

# 易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

## 金

### 2022 年年度报告

2022 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：二〇二三年三月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。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 2022 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遵规守信情况的说明	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	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计意见	15
6.2	形成审计意见的基础	15
6.3	其他信息	16
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任	16
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	净资产（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	54
8.1	期末基金资产组合情况	54
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	74
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
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 .....	75
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	75
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12	投资组合报告附注 .....	76
§ 9	基金份额持有人信息 .....	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	77
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	77
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
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 .....	78
§ 10	开放式基金份额变动 .....	78
§ 11	重大事件揭示 .....	78
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	79
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	79
11.4	基金投资策略的改变 .....	79
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	79
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8	其他重大事件 .....	80
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
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 .....	82
§ 13	备查文件目录 .....	82
13.1	备查文件目录 .....	82
13.2	存放地点 .....	83
13.3	查阅方式 .....	83

## § 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	116,908,843.00 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	<p>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。</p>

业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-17,832,493.39	12,832,973.54	58,075,395.57
本期利润	-23,442,341.49	2,282,759.58	51,910,026.57
加权平均基金份额本期利润	-0.2681	0.0327	0.3919
本期加权平均净值利润率	-21.74%	2.26%	35.26%
本期基金份额净值增长率	-19.64%	1.94%	43.87%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	20,552,022.16	31,912,218.52	29,219,194.12
期末可供分配基金份额利润	0.1758	0.4631	0.4063
期末基金资产净值	137,460,865.16	100,821,061.52	103,202,921.39
期末基金份额净值	1.1758	1.4631	1.4352
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	17.58%	46.31%	43.52%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	1.18%	1.96%	1.18%	0.10%	0.00%
过去六个月	-11.67%	1.05%	-12.60%	1.06%	0.93%	-0.01%
过去一年	-19.64%	1.26%	-21.32%	1.27%	1.68%	-0.01%
过去三年	17.86%	1.27%	-1.77%	1.28%	19.63%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	17.58%	1.24%	5.31%	1.24%	12.27%	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 2022 年 12 月 31 日)



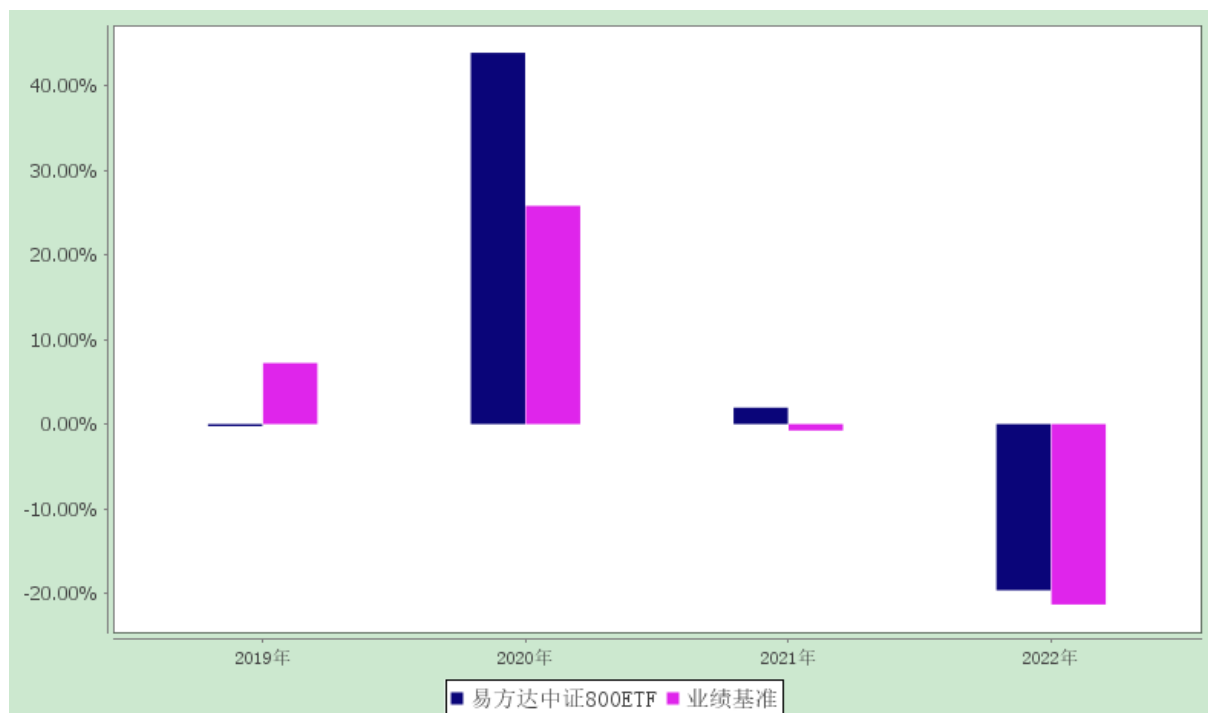
注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 17.58%，同期业绩比较基准收益率为 5.31%。

3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图





注：本基金合同生效日为2019年10月8日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
林伟斌	本基金的基金经理，易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证国有企业改革指数 (LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达上证科创板 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接的基金经理，指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员	2019-10-08	-	14 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、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) 的基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数 (LOF)、易方达中证万得并购重组指数 (LOF)、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达香港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行指数 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证 1000ETF 的基金经理，易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理助理	2019-10-08	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员，易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF(QDII)的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 42 次，其中 27 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，15 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。

2022 年，受国内局部地区疫情反复、地缘政治风险加剧以及大宗商品价格大幅波动等不稳定因素的影响，企业和居民的生产 and 消费活动受到影响，经济发展面临一定的下行压力。多重因素影响下，投资者风险偏好持续回落，随后在稳增长政策不断出台、国内防疫措施持续优化的背景下，市场信心在 11 月份迎来了较大幅度的修复。报告期内，A 股市场整体表现不佳，波动率维持在较高水平，中证 800 指数下跌 21.32%。从行业结构上看，31 个申万一级行业中，仅煤炭、综合上涨，其他行业均有不同程度的下跌。中证 800 指数所涵盖的申万一级行业中，权重占比较大的行业为电力设备、食品饮料、银行、非银金融、医药生物、电子，其中医药生物、非银金融、医药生物、电子行业跌幅都在 20% 以上拖累指数表现，而表现较好的煤炭行业在指数权重中占比较低，对指数收益的贡献有限。

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 1.1758 元，本报告期份额净值增长率为-19.64%，同期业绩比较基准收益率为-21.32%，年化跟踪误差 0.49%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，国内经济的复苏情况或将成为 2023 年对 A 股市场最重要的边际影响因素。随着制约市场和经济的疫情因素大幅缓解，各项消费活动的回暖提振了市场对经济修复的信心，经济活动修复有助于改善投资者预期。稳经济各项政策举措加速落实的背景下，国内经济动能有望迎来持续改善，A 股上市企业盈利增速中枢有望得到抬升。中长期而言，国内市场潜力巨大，中国经济有望维持高质量发展，上市公司质量提升及资本市场基础制度完善也有助于提升 A 股市场在国内与全球资产配置中的重要性。

据 wind 数据显示，中证 800 指数是覆盖了 70%A 股市值的代表性宽基指数，市值风格偏向于中大盘，行业分布相对均衡，指数表现与中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上的核心价值观，加强员工合规风控、廉洁从业教育培训并完善合规监督考评机制，筑牢廉洁从业的红线认识，不断提高员工合规风控意识。

(2) 坚持投资合规风险闭环管理，认真贯彻落实法律法规、基金合同和公司制度的各项控制要求，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示、情况核查和结果跟踪；持续推动投资、研究、交易等业务部门完善相应内控机制；加强公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 持续提升产品合规审查质量，督促健全基金募集申请材料质量内控机制和工具手段；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，加强营销宣传、销售、客服等环节的合规管

控，深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度，着力提高投资者获得感。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露文件制作、审核、报送的系统化水平，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，进一步修订制度流程、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，建立健全洗钱风险自评估工作机制，扎实开展风险自评估，持续完善风险管控措施，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

(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、产品运营、信息技术、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时参考国际标准，聘请外部机构开展内控合规评估和业绩标准鉴证，报告期内通过 ISAE3402（国际鉴证业务准则 3402 号）内控鉴证和 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，通过内外部不同视角审视公司内控机制和执行情况，提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本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（2023）审字第 60468000\_G96 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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

