

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基 金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12	投资组合报告附注	60
8	基金份额持有人信息	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2	期末上市基金前十名持有人	63
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	64
9	开放式基金份额变动	64
10	重大事件揭示	64
10.1	基金份额持有人大会决议	64
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4	基金投资策略的改变	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8	其他重大事件	66
11	影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
12	备查文件目录	68
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

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	62,908,843.00 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	张南	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	400 881 8088	021-60637111	
传真	020-38798812	021-60635778	
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号	
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
邮政编码	510620	100033	
法定代表人	刘晓艳	田国立	

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	6,460,004.82
本期利润	2,708,593.25
加权平均基金份额本期利润	0.0402
本期加权平均净值利润率	2.77%
本期基金份额净值增长率	3.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	30,224,188.34

期末可供分配基金份额利润	0.4804
期末基金资产净值	93,133,031.34
期末基金份额净值	1.4804
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	48.04%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

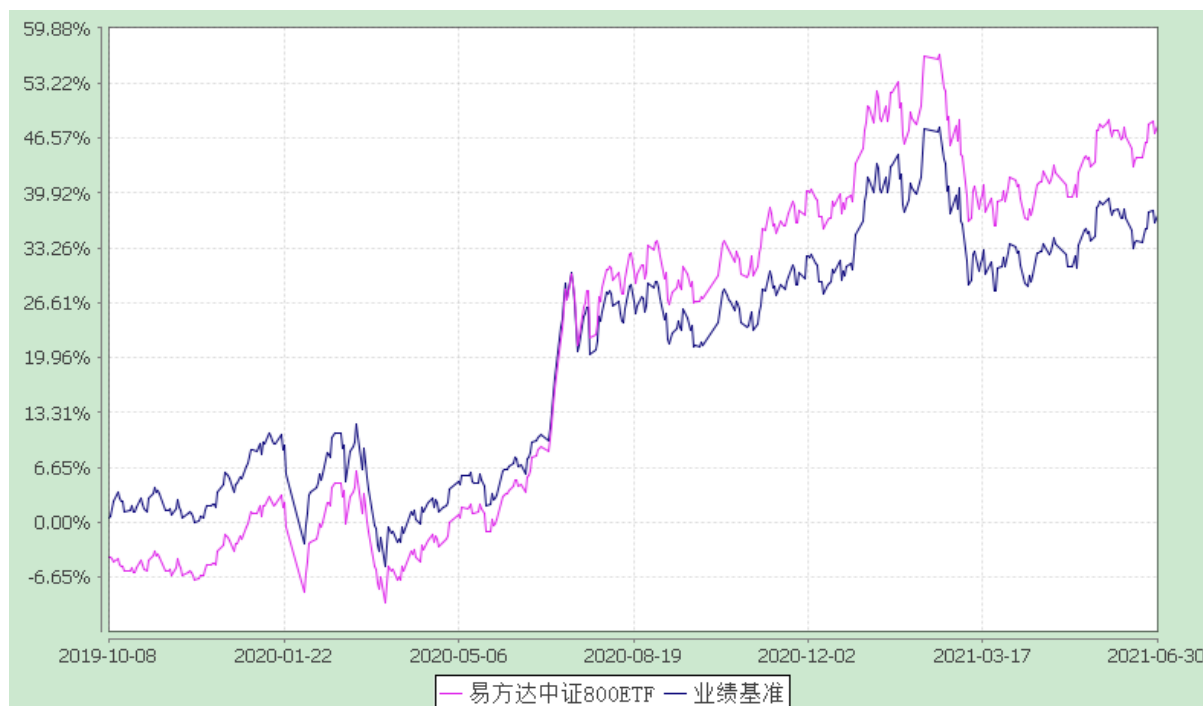
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.28%	0.76%	-1.30%	0.77%	1.02%	-0.01%
过去三个月	6.56%	0.88%	4.68%	0.88%	1.88%	0.00%
过去六个月	3.15%	1.20%	1.72%	1.21%	1.43%	-0.01%
过去一年	34.41%	1.28%	23.10%	1.28%	11.31%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	48.04%	1.31%	37.19%	1.31%	10.85%	0.00%

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 2021 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 48.04%，同期业绩比较基准收益率为 37.19%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易	2019-10-08	-	13 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量

	<p>方达上证 50 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员</p>			<p>化策略部副总经理、指数投资部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。</p>	
刘树荣	<p>本基金的基金经理、易方达中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证</p>	2019-10-08	-	14 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理。</p>

券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中小企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理				
---	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 15 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，兼具成长性与价值性，综合反映中国 A 股市场大中小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投资策略，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而进行相应调整。

中证 800 指数覆盖 A 股 28 个申万一级行业，由各行业市值排名靠前的上市公司组成，指数的二级市场表现主要受经济发展形势、市场流动性、投资者风险偏好等因素影响。2021 年上半年，国内股票市场分化显著。春节前，以大盘蓝筹为代表的机构重仓股涨幅较大，而以中证 1000 为代表的小市值股票却持续走低。春节后，大宗商品价格显著走强，通胀预期带来的名义利率上行对全球股票估值都构成了显著压力，市场风险偏好显著下降，国内股票市场出现大幅回调，前期剧烈的市场分化有所收敛。股票市场的整体下跌趋势直到一季度末才有所缓解，步入震荡区间。二季度，市场风险偏好有所修复，指数震荡上行，但结构分化依然明显。季初流动性宽松推动前期调整幅度较大的机构重仓股走出了一轮估值修复行情。5 月初开始，市场关注点逐步从流动性切换到企业盈利，市场风格从周期向成长切换。整体而言，2021 年上半年，电气设备、钢铁、化工行业表现强势，而家用电器、非银行金融、房地产行业表现较弱。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作。

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 1.4804 元，本报告期份额净值增长率为 3.15%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%，年化跟踪误差 0.68%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对国内经济高位回落的预期已有较长时间，但二季度 GDP 环比增速和复合增速均较一季度明显提升，6 月多数经济指标也偏强，指向当前经济总体仍偏强、总体不差。展望下半年经济增长虽然会放缓，但更多是回到疫情前正常的水平，实质性下行的迹象尚不明显，宏观经济仍将保持平稳运行。近年来，证券市场分化已成为一种常态，但市场上没有不变的热点，不变的只有风格切换

和行业轮动。中证 800 指数覆盖 A 股 28 个申万一级行业，代表国内证券市场的整体走势。作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，致力于为投资者提供分享经济增长的优质指数产品。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,477,434.99	5,578,664.43
结算备付金		1,204,729.96	1,173,990.72
存出保证金		759,228.00	961,608.70
交易性金融资产	6.4.7.2	86,775,202.23	95,689,141.38
其中：股票投资		86,728,683.87	95,633,541.62
基金投资		-	-
债券投资		46,518.36	55,599.76
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,127.25	1,864,899.25
应收利息	6.4.7.5	867.39	1,037.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		93,315,206.06	105,269,342.09
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,425,506.63
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,365.67	13,484.46
应付托管费		3,788.52	4,494.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,945.20	10,124.95
应交税费		17,815.18	12,924.12
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	144,260.15	599,885.74
负债合计		182,174.72	2,066,420.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	62,908,843.00	71,908,843.00
未分配利润	6.4.7.10	30,224,188.34	31,294,078.39
所有者权益合计		93,133,031.34	103,202,921.39
负债和所有者权益总计		93,315,206.06	105,269,342.09

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4804 元，基金份额总额 62,908,843.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		3,079,216.20	17,864,767.26
1.利息收入		18,871.55	46,114.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,826.61	45,982.73
债券利息收入		44.94	131.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,850,768.04	28,486,276.35

其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,640,377.35	27,264,398.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	25,646.33	216,550.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	531,475.73	-97,100.00
股利收益	6.4.7.15	653,268.63	1,102,427.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,751,411.57	-10,627,268.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-39,011.82	-40,355.14
减：二、费用		370,622.95	773,115.19
1. 管理人报酬		72,842.57	133,379.69
2. 托管费		24,280.79	44,459.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	36,401.31	343,913.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,913.35	0.40
7. 其他费用	6.4.7.19	235,184.93	251,361.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,708,593.25	17,091,652.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,708,593.25	17,091,652.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	71,908,843.00	31,294,078.39	103,202,921.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,708,593.25	2,708,593.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,000,000.00	-3,778,483.30	-12,778,483.30
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	5,562,533.53	17,562,533.53

2.基金赎回款	-21,000,000.00	-9,341,016.83	-30,341,016.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	62,908,843.00	30,224,188.34	93,133,031.34
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	401,908,843.00	-966,497.05	400,942,345.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,091,652.07	17,091,652.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-291,000,000.00	-4,876,636.94	-295,876,636.94
其中：1.基金申购款	171,000,000.00	-785,363.66	170,214,636.34
2.基金赎回款	-462,000,000.00	-4,091,273.28	-466,091,273.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	110,908,843.00	11,248,518.08	122,157,361.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有

