.39
41	002714	牧原股份	45,440	2,298,355.20	0.38
42	601688	华泰证券	97,300	2,295,307.00	0.38
43	688008	澜起科技	19,052	2,244,325.60	0.37
44	601088	中国神华	54,900	2,223,450.00	0.37
45	688012	中微公司	7,729	2,107,852.88	0.35
46	600031	三一重工	98,700	2,085,531.00	0.35
47	603019	中科曙光	24,320	2,082,764.80	0.35
48	002050	三花智控	37,200	2,057,532.00	0.34
49	000063	中兴通讯	53,600	2,028,224.00	0.34
50	601857	中国石油	188,600	1,963,326.00	0.33
51	600111	北方稀土	42,100	1,941,652.00	0.32
52	002230	科大讯飞	38,500	1,936,165.00	0.32
53	300760	迈瑞医疗	10,100	1,923,545.00	0.32
54	600089	特变电工	84,040	1,867,368.80	0.31
55	000001	平安银行	161,400	1,841,574.00	0.31
56	601012	隆基绿能	100,812	1,834,778.40	0.30
57	002415	海康威视	61,000	1,820,240.00	0.30
58	000425	徐工机械	156,400	1,811,112.00	0.30
59	002384	东山精密	21,300	1,803,045.00	0.30
60	603501	豪威集团	14,035	1,767,006.50	0.29
61	601668	中国建筑	343,700	1,763,181.00	0.29
62	600660	福耀玻璃	26,700	1,729,359.00	0.29
63	603799	华友钴业	25,285	1,725,954.10	0.29
64	601229	上海银行	165,500	1,671,550.00	0.28
65	601127	赛力斯	13,600	1,645,056.00	0.27
66	002463	沪电股份	22,400	1,636,768.00	0.27
67	600690	海尔智家	62,400	1,628,016.00	0.27
68	601728	中国电信	258,300	1,627,290.00	0.27
69	601600	中国铝业	131,900	1,611,818.00	0.27
70	002028	思源电气	10,400	1,607,736.00	0.27
71	601919	中远海控	104,890	1,592,230.20	0.26

72	600016	民生银行	413,000	1,581,790.00	0.26
73	300394	天孚通信	7,760	1,575,512.80	0.26
74	000100	TCL 科技	346,414	1,571,041.16	0.26
75	000338	潍柴动力	90,100	1,549,720.00	0.26
76	002142	宁波银行	54,940	1,543,264.60	0.26
77	601888	中国中免	16,200	1,531,872.00	0.25
78	002352	顺丰控股	39,900	1,528,968.00	0.25
79	600941	中国移动	15,000	1,515,750.00	0.25
80	600406	国电南瑞	66,862	1,503,057.76	0.25
81	600028	中国石化	242,400	1,498,032.00	0.25
82	300498	温氏股份	88,560	1,494,892.80	0.25
83	000792	盐湖股份	52,800	1,486,848.00	0.25
84	600183	生益科技	20,200	1,442,482.00	0.24
85	000568	泸州老窖	12,200	1,417,884.00	0.24
86	600809	山西汾酒	8,080	1,387,336.00	0.23
87	601766	中国中车	202,400	1,380,368.00	0.23
88	601225	陕西煤业	64,535	1,375,886.20	0.23
89	601988	中国银行	238,200	1,364,886.00	0.23
90	300014	亿纬锂能	20,703	1,361,429.28	0.23
91	601169	北京银行	246,200	1,349,176.00	0.22
92	600050	中国联通	260,100	1,329,111.00	0.22
93	601939	建设银行	141,000	1,308,480.00	0.22
94	600926	杭州银行	84,400	1,289,632.00	0.21
95	601628	中国人寿	27,700	1,260,350.00	0.21
96	002027	分众传媒	168,200	1,239,634.00	0.21
97	002625	光启技术	25,100	1,223,876.00	0.20
98	688111	金山办公	3,923	1,204,635.61	0.20
99	600938	中国海油	39,800	1,201,164.00	0.20
100	002241	歌尔股份	41,300	1,186,549.00	0.20
101	601985	中国核电	136,900	1,184,185.00	0.20
102	002460	赣锋锂业	18,780	1,181,074.20	0.20
103	601009	南京银行	102,817	1,175,198.31	0.20
104	600547	山东黄金	30,100	1,165,171.00	0.19
105	600104	上汽集团	76,503	1,164,375.66	0.19
106	300033	同花顺	3,600	1,159,848.00	0.19
107	000977	浪潮信息	17,100	1,138,860.00	0.19
108	000807	云铝股份	34,600	1,136,264.00	0.19
109	600489	中金黄金	48,400	1,130,624.00	0.19
110	601689	拓普集团	14,455	1,115,636.90	0.19
111	000408	藏格矿业	13,100	1,105,640.00	0.18
112	002709	天赐材料	23,640	1,095,241.20	0.18
113	000776	广发证券	49,100	1,081,182.00	0.18
114	600019	宝钢股份	145,000	1,080,250.00	0.18
115	601818	光大银行	308,800	1,077,712.00	0.18

116	601006	大秦铁路	201,100	1,037,676.00	0.17
117	002837	英维克	9,700	1,036,833.00	0.17
118	688271	联影医疗	8,227	1,032,488.50	0.17
119	600999	招商证券	61,740	1,027,353.60	0.17
120	603288	海天味业	27,712	1,025,898.24	0.17
121	300408	三环集团	22,300	1,020,225.00	0.17
122	002916	深南电路	4,388	1,019,288.52	0.17
123	300433	蓝思科技	33,200	1,004,964.00	0.17
124	601658	邮储银行	183,400	999,530.00	0.17
125	300136	信维通信	16,100	998,200.00	0.17
126	000625	长安汽车	82,532	978,829.52	0.16
127	601100	恒立液压	8,896	977,759.36	0.16
128	002558	巨人网络	22,500	974,025.00	0.16
129	600905	三峡能源	237,800	972,602.00	0.16
130	601336	新华保险	13,900	968,830.00	0.16
131	002466	天齐锂业	17,200	952,536.00	0.16
132	600362	江西铜业	17,300	950,116.00	0.16
133	600958	东方证券	86,988	948,169.20	0.16
134	002600	领益智造	60,810	944,987.40	0.16
135	002738	中矿资源	12,000	942,600.00	0.16
136	600879	航天电子	43,900	935,948.00	0.16
137	605499	东鹏饮料	3,500	935,865.00	0.16
138	600118	中国卫星	9,800	930,510.00	0.15
139	002049	紫光国微	11,780	928,381.80	0.15
140	601390	中国中铁	170,400	921,864.00	0.15
141	600438	通威股份	44,900	921,348.00	0.15
142	300450	先导智能	18,200	909,636.00	0.15
143	600010	宝钢股份	376,700	896,546.00	0.15
144	601825	沪农商行	96,300	894,627.00	0.15
145	600580	卧龙电驱	18,180	892,638.00	0.15
146	600893	航发动力	22,160	887,064.80	0.15
147	600584	长电科技	23,800	875,364.00	0.15
148	600585	海螺水泥	39,900	872,214.00	0.14
149	600988	赤峰黄金	27,700	865,348.00	0.14
150	600160	巨化股份	22,500	864,450.00	0.14
151	601377	兴业证券	114,900	852,558.00	0.14
152	300015	爱尔眼科	77,550	851,499.00	0.14
153	600115	中国东航	141,600	849,600.00	0.14
154	600436	片仔癀	5,000	843,900.00	0.14
155	000538	云南白药	14,820	841,183.20	0.14
156	000426	兴业银锡	23,600	840,160.00	0.14
157	600522	中天科技	45,400	822,648.00	0.14
158	002202	金风科技	40,200	820,080.00	0.14
159	000938	紫光股份	33,280	818,688.00	0.14