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

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

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

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

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

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

### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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



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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

昌华 马婧

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

2023 年 3 月 27 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,632,197.72	3,888,186.85
结算备付金		1,143,028.20	1,712,677.72
存出保证金		703,065.26	820,614.95

交易性金融资产	7.4.7.2	132,186,573.45	94,560,913.24
其中：股票投资		132,186,573.45	94,346,914.59
基金投资		-	-
债券投资		-	213,998.65
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		42,091.95	73,609.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,136.22
<b>资产总计</b>		<b>137,706,956.58</b>	<b>101,057,138.71</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	20.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,319.40	13,277.13
应付托管费		5,773.14	4,425.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	222,998.88	218,354.33
<b>负债合计</b>		<b>246,091.42</b>	<b>236,077.19</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	116,908,843.00	68,908,843.00
未分配利润	7.4.7.8	20,552,022.16	31,912,218.52
<b>净资产合计</b>		<b>137,460,865.16</b>	<b>100,821,061.52</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>137,706,956.58</b>	<b>101,057,138.71</b>

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1758 元，基金份额总额 116,908,843.00 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-22,769,534.49</b>	<b>3,103,010.67</b>
1.利息收入		33,510.76	39,174.04
其中：存款利息收入	7.4.7.9	33,510.76	39,116.32
债券利息收入		-	57.72
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）		-17,541,708.78	13,583,722.14
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-18,969,748.12	11,258,921.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	82,908.78	54,118.21
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	-585,515.48	966,857.87
股利收益	7.4.7.14	1,930,646.04	1,303,824.67
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	-5,609,848.10	-10,550,213.96
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	348,511.63	30,328.45
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>672,807.00</b>	<b>820,251.09</b>
1. 管理人报酬		160,326.64	151,517.36
2. 托管费		53,442.17	50,505.80
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.01	3,876.30
8. 其他费用	7.4.7.18	459,038.18	614,351.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-23,442,341.49</b>	<b>2,282,759.58</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-23,442,341.49</b>	<b>2,282,759.58</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-23,442,341.49</b>	<b>2,282,759.58</b>

注：1.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目

的“本期”金额合并列示在本年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

2.上表中以下本期数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：本年度报告利润表中“投资收益”项目对应品种的投资收益已扣减对应投资品种产生的交易费用。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	68,908,843.00	31,912,218.52	100,821,061.52
二、本期期初净资产（基金净值）	68,908,843.00	31,912,218.52	100,821,061.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	48,000,000.00	-11,360,196.36	36,639,803.64
（一）、综合收益总额	-	-23,442,341.49	-23,442,341.49
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	48,000,000.00	12,082,145.13	60,082,145.13
其中：1.基金申购款	258,000,000.00	49,234,273.22	307,234,273.22
2.基金赎回款	-210,000,000.00	-37,152,128.09	-247,152,128.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	116,908,843.00	20,552,022.16	137,460,865.16
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	71,908,843.00	31,294,078.39	103,202,921.39

产（基金净值）			
二、本期期初净资产（基金净值）	71,908,843.00	31,294,078.39	103,202,921.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	618,140.13	-2,381,859.87
（一）、综合收益总额	-	2,282,759.58	2,282,759.58
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	-1,664,619.45	-4,664,619.45
其中：1.基金申购款	129,000,000.00	57,305,521.13	186,305,521.13
2.基金赎回款	-132,000,000.00	-58,970,140.58	-190,970,140.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	68,908,843.00	31,912,218.52	100,821,061.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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基金净值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）占基金净值比例计算的金额。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）占基金净值比例计算的金额。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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,888,186.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 374.66 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,888,561.51 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,712,677.72 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 743.69 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值

为人民币 1,713,421.41 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 820,614.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 12.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 820,627.85 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,136.22 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 374.66 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 743.69 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 12.90 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 4.97 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 94,560,913.24 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4.97 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 94,560,918.21 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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。

##### (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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,632,197.72	3,888,186.85
等于：本金	3,631,875.37	3,888,186.85
加：应计利息	322.35	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	3,632,197.72	3,888,186.85

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	135,808,982.42	-	132,186,573.45	-3,622,408.97
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		135,808,982.42	-	132,186,573.45	-3,622,408.97
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		92,693,235.46	-	94,346,914.59	1,653,679.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	213,998.65	-	213,998.65	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	213,998.65	-	213,998.65	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		92,907,234.11	-	94,560,913.24	1,653,679.13

## 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 2022 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	4,843,540.00	-	-	-
IC2303	3,638,680.00	-	-	-
IF2303	1,204,860.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,843,540.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 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	5,682,540.00	-	-	-
IC2203	4,231,920.00	-	-	-
IF2203	1,450,620.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,682,540.00	-	-	-

## 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
IC2303	IC2303	3	3,524,640.00	-114,040.00
IF2303	IF2303	1	1,171,260.00	-33,600.00
合计	-	-	-	-147,640.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-147,640.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	1,136.22
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,136.22

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	20,998.88	16,744.73
其中：交易所市场	20,998.88	16,744.73
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	167,000.00	164,200.00
其他应付款	35,000.00	35,000.00
可退替代款	-	2,409.60
合计	222,998.88	218,354.33

## 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,908,843.00	68,908,843.00
本期申购	258,000,000.00	258,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-210,000,000.00	-210,000,000.00
本期末	116,908,843.00	116,908,843.00

#### 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	40,705,507.18	-8,793,288.66	31,912,218.52
本期利润	-17,832,493.39	-5,609,848.10	-23,442,341.49
本期基金份额交易产生的变动数	27,482,080.02	-15,399,934.89	12,082,145.13
其中：基金申购款	131,849,608.95	-82,615,335.73	49,234,273.22
基金赎回款	-104,367,528.93	67,215,400.84	-37,152,128.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,355,093.81	-29,803,071.65	20,552,022.16

#### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,913.83	18,640.36
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	19,975.35	20,129.11
其他	621.58	346.85
合计	33,510.76	39,116.32

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,976,740.70	6,998,675.15
股票投资收益——赎回差价收入	-8,993,007.42	4,260,246.24
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	-18,969,748.12	11,258,921.39

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	130,568,144.41	105,143,329.15
减：卖出股票成本总额	140,350,781.98	98,144,654.00
减：交易费用	194,103.13	-
买卖股票差价收入	-9,976,740.70	6,998,675.15

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	247,152,128.09	190,970,140.58
减：现金支付赎回款总额	107,412,775.09	80,975,993.58
减：赎回股票成本总额	148,732,360.42	105,733,900.76
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-8,993,007.42	4,260,246.24

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	46.33	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	82,862.45	54,118.21
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	82,908.78	54,118.21

#### 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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	590,717.55	497,776.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	507,797.72	443,597.52
减：应计利息总额	52.32	60.79
减：交易费用	5.06	-
买卖债券差价收入	82,862.45	54,118.21

#### 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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-585,515.48	966,857.87

#### 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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,930,646.04	1,303,824.67
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,930,646.04	1,303,824.67

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-5,276,088.10	-10,546,953.96
——股票投资	-5,276,088.10	-10,546,953.96
——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	-333,760.00	-3,260.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-333,760.00	-3,260.00
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	-5,609,848.10	-10,550,213.96

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	348,511.63	30,328.45
合计	348,511.63	30,328.45

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月	2021年1月1日至2021年12月31日

	31日	
审计费用	27,000.00	24,200.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	140,000.00	140,000.00
存托服务费	8.38	-
银行汇划费	2,029.80	3,754.97
其他	170,000.00	170,000.00
交易费用	-	156,396.66
合计	459,038.18	614,351.63

#### 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
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：1. 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、

珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）自 2022 年 9 月 9 日起名称分别变更为珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）。

2. 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	24,036,393.50	8.35%	23,923,295.90	11.37%

##### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	49,502.99	8.38%	159,350.42	32.01%

##### 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



	2022年1月1日至2022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	10,366.76	28.02%	5,463.42	26.02%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	10,318.50	35.05%	5,829.40	34.81%

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

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

#### 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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	160,326.64	151,517.36
其中：支付销售机构的客户维护费	2,324.60	1,315.16

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	53,442.17	50,505.80

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	61,802,743.00	52.8640%	29,566,279.00	42.9064%

交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金				
广发证券股份有限公司	5,404,361.00	4.6227%	3,554,366.00	5.1581%

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	3,632,197.72	12,913.83	3,888,186.85	18,640.36