关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,477,434.99
定期存款	-
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	-
合计	4,477,434.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	78,182,500.86	86,728,683.87	8,546,183.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,999.85	46,518.36
	银行间市场	-	-
	合计	44,999.85	46,518.36
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	78,227,500.71	86,775,202.23	8,547,701.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,459,220.00	-	-	-
IC2109	3,915,960.00	-	-	-
IF2109	1,543,260.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,459,220.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IC2109	IC2109	3	4,000,200.00	84,240.00
IF2109	IF2109	1	1,549,920.00	6,660.00
总额合计				90,900.00
减：可抵销期货暂收款				90,900.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	384.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	474.07
应收债券利息	3.36
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.31
合计	867.39

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,945.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,945.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	109,260.15
其他应付款	35,000.00
合计	144,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,908,843.00	71,908,843.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-21,000,000.00	-21,000,000.00
本期末	62,908,843.00	62,908,843.00

6.4.7.10 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	29,219,194.12	2,074,884.27	31,294,078.39
本期利润	6,460,004.82	-3,751,411.57	2,708,593.25
本期基金份额交易产生的变动数	-4,039,427.41	260,944.11	-3,778,483.30
其中：基金申购款	5,178,462.39	384,071.14	5,562,533.53
基金赎回款	-9,217,889.80	-123,127.03	-9,341,016.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,639,771.53	-1,415,583.19	30,224,188.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,391.30
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	8,213.41
其他	221.90
合计	18,826.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,789,671.91
股票投资收益——赎回差价收入	1,850,705.44
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,640,377.35

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,258,637.82
减：卖出股票成本总额	20,468,965.91
买卖股票差价收入	3,789,671.91

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

赎回基金份额对价总额	30,341,016.83
减：现金支付赎回款总额	12,582,137.83
减：赎回股票成本总额	15,908,173.56
赎回差价收入	1,850,705.44

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	359,592.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	333,897.78
减：应收利息总额	48.16
买卖债券差价收入	25,646.33

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	531,475.73

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	653,268.63
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	653,268.63

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-3,652,931.57
——股票投资	-3,654,450.08
——债券投资	1,518.51
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-98,480.00
——权证投资	-

——期货投资	-98,480.00
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	-3,751,411.57

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	-39,011.82
其他	-
合计	-39,011.82

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	36,401.31
银行间市场交易费用	-
合计	36,401.31

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,541.02
指数使用费	70,000.00
其他	84,300.75
合计	235,184.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
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
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	8,933,807.04	20.05%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	3,853.35	51.16%	3,384.81	68.45%
关联方名称	上年度可比期间			

	2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	72,842.57	133,379.69
其中：支付销售机构的客户维护费	286.44	416.26

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,280.79	44,459.89

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	32,932,279.00	52.3492%	33,012,358.00	45.9086%
广发证券	829,469.00	1.3185%	2,007,506.00	2.7917%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	4,477,434.99	10,391.30	6,812,715.90	33,517.20

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30
上年度可比期间					
2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：报告期内本基金参与了九丰能源首次公开发行的申购，此次发行的分销商广发证券股份有限公司为本基金管理人的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票建设银行。于2021年6月30日，本基金持有广发证券的A股的估值总额为人民币140,802.00元(2020年12月31日：175,824.00元)，持有中国建设银行的A股的估值总额为人民币139,650.00元(2020年12月31日：154,488.00元)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	300	29,999.87	29,999.87	-
113051	节能转债	2021-06-22	2021-07-22	新发流通受限	100.00	100.00	50	4,999.98	4,999.98	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新发流通受限	100.00	100.00	16	1,600.00	1,600.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新发流通受限	100.00	100.00	35	3,500.00	3,500.00	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	11,400	104,789.04	63,726.00	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	2,200	43,988.00	123,970.00	-
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项停牌	3.05	2021-07-14	3.36	8,300	32,576.03	25,315.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	30,001.97	50,003.73
AAA 以下	16,519.75	5,600.13
未评级	0.00	0.00
合计	46,521.72	55,603.86

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,477,434.99	-	-	-	4,477,434.99
结算备付金	1,204,729.96	-	-	-	1,204,729.96
存出保证金	759,228.00	-	-	-	759,228.00
交易性金融资产	-	-	46,518.36	86,728,683.87	86,775,202.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	22,127.25	22,127.25
应收利息	-	-	-	867.39	867.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	6,441,392.95	-	46,518.36	86,827,294.75	93,315,206.06
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	11,365.67	11,365.67
应付托管费	-	-	-	3,788.52	3,788.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,945.20	4,945.20
应交税费	-	-	-	17,815.18	17,815.18
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	144,260.15	144,260.15
负债总计	-	-	-	182,174.72	182,174.72
利率敏感度缺口	6,441,392.95	-	46,518.36	86,645,120.03	93,133,031.34

上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,578,664.43	-	-	-	5,578,664.43
结算备付金	1,173,990.72	-	-	-	1,173,990.72
存出保证金	961,608.70	-	-	-	961,608.70
交易性金融资产	-	-	55,599.76	95,633,541.62	95,689,141.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,864,899.25	1,864,899.25
应收利息	-	-	-	1,037.61	1,037.61
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,714,263.85	-	55,599.76	97,499,478.48	105,269,342.09
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,425,506.63	1,425,506.63
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	13,484.46	13,484.46
应付托管费	-	-	-	4,494.80	4,494.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,124.95	10,124.95
应交税费	-	-	-	12,924.12	12,924.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	599,885.74	599,885.74
负债总计	-	-	-	2,066,420.70	2,066,420.70
利率敏感度缺口	7,714,263.85	-	55,599.76	95,433,057.78	103,202,921.39

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	86,728,683.87	93.12	95,633,541.62	92.67
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	86,728,683.87	93.12	95,633,541.62	92.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	4,362,763.18	4,701,564.03
	2.业绩比较基准下降 5%	-4,362,763.18	-4,701,564.03

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 86,551,176.79 元，属于第二层次的余额为 224,025.44 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 93,403,648.83 元，第二层次 2,285,492.55 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	86,728,683.87	92.94
	其中：股票	86,728,683.87	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,518.36	0.05
	其中：债券	46,518.36	0.05
	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	5,682,164.95	6.09
8	其他各项资产	857,838.88	0.92
9	合计	93,315,206.06	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	873,719.00	0.94
B	采矿业	1,970,745.25	2.12
C	制造业	49,859,341.68	53.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,613,521.70	1.73
E	建筑业	1,143,216.44	1.23
F	批发和零售业	1,134,934.70	1.22

G	交通运输、仓储和邮政业	2,275,831.04	2.44
H	住宿和餐饮业	101,744.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,825,574.31	4.11
J	金融业	16,905,756.89	18.15
K	房地产业	1,965,348.30	2.11
L	租赁和商务服务业	1,470,348.00	1.58
M	科学研究和技术服务业	1,030,437.60	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	149,533.30	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	136,079.00	0.15
Q	卫生和社会工作	1,619,357.66	1.74
R	文化、体育和娱乐业	465,164.00	0.50
S	综合	188,031.00	0.20
	合计	86,728,683.87	93.12

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,000	4,113,400.00	4.42
2	601318	中国平安	34,100	2,191,948.00	2.35
3	600036	招商银行	38,915	2,108,803.85	2.26
4	000858	五粮液	6,200	1,846,918.00	1.98
5	601012	隆基股份	13,580	1,206,447.20	1.30
6	000333	美的集团	15,600	1,113,372.00	1.20
7	600276	恒瑞医药	14,120	959,736.40	1.03
8	002415	海康威视	14,600	941,700.00	1.01
9	601166	兴业银行	45,800	941,190.00	1.01
10	601888	中国中免	3,100	930,310.00	1.00
11	603259	药明康德	5,640	883,167.60	0.95
12	300059	东方财富	25,764	844,801.56	0.91
13	000651	格力电器	15,200	791,920.00	0.85
14	600900	长江电力	35,400	730,656.00	0.78
15	002594	比亚迪	2,900	727,900.00	0.78
16	002475	立讯精密	15,299	703,754.00	0.76
17	600887	伊利股份	19,035	701,059.05	0.75
18	000001	平安银行	30,300	685,386.00	0.74