160	600487	亨通光电	32,800	811,144.00	0.13
161	000630	铜陵有色	133,900	804,739.00	0.13
162	600760	中航沈飞	14,144	794,185.60	0.13
163	600346	恒力石化	35,100	790,803.00	0.13
164	000166	申万宏源	150,000	790,500.00	0.13
165	300803	指南针	5,980	782,602.60	0.13
166	600426	华鲁恒升	24,740	777,578.20	0.13
167	601168	西部矿业	27,800	768,392.00	0.13
168	002311	海大集团	13,800	764,244.00	0.13
169	601916	浙商银行	250,900	762,736.00	0.13
170	002156	通富微电	20,200	761,540.00	0.13
171	600549	厦门钨业	18,500	759,610.00	0.13
172	600570	恒生电子	25,169	758,845.35	0.13
173	002532	天山铝业	46,400	750,752.00	0.12
174	002179	中航光电	21,160	749,910.40	0.12
175	300604	长川科技	7,400	749,694.00	0.12
176	600795	国电电力	148,400	747,936.00	0.12
177	601669	中国电建	143,300	745,160.00	0.12
178	300115	长盈精密	15,800	734,700.00	0.12
179	688347	华虹公司	6,784	731,790.08	0.12
180	600048	保利发展	119,500	728,950.00	0.12
181	600015	华夏银行	105,900	727,533.00	0.12
182	600415	小商品城	45,600	727,320.00	0.12
183	600066	宇通客车	22,100	722,670.00	0.12
184	002353	杰瑞股份	10,200	722,466.00	0.12
185	000933	神火股份	26,200	719,714.00	0.12
186	600029	南方航空	89,700	718,497.00	0.12
187	600989	宝丰能源	36,600	718,458.00	0.12
188	300442	润泽科技	13,600	718,080.00	0.12
189	000157	中联重科	82,600	712,838.00	0.12
190	002340	格林美	85,100	711,436.00	0.12
191	601058	赛轮轮胎	43,800	708,684.00	0.12
192	600096	云天化	21,200	708,292.00	0.12
193	002074	国轩高科	18,000	703,980.00	0.12
194	300395	菲利华	7,000	702,100.00	0.12
195	002261	拓维信息	21,000	695,100.00	0.12
196	300058	蓝色光标	59,740	688,204.80	0.11
197	688126	沪硅产业	31,801	688,173.64	0.11
198	600143	金发科技	35,112	686,088.48	0.11
199	301308	江波龙	2,800	685,552.00	0.11
200	600176	中国巨石	39,938	682,939.80	0.11
201	601995	中金公司	19,500	682,500.00	0.11
202	601838	成都银行	42,300	681,876.00	0.11
203	601998	中信银行	88,200	679,140.00	0.11

204	600009	上海机场	20,700	678,132.00	0.11
205	300857	协创数据	4,000	674,720.00	0.11
206	000975	山金国际	27,700	673,941.00	0.11
207	002736	国信证券	51,100	670,432.00	0.11
208	002195	岩山科技	94,300	668,587.00	0.11
209	002851	麦格米特	7,300	657,511.00	0.11
210	300339	润和软件	13,200	653,400.00	0.11
211	601360	三六零	58,200	650,094.00	0.11
212	002001	新和成	25,576	644,259.44	0.11
213	300207	欣旺达	24,600	643,290.00	0.11
214	002131	利欧股份	112,700	635,628.00	0.11
215	688036	传音控股	9,576	633,548.16	0.11
216	600885	宏发股份	20,585	625,784.00	0.10
217	603893	瑞芯微	3,500	623,980.00	0.10
218	688525	佰维存储	5,435	623,883.65	0.10
219	600219	南山铝业	115,900	623,542.00	0.10
220	002236	大华股份	32,800	621,232.00	0.10
221	002517	恺英网络	28,400	621,108.00	0.10
222	688002	睿创微纳	6,125	617,400.00	0.10
223	603296	华勤技术	6,800	617,032.00	0.10
224	002966	苏州银行	74,360	616,444.40	0.10
225	300418	昆仑万维	14,600	608,820.00	0.10
226	688120	华海清科	4,052	608,124.16	0.10
227	002304	洋河股份	10,000	607,400.00	0.10
228	002402	和而泰	15,400	602,448.00	0.10
229	002920	德赛西威	5,000	601,500.00	0.10
230	603228	景旺电子	8,214	600,361.26	0.10
231	601555	东吴证券	66,168	599,482.08	0.10
232	002436	兴森科技	28,300	599,111.00	0.10
233	688795	摩尔线程	1,428	594,076.56	0.10
234	300223	北京君正	5,600	593,824.00	0.10
235	601186	中国铁建	76,600	587,522.00	0.10
236	002938	鹏鼎控股	11,600	586,728.00	0.10
237	000768	中航西飞	23,100	586,278.00	0.10
238	601111	中国国航	62,400	584,688.00	0.10
239	002493	荣盛石化	49,900	584,329.00	0.10
240	600601	方正科技	49,800	583,656.00	0.10
241	300751	迈为股份	2,832	583,363.68	0.10
242	002273	水晶光电	23,100	580,272.00	0.10
243	601066	中信建投	21,600	578,232.00	0.10
244	000963	华东医药	14,600	575,970.00	0.10
245	000831	中国稀土	12,400	575,856.00	0.10
246	601077	渝农商行	88,300	570,418.00	0.09
247	601788	光大证券	32,500	570,375.00	0.09