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 2022年1月1日至2022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
广发证券股份有限公司	600958	东方证券	配股	4,088	34,584.48
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下发行	488	10,677.44
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下发行	5,480	50,196.80
上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
广发证券股份有限公司	605090	九丰能源	新股网下 发行	1,090	37,681.30

#### 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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 16,000 股（2021 年 12 月 31 日:9,900 股），占本基金净值比例为 0.18%(2021 年 12 月 31 日:0.24%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 36,500 股（2021 年 12 月 31 日:22,400 股），占本基金净值比例为 0.15%(2021 年 12 月 31 日:0.13%)。

#### 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（2022 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
301290	东星医疗	2022-11-23	6 个月	新股流通受限	44.09	35.13	123	5,423.07	4,320.99	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6 个月	新股流通受限	13.88	15.86	356	4,941.28	5,646.16	-

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
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	2023-01-10	56.88	900	54,621.00	47,952.00	-
600038	中直股份	2022-12-26	重大事项停牌	46.41	2023-01-10	51.05	1,400	67,596.33	64,974.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 2022 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。

##### 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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.21%)。

#### 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 2022年12月31日	上年度末 2021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。

#### 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 2022年12月31日	上年度末 2021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 2022年12月31日	上年度末 2021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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	211,003.30
AAA 以下	0.00	3,000.32
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	214,003.62

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。

#### 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 2022年12月31日	上年度末 2021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 2022年12月31日	上年度末 2021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 2022 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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,632,197.72	-	-	-	3,632,197.72
结算备付金	1,143,028.20	-	-	-	1,143,028.20
存出保证金	703,065.26	-	-	-	703,065.26
交易性金融资产	-	-	-	132,186,573.45	132,186,573.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	42,091.95	42,091.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,478,291.18	-	-	132,228,665.40	137,706,956.58
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	17,319.40	17,319.40
应付托管费	-	-	-	5,773.14	5,773.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	222,998.88	222,998.88
负债总计	-	-	-	246,091.42	246,091.42
利率敏感度缺口	5,478,291.18	-	-	131,982,573.98	137,460,865.16

					6
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,888,186.85	-	-	-	3,888,186.85
结算备付金	1,712,677.72	-	-	-	1,712,677.72
存出保证金	820,614.95	-	-	-	820,614.95
交易性金融资产	-	-	213,998.65	94,346,914.59	94,560,913.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	73,609.73	73,609.73
应收利息	-	-	-	1,136.22	1,136.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,421,479.52	-	213,998.65	94,421,660.54	101,057,138.71
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	-	-	-	20.00	20.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	13,277.13	13,277.13
应付托管费	-	-	-	4,425.73	4,425.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	16,744.73	16,744.73
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	201,609.60	201,609.60
负债总计	-	-	-	236,077.19	236,077.19
利率敏感度缺口	6,421,479.52	-	213,998.65	94,185,583.35	100,821,061.5

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	132,186,573.45	96.16	94,346,914.59	93.58
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	132,186,573.45	96.16	94,346,914.59	93.58

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	6,598,002.50	4,794,907.87
	2.业绩比较基准下降 5%	-6,598,002.50	-4,794,907.87

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	132,063,680.30	94,424,324.00
第二层次	112,926.00	136,589.24
第三层次	9,967.15	-
合计	132,186,573.45	94,560,913.24

###### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	-
当期购买	-	10,364.35	10,364.35

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-397.20	-397.20
其中：计入损益的利得或损失	-	-397.20	-397.20
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	9,967.15	9,967.15
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	-	-397.20	-397.20
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

## 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	9,967.15	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.42—0.7319	负相关
项目	上年度末公	采用的估值技	不可观察输入值		

	允价值	术	名称	范围/加权平均 值	与公允价值之 间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 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	132,186,573.45	95.99
	其中：股票	132,186,573.45	95.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返 售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合 计	4,775,225.92	3.47
8	其他各项资产	745,157.21	0.54
9	合计	137,706,956.58	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	1,563,463.20	1.14
B	采矿业	4,284,261.70	3.12
C	制造业	76,454,771.99	55.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,872,761.10	2.82
E	建筑业	2,469,147.64	1.80
F	批发和零售业	1,557,319.84	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,093,091.30	2.98
H	住宿和餐饮业	81,840.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,118,121.85	4.45
J	金融业	23,722,310.04	17.26
K	房地产业	2,517,538.44	1.83
L	租赁和商务服务业	1,856,370.80	1.35
M	科学研究和技术服务业	1,727,246.40	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	176,109.49	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	967,651.66	0.70
R	文化、体育和娱乐业	536,944.00	0.39
S	综合	187,624.00	0.14
	合计	132,186,573.45	96.16

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,400	5,871,800.00	4.27
2	300750	宁德时代	7,900	3,108,018.00	2.26
3	601318	中国平安	58,700	2,758,900.00	2.01
4	600036	招商银行	66,947	2,494,445.22	1.81
5	000858	五粮液	10,500	1,897,245.00	1.38
6	601166	兴业银行	78,900	1,387,851.00	1.01

7	601012	隆基绿能	32,812	1,386,635.12	1.01
8	000333	美的集团	26,500	1,372,700.00	1.00
9	600900	长江电力	61,600	1,293,600.00	0.94
10	002594	比亚迪	4,900	1,259,153.00	0.92
11	601888	中国中免	5,200	1,123,356.00	0.82
12	300059	东方财富	57,357	1,112,725.80	0.81
13	600887	伊利股份	34,735	1,076,785.00	0.78
14	600030	中信证券	52,960	1,054,433.60	0.77
15	600309	万华化学	10,200	945,030.00	0.69
16	600276	恒瑞医药	24,320	937,049.60	0.68
17	603259	药明康德	11,140	902,340.00	0.66
18	000568	泸州老窖	4,000	897,120.00	0.65
19	002415	海康威视	25,600	887,808.00	0.65
20	002475	立讯精密	26,899	854,043.25	0.62
21	300760	迈瑞医疗	2,700	853,119.00	0.62
22	601398	工商银行	190,200	825,468.00	0.60
23	000651	格力电器	24,500	791,840.00	0.58
24	601899	紫金矿业	78,200	782,000.00	0.57
25	002352	顺丰控股	13,300	768,208.00	0.56
26	600809	山西汾酒	2,680	763,773.20	0.56
27	601328	交通银行	149,100	706,734.00	0.51
28	300124	汇川技术	10,150	705,425.00	0.51
29	002714	牧原股份	14,440	703,950.00	0.51
30	002142	宁波银行	21,540	698,973.00	0.51
31	000001	平安银行	52,700	693,532.00	0.50
32	000725	京东方 A	203,600	688,168.00	0.50
33	000002	万科 A	37,000	673,400.00	0.49
34	000792	盐湖股份	29,500	669,355.00	0.49
35	601816	京沪高铁	133,300	655,836.00	0.48
36	300274	阳光电源	5,700	637,260.00	0.46
37	601668	中国建筑	113,900	618,477.00	0.45
38	300015	爱尔眼科	19,438	603,938.66	0.44
39	603288	海天味业	7,510	597,796.00	0.43
40	600048	保利发展	39,000	590,070.00	0.43
41	300014	亿纬锂能	6,603	580,403.70	0.42
42	600438	通威股份	14,700	567,126.00	0.41
43	300498	温氏股份	28,460	558,669.80	0.41
44	002129	TCL 中环	14,100	531,006.00	0.39
45	002304	洋河股份	3,300	529,650.00	0.39
46	600031	三一重工	32,300	510,340.00	0.37
47	601288	农业银行	173,300	504,303.00	0.37
48	600690	海尔智家	20,600	503,876.00	0.37
49	601088	中国神华	17,900	494,398.00	0.36
50	002049	紫光国微	3,680	485,097.60	0.35