19	600030	中信证券	26,600	663,404.00	0.71
20	000725	京东方 A	105,500	658,320.00	0.71
21	300015	爱尔眼科	8,467	600,987.66	0.65
22	000568	泸州老窖	2,400	566,256.00	0.61
23	601398	工商银行	109,200	564,564.00	0.61
24	603501	韦尔股份	1,700	547,400.00	0.59
25	600309	万华化学	5,000	544,100.00	0.58
26	600436	片仔癀	1,200	537,960.00	0.58
27	600031	三一重工	18,500	537,795.00	0.58
28	600809	山西汾酒	1,200	537,600.00	0.58
29	603288	海天味业	4,064	524,052.80	0.56
30	000002	万科 A	21,200	504,772.00	0.54
31	002714	牧原股份	8,240	501,156.80	0.54
32	300122	智飞生物	2,600	485,498.00	0.52
33	000661	长春高新	1,200	464,400.00	0.50
34	601919	中远海控	15,100	461,154.00	0.50
35	002142	宁波银行	11,300	440,361.00	0.47
36	601328	交通银行	85,600	419,440.00	0.45
37	601899	紫金矿业	43,100	417,639.00	0.45
38	002812	恩捷股份	1,700	397,970.00	0.43
39	002304	洋河股份	1,900	393,680.00	0.42
40	002352	顺丰控股	5,700	385,890.00	0.41
41	300274	阳光电源	3,300	379,698.00	0.41
42	002230	科大讯飞	5,600	378,448.00	0.41
43	300014	亿纬锂能	3,603	374,459.79	0.40
44	600763	通策医疗	900	369,900.00	0.40
45	600438	通威股份	8,500	367,795.00	0.39
46	600000	浦发银行	36,600	366,000.00	0.39
47	300124	汇川技术	4,850	360,161.00	0.39
48	600837	海通证券	30,100	346,150.00	0.37
49	000100	TCL 科技	43,700	334,305.00	0.36
50	601816	京沪高铁	62,700	331,683.00	0.36
51	300347	泰格医药	1,700	328,610.00	0.35
52	000063	中兴通讯	9,700	322,331.00	0.35
53	002241	歌尔股份	7,500	320,550.00	0.34
54	603986	兆易创新	1,696	318,678.40	0.34
55	002460	赣锋锂业	2,600	314,834.00	0.34
56	601601	中国太保	10,700	309,979.00	0.33
57	603799	华友钴业	2,700	308,340.00	0.33
58	600585	海螺水泥	7,500	307,875.00	0.33
59	600690	海尔智家	11,800	305,738.00	0.33
60	002371	北方华创	1,100	305,118.00	0.33
61	002271	东方雨虹	5,500	304,260.00	0.33
62	601668	中国建筑	65,300	303,645.00	0.33

63	300142	沃森生物	4,900	302,330.00	0.32
64	002027	分众传媒	32,000	301,120.00	0.32
65	600016	民生银行	66,300	292,383.00	0.31
66	600196	复星医药	3,800	274,094.00	0.29
67	601288	农业银行	89,500	271,185.00	0.29
68	600048	保利地产	22,400	269,696.00	0.29
69	600703	三安光电	8,400	269,220.00	0.29
70	000338	潍柴动力	14,800	264,476.00	0.28
71	600919	江苏银行	36,800	261,280.00	0.28
72	002129	中环股份	6,700	258,620.00	0.28
73	601688	华泰证券	16,100	254,380.00	0.27
74	601229	上海银行	31,000	254,200.00	0.27
75	600050	中国联通	58,000	250,560.00	0.27
76	600660	福耀玻璃	4,400	245,740.00	0.26
77	600570	恒生电子	2,630	245,247.50	0.26
78	600104	上汽集团	11,003	241,735.91	0.26
79	601211	国泰君安	14,100	241,674.00	0.26
80	600132	重庆啤酒	1,200	237,540.00	0.26
81	688111	金山办公	596	235,300.80	0.25
82	601766	中国中车	37,900	230,432.00	0.25
83	601169	北京银行	46,100	224,507.00	0.24
84	002821	凯莱英	600	223,560.00	0.24
85	600999	招商证券	11,640	221,392.80	0.24
86	002049	紫光国微	1,400	215,866.00	0.23
87	600019	宝钢股份	27,800	212,392.00	0.23
88	002311	海大集团	2,600	212,160.00	0.23
89	603486	科沃斯	900	205,272.00	0.22
90	002410	广联达	3,000	204,600.00	0.22
91	601988	中国银行	65,700	202,356.00	0.22
92	601088	中国神华	10,300	201,056.00	0.22
93	600406	国电南瑞	8,640	200,793.60	0.22
94	300498	温氏股份	13,960	200,605.20	0.22
95	300450	先导智能	3,300	198,462.00	0.21
96	000538	云南白药	1,700	196,724.00	0.21
97	601818	光大银行	51,500	194,670.00	0.21
98	600745	闻泰科技	2,005	194,284.50	0.21
99	300601	康泰生物	1,300	193,700.00	0.21
100	603882	金城医学	1,200	191,724.00	0.21
101	000625	长安汽车	7,100	186,588.00	0.20
102	600028	中国石化	41,700	181,812.00	0.20
103	600893	航发动力	3,400	180,846.00	0.19
104	000799	酒鬼酒	700	178,920.00	0.19
105	601628	中国人寿	5,200	176,228.00	0.19
106	300595	欧普康视	1,700	176,035.00	0.19

107	600346	恒力石化	6,600	173,184.00	0.19
108	601658	邮储银行	34,300	172,186.00	0.18
109	600588	用友网络	5,091	169,326.66	0.18
110	002709	天赐材料	1,570	167,330.60	0.18
111	601390	中国中铁	31,700	166,108.00	0.18
112	601633	长城汽车	3,800	165,642.00	0.18
113	601009	南京银行	15,600	164,112.00	0.18
114	002493	荣盛石化	9,500	164,065.00	0.18
115	601377	兴业证券	16,700	161,322.00	0.17
116	601857	中国石油	30,300	160,287.00	0.17
117	300413	芒果超媒	2,300	157,780.00	0.17
118	600009	上海机场	3,100	149,203.00	0.16
119	002841	视源股份	1,200	149,148.00	0.16
120	601225	陕西煤业	12,535	148,539.75	0.16
121	600584	长电科技	3,900	146,952.00	0.16
122	601100	恒立液压	1,696	145,720.32	0.16
123	002601	龙蟠佰利	4,200	145,236.00	0.16
124	300408	三环集团	3,400	144,228.00	0.15
125	600426	华鲁恒升	4,640	143,608.00	0.15
126	002179	中航光电	1,800	142,236.00	0.15
127	688012	中微公司	851	141,197.92	0.15
128	000776	广发证券	9,300	140,802.00	0.15
129	600111	北方稀土	6,800	140,760.00	0.15
130	002001	新和成	4,880	139,958.40	0.15
131	000895	双汇发展	4,400	139,920.00	0.15
132	601939	建设银行	21,000	139,650.00	0.15
133	600600	青岛啤酒	1,200	138,780.00	0.15
134	300433	蓝思科技	4,700	138,227.00	0.15
135	600926	杭州银行	9,300	137,175.00	0.15
136	603806	福斯特	1,296	136,248.48	0.15
137	601799	星宇股份	600	135,432.00	0.15
138	002050	三花智控	5,600	134,288.00	0.14
139	600089	特变电工	10,400	133,640.00	0.14
140	688036	传音控股	636	133,242.00	0.14
141	000009	中国宝安	7,200	131,544.00	0.14
142	000166	申万宏源	28,100	131,508.00	0.14
143	600741	华域汽车	5,000	131,350.00	0.14
144	600958	东方证券	13,100	130,869.00	0.14
145	603160	汇顶科技	1,000	129,630.00	0.14
146	002340	格林美	13,800	129,030.00	0.14
147	000963	华东医药	2,800	128,828.00	0.14
148	300003	乐普医疗	4,000	128,480.00	0.14
149	002007	华兰生物	3,480	127,646.40	0.14
150	002074	国轩高科	2,900	126,324.00	0.14