248	600157	永泰能源	363,000	569,910.00	0.09
249	601881	中国银河	36,200	569,064.00	0.09
250	002281	光迅科技	8,100	566,595.00	0.09
251	002595	豪迈科技	6,700	566,217.00	0.09
252	002008	大族激光	13,700	564,303.00	0.09
253	688122	西部超导	7,566	564,272.28	0.09
254	600673	东阳光	25,000	560,750.00	0.09
255	002252	上海莱士	88,300	559,822.00	0.09
256	688469	芯联集成	83,676	559,792.44	0.09
257	600196	复星医药	21,100	558,939.00	0.09
258	002130	沃尔核材	21,000	552,720.00	0.09
259	600460	士兰微	19,400	551,154.00	0.09
260	600011	华能国际	73,210	546,146.60	0.09
261	002422	科伦药业	18,600	545,910.00	0.09
262	688361	中科飞测	3,559	544,491.41	0.09
263	002601	龙佰集团	27,800	544,324.00	0.09
264	600372	中航机载	40,300	540,826.00	0.09
265	688235	百济神州	1,997	536,394.20	0.09
266	002472	双环传动	11,300	535,733.00	0.09
267	601901	方正证券	68,500	534,300.00	0.09
268	688169	石头科技	3,507	533,274.42	0.09
269	689009	九号公司	9,551	530,940.09	0.09
270	002126	银轮股份	14,000	529,200.00	0.09
271	301236	软通动力	11,100	526,473.00	0.09
272	300390	天华新能	9,640	526,440.40	0.09
273	000002	万科 A	113,200	526,380.00	0.09
274	600886	国投电力	40,000	524,800.00	0.09
275	600741	华域汽车	26,200	524,000.00	0.09
276	605117	德业股份	6,064	522,716.80	0.09
277	002465	海格通信	33,000	519,750.00	0.09
278	688777	中控技术	10,530	519,550.20	0.09
279	002128	电投能源	18,600	519,126.00	0.09
280	001979	招商蛇口	60,000	518,400.00	0.09
281	600699	均胜电子	16,300	511,168.00	0.08
282	601868	中国能建	215,820	507,177.00	0.08
283	600515	海南机场	95,000	506,350.00	0.08
284	300782	卓胜微	6,200	505,176.00	0.08
285	002850	科达利	3,200	505,152.00	0.08
286	601698	中国卫通	14,100	503,793.00	0.08
287	600392	盛和资源	23,300	501,649.00	0.08
288	603129	春风动力	1,800	501,624.00	0.08
289	000661	长春高新	5,400	499,770.00	0.08
290	601877	正泰电器	17,900	499,231.00	0.08
291	002648	卫星化学	27,980	494,686.40	0.08

292	300661	圣邦股份	7,202	494,345.28	0.08
293	601878	浙商证券	45,700	494,017.00	0.08
294	300346	南大光电	11,500	493,350.00	0.08
295	600875	东方电气	20,300	492,884.00	0.08
296	003816	中国广核	130,900	492,184.00	0.08
297	301358	湖南裕能	7,600	491,416.00	0.08
298	300759	康龙化成	17,200	488,996.00	0.08
299	601162	天风证券	117,310	488,009.60	0.08
300	601800	中国交建	59,200	487,808.00	0.08
301	300347	泰格医药	8,600	487,620.00	0.08
302	688099	晶晨股份	5,588	487,441.24	0.08
303	603659	璞泰来	17,765	485,695.10	0.08
304	300454	深信服	4,200	483,672.00	0.08
305	601872	招商轮船	53,780	482,944.40	0.08
306	601021	春秋航空	8,100	481,950.00	0.08
307	002797	第一创业	69,900	480,213.00	0.08
308	000301	东方盛虹	44,000	479,160.00	0.08
309	000878	云南铜业	23,300	477,883.00	0.08
310	601319	中国人保	53,200	476,140.00	0.08
311	002138	顺络电子	13,400	476,102.00	0.08
312	300054	鼎龙股份	12,600	473,760.00	0.08
313	603979	金诚信	6,200	472,130.00	0.08
314	601108	财通证券	54,120	471,926.40	0.08
315	688027	国盾量子	935	471,043.65	0.08
316	601633	长城汽车	20,800	470,704.00	0.08
317	600021	上海电力	23,500	470,470.00	0.08
318	600233	圆通速递	28,500	467,970.00	0.08
319	002185	华天科技	42,600	467,322.00	0.08
320	688396	华润微	8,834	466,965.24	0.08
321	688578	艾利斯	4,480	466,592.00	0.08
322	601099	太平洋	113,400	466,074.00	0.08
323	600352	浙江龙盛	43,300	461,578.00	0.08
324	688385	复旦微电	6,255	460,993.50	0.08
325	002294	信立泰	9,300	460,815.00	0.08
326	000021	深科技	18,200	460,096.00	0.08
327	601117	中国化学	61,000	459,330.00	0.08
328	688608	恒玄科技	2,019	458,191.86	0.08
329	000895	双汇发展	17,300	457,931.00	0.08
330	000960	锡业股份	16,400	457,232.00	0.08
331	300037	新宙邦	8,680	454,832.00	0.08
332	600588	用友网络	34,091	452,046.66	0.08
333	600674	川投能源	32,400	450,360.00	0.07
334	000783	长江证券	55,200	449,880.00	0.07
335	601198	东兴证券	32,300	448,324.00	0.07

336	688506	百利天恒	1,381	446,201.10	0.07
337	688213	思特威	4,680	445,021.20	0.07
338	600141	兴发集团	12,800	442,624.00	0.07
339	601717	中创智领	18,000	441,900.00	0.07
340	600298	安琪酵母	10,100	441,774.00	0.07
341	603179	新泉股份	5,977	441,580.76	0.07
342	000893	亚钾国际	9,200	441,324.00	0.07
343	300724	捷佳伟创	4,600	439,760.00	0.07
344	688047	龙芯中科	3,327	439,529.97	0.07
345	002078	太阳纸业	27,900	439,425.00	0.07
346	600498	烽火通信	13,631	437,282.48	0.07
347	601615	明阳智能	30,100	435,848.00	0.07
348	300474	景嘉微	6,050	434,813.50	0.07
349	600536	中国软件	9,340	432,442.00	0.07
350	002271	东方雨虹	31,800	432,162.00	0.07
351	600039	四川路桥	43,380	431,631.00	0.07
352	603369	今世缘	12,400	431,272.00	0.07
353	688019	安集科技	1,958	426,687.36	0.07
354	688802	沐曦股份	1,065	425,361.00	0.07
355	000786	北新建材	17,000	424,490.00	0.07
356	000657	中钨高新	15,200	421,192.00	0.07
357	300017	网宿科技	40,900	419,225.00	0.07
358	002414	高德红外	28,437	417,170.79	0.07
359	300073	当升科技	7,200	416,160.00	0.07
360	601696	中银证券	27,700	415,223.00	0.07
361	688676	金盘科技	4,590	414,660.60	0.07
362	601233	桐昆股份	24,000	413,040.00	0.07
363	603606	东方电缆	6,900	412,275.00	0.07
364	300866	安克创新	3,600	411,804.00	0.07
365	300496	中科创达	6,100	411,750.00	0.07
366	601665	齐鲁银行	71,700	411,558.00	0.07
367	688017	绿的谐波	2,129	408,980.90	0.07
368	603087	甘李药业	6,000	408,420.00	0.07
369	002080	中材科技	11,200	407,008.00	0.07
370	002444	巨星科技	11,900	404,838.00	0.07
371	000617	中油资本	42,100	404,160.00	0.07
372	600884	杉杉股份	29,900	403,949.00	0.07
373	300458	全志科技	9,600	403,488.00	0.07
374	600109	国金证券	43,200	401,760.00	0.07
375	300316	晶盛机电	10,900	400,575.00	0.07
376	300251	光线传媒	24,400	399,672.00	0.07
377	002157	正邦科技	123,100	398,844.00	0.07
378	300757	罗博特科	1,700	396,610.00	0.07
379	688568	中科星图	6,722	396,598.00	0.07