51	600919	江苏银行	64,100	467,289.00	0.34
52	600016	民生银行	134,700	464,715.00	0.34
53	600050	中国联通	103,600	464,128.00	0.34
54	600000	浦发银行	63,700	463,736.00	0.34
55	600436	片仔癀	1,600	461,536.00	0.34
56	601601	中国太保	18,600	456,072.00	0.33
57	600837	海通证券	52,400	455,356.00	0.33
58	000063	中兴通讯	17,300	447,378.00	0.33
59	600406	国电南瑞	18,168	443,299.20	0.32
60	002466	天齐锂业	5,600	442,344.00	0.32
61	688981	中芯国际	10,625	437,112.50	0.32
62	002460	赣锋锂业	6,180	429,571.80	0.31
63	600089	特变电工	21,100	423,688.00	0.31
64	601225	陕西煤业	21,035	390,830.30	0.28
65	603799	华友钴业	6,940	386,072.20	0.28
66	002812	恩捷股份	2,900	380,741.00	0.28
67	688599	天合光能	5,932	378,224.32	0.28
68	300122	智飞生物	4,300	377,669.00	0.27
69	603986	兆易创新	3,596	368,482.12	0.27
70	002027	分众传媒	54,900	366,732.00	0.27
71	600104	上汽集团	25,403	366,057.23	0.27
72	002271	东方雨虹	10,900	365,913.00	0.27
73	601988	中国银行	114,400	361,504.00	0.26
74	600585	海螺水泥	13,100	358,678.00	0.26
75	601688	华泰证券	28,000	356,720.00	0.26
76	601919	中远海控	34,590	355,931.10	0.26
77	601728	中国电信	84,300	353,217.00	0.26
78	300142	沃森生物	8,700	349,653.00	0.25
79	601169	北京银行	80,400	346,524.00	0.25
80	300896	爱美客	600	339,810.00	0.25
81	601766	中国中车	66,100	337,771.00	0.25
82	600570	恒生电子	8,269	334,563.74	0.24
83	601628	中国人寿	9,000	334,080.00	0.24
84	601211	国泰君安	24,500	332,955.00	0.24
85	002230	科大讯飞	10,100	331,583.00	0.24
86	000625	长安汽车	26,932	331,532.92	0.24
87	601229	上海银行	54,000	319,140.00	0.23
88	600028	中国石化	72,700	316,972.00	0.23
89	002371	北方华创	1,400	315,420.00	0.23
90	601390	中国中铁	55,800	310,248.00	0.23
91	601985	中国核电	51,200	307,200.00	0.22
92	600893	航发动力	7,260	306,952.80	0.22
93	600009	上海机场	5,300	305,863.00	0.22
94	002410	广联达	5,100	305,745.00	0.22

95	600660	福耀玻璃	8,700	305,109.00	0.22
96	300347	泰格医药	2,900	303,920.00	0.22
97	002459	晶澳科技	5,040	302,853.60	0.22
98	000338	潍柴动力	29,500	300,310.00	0.22
99	000661	长春高新	1,800	299,610.00	0.22
100	603501	韦尔股份	3,835	295,640.15	0.22
101	600111	北方稀土	11,800	295,590.00	0.22
102	601009	南京银行	28,000	291,760.00	0.21
103	601669	中国电建	41,100	290,988.00	0.21
104	000100	TCL 科技	76,100	283,092.00	0.21
105	002311	海大集团	4,500	277,785.00	0.20
106	601818	光大银行	89,800	275,686.00	0.20
107	002709	天赐材料	6,240	273,686.40	0.20
108	601658	邮储银行	59,100	273,042.00	0.20
109	600019	宝钢股份	48,400	270,556.00	0.20
110	600588	用友网络	11,191	270,486.47	0.20
111	600999	招商证券	20,140	267,862.00	0.19
112	600426	华鲁恒升	8,040	266,526.00	0.19
113	688008	澜起科技	4,220	264,172.00	0.19
114	600905	三峡能源	46,700	263,855.00	0.19
115	688111	金山办公	996	263,432.04	0.19
116	601857	中国石油	52,700	261,919.00	0.19
117	600958	东方证券	28,388	253,788.72	0.18
118	600760	中航沈飞	4,260	249,763.80	0.18
119	002179	中航光电	4,300	248,368.00	0.18
120	002050	三花智控	11,700	248,274.00	0.18
121	000776	广发证券	16,000	247,840.00	0.18
122	600196	复星医药	6,900	243,156.00	0.18
123	300450	先导智能	6,000	241,500.00	0.18
124	000596	古井贡酒	900	240,210.00	0.17
125	002180	纳思达	4,600	238,694.00	0.17
126	600010	包钢股份	123,700	237,504.00	0.17
127	300661	圣邦股份	1,350	233,010.00	0.17
128	000733	振华科技	2,000	228,460.00	0.17
129	300408	三环集团	7,300	224,183.00	0.16
130	688012	中微公司	2,286	224,050.86	0.16
131	600029	南方航空	29,300	222,680.00	0.16
132	300316	晶盛机电	3,500	222,460.00	0.16
133	000963	华东医药	4,700	219,960.00	0.16
134	002241	歌尔股份	13,000	218,790.00	0.16
135	600150	中国船舶	9,800	218,344.00	0.16
136	601615	明阳智能	8,600	217,236.00	0.16
137	601989	中国重工	61,900	216,031.00	0.16
138	601006	大秦铁路	32,300	215,764.00	0.16

139	601377	兴业证券	37,500	215,250.00	0.16
140	600600	青岛啤酒	2,000	215,000.00	0.16
141	001979	招商蛇口	16,900	213,447.00	0.16
142	000538	云南白药	3,920	213,091.20	0.16
143	000938	紫光股份	10,880	212,268.80	0.15
144	600926	杭州银行	16,100	210,588.00	0.15
145	600745	闻泰科技	4,005	210,582.90	0.15
146	600795	国电电力	48,400	206,668.00	0.15
147	601939	建设银行	36,500	205,495.00	0.15
148	300782	卓胜微	1,780	203,454.00	0.15
149	600941	中国移动	3,000	203,010.00	0.15
150	002493	荣盛石化	16,400	201,720.00	0.15
151	601633	长城汽车	6,700	198,454.00	0.14
152	601138	工业富联	21,600	198,288.00	0.14
153	603659	璞泰来	3,800	197,182.00	0.14
154	000166	申万宏源	48,900	194,622.00	0.14
155	601186	中国铁建	25,000	193,250.00	0.14
156	603806	福斯特	2,899	192,609.56	0.14
157	601600	中国铝业	43,000	192,210.00	0.14
158	000768	中航西飞	7,500	190,875.00	0.14
159	002001	新和成	10,076	188,925.00	0.14
160	600233	圆通速递	9,400	188,846.00	0.14
161	002340	格林美	25,400	188,722.00	0.14
162	600547	山东黄金	9,800	187,768.00	0.14
163	300759	康龙化成	2,700	183,600.00	0.13
163	601838	成都银行	12,000	183,600.00	0.13
165	600763	通策医疗	1,200	183,588.00	0.13
166	601100	恒立液压	2,896	182,882.40	0.13
167	300012	华测检测	8,200	182,860.00	0.13
168	600011	华能国际	23,810	181,194.10	0.13
169	300496	中科创达	1,800	180,540.00	0.13
170	600176	中国巨石	13,101	179,614.71	0.13
171	601995	中金公司	4,700	179,211.00	0.13
172	600015	华夏银行	34,500	179,055.00	0.13
173	600346	恒力石化	11,500	178,595.00	0.13
174	600584	长电科技	7,700	177,485.00	0.13
175	600383	金地集团	17,200	175,956.00	0.13
176	600886	国投电力	16,200	175,446.00	0.13
177	603993	洛阳钼业	38,300	174,265.00	0.13
178	603369	今世缘	3,400	173,060.00	0.13
179	300751	迈为股份	420	172,972.80	0.13
180	601111	中国国航	16,200	171,720.00	0.12
181	300763	锦浪科技	950	171,047.50	0.12
182	601066	中信建投	7,100	168,625.00	0.12