151	000786	北新建材	3,200	125,600.00	0.13
152	600460	士兰微	2,200	123,970.00	0.13
153	002607	中公教育	5,900	123,251.00	0.13
154	603737	三棵树	700	123,200.00	0.13
155	000157	中联重科	13,300	122,892.00	0.13
156	601006	大秦铁路	18,600	122,388.00	0.13
157	601901	方正证券	12,900	120,744.00	0.13
158	601155	新城控股	2,898	120,556.80	0.13
159	300037	新宙邦	1,200	120,120.00	0.13
160	000596	古井贡酒	500	119,750.00	0.13
161	601336	新华保险	2,600	119,366.00	0.13
162	600143	金发科技	5,700	118,902.00	0.13
163	600015	华夏银行	19,200	118,848.00	0.13
164	600760	中航沈飞	1,960	118,188.00	0.13
165	002236	大华股份	5,600	118,160.00	0.13
166	601989	中国重工	28,400	117,008.00	0.13
167	600176	中国巨石	7,501	116,340.51	0.12
168	000768	中航西飞	4,400	115,632.00	0.12
169	601138	工业富联	9,300	115,413.00	0.12
170	603993	洛阳钼业	22,000	113,520.00	0.12
171	601877	正泰电器	3,400	113,492.00	0.12
172	600352	浙江龙盛	8,200	112,668.00	0.12
173	300529	健帆生物	1,300	112,268.00	0.12
174	300285	国瓷材料	2,300	112,125.00	0.12
175	600010	包钢股份	71,000	110,050.00	0.12
176	600547	山东黄金	5,700	109,554.00	0.12
177	601788	光大证券	6,100	109,129.00	0.12
178	002008	大族激光	2,700	109,053.00	0.12
179	001979	招商蛇口	9,900	108,405.00	0.12
179	601233	桐昆股份	4,500	108,405.00	0.12
181	603369	今世缘	2,000	108,320.00	0.12
182	601600	中国铝业	20,400	108,120.00	0.12
183	601186	中国铁建	14,400	106,992.00	0.11
184	603444	吉比特	200	106,000.00	0.11
185	002202	金风科技	8,600	104,576.00	0.11
186	601916	浙商银行	26,300	104,411.00	0.11
187	000876	新希望	7,100	104,157.00	0.11
188	603833	欧派家居	722	102,495.12	0.11
189	300033	同花顺	900	101,502.00	0.11
190	603899	晨光文具	1,200	101,472.00	0.11
191	603517	绝味食品	1,200	101,148.00	0.11
192	600779	水井坊	800	101,080.00	0.11
193	300207	欣旺达	3,100	100,936.00	0.11
194	002555	三七互娱	4,200	100,884.00	0.11

195	300677	英科医疗	800	99,840.00	0.11
196	601636	旗滨集团	5,300	98,368.00	0.11
197	003816	中国广核	36,800	98,256.00	0.11
198	000938	紫光股份	4,480	98,022.40	0.11
199	601066	中信建投	3,100	97,433.00	0.10
200	300558	贝达药业	900	97,416.00	0.10
201	002736	国信证券	9,000	96,750.00	0.10
202	600109	国金证券	7,600	96,444.00	0.10
203	600989	宝丰能源	7,000	95,760.00	0.10
204	300136	信维通信	3,100	95,728.00	0.10
205	603659	璞泰来	700	95,620.00	0.10
206	002916	深南电路	860	95,571.80	0.10
207	000069	华侨城 A	12,800	95,232.00	0.10
208	600563	法拉电子	600	95,016.00	0.10
209	300676	华大基因	800	94,880.00	0.10
210	600150	中国船舶	5,700	94,107.00	0.10
211	600885	宏发股份	1,500	94,050.00	0.10
212	002185	华天科技	6,100	93,879.00	0.10
213	000425	徐工机械	14,700	93,639.00	0.10
214	688008	澜起科技	1,484	92,571.92	0.10
215	601669	中国电建	23,900	92,493.00	0.10
216	688099	晶晨股份	818	91,779.60	0.10
217	300699	光威复材	1,200	91,140.00	0.10
218	300253	卫宁健康	5,600	91,112.00	0.10
219	300316	晶盛机电	1,800	90,900.00	0.10
220	000977	浪潮信息	3,200	90,016.00	0.10
221	600085	同仁堂	2,200	89,870.00	0.10
222	002384	东山精密	4,300	89,612.00	0.10
223	600795	国电电力	36,800	89,424.00	0.10
224	600486	扬农化工	800	89,416.00	0.10
225	601238	广汽集团	6,900	89,355.00	0.10
226	603019	中科曙光	3,220	88,904.20	0.10
227	000783	长江证券	12,100	88,572.00	0.10
228	688002	睿创微纳	885	88,349.55	0.09
229	600079	人福医药	3,100	87,637.00	0.09
230	002624	完美世界	3,650	87,271.50	0.09
231	601838	成都银行	6,800	85,952.00	0.09
232	600183	生益科技	3,600	84,276.00	0.09
233	300144	宋城演艺	4,980	83,664.00	0.09
234	600886	国投电力	8,700	83,607.00	0.09
235	600029	南方航空	13,800	83,076.00	0.09
236	601985	中国核电	16,400	82,984.00	0.09
237	601108	财通证券	7,900	82,871.00	0.09
238	000703	恒逸石化	6,890	82,335.50	0.09

239	601360	三六零	6,700	81,807.00	0.09
240	601555	东吴证券	9,760	81,398.40	0.09
241	603589	口子窖	1,200	81,228.00	0.09
242	002414	高德红外	2,936	80,974.88	0.09
243	600733	北汽蓝谷	6,000	80,880.00	0.09
244	002600	领益智造	8,800	80,872.00	0.09
245	300223	北京君正	800	80,736.00	0.09
246	000066	中国长城	5,500	80,300.00	0.09
247	601127	小康股份	1,200	80,004.00	0.09
248	300146	汤臣倍健	2,400	78,960.00	0.08
249	002938	鹏鼎控股	2,200	78,936.00	0.08
250	002252	上海莱士	10,500	78,645.00	0.08
251	002044	美年健康	8,600	78,346.00	0.08
252	601077	渝农商行	19,600	78,204.00	0.08
253	688396	华润微	854	77,731.08	0.08
254	600522	中天科技	7,700	77,000.00	0.08
255	002625	光启技术	3,700	76,997.00	0.08
256	002223	鱼跃医疗	2,000	76,260.00	0.08
257	601607	上海医药	3,600	76,068.00	0.08
258	600161	天坛生物	2,220	76,035.00	0.08
259	000728	国元证券	9,540	76,033.80	0.08
260	002648	卫星石化	1,940	76,028.60	0.08
261	600872	中炬高新	1,800	75,636.00	0.08
262	300628	亿联网络	900	75,420.00	0.08
263	600884	杉杉股份	3,220	75,090.40	0.08
264	002602	世纪华通	11,660	74,857.20	0.08
265	600332	白云山	2,200	74,470.00	0.08
266	600845	宝信软件	1,460	74,314.00	0.08
267	600362	江西铜业	3,300	73,854.00	0.08
268	300308	中际旭创	1,900	73,188.00	0.08
269	601111	中国国航	9,400	73,132.00	0.08
270	600383	金地集团	7,100	72,704.00	0.08
271	603392	万泰生物	280	72,570.40	0.08
272	002439	启明星辰	2,500	72,525.00	0.08
273	600315	上海家化	1,200	72,168.00	0.08
274	600219	南山铝业	20,000	72,000.00	0.08
275	000860	顺鑫农业	1,700	71,706.00	0.08
276	002353	杰瑞股份	1,600	71,520.00	0.08
277	601800	中国交建	11,000	71,280.00	0.08
278	600115	中国东航	14,000	71,120.00	0.08
279	002422	科伦药业	3,500	69,825.00	0.07
280	002138	顺络电子	1,800	69,786.00	0.07
281	002508	老板电器	1,500	69,750.00	0.07
282	603893	瑞芯微	500	69,730.00	0.07

283	002212	天融信	3,500	69,195.00	0.07
284	002797	第一创业	9,600	68,544.00	0.07
285	600754	锦江酒店	1,200	68,340.00	0.07
286	600536	中国软件	1,200	68,316.00	0.07
287	601021	春秋航空	1,200	68,280.00	0.07
288	000988	华工科技	2,900	68,208.00	0.07
289	002444	巨星科技	2,000	68,160.00	0.07
290	600061	国投资本	8,004	67,953.96	0.07
291	000547	航天发展	3,600	67,932.00	0.07
292	601727	上海电气	16,000	67,840.00	0.07
293	002180	纳思达	2,100	67,620.00	0.07
294	603939	益丰药房	1,200	67,308.00	0.07
295	000708	中信特钢	3,200	66,688.00	0.07
296	601618	中国中冶	22,300	66,454.00	0.07
297	601162	天风证券	13,510	65,658.60	0.07
298	601117	中国化学	7,400	64,824.00	0.07
299	688363	华熙生物	233	64,741.38	0.07
300	600705	中航资本	16,700	64,629.00	0.07
301	601099	太平洋	19,000	64,410.00	0.07
302	000807	云铝股份	5,400	64,260.00	0.07
303	601878	浙商证券	4,900	64,092.00	0.07
304	603290	斯达半导	200	64,000.00	0.07
305	002385	大北农	9,400	63,920.00	0.07
306	600704	物产中大	8,100	63,747.00	0.07
307	002024	苏宁易购	11,400	63,726.00	0.07
308	600038	中直股份	1,200	63,288.00	0.07
309	601168	西部矿业	5,300	63,229.00	0.07
310	002127	南极电商	6,400	62,528.00	0.07
311	600068	葛洲坝	8,300	62,167.00	0.07
312	600606	绿地控股	11,400	62,130.00	0.07
313	600862	中航高科	2,000	61,560.00	0.07
314	600739	辽宁成大	2,950	61,389.50	0.07
315	601990	南京证券	5,800	61,016.00	0.07
316	603195	公牛集团	300	60,600.00	0.07
317	600521	华海药业	2,900	60,552.00	0.07
318	002456	欧菲光	6,800	60,384.00	0.06
319	000830	鲁西化工	3,200	59,936.00	0.06
320	000513	丽珠集团	1,183	59,173.66	0.06
321	603658	安图生物	780	59,100.60	0.06
322	600392	盛和资源	3,400	59,024.00	0.06
323	603605	珀莱雅	300	59,013.00	0.06
324	300630	普利制药	1,126	59,002.40	0.06
325	002030	达安基因	2,776	58,962.24	0.06
326	002463	沪电股份	3,800	58,786.00	0.06