380	002085	万丰奥威	24,700	395,447.00	0.07
381	688183	生益电子	4,087	391,085.03	0.07
382	600188	兖矿能源	29,725	390,883.75	0.06
383	300748	金力永磁	11,420	389,536.20	0.06
384	601577	长沙银行	40,100	388,970.00	0.06
385	601128	常熟银行	55,191	388,544.64	0.06
386	601179	中国西电	42,600	387,660.00	0.06
387	302132	中航成飞	4,900	387,100.00	0.06
388	600482	中国动力	18,700	387,090.00	0.06
389	002155	湖南黄金	18,190	383,627.10	0.06
390	301269	华大九天	3,600	382,788.00	0.06
391	300699	光威复材	9,700	382,762.00	0.06
392	002223	鱼跃医疗	10,000	382,100.00	0.06
393	000559	万向钱潮	22,100	380,120.00	0.06
394	601898	中煤能源	30,500	379,420.00	0.06
395	300012	华测检测	28,000	379,400.00	0.06
396	002459	晶澳科技	33,056	378,491.20	0.06
397	600363	联创光电	6,000	378,360.00	0.06
398	300024	机器人	20,800	378,352.00	0.06
399	300002	神州泰岳	32,700	376,704.00	0.06
400	300122	智飞生物	19,950	376,456.50	0.06
401	688223	晶科能源	66,582	375,522.48	0.06
402	000034	神州数码	9,500	369,645.00	0.06
403	002624	完美世界	22,550	369,594.50	0.06
404	000423	东阿阿胶	7,500	368,100.00	0.06
405	600085	同仁堂	11,400	367,764.00	0.06
406	600497	驰宏锌锗	50,300	367,693.00	0.06
407	300373	扬杰科技	5,400	367,200.00	0.06
408	300832	新产业	6,500	365,625.00	0.06
409	688472	阿特斯	24,508	365,414.28	0.06
410	300285	国瓷材料	13,300	364,553.00	0.06
411	000728	国元证券	43,540	363,559.00	0.06
412	603160	汇顶科技	4,600	363,400.00	0.06
413	002683	广东宏大	7,600	363,280.00	0.06
414	002064	华峰化学	33,000	363,000.00	0.06
415	300896	爱美客	2,560	362,803.20	0.06
416	300919	中伟股份	7,820	362,300.60	0.06
417	600600	青岛啤酒	5,900	361,080.00	0.06
418	603596	伯特利	7,040	360,940.80	0.06
419	688599	天合光能	21,695	359,052.25	0.06
420	000596	古井贡酒	2,700	358,020.00	0.06
421	002409	雅克科技	4,800	355,680.00	0.06
422	601618	中国中冶	118,800	352,836.00	0.06
423	002673	西部证券	44,600	351,894.00	0.06

424	600765	中航重机	18,340	351,394.40	0.06
425	603920	世运电路	7,200	348,552.00	0.06
426	000876	新希望	37,500	345,750.00	0.06
427	002410	广联达	27,440	345,195.20	0.06
428	600079	ST 人福	19,000	344,090.00	0.06
429	600918	中泰证券	52,700	342,550.00	0.06
430	688617	惠泰医疗	1,408	342,524.16	0.06
431	002756	永兴材料	6,300	341,775.00	0.06
432	001965	招商公路	33,900	341,712.00	0.06
433	002065	东华软件	37,300	341,295.00	0.06
434	000733	振华科技	6,500	340,665.00	0.06
435	300003	乐普医疗	21,500	339,915.00	0.06
436	688220	翱捷科技	4,111	339,609.71	0.06
437	000997	新大陆	11,800	334,176.00	0.06
438	002335	科华数据	6,000	333,180.00	0.06
439	601607	上海医药	18,600	332,196.00	0.06
440	600873	梅花生物	32,700	331,251.00	0.06
441	600023	浙能电力	66,900	331,155.00	0.06
442	600637	东方明珠	33,600	330,960.00	0.06
443	603766	隆鑫通用	20,500	330,255.00	0.05
444	002318	久立特材	11,400	330,030.00	0.05
445	600862	中航高科	13,900	328,457.00	0.05
446	600027	华电国际	65,800	326,368.00	0.05
447	601231	环旭电子	10,864	325,920.00	0.05
448	600061	国投资本	42,504	325,155.60	0.05
449	600026	中远海能	27,700	323,536.00	0.05
450	000932	华菱钢铁	57,500	323,150.00	0.05
451	000703	恒逸石化	29,990	322,992.30	0.05
452	000683	博源化工	43,300	322,152.00	0.05
453	600803	新奥股份	15,500	321,780.00	0.05
454	300972	万辰集团	1,600	321,712.00	0.05
455	000528	柳工	27,000	320,490.00	0.05
456	605589	圣泉集团	11,300	319,790.00	0.05
457	300627	华测导航	9,160	319,775.60	0.05
458	600909	华安证券	46,740	316,897.20	0.05
459	688234	天岳先进	3,565	316,857.20	0.05
460	300001	特锐德	12,300	315,864.00	0.05
461	600060	海信视像	13,000	315,640.00	0.05
462	000999	华润三九	11,085	315,479.10	0.05
463	000750	国海证券	74,380	315,371.20	0.05
464	000830	鲁西化工	19,000	314,830.00	0.05
465	603486	科沃斯	3,900	314,652.00	0.05
466	603260	合盛硅业	5,900	310,930.00	0.05
467	000623	吉林敖东	15,900	310,527.00	0.05