183	600157	永泰能源	109,600	167,688.00	0.12
184	002074	国轩高科	5,800	167,214.00	0.12
185	002384	东山精密	6,700	165,691.00	0.12
186	605117	德业股份	500	165,600.00	0.12
187	600132	重庆啤酒	1,300	165,594.00	0.12
188	600085	同仁堂	3,700	165,316.00	0.12
189	002202	金风科技	15,000	165,000.00	0.12
190	600188	兖矿能源	4,900	164,542.00	0.12
191	600115	中国东航	29,700	164,241.00	0.12
192	601877	正泰电器	5,900	163,430.00	0.12
193	000425	徐工机械	32,100	162,747.00	0.12
194	002252	上海莱士	25,600	162,304.00	0.12
195	601868	中国能建	70,420	161,261.80	0.12
196	000876	新希望	12,300	158,793.00	0.12
197	603613	国联股份	1,788	158,130.72	0.12
198	002920	德赛西威	1,500	158,010.00	0.11
199	601117	中国化学	19,900	158,006.00	0.11
200	601788	光大证券	10,600	157,622.00	0.11
201	688063	派能科技	497	156,878.05	0.11
202	002821	凯莱英	1,040	153,920.00	0.11
203	601800	中国交建	19,100	153,755.00	0.11
204	688777	中控技术	1,686	153,139.38	0.11
205	600460	士兰微	4,600	150,834.00	0.11
206	300207	欣旺达	7,100	150,165.00	0.11
207	688396	华润微	2,852	150,157.80	0.11
208	300003	乐普医疗	6,500	149,305.00	0.11
209	688122	西部超导	1,575	149,136.75	0.11
210	002422	科伦药业	5,600	149,016.00	0.11
211	300724	捷佳伟创	1,300	148,226.00	0.11
212	000895	双汇发展	5,700	147,801.00	0.11
213	002601	龙佰集团	7,800	147,576.00	0.11
214	600741	华域汽车	8,500	147,305.00	0.11
215	000157	中联重科	26,900	146,336.00	0.11
216	300454	深信服	1,300	146,315.00	0.11
217	600487	亨通光电	9,700	146,082.00	0.11
218	002385	大北农	16,400	145,960.00	0.11
219	600989	宝丰能源	11,900	143,633.00	0.10
220	600845	宝信软件	3,188	142,822.40	0.10
221	603606	东方电缆	2,100	142,443.00	0.10
222	000786	北新建材	5,500	142,340.00	0.10
223	601901	方正证券	22,300	142,274.00	0.10
224	603019	中科曙光	6,420	142,138.80	0.10
225	601021	春秋航空	2,200	141,350.00	0.10
226	002648	卫星化学	9,080	140,740.00	0.10

227	601689	拓普集团	2,400	140,592.00	0.10
228	002966	苏州银行	18,060	140,506.80	0.10
229	300999	金龙鱼	3,200	139,392.00	0.10
230	002736	国信证券	15,600	138,528.00	0.10
231	300769	德方纳米	600	137,754.00	0.10
232	600885	宏发股份	4,080	136,312.80	0.10
233	600079	人福医药	5,700	136,173.00	0.10
234	688036	传音控股	1,706	135,661.12	0.10
235	601336	新华保险	4,500	135,360.00	0.10
236	002007	华兰生物	5,980	135,327.40	0.10
237	600765	中航重机	4,340	134,930.60	0.10
238	600096	云天化	6,300	132,552.00	0.10
239	002497	雅化集团	5,700	132,525.00	0.10
240	601238	广汽集团	12,000	132,360.00	0.10
241	603290	斯达半导	400	131,720.00	0.10
242	000301	东方盛虹	10,100	131,704.00	0.10
243	002555	三七互娱	7,200	130,320.00	0.09
244	603345	安井食品	800	129,504.00	0.09
245	601555	东吴证券	19,768	129,085.04	0.09
246	600352	浙江龙盛	12,900	127,710.00	0.09
247	000723	美锦能源	14,100	127,182.00	0.09
248	002407	多氟多	3,800	126,616.00	0.09
249	603392	万泰生物	996	126,193.20	0.09
250	002625	光启技术	7,400	125,948.00	0.09
251	600219	南山铝业	38,100	124,587.00	0.09
252	000009	中国宝安	10,200	123,318.00	0.09
253	300413	芒果超媒	4,100	123,082.00	0.09
254	601618	中国中冶	38,700	123,066.00	0.09
255	002603	以岭药业	4,080	122,236.80	0.09
256	601058	赛轮轮胎	12,100	121,242.00	0.09
257	300628	亿联网络	2,000	121,180.00	0.09
258	000977	浪潮信息	5,600	120,512.00	0.09
259	002738	中矿资源	1,800	119,988.00	0.09
260	601233	桐昆股份	8,300	119,935.00	0.09
261	600988	赤峰黄金	6,600	119,130.00	0.09
262	000069	华侨城 A	22,300	118,859.00	0.09
263	600674	川投能源	9,700	118,631.00	0.09
264	603688	石英股份	900	118,188.00	0.09
265	600298	安琪酵母	2,600	117,572.00	0.09
266	300390	天华超净	2,100	117,348.00	0.09
267	603882	金域医学	1,500	117,300.00	0.09
268	600489	中金黄金	14,300	117,117.00	0.09
269	600536	中国软件	2,000	116,660.00	0.08
270	603185	上机数控	1,100	116,435.00	0.08

271	300146	汤臣倍健	5,100	116,382.00	0.08
272	300699	光威复材	1,600	115,600.00	0.08
273	603899	晨光股份	2,100	115,458.00	0.08
274	002008	大族激光	4,500	115,425.00	0.08
275	300601	康泰生物	3,660	115,399.80	0.08
276	003816	中国广核	42,800	115,132.00	0.08
277	603939	益丰药房	1,800	114,912.00	0.08
278	002028	思源电气	3,000	114,660.00	0.08
279	000807	云铝股份	10,300	114,536.00	0.08
280	600418	江淮汽车	8,700	114,231.00	0.08
281	601108	财通证券	16,020	114,062.40	0.08
282	300037	新宙邦	2,620	113,891.40	0.08
283	300433	蓝思科技	10,800	113,724.00	0.08
284	002120	韵达股份	7,900	113,602.00	0.08
285	600039	四川路桥	10,200	113,424.00	0.08
286	600332	白云山	3,800	113,202.00	0.08
287	000630	铜陵有色	36,200	112,944.00	0.08
288	300073	当升科技	2,000	112,800.00	0.08
289	002841	视源股份	1,900	112,176.00	0.08
290	300144	宋城演艺	7,680	112,128.00	0.08
291	603833	欧派家居	922	112,050.66	0.08
292	002236	大华股份	9,900	111,969.00	0.08
293	600884	杉杉股份	6,100	111,020.00	0.08
294	603605	珀莱雅	660	110,536.80	0.08
295	600141	兴发集团	3,800	110,200.00	0.08
296	600399	抚顺特钢	7,700	110,187.00	0.08
297	603517	绝味食品	1,800	109,962.00	0.08
298	600859	王府井	3,900	109,746.00	0.08
299	300033	同花顺	1,100	108,471.00	0.08
300	300568	星源材质	5,100	108,426.00	0.08
301	002602	世纪华通	28,360	108,051.60	0.08
302	601077	渝农商行	30,500	107,665.00	0.08
303	300285	国瓷材料	3,900	107,523.00	0.08
304	600873	梅花生物	10,500	106,890.00	0.08
305	603816	顾家家居	2,500	106,775.00	0.08
306	603456	九洲药业	2,500	106,075.00	0.08
307	002185	华天科技	12,700	105,283.00	0.08
308	688126	沪硅产业	5,959	104,937.99	0.08
309	002138	顺络电子	4,000	104,720.00	0.08
310	300957	贝泰妮	700	104,468.00	0.08
311	002938	鹏鼎控股	3,800	104,272.00	0.08
312	601878	浙商证券	10,500	104,265.00	0.08
313	600160	巨化股份	6,700	103,917.00	0.08
314	603589	口子窖	1,800	103,806.00	0.08