327	300474	景嘉微	600	58,752.00	0.06
328	002078	太阳纸业	4,400	58,740.00	0.06
329	600699	均胜电子	2,300	58,696.00	0.06
330	002250	联化科技	2,100	58,590.00	0.06
331	002157	正邦科技	4,900	58,555.00	0.06
332	000656	金科股份	10,000	57,900.00	0.06
333	600011	华能国际	13,700	57,814.00	0.06
334	300088	长信科技	6,900	56,994.00	0.06
335	600988	赤峰黄金	3,800	56,962.00	0.06
336	600655	豫园股份	4,900	56,791.00	0.06
337	002507	涪陵榨菜	1,500	56,490.00	0.06
338	601933	永辉超市	11,900	56,287.00	0.06
339	600201	生物股份	3,200	55,840.00	0.06
340	000630	铜陵有色	20,500	55,760.00	0.06
341	600118	中国卫星	1,900	55,594.00	0.06
342	601696	中银证券	2,700	55,593.00	0.06
343	601995	中金公司	900	55,350.00	0.06
344	300618	寒锐钴业	700	55,188.00	0.06
345	600177	雅戈尔	8,368	55,145.12	0.06
346	600848	上海临港	3,067	54,899.30	0.06
347	002075	沙钢股份	5,000	54,550.00	0.06
348	000039	中集集团	3,000	54,540.00	0.06
349	002013	中航机电	5,400	54,378.00	0.06
350	300001	特锐德	1,800	54,198.00	0.06
351	601216	君正集团	10,600	53,954.00	0.06
352	600489	中金黄金	6,100	52,582.00	0.06
353	002299	圣农发展	2,200	52,536.00	0.06
354	002511	中顺洁柔	1,900	52,345.00	0.06
355	002028	思源电气	1,700	52,343.00	0.06
356	603638	艾迪精密	1,220	52,301.40	0.06
357	600018	上港集团	10,900	51,993.00	0.06
358	002557	洽洽食品	1,200	51,720.00	0.06
359	000021	深科技	2,700	51,678.00	0.06
360	601997	贵阳银行	7,200	51,552.00	0.06
361	300357	我武生物	800	51,296.00	0.06
362	600066	宇通客车	4,100	51,209.00	0.05
363	300168	万达信息	3,500	51,100.00	0.05
364	000050	深天马 A	3,600	51,048.00	0.05
365	601005	重庆钢铁	19,100	50,997.00	0.05
366	600637	东方明珠	6,200	50,778.00	0.05
367	002558	巨人网络	3,800	50,540.00	0.05
368	300463	迈克生物	1,200	50,508.00	0.05
369	300383	光环新网	3,500	50,365.00	0.05
370	603707	健友股份	1,200	50,100.00	0.05

371	002120	韵达股份	3,700	50,061.00	0.05
372	600549	厦门钨业	2,400	49,992.00	0.05
373	000739	普洛药业	1,700	49,980.00	0.05
374	002273	水晶光电	3,400	49,946.00	0.05
375	300482	万孚生物	770	49,811.30	0.05
376	300244	迪安诊断	1,300	49,790.00	0.05
377	002080	中材科技	1,900	49,723.00	0.05
378	002603	以岭药业	1,700	49,572.00	0.05
379	603338	浙江鼎力	840	49,299.60	0.05
380	002092	中泰化学	4,800	49,296.00	0.05
381	002465	海格通信	5,200	49,192.00	0.05
382	000723	美锦能源	6,500	49,140.00	0.05
383	600487	亨通光电	4,300	49,020.00	0.05
384	601998	中信银行	9,600	48,960.00	0.05
385	603198	迎驾贡酒	1,100	48,730.00	0.05
386	600369	西南证券	10,000	48,700.00	0.05
387	600171	上海贝岭	1,600	48,688.00	0.05
388	601689	拓普集团	1,300	48,659.00	0.05
389	002065	东华软件	6,100	48,373.00	0.05
390	000998	隆平高科	3,000	48,120.00	0.05
391	000825	太钢不锈	6,400	47,936.00	0.05
392	300009	安科生物	3,216	47,918.40	0.05
393	600867	通化东宝	4,000	47,760.00	0.05
394	601128	常熟银行	7,700	47,740.00	0.05
395	600529	山东药玻	1,400	47,530.00	0.05
396	600516	方大炭素	6,360	47,318.40	0.05
397	000983	山西焦煤	5,690	47,283.90	0.05
398	603927	中科软	1,100	47,245.00	0.05
399	601615	明阳智能	2,900	46,951.00	0.05
400	000932	华菱钢铁	7,100	46,860.00	0.05
401	688126	沪硅产业	1,603	46,775.54	0.05
402	002373	千方科技	2,800	46,760.00	0.05
403	601872	招商轮船	10,080	46,569.60	0.05
404	600827	百联股份	2,300	46,345.00	0.05
405	688009	中国通号	8,141	46,322.29	0.05
406	601319	中国人保	7,800	46,254.00	0.05
407	002673	西部证券	5,600	46,200.00	0.05
407	300271	华宇软件	2,400	46,200.00	0.05
409	600316	洪都航空	1,200	46,176.00	0.05
410	603260	合盛硅业	600	46,146.00	0.05
411	600418	江淮汽车	3,700	45,991.00	0.05
412	601198	东兴证券	4,200	45,906.00	0.05
413	600879	航天电子	6,100	45,872.00	0.05
414	603156	养元饮品	1,600	45,728.00	0.05

415	002156	通富微电	1,900	45,676.00	0.05
416	002152	广电运通	3,500	45,605.00	0.05
417	300296	利亚德	5,800	45,356.00	0.05
418	300070	碧水源	6,200	45,322.00	0.05
419	600380	健康元	3,300	45,309.00	0.05
420	000750	国海证券	10,680	45,283.20	0.05
421	688088	虹软科技	807	44,990.25	0.05
422	000960	锡业股份	2,800	44,884.00	0.05
423	002032	苏泊尔	700	44,653.00	0.05
424	002690	美亚光电	800	44,608.00	0.05
425	600998	九州通	2,900	44,573.00	0.05
426	000975	银泰黄金	4,660	44,316.60	0.05
427	600271	航天信息	3,400	44,302.00	0.05
428	603883	老百姓	840	44,251.20	0.05
429	600909	华安证券	7,940	44,225.80	0.05
430	002739	万达电影	2,800	44,212.00	0.05
431	601881	中国银河	4,100	44,198.00	0.05
432	600166	福田汽车	12,800	44,160.00	0.05
433	002131	利欧股份	18,800	43,992.00	0.05
434	002572	索菲亚	1,800	43,560.00	0.05
435	002926	华西证券	4,500	43,335.00	0.05
436	603712	七一二	1,200	43,320.00	0.05
437	300115	长盈精密	2,080	42,848.00	0.05
438	600642	申能股份	6,900	42,366.00	0.05
439	601866	中远海发	11,100	41,625.00	0.04
440	600707	彩虹股份	4,400	41,404.00	0.04
441	300251	光线传媒	3,800	41,078.00	0.04
442	603233	大参林	800	40,888.00	0.04
443	600390	五矿资本	6,800	40,664.00	0.04
444	000623	吉林敖东	2,600	40,274.00	0.04
445	600895	张江高科	2,200	40,194.00	0.04
446	002500	山西证券	5,990	40,192.90	0.04
447	601699	潞安环能	3,400	40,154.00	0.04
448	600233	圆通速递	4,000	40,040.00	0.04
449	000012	南玻 A	3,900	39,936.00	0.04
450	002925	盈趣科技	1,020	39,688.20	0.04
451	600511	国药股份	1,200	39,672.00	0.04
452	600415	小商品城	7,700	39,655.00	0.04
453	002294	信立泰	1,200	39,480.00	0.04
454	600208	新湖中宝	12,900	39,216.00	0.04
455	600498	烽火通信	2,100	39,123.00	0.04
456	002242	九阳股份	1,200	38,988.00	0.04
457	600153	建发股份	4,800	38,880.00	0.04
458	600663	陆家嘴	2,900	38,628.00	0.04