468	002821	凯莱英	3,340	310,386.20	0.05
469	605358	立昂微	8,900	309,898.00	0.05
470	000039	中集集团	30,600	308,754.00	0.05
471	600737	中粮糖业	17,800	306,338.00	0.05
472	688629	华丰科技	3,059	306,083.54	0.05
473	000400	许继电气	11,900	305,949.00	0.05
474	600930	华电新能	48,600	305,694.00	0.05
475	688180	君实生物	8,925	304,878.00	0.05
476	000887	中鼎股份	13,100	304,051.00	0.05
477	000983	山西焦煤	47,200	303,024.00	0.05
478	300413	芒果超媒	12,400	302,808.00	0.05
479	000060	中金岭南	51,700	302,445.00	0.05
480	600332	白云山	11,700	301,158.00	0.05
481	601238	广汽集团	36,900	301,104.00	0.05
482	300567	精测电子	3,300	300,960.00	0.05
483	300570	太辰光	2,600	300,430.00	0.05
484	300628	亿联网络	8,420	300,173.00	0.05
485	688052	纳芯微	1,892	299,276.56	0.05
486	300383	光环新网	23,900	298,989.00	0.05
487	688065	凯赛生物	5,995	298,551.00	0.05
488	688322	奥比中光	3,328	298,421.76	0.05
489	600369	西南证券	66,300	297,024.00	0.05
490	603444	吉比特	700	296,695.00	0.05
491	601799	星宇股份	2,400	296,088.00	0.05
492	300677	英科医疗	7,600	295,640.00	0.05
493	000009	中国宝安	30,000	295,500.00	0.05
494	600845	宝信软件	14,263	295,386.73	0.05
495	688702	盛科通信	2,084	295,281.96	0.05
496	600521	华海药业	17,400	295,278.00	0.05
497	600171	上海贝岭	9,400	293,750.00	0.05
498	688387	信科移动	22,688	292,675.20	0.05
499	600177	雅戈尔	38,468	292,356.80	0.05
500	601990	南京证券	36,800	291,456.00	0.05
501	300142	沃森生物	26,600	290,206.00	0.05
502	002203	海亮股份	22,878	289,635.48	0.05
503	001696	宗申动力	13,300	288,477.00	0.05
504	601212	白银有色	49,300	288,405.00	0.05
505	600704	物产中大	51,600	287,412.00	0.05
506	603568	伟明环保	11,318	287,250.84	0.05
507	688303	大全能源	10,707	287,161.74	0.05
508	601059	信达证券	16,200	286,902.00	0.05
509	601997	贵阳银行	48,700	285,869.00	0.05
510	002152	广电运通	20,700	285,867.00	0.05
511	300432	富临精工	17,100	285,570.00	0.05

512	688266	泽璟制药	3,074	284,959.80	0.05
513	688082	盛美上海	1,618	284,848.90	0.05
514	300999	金龙鱼	9,900	284,526.00	0.05
515	300763	锦浪科技	3,976	283,926.16	0.05
516	603392	万泰生物	6,300	283,122.00	0.05
517	688018	乐鑫科技	1,664	282,880.00	0.05
518	600025	华能水电	31,000	281,480.00	0.05
519	688783	西安奕材	15,242	280,300.38	0.05
520	002429	兆驰股份	37,700	279,734.00	0.05
521	600486	扬农化工	4,030	279,641.70	0.05
522	000738	航发控制	13,100	279,161.00	0.05
523	002739	万达电影	24,600	278,472.00	0.05
524	002007	华兰生物	18,280	276,576.40	0.05
525	688375	国博电子	2,967	276,257.37	0.05
526	002044	美年健康	52,100	275,088.00	0.05
527	000708	中信特钢	16,800	275,016.00	0.05
528	600378	昊华科技	8,600	274,856.00	0.05
529	600801	华新建材	11,200	274,848.00	0.05
530	600208	衢州发展	70,800	273,996.00	0.05
531	603605	珀莱雅	4,000	273,920.00	0.05
532	002841	视源股份	6,900	273,447.00	0.05
533	002939	长城证券	26,800	273,360.00	0.05
534	600435	北方导航	17,600	271,392.00	0.05
535	601611	中国核建	20,100	270,948.00	0.05
536	601216	君正集团	56,200	270,884.00	0.05
537	603699	纽威股份	5,200	270,244.00	0.04
538	603345	安井食品	3,400	269,552.00	0.04
539	601567	三星医疗	11,700	269,334.00	0.04
540	600161	天坛生物	16,429	268,449.86	0.04
541	600153	建发股份	28,900	267,325.00	0.04
542	600516	方大炭素	46,860	266,633.40	0.04
543	688778	厦钨新能	3,441	266,230.17	0.04
544	601456	国联民生	26,100	265,437.00	0.04
545	600499	科达制造	19,100	264,917.00	0.04
546	688615	合合信息	1,161	264,220.38	0.04
547	002056	横店东磁	13,500	263,250.00	0.04
548	000729	燕京啤酒	23,400	262,782.00	0.04
549	300487	蓝晓科技	4,200	259,350.00	0.04
550	600642	申能股份	32,600	253,628.00	0.04
551	688188	柏楚电子	1,864	253,298.96	0.04
552	603728	鸣志电器	3,500	253,225.00	0.04
553	000519	中兵红箭	13,900	253,119.00	0.04
554	603816	顾家家居	8,200	252,068.00	0.04
555	600018	上港集团	46,500	252,030.00	0.04

556	688114	华大智造	4,146	251,910.96	0.04
557	600316	洪都航空	7,200	251,352.00	0.04
558	601958	金钼股份	16,100	250,838.00	0.04
559	000155	川能动力	21,500	250,475.00	0.04
560	000415	渤海租赁	61,700	249,885.00	0.04
561	603379	三美股份	4,100	248,952.00	0.04
562	301611	珂玛科技	2,900	248,617.00	0.04
563	600348	华阳股份	30,000	247,800.00	0.04
564	600038	中直股份	6,800	245,684.00	0.04
565	688692	达梦数据	939	245,332.53	0.04
566	688538	和辉光电	91,898	244,448.68	0.04
567	002262	恩华药业	10,100	243,713.00	0.04
568	688772	珠海冠宇	11,300	243,289.00	0.04
569	600863	内蒙华电	54,300	243,264.00	0.04
570	002926	华西证券	26,200	243,136.00	0.04
571	603806	福斯特	17,339	242,052.44	0.04
572	600398	海澜之家	40,000	242,000.00	0.04
573	002430	杭氧股份	8,100	241,947.00	0.04
574	603156	养元饮品	8,400	241,500.00	0.04
575	000723	美锦能源	51,300	241,110.00	0.04
576	688166	博瑞医药	4,914	241,080.84	0.04
577	000629	钒钛股份	77,300	239,630.00	0.04
578	600967	内蒙一机	14,200	238,560.00	0.04
579	300679	电连技术	4,900	238,532.00	0.04
580	603338	浙江鼎力	4,200	237,888.00	0.04
581	600820	隧道股份	36,600	237,534.00	0.04
582	002603	以岭药业	13,900	237,273.00	0.04
583	600901	江苏金租	38,580	236,109.60	0.04
584	688009	中国通号	43,028	235,363.16	0.04
585	600170	上海建工	88,700	235,055.00	0.04
586	601018	宁波港	64,700	234,861.00	0.04
587	601699	潞安环能	19,900	234,820.00	0.04
588	600562	国睿科技	8,300	234,558.00	0.04
589	600312	平高电气	13,500	234,225.00	0.04
590	688278	特宝生物	2,785	233,048.80	0.04
591	603077	和邦生物	102,800	232,328.00	0.04
592	603298	杭叉集团	8,700	231,159.00	0.04
593	600563	法拉电子	2,200	230,890.00	0.04
594	600166	福田汽车	79,000	230,680.00	0.04
595	601399	国机重装	48,000	229,440.00	0.04
596	002958	青农商行	73,900	229,090.00	0.04
597	002385	大北农	57,200	228,800.00	0.04
598	001389	广合科技	2,800	228,564.00	0.04
599	601106	中国一重	57,000	227,430.00	0.04