315	601128	常熟银行	13,500	101,925.00	0.07
316	601799	星宇股份	800	101,896.00	0.07
317	000783	长江证券	19,100	101,803.00	0.07
318	002756	永兴材料	1,100	101,387.00	0.07
319	601360	三六零	15,500	101,370.00	0.07
320	600153	建发股份	7,400	101,010.00	0.07
321	601155	新城控股	4,898	100,409.00	0.07
322	000629	钒钛股份	21,200	100,276.00	0.07
323	688005	容百科技	1,452	99,825.00	0.07
324	601699	潞安环能	5,900	99,415.00	0.07
325	002568	百润股份	2,660	99,377.60	0.07
326	600362	江西铜业	5,700	99,351.00	0.07
327	300357	我武生物	1,800	99,180.00	0.07
328	688099	晶晨股份	1,404	98,996.04	0.07
329	601162	天风证券	34,210	98,182.70	0.07
330	601607	上海医药	5,500	98,065.00	0.07
331	000683	远兴能源	12,500	98,000.00	0.07
332	002192	融捷股份	1,000	97,900.00	0.07
333	688561	奇安信	1,473	96,879.21	0.07
334	600918	中泰证券	15,100	96,791.00	0.07
335	600392	盛和资源	6,900	96,600.00	0.07
336	600521	华海药业	4,400	96,184.00	0.07
337	600563	法拉电子	600	95,928.00	0.07
338	000932	华菱钢铁	20,400	95,880.00	0.07
338	601168	西部矿业	9,400	95,880.00	0.07
340	603596	伯特利	1,200	95,760.00	0.07
341	600109	国金证券	11,000	95,700.00	0.07
342	002223	鱼跃医疗	3,000	95,580.00	0.07
343	600161	天坛生物	4,024	95,489.52	0.07
344	000831	中国稀土	2,900	95,352.00	0.07
345	600499	科达制造	6,700	95,207.00	0.07
346	600027	华电国际	16,100	94,668.00	0.07
347	688567	孚能科技	3,488	94,280.64	0.07
348	000999	华润三九	2,000	93,620.00	0.07
349	600486	扬农化工	900	93,510.00	0.07
350	002797	第一创业	16,600	93,458.00	0.07
351	601865	福莱特	2,800	93,268.00	0.07
352	603077	和邦生物	30,500	92,720.00	0.07
353	000708	中信特钢	5,400	92,664.00	0.07
354	002294	信立泰	2,800	91,980.00	0.07
355	688301	奕瑞科技	200	91,576.00	0.07
356	300223	北京君正	1,300	91,572.00	0.07
357	600862	中航高科	4,100	91,389.00	0.07
358	603260	合盛硅业	1,100	91,234.00	0.07

359	002078	太阳纸业	7,900	91,008.00	0.07
360	601319	中国人保	17,400	90,828.00	0.07
361	600183	生益科技	6,300	90,783.00	0.07
362	688390	固德威	280	90,465.20	0.07
363	000975	银泰黄金	8,160	90,086.40	0.07
364	601636	旗滨集团	7,900	89,981.00	0.07
365	601872	招商轮船	16,080	89,887.20	0.07
366	600061	国投资本	14,004	89,485.56	0.07
367	600143	金发科技	9,212	89,264.28	0.06
368	300595	欧普康视	2,500	89,250.00	0.06
369	600497	驰宏锌锗	17,600	89,056.00	0.06
370	002268	卫士通	2,900	88,537.00	0.06
371	000408	藏格矿业	3,400	88,298.00	0.06
372	002532	天山铝业	11,400	88,008.00	0.06
373	002299	圣农发展	3,700	87,653.00	0.06
374	600018	上港集团	16,400	87,576.00	0.06
375	603486	科沃斯	1,200	87,528.00	0.06
376	300253	卫宁健康	8,500	87,380.00	0.06
377	601696	中银证券	8,200	86,674.00	0.06
378	600177	雅戈尔	13,668	86,518.44	0.06
379	601990	南京证券	10,900	86,437.00	0.06
380	601898	中煤能源	10,000	86,200.00	0.06
381	002025	航天电器	1,300	86,125.00	0.06
382	002439	启明星辰	3,300	86,064.00	0.06
383	600705	中航产融	26,200	85,936.00	0.06
384	600348	华阳股份	6,000	85,500.00	0.06
385	688385	复旦微电	1,219	85,098.39	0.06
386	002624	完美世界	6,650	84,588.00	0.06
387	000591	太阳能	11,500	84,295.00	0.06
388	300529	健帆生物	2,700	83,619.00	0.06
389	000998	隆平高科	5,200	83,564.00	0.06
390	002850	科达利	700	83,167.00	0.06
391	600026	中远海能	6,900	83,145.00	0.06
392	601998	中信银行	16,600	82,668.00	0.06
393	600482	中国动力	5,400	82,566.00	0.06
394	600549	厦门钨业	4,200	82,110.00	0.06
395	000738	航发控制	3,200	82,048.00	0.06
396	000728	国元证券	12,940	81,910.20	0.06
397	600258	首旅酒店	3,300	81,840.00	0.06
398	002273	水晶光电	6,900	81,351.00	0.06
399	600803	新奥股份	5,000	80,500.00	0.06
400	000988	华工科技	4,900	80,409.00	0.06
401	002673	西部证券	13,200	80,388.00	0.06
402	300604	长川科技	1,800	80,244.00	0.06



403	300832	新产业	1,600	80,224.00	0.06
404	002507	涪陵榨菜	3,100	79,887.00	0.06
405	603737	三棵树	700	79,681.00	0.06
406	002414	高德红外	7,190	79,090.00	0.06
407	601997	贵阳银行	14,400	79,056.00	0.06
408	002430	杭氧股份	2,000	78,720.00	0.06
409	603233	大参林	1,960	77,616.00	0.06
410	300363	博腾股份	1,900	77,615.00	0.06
411	300136	信维通信	4,700	77,597.00	0.06
412	002092	中泰化学	10,300	76,838.00	0.06
413	002916	深南电路	1,060	76,479.00	0.06
414	688303	大全能源	1,602	76,383.36	0.06
415	688187	时代电气	1,396	76,179.72	0.06
416	000703	恒逸石化	10,790	75,853.70	0.06
417	300308	中际旭创	2,800	75,684.00	0.06
418	002739	万达电影	5,400	75,600.00	0.05
419	600325	华发股份	8,300	75,198.00	0.05
420	002557	洽洽食品	1,500	75,000.00	0.05
421	002056	横店东磁	4,000	74,960.00	0.05
422	002030	达安基因	4,776	74,314.56	0.05
423	601198	东兴证券	9,600	74,112.00	0.05
424	600704	物产中大	15,400	74,074.00	0.05
425	002465	海格通信	9,100	73,892.00	0.05
426	600529	山东药玻	2,600	73,840.00	0.05
427	688169	石头科技	298	73,829.50	0.05
428	601666	平煤股份	6,800	73,508.00	0.05
429	601016	节能风电	19,290	73,494.90	0.05
430	002064	华峰化学	10,800	73,440.00	0.05
431	000729	燕京啤酒	6,900	73,278.00	0.05
432	600655	豫园股份	9,600	73,056.00	0.05
433	601216	君正集团	18,300	73,017.00	0.05
434	600879	航天电子	10,700	72,760.00	0.05
435	002353	杰瑞股份	2,600	72,566.00	0.05
436	002156	通富微电	4,400	72,512.00	0.05
437	300088	长信科技	12,100	72,237.00	0.05
438	300919	中伟股份	1,100	72,171.00	0.05
439	603267	鸿远电子	700	70,812.00	0.05
440	600415	小商品城	13,500	70,740.00	0.05
441	002080	中材科技	3,300	70,719.00	0.05
442	000830	鲁西化工	5,700	70,623.00	0.05
443	002409	雅克科技	1,400	70,518.00	0.05
444	000878	云南铜业	6,000	70,500.00	0.05
445	002683	广东宏大	2,600	70,096.00	0.05
446	000400	许继电气	3,500	69,895.00	0.05

447	600546	山煤国际	4,800	69,552.00	0.05
448	002600	领益智造	15,300	69,462.00	0.05
449	000960	锡业股份	4,900	69,090.00	0.05
450	000623	吉林敖东	4,600	68,954.00	0.05
451	600516	方大炭素	11,260	68,911.20	0.05
452	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.05
453	600170	上海建工	26,400	68,640.00	0.05
454	002444	巨星科技	3,600	68,328.00	0.05
455	600606	绿地控股	22,908	68,265.84	0.05
456	300017	网宿科技	12,100	67,518.00	0.05
457	600739	辽宁成大	5,350	67,356.50	0.05
458	600637	东方明珠	10,100	67,165.00	0.05
459	600642	申能股份	12,200	66,978.00	0.05
460	601577	长沙银行	9,900	66,924.00	0.05
461	603658	安图生物	1,080	66,798.00	0.05
462	002508	老板电器	2,400	66,624.00	0.05
463	600166	福田汽车	23,700	66,597.00	0.05
464	002531	天顺风能	4,400	66,572.00	0.05
465	601456	国联证券	5,900	66,375.00	0.05
466	603712	七一二	1,900	66,348.00	0.05
467	300418	昆仑万维	4,600	66,286.00	0.05
468	002372	伟星新材	3,100	66,154.00	0.05
469	600699	均胜电子	4,700	66,035.00	0.05
470	002203	海亮股份	5,800	65,540.00	0.05
471	601966	玲珑轮胎	3,200	65,536.00	0.05
472	002326	永太科技	3,000	65,490.00	0.05
473	603160	汇顶科技	1,300	65,260.00	0.05
474	688002	睿创微纳	1,753	65,194.07	0.05
475	000970	中科三环	4,775	65,131.00	0.05
476	601881	中国银河	7,000	65,030.00	0.05
477	600038	中直股份	1,400	64,974.00	0.05
478	600025	华能水电	9,800	64,680.00	0.05
479	603026	胜华新材	700	64,610.00	0.05
480	600380	健康元	5,700	64,353.00	0.05
481	600673	东阳光	7,400	64,306.00	0.05
482	000155	川能动力	3,600	64,224.00	0.05
483	000039	中集集团	9,100	64,064.00	0.05
484	600909	华安证券	13,840	63,525.60	0.05
485	689009	九号公司	2,080	63,419.20	0.05
486	600056	中国医药	3,680	63,406.40	0.05
487	600867	通化东宝	6,900	63,342.00	0.05
488	300373	扬杰科技	1,200	63,120.00	0.05
489	000750	国海证券	18,880	62,870.40	0.05
490	002831	裕同科技	1,900	62,833.00	0.05