459	600535	天士力	2,600	38,506.00	0.04
460	603650	彤程新材	800	38,480.00	0.04
461	600188	兖州煤业	2,500	38,400.00	0.04
462	600497	驰宏锌锗	8,800	37,928.00	0.04
463	002146	荣盛发展	6,700	37,788.00	0.04
464	300418	昆仑万维	2,300	37,674.00	0.04
465	600141	兴发集团	2,000	37,660.00	0.04
466	688321	微芯生物	815	37,644.85	0.04
467	600256	广汇能源	11,300	37,629.00	0.04
468	002670	国盛金控	3,300	37,587.00	0.04
469	600732	爱旭股份	2,700	37,584.00	0.04
470	002382	蓝帆医疗	1,800	37,530.00	0.04
471	603866	桃李面包	1,200	37,440.00	0.04
472	300024	机器人	3,500	37,345.00	0.04
473	600667	太极实业	4,100	37,310.00	0.04
474	000027	深圳能源	4,060	37,230.20	0.04
475	000878	云南铜业	2,900	37,207.00	0.04
476	002372	伟星新材	1,800	37,206.00	0.04
477	600060	海信视像	2,200	37,180.00	0.04
478	600008	首创环保	12,250	36,872.50	0.04
479	600482	中国动力	2,100	36,582.00	0.04
480	600372	中航电子	2,200	36,410.00	0.04
481	600155	华创阳安	3,400	36,380.00	0.04
482	600765	中航重机	1,600	36,240.00	0.04
483	002019	亿帆医药	2,100	36,225.00	0.04
484	002221	东华能源	3,300	36,135.00	0.04
485	002683	宏大爆破	1,300	36,101.00	0.04
486	002174	游族网络	2,100	36,057.00	0.04
487	603858	步长制药	1,600	35,984.00	0.04
488	002958	青农商行	8,400	35,952.00	0.04
489	000718	苏宁环球	4,300	35,647.00	0.04
490	002831	裕同科技	1,200	35,628.00	0.04
491	600409	三友化工	3,500	35,385.00	0.04
492	601231	环旭电子	2,100	35,301.00	0.04
493	002153	石基信息	1,500	35,265.00	0.04
494	000997	新大陆	2,100	34,839.00	0.04
495	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
496	600859	王府井	1,200	34,656.00	0.04
497	002390	信邦制药	3,300	34,584.00	0.04
498	000401	冀东水泥	2,800	34,580.00	0.04
499	002966	苏州银行	4,700	34,545.00	0.04
500	603225	新凤鸣	1,700	34,510.00	0.04
501	600170	上海建工	12,400	34,224.00	0.04
502	002506	协鑫集成	9,800	34,104.00	0.04

503	600875	东方电气	3,100	34,007.00	0.04
504	300058	蓝色光标	5,600	33,880.00	0.04
505	000686	东北证券	4,000	33,800.00	0.04
506	000961	中南建设	5,700	33,744.00	0.04
507	601717	郑煤机	2,900	33,727.00	0.04
508	600027	华电国际	9,800	33,712.00	0.04
509	600329	中新药业	1,200	33,708.00	0.04
510	600160	巨化股份	3,800	33,592.00	0.04
511	000800	一汽解放	3,100	33,542.00	0.04
512	002408	齐翔腾达	2,700	33,534.00	0.04
513	600258	首旅酒店	1,400	33,404.00	0.04
514	600801	华新水泥	1,900	33,383.00	0.04
515	000738	航发控制	1,600	33,328.00	0.04
516	601016	节能风电	8,900	33,286.00	0.04
517	688208	道通科技	382	33,230.18	0.04
518	002985	北摩高科	340	33,150.00	0.04
519	002268	卫士通	1,700	33,116.00	0.04
520	601577	长沙银行	3,700	33,078.00	0.04
521	600025	华能水电	5,700	33,003.00	0.04
522	000671	阳光城	6,300	32,760.00	0.04
523	300315	掌趣科技	7,700	32,725.00	0.04
524	002195	二三四五	16,000	32,480.00	0.03
525	600325	华发股份	4,800	32,352.00	0.03
526	300212	易华录	1,200	32,292.00	0.03
527	002939	长城证券	2,900	32,277.00	0.03
528	300017	网宿科技	5,500	32,175.00	0.03
529	600340	华夏幸福	6,130	32,121.20	0.03
530	000999	华润三九	1,200	32,100.00	0.03
531	002595	豪迈科技	1,200	32,040.00	0.03
532	603087	甘李药业	300	31,974.00	0.03
533	000540	中天金融	11,700	31,941.00	0.03
534	002191	劲嘉股份	3,000	31,920.00	0.03
535	000060	中金岭南	7,000	31,640.00	0.03
536	002705	新宝股份	1,200	31,500.00	0.03
537	600803	新奥股份	1,900	31,369.00	0.03
538	601992	金隅集团	11,600	31,204.00	0.03
539	601236	红塔证券	2,300	31,188.00	0.03
540	600567	山鹰国际	9,000	31,050.00	0.03
541	000158	常山北明	2,700	31,023.00	0.03
542	002429	兆驰股份	5,100	30,957.00	0.03
543	603077	和邦生物	14,800	30,784.00	0.03
544	600528	中铁工业	3,800	30,780.00	0.03
545	600500	中化国际	3,900	30,654.00	0.03
546	600282	南钢股份	8,600	30,616.00	0.03

547	600216	浙江医药	1,900	30,419.00	0.03
548	600737	中粮糖业	3,000	30,030.00	0.03
549	600839	四川长虹	10,300	29,973.00	0.03
550	600598	北大荒	2,000	29,920.00	0.03
551	002056	横店东磁	2,300	29,900.00	0.03
552	000898	鞍钢股份	6,700	29,815.00	0.03
553	002203	海亮股份	2,800	29,792.00	0.03
554	002124	天邦股份	4,240	29,722.40	0.03
555	002867	周大生	1,500	29,655.00	0.03
556	600728	佳都科技	4,000	29,640.00	0.03
557	002281	光迅科技	1,200	29,520.00	0.03
558	002081	金螳螂	3,700	29,304.00	0.03
559	600580	卧龙电驱	2,200	29,260.00	0.03
560	000581	威孚高科	1,400	29,162.00	0.03
561	000709	河钢股份	11,800	29,028.00	0.03
562	000729	燕京啤酒	4,000	28,960.00	0.03
563	300182	捷成股份	5,800	28,942.00	0.03
564	002387	维信诺	2,765	28,838.95	0.03
565	000930	中粮科技	3,200	28,832.00	0.03
566	600808	马钢股份	6,700	28,743.00	0.03
567	002010	传化智联	3,700	28,527.00	0.03
568	000488	晨鸣纸业	3,500	28,490.00	0.03
569	300166	东方国信	2,300	28,428.00	0.03
570	002745	木林森	2,100	28,140.00	0.03
571	600820	隧道股份	5,300	28,037.00	0.03
572	002004	华邦健康	4,500	27,945.00	0.03
573	603228	景旺电子	1,060	27,772.00	0.03
574	002773	康弘药业	1,200	27,756.00	0.03
575	002396	星网锐捷	1,300	27,755.00	0.03
576	603568	伟明环保	1,210	27,624.30	0.03
577	600645	中源协和	1,200	27,540.00	0.03
578	603000	人民网	1,600	27,504.00	0.03
579	002563	森马服饰	2,300	27,485.00	0.03
580	000629	攀钢钒钛	12,000	27,480.00	0.03
581	600729	重庆百货	1,000	27,450.00	0.03
582	002048	宁波华翔	1,400	27,300.00	0.03
583	601808	中海油服	1,900	27,284.00	0.03
584	600259	广晟有色	800	27,048.00	0.03
585	600037	歌华有线	2,800	26,908.00	0.03
586	300002	神州泰岳	5,500	26,675.00	0.03
587	600970	中材国际	2,900	26,593.00	0.03
588	600022	山东钢铁	15,300	26,316.00	0.03
589	600755	厦门国贸	3,200	26,272.00	0.03
590	601456	国联证券	1,700	26,180.00	0.03