600	688187	时代电气	4,421	226,753.09	0.04
601	600970	中材国际	21,800	226,502.00	0.04
602	603737	三棵树	4,892	226,352.84	0.04
603	300100	双林股份	5,700	225,834.00	0.04
604	002025	航天电器	4,500	225,585.00	0.04
605	300623	捷捷微电	8,300	225,511.00	0.04
606	002607	中公教育	82,100	224,954.00	0.04
607	688582	芯动联科	3,395	224,443.45	0.04
608	688301	奕瑞科技	2,209	223,351.99	0.04
609	300676	华大基因	4,900	222,264.00	0.04
610	000050	深天马 A	24,500	221,235.00	0.04
611	600008	首创环保	73,250	219,750.00	0.04
612	003031	中瓷电子	3,000	219,480.00	0.04
613	603939	益丰药房	10,060	218,503.20	0.04
614	002984	森麒麟	10,300	218,051.00	0.04
615	002432	九安医疗	5,400	216,216.00	0.04
616	601991	大唐发电	61,900	216,031.00	0.04
617	603885	吉祥航空	14,500	215,760.00	0.04
618	600282	南钢股份	41,000	215,660.00	0.04
619	688297	中无人机	4,480	215,129.60	0.04
620	600998	九州通	41,987	214,973.44	0.04
621	300144	宋城演艺	26,180	214,414.20	0.04
622	600329	达仁堂	4,700	214,414.00	0.04
623	002500	山西证券	35,790	214,382.10	0.04
624	600380	健康元	18,300	211,365.00	0.04
625	600763	通策医疗	5,241	210,740.61	0.04
626	603589	口子窖	7,000	210,350.00	0.03
627	600095	湘财股份	19,000	210,140.00	0.03
628	601155	新城控股	14,998	209,222.10	0.03
629	600132	重庆啤酒	4,000	208,960.00	0.03
630	002244	滨江集团	20,700	208,035.00	0.03
631	600390	五矿资本	37,400	207,570.00	0.03
632	000513	丽珠集团	6,000	206,760.00	0.03
633	002312	川发龙蟒	18,900	206,577.00	0.03
634	002583	海能达	18,200	206,024.00	0.03
635	000987	越秀资本	25,060	203,988.40	0.03
636	300146	汤臣倍健	16,900	202,969.00	0.03
637	000591	太阳能	45,600	202,464.00	0.03
638	600583	海油工程	36,800	202,032.00	0.03
639	600995	南网储能	16,000	201,120.00	0.03
640	601608	中信重工	30,500	200,995.00	0.03
641	600602	云赛智联	10,700	199,983.00	0.03
642	688759	必贝特	7,932	199,331.16	0.03
643	601865	福莱特	12,700	199,009.00	0.03

644	600985	淮北矿业	17,900	198,869.00	0.03
645	003021	兆威机电	1,600	198,688.00	0.03
646	603225	新凤鸣	10,100	196,546.00	0.03
647	300558	贝达药业	4,200	196,098.00	0.03
648	601880	辽港股份	122,500	196,000.00	0.03
649	601156	东航物流	10,600	195,146.00	0.03
650	600977	中国电影	12,400	194,928.00	0.03
651	688728	格科微	12,980	193,921.20	0.03
652	601666	平煤股份	24,600	193,602.00	0.03
653	600685	中船防务	6,800	193,460.00	0.03
654	601236	红塔证券	23,520	192,628.80	0.03
655	600754	锦江酒店	7,600	192,052.00	0.03
656	300735	光弘科技	7,700	191,422.00	0.03
657	002568	百润股份	8,760	191,055.60	0.03
658	000921	海信家电	7,700	191,037.00	0.03
659	603290	斯达半导	1,980	190,258.20	0.03
660	601016	节能风电	64,290	189,655.50	0.03
661	601000	唐山港	49,300	189,312.00	0.03
662	600535	天士力	12,400	186,868.00	0.03
663	600848	上海临港	15,967	186,813.90	0.03
664	600004	白云机场	19,700	186,362.00	0.03
665	600816	建元信托	65,500	185,365.00	0.03
666	000825	太钢不锈	37,900	185,331.00	0.03
667	603927	中科软	9,680	184,791.20	0.03
668	603195	公牛集团	4,514	184,306.62	0.03
669	000032	深桑达 A	9,500	183,825.00	0.03
670	600126	杭钢股份	22,500	183,600.00	0.03
671	002773	康弘药业	6,100	182,817.00	0.03
672	601001	晋控煤业	13,900	182,785.00	0.03
673	603650	彤程新材	4,107	181,282.98	0.03
674	600511	国药股份	6,300	181,125.00	0.03
675	002266	浙富控股	43,400	180,544.00	0.03
676	002423	中粮资本	15,300	179,010.00	0.03
677	000598	兴蓉环境	24,800	177,816.00	0.03
678	601966	玲珑轮胎	12,200	177,266.00	0.03
679	600598	北大荒	11,800	176,410.00	0.03
680	000563	陕国投 A	51,000	175,950.00	0.03
681	603000	人民网	9,200	175,260.00	0.03
682	600483	福能股份	18,500	175,195.00	0.03
683	000958	电投产融	26,900	174,043.00	0.03
684	002831	裕同科技	6,100	173,911.00	0.03
685	000062	深圳华强	7,000	172,340.00	0.03
686	601333	广深铁路	56,400	171,456.00	0.03
687	600517	国网英大	28,500	171,285.00	0.03