491	300244	迪安诊断	2,500	62,825.00	0.05
492	603444	吉比特	200	62,568.00	0.05
493	600118	中国卫星	2,900	62,495.00	0.05
494	000739	普洛药业	2,900	62,466.00	0.05
495	002065	东华软件	11,000	62,260.00	0.05
496	300058	蓝色光标	12,300	62,115.00	0.05
497	300676	华大基因	1,200	62,028.00	0.05
498	600369	西南证券	16,400	61,500.00	0.04
499	600985	淮北矿业	4,800	61,440.00	0.04
500	688116	天奈科技	795	61,326.30	0.04
501	600008	首创环保	21,650	61,269.50	0.04
502	000513	丽珠集团	1,883	61,159.84	0.04
503	688009	中国通号	12,719	60,924.01	0.04
504	603127	昭衍新药	1,040	60,746.40	0.04
505	600372	中航电子	3,800	60,686.00	0.04
506	002152	广电运通	6,100	60,634.00	0.04
507	600435	北方导航	5,200	60,320.00	0.04
508	601880	辽港股份	37,100	60,102.00	0.04
509	600998	九州通	4,600	59,984.00	0.04
510	002936	郑州银行	25,444	59,793.40	0.04
511	002408	齐翔腾达	8,480	59,699.20	0.04
512	000027	深圳能源	9,360	59,529.60	0.04
513	300866	安克创新	1,000	59,270.00	0.04
514	000547	航天发展	6,300	59,157.00	0.04
515	300070	碧水源	12,500	59,125.00	0.04
516	300558	贝达药业	1,200	59,124.00	0.04
517	300026	红日药业	10,400	59,072.00	0.04
518	002131	利欧股份	33,300	58,941.00	0.04
518	002212	天融信	5,900	58,941.00	0.04
520	002506	协鑫集成	20,200	58,782.00	0.04
521	688363	华熙生物	433	58,576.24	0.04
522	002368	太极股份	2,080	58,510.40	0.04
523	002572	索菲亚	3,200	58,112.00	0.04
524	002926	华西证券	7,700	57,981.00	0.04
525	300383	光环新网	7,100	57,936.00	0.04
526	688065	凯赛生物	945	57,919.05	0.04
527	002183	怡亚通	9,000	57,870.00	0.04
528	603195	公牛集团	400	57,304.00	0.04
529	300474	景嘉微	1,050	57,298.50	0.04
530	600271	航天信息	5,500	57,255.00	0.04
531	300682	朗新科技	2,600	57,148.00	0.04
532	600820	隧道股份	10,800	56,916.00	0.04
533	603883	老百姓	1,402	56,738.94	0.04
534	603858	步长制药	2,700	56,727.00	0.04

535	002195	二三四五	28,200	56,682.00	0.04
536	300296	利亚德	10,000	56,600.00	0.04
537	000887	中鼎股份	3,900	56,433.00	0.04
538	600390	五矿资本	11,100	56,388.00	0.04
539	600863	内蒙华电	16,100	56,189.00	0.04
540	002500	山西证券	10,590	56,127.00	0.04
541	600580	卧龙电驱	4,500	56,070.00	0.04
542	600021	上海电力	5,600	56,056.00	0.04
543	002250	联化科技	3,600	55,800.00	0.04
544	600378	昊华科技	1,300	55,783.00	0.04
545	603156	养元饮品	2,500	55,675.00	0.04
546	600848	上海临港	4,667	55,630.64	0.04
547	002958	青农商行	19,200	55,488.00	0.04
548	600316	洪都航空	2,200	55,418.00	0.04
549	688538	和辉光电	20,607	55,226.76	0.04
550	603893	瑞芯微	800	55,048.00	0.04
551	300024	机器人	6,100	54,778.00	0.04
552	300001	特锐德	3,600	54,756.00	0.04
553	002244	滨江集团	6,200	54,746.00	0.04
554	300009	安科生物	5,816	54,437.76	0.04
555	601958	金铂股份	4,700	54,285.00	0.04
556	600755	厦门国贸	7,600	54,264.00	0.04
557	600315	上海家化	1,700	54,145.00	0.04
558	688779	长远锂科	3,705	54,055.95	0.04
559	600208	新湖中宝	21,200	53,848.00	0.04
560	002511	中顺洁柔	3,900	53,586.00	0.04
561	601231	环旭电子	3,300	53,559.00	0.04
562	603885	吉祥航空	3,300	53,394.00	0.04
563	000997	新大陆	4,100	53,341.00	0.04
564	688256	寒武纪	977	53,305.12	0.04
565	603927	中科软	1,800	53,298.00	0.04
566	688521	芯原股份	1,209	53,280.63	0.04
567	002155	湖南黄金	4,100	53,095.00	0.04
568	601808	中海油服	3,200	53,056.00	0.04
569	600511	国药股份	1,900	53,010.00	0.04
570	000060	中金岭南	12,900	52,890.00	0.04
571	000050	深天马 A	6,100	52,826.00	0.04
572	600060	海信视像	3,900	52,806.00	0.04
573	601992	金隅集团	20,600	52,324.00	0.04
574	601005	重庆钢铁	33,100	52,298.00	0.04
575	600566	济川药业	1,900	51,718.00	0.04
576	600201	生物股份	5,600	50,456.00	0.04
577	300776	帝尔激光	400	50,400.00	0.04
578	600801	华新水泥	3,400	50,388.00	0.04

579	600528	中铁工业	6,600	50,358.00	0.04
580	300251	光线传媒	5,800	50,228.00	0.04
581	601717	郑煤机	4,500	50,220.00	0.04
582	300168	万达信息	5,900	49,737.00	0.04
583	002939	长城证券	6,000	49,680.00	0.04
584	600066	宇通客车	6,600	49,566.00	0.04
585	000021	深科技	4,600	49,174.00	0.04
586	002373	千方科技	5,500	49,060.00	0.04
587	000825	太钢不锈	11,300	48,816.00	0.04
588	600171	上海贝岭	2,800	48,804.00	0.04
589	603218	日月股份	2,400	48,720.00	0.04
590	600906	财达证券	6,400	48,448.00	0.04
591	300677	英科医疗	2,300	48,369.00	0.04
592	600598	北大荒	3,500	48,160.00	0.04
593	600839	四川长虹	18,200	48,048.00	0.03
594	300850	新强联	900	47,952.00	0.03
595	600282	南钢股份	15,200	47,880.00	0.03
596	600970	中材国际	5,600	47,712.00	0.03
597	601866	中远海发	19,600	47,432.00	0.03
598	600535	天士力	4,400	47,344.00	0.03
599	601778	晶科科技	8,600	47,300.00	0.03
600	600827	百联股份	3,900	47,268.00	0.03
601	601665	齐鲁银行	11,300	47,121.00	0.03
602	603568	伟明环保	2,533	46,936.49	0.03
603	600500	中化国际	7,100	46,931.00	0.03
604	002128	电投能源	3,800	46,892.00	0.03
605	000930	中粮科技	5,600	46,816.00	0.03
606	002127	南极电商	9,700	46,657.00	0.03
607	601179	中国西电	10,100	46,561.00	0.03
608	002153	石基信息	3,100	46,469.00	0.03
609	002595	豪迈科技	2,000	46,300.00	0.03
610	000709	河钢股份	20,400	46,104.00	0.03
611	600498	烽火通信	3,500	45,990.00	0.03
612	300979	华利集团	800	45,688.00	0.03
613	000012	南玻 A	6,800	45,628.00	0.03
614	300182	捷成股份	10,200	45,594.00	0.03
615	600398	海澜之家	8,600	45,580.00	0.03
616	603000	人民网	2,700	45,549.00	0.03
617	002701	奥瑞金	8,900	44,945.00	0.03
618	688690	纳微科技	863	44,677.51	0.03
619	002032	苏泊尔	900	44,514.00	0.03
620	603707	健友股份	2,460	44,378.40	0.03
621	000581	威孚高科	2,500	44,325.00	0.03
622	300861	美畅股份	900	44,244.00	0.03