591	601106	中国一重	7,700	26,103.00	0.03
592	600398	海澜之家	3,600	26,064.00	0.03
593	000598	兴蓉环境	5,000	26,050.00	0.03
594	600918	中泰证券	2,400	25,968.00	0.03
595	603885	吉祥航空	1,700	25,942.00	0.03
596	002002	鸿达兴业	6,600	25,938.00	0.03
596	600597	光明乳业	1,800	25,938.00	0.03
598	600881	亚泰集团	9,100	25,935.00	0.03
599	002368	太极股份	1,280	25,676.80	0.03
600	000887	中鼎股份	2,100	25,368.00	0.03
601	600811	东方集团	8,300	25,315.00	0.03
602	000883	湖北能源	5,500	25,245.00	0.03
603	600348	华阳股份	3,400	25,228.00	0.03
604	002249	大洋电机	4,800	25,200.00	0.03
605	600126	杭钢股份	4,900	25,137.00	0.03
606	600782	新钢股份	4,500	25,110.00	0.03
607	000690	宝新能源	4,900	25,039.00	0.03
608	601880	辽港股份	14,600	24,966.00	0.03
609	000778	新兴铸管	6,700	24,924.00	0.03
610	603355	莱克电气	400	24,892.00	0.03
611	600260	凯乐科技	2,800	24,864.00	0.03
612	003035	南网能源	2,500	24,850.00	0.03
613	002701	奥瑞金	4,800	24,672.00	0.03
614	600718	东软集团	2,500	24,450.00	0.03
615	601118	海南橡胶	4,800	24,432.00	0.03
616	600985	淮北矿业	2,000	24,420.00	0.03
617	600908	无锡银行	4,200	24,360.00	0.03
618	600967	内蒙一机	2,400	24,288.00	0.03
619	002085	万丰奥威	4,300	24,080.00	0.03
620	002183	怡亚通	4,200	24,066.00	0.03
621	600410	华胜天成	3,100	24,056.00	0.03
622	600026	中远海能	3,900	24,024.00	0.03
623	600517	国网英大	3,500	23,835.00	0.03
624	600039	四川路桥	3,800	23,826.00	0.03
625	000528	柳工	2,900	23,780.00	0.03
626	002110	三钢闽光	3,500	23,590.00	0.03
627	601179	中国西电	5,700	23,484.00	0.03
628	000877	天山股份	1,800	23,454.00	0.03
629	600064	南京高科	2,500	23,225.00	0.02
630	600167	联美控股	2,600	23,218.00	0.02
631	605358	立昂微	200	23,116.00	0.02
632	600446	金证股份	1,600	23,104.00	0.02
633	600572	康恩贝	5,200	23,088.00	0.02
634	000402	金融街	3,400	22,950.00	0.02

635	000970	中科三环	2,400	22,920.00	0.02
636	000990	诚志股份	1,800	22,914.00	0.02
637	002128	露天煤业	2,200	22,902.00	0.02
638	601200	上海环境	1,900	22,743.00	0.02
639	000028	国药一致	600	22,704.00	0.02
640	601698	中国卫通	1,400	22,666.00	0.02
641	000089	深圳机场	2,900	22,533.00	0.02
642	002266	浙富控股	4,500	22,455.00	0.02
643	000869	张裕 A	600	22,284.00	0.02
644	601598	中国外运	4,400	22,220.00	0.02
645	600158	中体产业	1,900	21,679.00	0.02
646	300026	红日药业	5,100	21,675.00	0.02
647	000400	许继电气	1,700	21,522.00	0.02
648	601718	际华集团	7,600	21,432.00	0.02
649	601991	大唐发电	8,100	21,384.00	0.02
650	600095	湘财股份	1,800	21,078.00	0.02
651	600120	浙江东方	4,904	20,989.12	0.02
652	600507	方大特钢	3,091	20,956.98	0.02
653	300376	易事特	2,600	20,904.00	0.02
654	000959	首钢股份	3,700	20,794.00	0.02
655	600195	中牧股份	1,736	20,762.56	0.02
656	601975	招商南油	9,700	20,758.00	0.02
657	001914	招商积余	1,200	20,616.00	0.02
658	002505	鹏都农牧	9,200	20,608.00	0.02
659	002233	塔牌集团	2,000	20,560.00	0.02
660	603317	天味食品	696	20,483.28	0.02
661	000090	天健集团	3,700	20,461.00	0.02
662	000685	中山公用	2,500	20,400.00	0.02
663	002440	闰土股份	2,300	20,355.00	0.02
664	000062	深圳华强	1,200	20,292.00	0.02
665	300741	华宝股份	400	20,288.00	0.02
666	600307	酒钢宏兴	8,700	20,184.00	0.02
667	600376	首开股份	3,600	20,160.00	0.02
668	601333	广深铁路	9,500	20,140.00	0.02
669	601000	唐山港	8,300	20,003.00	0.02
670	600435	北方导航	2,500	19,850.00	0.02
671	000559	万向钱潮	3,700	19,647.00	0.02
672	002839	张家港行	3,600	19,584.00	0.02
673	600643	爱建集团	2,800	19,544.00	0.02
674	600835	上海机电	1,200	19,500.00	0.02
675	600804	鹏博士	4,000	19,360.00	0.02
676	002399	海普瑞	1,200	19,116.00	0.02
677	603888	新华网	900	19,053.00	0.02
678	002038	双鹭药业	1,800	18,954.00	0.02

679	300133	华策影视	3,200	18,944.00	0.02
680	600673	东阳光	4,200	18,858.00	0.02
681	600373	中文传媒	1,900	18,734.00	0.02
682	002155	湖南黄金	2,400	18,600.00	0.02
683	000967	盈峰环境	2,700	18,549.00	0.02
684	600131	国网信通	1,400	18,536.00	0.02
685	000758	中色股份	3,900	18,525.00	0.02
686	601860	紫金银行	5,100	18,513.00	0.02
687	003022	联泓新科	600	18,420.00	0.02
688	601608	中信重工	4,900	18,326.00	0.02
689	600056	中国医药	1,500	18,225.00	0.02
690	002936	郑州银行	4,940	18,129.80	0.02
691	300113	顺网科技	1,400	18,116.00	0.02
692	000681	视觉中国	1,400	18,102.00	0.02
693	002416	爱施德	1,800	18,054.00	0.02
694	000563	陕国投 A	5,600	18,032.00	0.02
695	600266	城建发展	3,800	18,012.00	0.02
696	603515	欧普照明	700	17,969.00	0.02
697	600582	天地科技	4,600	17,940.00	0.02
698	600388	龙净环保	2,100	17,892.00	0.02
699	600062	华润双鹤	1,500	17,865.00	0.02
700	600648	外高桥	1,200	17,736.00	0.02
701	600928	西安银行	3,800	17,708.00	0.02
702	600901	江苏租赁	3,400	17,680.00	0.02
703	601098	中南传媒	2,000	17,640.00	0.02
704	002635	安洁科技	1,200	17,556.00	0.02
705	601958	金钼股份	2,700	17,496.00	0.02
706	603708	家家悦	1,000	17,370.00	0.02
707	600776	东方通信	1,400	17,360.00	0.02
708	300180	华峰超纤	3,500	17,325.00	0.02
709	300257	开山股份	1,200	17,244.00	0.02
710	600649	城投控股	3,600	17,136.00	0.02
711	600959	江苏有线	5,600	17,080.00	0.02
712	600764	中国海防	600	16,980.00	0.02
713	600094	大名城	4,500	16,965.00	0.02
714	002458	益生股份	1,700	16,949.00	0.02
715	600006	东风汽车	2,300	16,790.00	0.02
716	000415	渤海租赁	6,900	16,698.00	0.02
717	601611	中国核建	2,300	16,606.00	0.02
718	600377	宁沪高速	1,700	16,592.00	0.02
719	600546	山煤国际	2,300	16,514.00	0.02
720	600639	浦东金桥	1,200	16,380.00	0.02
721	002317	众生药业	1,900	16,359.00	0.02
722	601828	美凯龙	1,320	15,840.00	0.02

723	600717	天津港	4,032	15,805.44	0.02
724	600633	浙数文化	2,200	15,796.00	0.02
725	601928	凤凰传媒	2,200	15,708.00	0.02
726	603983	丸美股份	300	15,633.00	0.02
727	000717	韶钢松山	3,400	15,606.00	0.02
728	600299	安迪苏	1,300	15,548.00	0.02
729	002434	万里扬	1,900	15,409.00	0.02
730	000501	鄂武商 A	1,300	15,210.00	0.02
731	600863	内蒙华电	6,500	15,145.00	0.02
732	603786	科博达	200	15,100.00	0.02
733	002653	海思科	700	15,064.00	0.02
734	002375	亚厦股份	1,900	15,048.00	0.02
735	000078	海王生物	4,600	14,996.00	0.02
736	002815	崇达技术	1,200	14,976.00	0.02
737	603379	三美股份	800	14,968.00	0.02
738	600968	海油发展	5,700	14,763.00	0.02
739	002424	贵州百灵	2,000	14,720.00	0.02
740	600640	号百控股	1,200	14,628.00	0.02
741	002901	大博医疗	200	14,578.00	0.02
742	600021	上海电力	2,100	14,511.00	0.02
743	600566	济川药业	800	14,320.00	0.02
744	002532	天山铝业	1,700	14,263.00	0.02
745	002244	滨江集团	3,400	14,246.00	0.02
746	600623	华谊集团	1,600	14,096.00	0.02
747	601969	海南矿业	1,200	13,956.00	0.01
748	002468	申通快递	1,800	13,716.00	0.01
749	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
750	600312	平高电气	2,300	13,432.00	0.01
751	600339	中油工程	4,700	13,348.00	0.01
752	600787	中储股份	2,500	13,325.00	0.01
753	603056	德邦股份	1,200	13,188.00	0.01
754	002583	海能达	2,600	13,104.00	0.01
754	601778	晶科科技	2,400	13,104.00	0.01
756	000031	大悦城	3,600	12,960.00	0.01
757	600823	世茂股份	3,200	12,928.00	0.01
758	000826	启迪环境	2,400	12,840.00	0.01
759	603377	东方时尚	1,200	12,828.00	0.01
760	600466	蓝光发展	4,300	12,685.00	0.01
761	002945	华林证券	900	12,438.00	0.01
762	601298	青岛港	2,000	12,360.00	0.01
763	000156	华数传媒	1,600	12,336.00	0.01
764	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
765	601869	长飞光纤	500	12,180.00	0.01
766	000553	安道麦 A	1,300	12,051.00	0.01