688	601918	新集能源	25,900	171,199.00	0.03
689	601136	首创证券	9,100	170,989.00	0.03
690	002439	启明星辰	12,100	170,852.00	0.03
691	300718	长盛轴承	2,000	170,720.00	0.03
692	600739	辽宁成大	15,250	170,495.00	0.03
693	002299	圣农发展	10,300	170,362.00	0.03
694	600578	京能电力	33,400	170,340.00	0.03
695	301536	星宸科技	2,800	167,748.00	0.03
696	600808	马钢股份	39,700	167,534.00	0.03
697	688318	财富趋势	1,266	167,517.12	0.03
698	688281	华秦科技	2,261	166,861.80	0.03
699	601118	海南橡胶	28,500	166,725.00	0.03
700	600546	山煤国际	16,500	166,485.00	0.03
701	603688	石英股份	4,550	166,439.00	0.03
702	600655	豫园股份	32,400	166,212.00	0.03
703	000951	中国重汽	9,800	165,620.00	0.03
704	603899	晨光股份	6,100	165,066.00	0.03
705	300601	康泰生物	11,160	164,833.20	0.03
706	603341	龙旗科技	3,900	164,814.00	0.03
707	601866	中远海发	64,900	163,548.00	0.03
708	002670	国盛证券	9,700	163,348.00	0.03
709	002120	韵达股份	24,100	162,434.00	0.03
710	600131	国网信通	10,000	161,400.00	0.03
711	600566	济川药业	6,100	160,430.00	0.03
712	600582	天地科技	27,500	160,325.00	0.03
713	000883	湖北能源	35,300	160,262.00	0.03
714	688561	奇安信	4,488	159,683.04	0.03
715	000709	河钢股份	68,800	158,928.00	0.03
716	603833	欧派家居	3,022	157,415.98	0.03
717	300529	健帆生物	8,000	157,360.00	0.03
718	601598	中国外运	25,800	156,348.00	0.03
719	603786	科博达	2,000	156,200.00	0.03
720	000739	普洛药业	9,600	156,192.00	0.03
721	600707	彩虹股份	23,900	155,111.00	0.03
722	600663	陆家嘴	19,600	155,036.00	0.03
723	000027	深圳能源	23,760	154,915.20	0.03
724	000967	盈峰环境	21,100	154,874.00	0.03
725	000088	盐田港	34,600	153,970.00	0.03
726	002508	老板电器	7,900	152,865.00	0.03
727	600528	中铁工业	18,500	151,330.00	0.03
728	000582	北部湾港	15,800	148,204.00	0.02
729	002153	石基信息	13,640	147,721.20	0.02
730	600871	石化油服	67,600	146,016.00	0.02
731	688709	成都华微	3,170	145,788.30	0.02

732	300979	华利集团	2,900	145,609.00	0.02
733	300888	稳健医疗	3,840	145,305.60	0.02
734	600906	财达证券	21,600	144,072.00	0.02
735	688363	华熙生物	3,295	143,925.60	0.02
736	600959	江苏有线	41,600	143,104.00	0.02
737	300070	碧水源	36,200	141,904.00	0.02
738	603565	中谷物流	14,000	140,560.00	0.02
739	002265	建设工业	5,200	139,464.00	0.02
740	601808	中海油服	9,900	138,996.00	0.02
741	300957	贝泰妮	3,500	138,635.00	0.02
742	603858	步长制药	8,800	137,632.00	0.02
743	688172	燕东微	4,705	136,162.70	0.02
744	688790	昂瑞微	1,160	135,801.20	0.02
745	601098	中南传媒	12,000	135,120.00	0.02
746	688425	铁建重工	26,547	134,593.29	0.02
747	603233	大参林	7,600	133,912.00	0.02
748	003022	联泓新科	6,700	132,727.00	0.02
749	688192	迪哲医药	2,295	132,192.00	0.02
750	301200	大族数控	1,100	130,647.00	0.02
751	688563	航材股份	2,232	130,460.40	0.02
752	301498	乖宝宠物	2,000	130,300.00	0.02
753	600968	海油发展	33,800	129,792.00	0.02
754	601061	中信金属	9,000	129,600.00	0.02
755	600764	中国海防	4,700	128,498.00	0.02
756	688248	南网科技	2,870	128,403.80	0.02
757	603529	爱玛科技	4,300	127,710.00	0.02
758	601928	凤凰传媒	12,700	127,508.00	0.02
759	000959	首钢股份	25,800	126,420.00	0.02
760	600062	华润双鹤	6,900	126,201.00	0.02
761	600295	鄂尔多斯	9,900	122,364.00	0.02
762	688336	三生国健	2,047	121,939.79	0.02
763	000785	居然智家	41,400	120,888.00	0.02
764	002032	苏泊尔	2,700	119,016.00	0.02
765	001286	陕西能源	12,500	116,375.00	0.02
766	600606	绿地控股	70,100	116,366.00	0.02
767	600098	广州发展	17,500	114,450.00	0.02
768	000537	中绿电	13,800	113,298.00	0.02
769	301301	川宁生物	11,100	112,554.00	0.02
770	601965	中国汽研	6,700	111,220.00	0.02
771	002372	伟星新材	10,600	110,558.00	0.02
772	600720	中交设计	15,300	110,466.00	0.02
773	000429	粤高速 A	8,700	102,486.00	0.02
774	603658	安图生物	2,880	102,009.60	0.02
775	600688	上海石化	36,600	101,748.00	0.02

776	688349	三一重能	4,013	101,448.64	0.02
777	600377	宁沪高速	8,300	100,513.00	0.02
778	000898	鞍钢股份	39,700	100,441.00	0.02
779	688295	中复神鹰	2,986	97,970.66	0.02
780	601298	青岛港	11,700	97,578.00	0.02
781	688520	神州细胞	2,217	96,018.27	0.02
782	001391	国货航	16,200	95,904.00	0.02
783	601139	深圳燃气	14,400	95,040.00	0.02
784	000937	冀中能源	17,600	94,688.00	0.02
785	688100	威胜信息	2,384	93,691.20	0.02
786	600339	中油工程	27,900	93,465.00	0.02
787	002608	江苏国信	12,600	93,114.00	0.02
788	601019	山东出版	10,400	89,856.00	0.01
789	600032	浙江新能	12,000	88,920.00	0.01
790	003035	南网能源	18,900	86,562.00	0.01
791	603049	中策橡胶	1,500	83,925.00	0.01
792	688475	萤石网络	2,713	81,688.43	0.01
793	601228	广州港	25,100	81,324.00	0.01
794	688819	天能股份	2,329	77,369.38	0.01
795	600927	永安期货	4,800	77,136.00	0.01
796	603707	健友股份	8,060	72,781.80	0.01
797	300140	节能环境	10,300	69,731.00	0.01
798	002945	华林证券	4,500	68,985.00	0.01
799	002461	珠江啤酒	7,400	68,746.00	0.01
800	001280	中国铀业	1,503	68,176.08	0.01
801	600007	中国国贸	3,400	67,388.00	0.01
802	000539	粤电力 A	14,800	65,416.00	0.01
803	600299	安迪苏	6,700	60,099.00	0.01
804	001213	中铁特货	14,800	59,940.00	0.01
805	301656	联合动力	2,339	59,550.94	0.01
806	601921	浙版传媒	7,400	57,868.00	0.01
807	001221	悍高集团	560	32,274.40	0.01
808	688809	强一股份	153	31,106.43	0.01
809	688729	屹唐股份	1,206	29,281.68	0.00
810	301638	南网数字	1,420	20,178.20	0.00
811	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
812	001386	马可波罗	958	17,751.74	0.00
813	688796	百奥赛图	372	15,717.00	0.00
814	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
815	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
816	001233	海安集团	246	12,762.48	0.00
817	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
818	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
819	001369	双欣环保	844	10,879.16	0.00