767	601512	中新集团	1,200	11,952.00	0.01
768	002302	西部建设	1,500	11,850.00	0.01
769	001872	招商港口	700	11,844.00	0.01
770	000937	冀中能源	3,000	11,790.00	0.01
771	002948	青岛银行	2,300	11,431.00	0.01
772	601187	厦门银行	1,200	11,376.00	0.01
773	000813	德展健康	2,500	11,350.00	0.01
774	300010	豆神教育	2,000	11,340.00	0.01
775	601228	广州港	3,500	11,130.00	0.01
776	601568	北元集团	1,300	11,128.00	0.01
777	600350	山东高速	1,800	11,070.00	0.01
778	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
779	002946	新乳业	700	10,605.00	0.01
780	601139	深圳燃气	1,600	10,496.00	0.01
781	000061	农产品	1,900	10,488.00	0.01
782	600871	石化油服	5,300	10,441.00	0.01
783	000046	泛海控股	4,400	10,120.00	0.01
784	600917	重庆燃气	1,200	9,804.00	0.01
785	600903	贵州燃气	1,000	9,200.00	0.01
786	002419	天虹股份	1,400	9,184.00	0.01
787	603719	良品铺子	200	9,000.00	0.01
788	601003	柳钢股份	1,500	8,850.00	0.01
789	603868	飞科电器	200	8,412.00	0.01
790	000537	广宇发展	1,600	8,368.00	0.01
791	600657	信达地产	2,400	8,352.00	0.01
792	601801	皖新传媒	1,700	8,024.00	0.01
793	002423	中粮资本	800	7,240.00	0.01
794	002818	富森美	600	7,236.00	0.01
795	603256	宏和科技	700	6,398.00	0.01
796	000732	泰禾集团	2,800	6,048.00	0.01
797	600956	新天绿能	400	4,684.00	0.01
798	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01
799	601068	中铝国际	1,200	4,140.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	889,936.00	0.86
2	000858	五粮液	424,419.00	0.41

3	000333	美的集团	379,561.00	0.37
4	002415	海康威视	307,315.00	0.30
5	601816	京沪高铁	305,006.00	0.30
6	000661	长春高新	299,411.00	0.29
7	688169	石头科技	274,696.00	0.27
8	000651	格力电器	255,814.00	0.25
9	688111	金山办公	252,892.14	0.25
10	000725	京东方 A	241,030.00	0.23
11	002594	比亚迪	226,782.00	0.22
12	002475	立讯精密	216,185.00	0.21
13	300059	东方财富	211,193.00	0.20
14	300450	先导智能	203,984.00	0.20
15	300015	爱尔眼科	200,159.00	0.19
16	000002	万科 A	195,012.00	0.19
17	000799	酒鬼酒	190,488.00	0.18
18	000568	泸州老窖	188,470.00	0.18
19	000001	平安银行	188,466.00	0.18
20	601318	中国平安	163,822.00	0.16

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601995	中金公司	1,145,379.33	1.11
2	000858	五粮液	717,148.00	0.69
3	000333	美的集团	581,363.00	0.56
4	000651	格力电器	396,185.00	0.38
5	300059	东方财富	334,951.00	0.32
6	000661	长春高新	305,830.00	0.30
7	000001	平安银行	302,594.00	0.29
8	002594	比亚迪	299,464.00	0.29
9	000002	万科 A	295,786.00	0.29
10	688169	石头科技	277,706.00	0.27
11	002415	海康威视	249,736.00	0.24
12	002714	牧原股份	246,362.00	0.24
13	300496	中科创达	234,186.00	0.23
14	300012	华测检测	224,696.00	0.22
15	002475	立讯精密	221,460.00	0.21
16	002352	顺丰控股	219,046.00	0.21
17	000568	泸州老窖	217,432.00	0.21
18	000725	京东方 A	206,356.00	0.20
19	688567	孚能科技	205,515.25	0.20

20	000100	TCL 科技	177,520.00	0.17
----	--------	--------	------------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,190,909.80
卖出股票收入（成交）总额	24,258,637.82

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	46,518.36	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,518.36	0.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	113050	南银转债	300	29,999.87	0.03

2	127036	三花转债	49	6,418.51	0.01
3	113051	节能转债	50	4,999.98	0.01
4	127038	国微转债	35	3,500.00	0.00
5	123117	健帆转债	16	1,600.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2109	IC2109	3	4,000,200.00	84,240.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
IF2109	IF2109	1	1,549,920.00	6,660.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					90,900.00
股指期货投资本期收益(元)					531,475.73
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-98,480.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,按照相关法律法规的有关规定,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理,本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时,

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定：1、2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

2020 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司涉嫌违反法律法规的行为处以责令整改，并处以罚款人民币 120 万元。

2020 年 11 月 27 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司违反规定办理结汇、售汇的行为，作出“责令改正、罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 万元人民币”的行政处罚决定。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 7170 万元的行政处罚决定：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、

贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。

2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款”的行政处罚决定：1.为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2.为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；3.违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；4.违反银行卡收单外包管理规定；5.未按规定履行客户身份识别义务。

2020 年 10 月 22 日，上海银保监局对兴业银行股份有限公司信用卡中心信用卡授信审批严重违反审慎经营规则作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚。

2021 年 4 月 12 日，中华人民共和国财政部依法对江苏恒瑞医药股份有限公司处以 5 万元的罚款。处罚事由：检查发现，公司存在以下问题：一是 2018 年以非本公司发生的机票等报销专家讲课费、点评费、主持费，涉及金额 108.80 万元。二是 2018 年以非本公司发生的机票及过路费、咨询费、广告费等发票列支公司员工福利奖励支出，涉及金额 214.91 万元。三是所属连云港综合二办 2018 年以非本单位发生的过桥过路费发票报销办事处销售人员补贴、赠送客户礼品、学术活动餐费等费用，涉及金额 96.19 万元。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除兴业银行、招商银行、恒瑞医药外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出

现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	759,228.00
2	应收证券清算款	22,127.25
3	应收股利	-
4	应收利息	867.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	857,838.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	
				中国建设银行股份有限公司一易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
702	89,613.74	37,479,910. 00	59.58%	25,428,933. 00	40.42%	32,932,279. 00	52.35%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张招兴	5,000,000.00	7.95%
2	邓玉良	2,213,600.00	3.52%
3	中信证券股份有限公司	1,572,251.00	2.50%
4	国泰君安证券股份有限公司	1,448,358.00	2.30%
5	广发证券股份有限公司	829,469.00	1.32%
6	游权	778,500.00	1.24%
7	刘晓彬	565,000.00	0.90%
8	海通证券股份有限公司	329,300.00	0.52%
9	车中智	320,000.00	0.51%
10	华泰证券股份有限公司	310,032.00	0.49%
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	32,932,279.00	52.35%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%
------------------	------	---------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 8 日）基金份额总额	887,908,843.00
本报告期期初基金份额总额	71,908,843.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,908,843.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	351,312.00	0.79%	151.52	2.01%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	8,933,807.04	20.05%	3,853.35	51.16%	-
华创证券	2	35,266,420.21	79.16%	3,526.76	46.83%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	99,482.47	27.67%	-	-	-	-
华创证券	260,109.80	72.33%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加南京证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-01-21
3	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	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加	中国证券报、基金管理人	2021-03-18

	东北证券为申购赎回代办证券公司的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加第一创业证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2021-03-26
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	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	2021-03-30
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报	2021-03-30
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2021-04-01
9	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	2021-04-02
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加安信证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2021-04-15
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-04-19

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司—易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2021 年 01 月 01 日~2021 年 06 月 30 日	33,012,358.00	3,920,000.00	4,000,079.00	32,932,279.00	52.35%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金将面临基金财产清算并终止的风险；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日