820	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
821	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
822	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
823	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
824	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
825	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
826	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
827	603418	友升股份	93	5,492.58	0.00
828	603092	德力佳	93	5,176.38	0.00
829	001285	瑞立科密	92	5,159.36	0.00
830	603406	天富龙	119	4,779.04	0.00
831	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
832	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
833	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
834	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
835	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
836	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
837	001396	誉帆科技	69	2,441.91	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	14,289,873.40	4.45
2	300308	中际旭创	7,599,128.00	2.37
3	002709	天赐材料	7,336,558.58	2.29
4	603799	华友钴业	7,231,924.12	2.25
5	300059	东方财富	5,987,531.30	1.87
6	300502	新易盛	5,725,278.00	1.78
7	000333	美的集团	5,604,632.00	1.75
8	600885	宏发股份	4,960,108.08	1.55
9	002475	立讯精密	4,346,816.00	1.35
10	002371	北方华创	4,278,518.75	1.33
11	002600	领益智造	4,224,166.08	1.32
12	002594	比亚迪	4,177,981.00	1.30
13	000858	五粮液	3,861,775.40	1.20
14	688256	寒武纪	3,618,933.30	1.13
15	000651	格力电器	3,153,377.00	0.98
16	300274	阳光电源	3,009,496.00	0.94
17	300476	胜宏科技	2,465,782.00	0.77

18	300760	迈瑞医疗	2,431,048.00	0.76
19	000725	京东方 A	2,361,536.00	0.74
20	601231	环旭电子	2,262,558.21	0.71

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	8,473,438.00	2.64
2	603799	华友钴业	7,094,572.53	2.21
3	002709	天赐材料	7,044,664.52	2.20
4	600885	宏发股份	4,972,617.07	1.55
5	300059	东方财富	4,433,825.34	1.38
6	002600	领益智造	3,479,430.76	1.08
7	000333	美的集团	3,405,608.60	1.06
8	300502	新易盛	3,282,385.00	1.02
9	002371	北方华创	3,030,330.00	0.94
10	002594	比亚迪	2,912,839.00	0.91
11	002475	立讯精密	2,718,555.00	0.85
12	000858	五粮液	2,712,479.00	0.85
13	300308	中际旭创	2,343,414.00	0.73
14	600519	贵州茅台	2,305,887.00	0.72
15	000988	华工科技	2,273,383.00	0.71
16	601231	环旭电子	2,237,216.57	0.70
17	000651	格力电器	2,151,557.00	0.67
18	300760	迈瑞医疗	1,851,751.00	0.58
19	300124	汇川技术	1,732,742.00	0.54
20	688256	寒武纪	1,671,692.47	0.52

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	351,514,007.59
卖出股票收入（成交）总额	263,078,293.94

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	18,000.24	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,000.24	0.00

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	180	18,000.24	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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管总局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省龙岩市上杭县住房和城乡建设局的处罚。

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。

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	2,738,930.55
2	应收清算款	209,446.75
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	2,948,377.30

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
1,312	281,180.52	341,030,844.00	92.44%	27,877,999.00	7.56%	89,330,127.00	24.21%

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	中国平安财产保险股份有限公司－传 统－普通保险产品	77,340,900.00	20.96%
2	平安资管－中国银行－平安资产夏荷 18 号资产管理产品	51,216,800.00	13.88%
3	长江金色晚晴（集合型）企业年金计划 －上海浦东发展银行股份有限公司	10,289,200.00	2.79%
4	上海市肆号职业年金计划－浦发银行	9,867,600.00	2.67%
5	重庆市叁号职业年金计划－建设银行	9,012,400.00	2.44%

6	四川省宜宾五粮液集团有限公司企业年金计划—中国银行股份有限公司	8,673,500.00	2.35%
7	国寿养老安享鑫祺混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	7,000,000.00	1.90%
8	广发证券股份有限公司	5,062,645.00	1.37%
9	辽宁省拾贰号职业年金计划—中国银行	5,009,600.00	1.36%
10	招商康欣股票型养老金产品—中国民生银行股份有限公司	4,621,700.00	1.25%
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	89,330,127.00	24.21%

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	248,908,843.00
本报告期基金总申购份额	294,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	174,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	368,908,843.00

§ 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 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

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，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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 7 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 45,400.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 5 日
采取调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
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施

受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。
其他	/

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

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	-	-	-	-	-
东方财富	1	86,031,996.17	14.96%	8,604.24	14.96%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	1,539,995.51	0.27%	154.09	0.27%	-
广发证券	3	188,429.00	0.03%	18.83	0.03%	-
国泰海通	2	6,993,481.95	1.22%	699.37	1.22%	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	111,133,804.48	19.33%	11,115.42	19.33%	-

瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	282,302,425.00	49.10%	28,232.63	49.10%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	1,221,883.86	0.21%	122.22	0.21%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	85,557,546.78	14.88%	8,557.17	14.88%	-

注：a）本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为国泰海通证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为瑞银证券有限责任公司。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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。本年度内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 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）本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

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

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	10,338,841.30	33.85%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	11,226,339.21	36.75%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信证券	8,979,436.83	29.40%	-	-	-	-

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 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-01-21
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银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	2025-02-27
3	关于易方达基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同、托管协议的公告	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	2025-03-20
4	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	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	2025-03-22
5	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	2025-03-22
6	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	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	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	2025-03-25

9	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）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证券报	2025-03-31
11	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	2025-04-11
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-04-22
13	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	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	2025-05-10
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	2025-05-17
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万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	2025-06-20
16	易方达基金管理有限公司关于设立易方达财富管理基金销售（广州）有限公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-07-03
17	易方达基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	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	2025-07-10
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-07-21
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配 TCL 科技（000100）非公开发行 A 股的公告	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	2025-08-16
20	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证券报	2025-08-30
21	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	2025-09-30
22	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-10-28
23	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中航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	2025-11-03
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	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	2025-11-10
25	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联	中国证券报、基金管理	2025-11-28

	交易事项的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
26	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	2025-12-19
27	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加世纪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	2025-12-22
28	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	2025-12-25
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	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	2025-12-30

§ 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
机构	1	2025 年 12 月 04 日~2025 年 12 月 14 日,2025 年 12 月 29 日~2025 年 12 月 31 日	0.00	77,340,900.00	0.00	77,340,900.00	20.96 %
	2	2025 年 03 月 11 日~2025 年 04 月 01 日	23,037,400.00	74,310,800.00	46,131,400.00	51,216,800.00	13.88 %
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	2025 年 01 月 01 日~2025 年 12 月 31 日	154,307,655.00	158,156,271.00	223,133,799.00	89,330,127.00	24.21 %
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

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

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

二〇二六年三月三十一日