623	002124	天邦食品	7,240	44,236.40	0.03
624	002019	亿帆医药	3,600	44,100.00	0.03
625	000987	越秀资本	7,360	44,086.40	0.03
626	002396	星网锐捷	2,300	44,068.00	0.03
627	600959	江苏有线	14,800	43,956.00	0.03
628	000401	冀东水泥	5,300	43,619.00	0.03
629	000598	兴蓉环境	8,900	43,521.00	0.03
630	000877	天山股份	5,100	43,452.00	0.03
631	000778	新兴铸管	11,900	43,435.00	0.03
632	688188	柏楚电子	200	43,416.00	0.03
633	600895	张江高科	3,800	43,092.00	0.03
634	002670	国盛金控	5,800	42,978.00	0.03
635	300888	稳健医疗	600	42,900.00	0.03
636	300115	长盈精密	4,080	42,146.40	0.03
637	600582	天地科技	8,100	42,120.00	0.03
638	600297	广汇汽车	20,000	42,000.00	0.03
639	002249	大洋电机	8,200	41,984.00	0.03
640	600663	陆家嘴	4,300	41,882.00	0.03
641	600718	东软集团	4,200	41,790.00	0.03
642	688208	道通科技	1,320	41,646.00	0.03
643	002690	美亚光电	1,740	41,586.00	0.03
644	600507	方大特钢	6,891	41,483.82	0.03
645	002266	浙富控股	10,600	41,446.00	0.03
646	603225	新凤鸣	3,800	41,344.00	0.03
647	603866	桃李面包	2,680	41,272.00	0.03
648	600517	国网英大	8,500	41,140.00	0.03
649	300212	易华录	2,000	40,820.00	0.03
650	002505	鹏都农牧	15,800	40,764.00	0.03
651	000883	湖北能源	9,700	40,740.00	0.03
651	600329	达仁堂	1,400	40,740.00	0.03
653	002985	北摩高科	902	40,680.20	0.03
654	300482	万孚生物	1,270	40,474.90	0.03
655	600409	三友化工	6,100	40,321.00	0.03
656	600259	广晟有色	1,000	40,200.00	0.03
657	002002	鸿达兴业	12,400	40,176.00	0.03
658	000656	金科股份	21,000	40,110.00	0.03
659	000089	深圳机场	5,100	40,086.00	0.03
660	300618	寒锐钴业	1,000	40,050.00	0.03
661	601000	唐山港	14,600	40,004.00	0.03
662	600022	山东钢铁	27,000	39,960.00	0.03
663	600871	石化油服	20,100	39,798.00	0.03
664	600567	山鹰国际	16,000	39,680.00	0.03
665	000785	居然之家	9,700	39,673.00	0.03
666	300376	易事特	5,800	39,614.00	0.03

667	601106	中国一重	13,500	39,555.00	0.03
668	600064	南京高科	5,980	39,527.80	0.03
669	002468	申通快递	3,800	39,254.00	0.03
670	600782	新钢股份	9,500	38,855.00	0.03
671	002429	兆驰股份	11,100	38,739.00	0.03
672	000800	一汽解放	5,000	38,650.00	0.03
673	600216	浙江医药	3,300	38,577.00	0.03
674	300463	迈克生物	2,200	38,060.00	0.03
675	601333	广深铁路	16,700	37,909.00	0.03
676	601236	红塔证券	5,120	37,888.00	0.03
677	002081	金螳螂	7,800	37,830.00	0.03
677	601718	际华集团	13,000	37,830.00	0.03
679	688185	康希诺	258	37,673.16	0.03
680	600667	太极实业	7,300	37,668.00	0.03
681	600062	华润双鹤	2,100	37,569.00	0.03
682	688029	南微医学	457	37,533.41	0.03
683	601187	厦门银行	6,500	37,245.00	0.03
684	601118	海南橡胶	8,500	37,230.00	0.03
685	000537	广宇发展	2,800	37,044.00	0.03
686	002191	劲嘉股份	5,100	36,873.00	0.03
687	002010	传化智联	6,900	36,846.00	0.03
688	600737	中粮糖业	5,300	36,782.00	0.03
689	601156	东航物流	2,400	36,624.00	0.03
690	600597	光明乳业	3,400	36,584.00	0.03
691	000540	中天金融	24,200	36,542.00	0.03
692	600728	佳都科技	6,900	36,432.00	0.03
693	600376	首开股份	6,400	36,416.00	0.03
694	600155	华创阳安	5,600	36,400.00	0.03
695	600131	国网信通	2,400	35,904.00	0.03
696	002745	木林森	4,400	35,684.00	0.03
697	603228	景旺电子	1,760	35,622.40	0.03
698	605499	东鹏饮料	200	35,580.00	0.03
699	002221	东华能源	4,600	35,098.00	0.03
700	002416	爱施德	3,700	35,076.00	0.03
701	601098	中南传媒	3,500	34,930.00	0.03
702	600967	内蒙一机	4,200	34,692.00	0.03
703	601991	大唐发电	12,300	34,317.00	0.02
704	600126	杭钢股份	8,300	34,279.00	0.02
705	603379	三美股份	1,200	34,152.00	0.02
706	600808	马钢股份	12,000	33,720.00	0.02
707	000937	冀中能源	5,300	33,708.00	0.02
708	000156	华数传媒	4,500	33,705.00	0.02
709	002048	宁波华翔	2,400	33,360.00	0.02
710	601568	北元集团	5,860	33,226.20	0.02

711	002281	光迅科技	2,100	33,012.00	0.02
712	301029	怡合达	500	32,870.00	0.02
713	600901	江苏租赁	5,900	32,332.00	0.02
714	001914	招商积余	2,100	32,298.00	0.02
715	002423	中粮资本	4,500	32,220.00	0.02
716	000898	鞍钢股份	11,900	31,773.00	0.02
717	003035	南网能源	5,600	31,752.00	0.02
717	600095	湘财股份	4,200	31,752.00	0.02
719	000559	万向钱潮	6,500	31,655.00	0.02
720	600373	中文传媒	3,300	31,581.00	0.02
721	688289	圣湘生物	1,435	31,498.25	0.02
722	002434	万里扬	3,900	31,395.00	0.02
723	603056	德邦股份	1,500	31,245.00	0.02
724	000402	金融街	5,900	30,975.00	0.02
725	002867	周大生	2,200	30,866.00	0.02
726	300630	普利制药	1,226	30,233.16	0.02
727	603317	天味食品	1,096	30,118.08	0.02
728	601928	凤凰传媒	3,800	30,096.00	0.02
729	601608	中信重工	8,600	30,014.00	0.02
730	300257	开山股份	2,000	30,000.00	0.02
731	001203	大中矿业	2,300	29,739.00	0.02
732	000563	陕国投 A	9,800	29,694.00	0.02
733	601611	中国核建	3,900	29,640.00	0.02
734	601598	中国外运	7,700	29,568.00	0.02
735	600195	中牧股份	2,536	29,468.32	0.02
736	600707	彩虹股份	7,100	29,394.00	0.02
737	002948	青岛银行	8,720	29,299.20	0.02
738	000959	首钢股份	7,700	29,029.00	0.02
739	600968	海油发展	10,000	28,800.00	0.02
740	002110	三钢闽光	6,100	28,670.00	0.02
741	000967	盈峰环境	6,300	28,602.00	0.02
742	600167	联美控股	4,500	28,440.00	0.02
743	002705	新宝股份	1,700	28,305.00	0.02
744	603650	彤程新材	900	27,747.00	0.02
745	000415	渤海租赁	12,200	26,962.00	0.02
746	002925	盈趣科技	1,620	26,762.40	0.02
747	000990	诚志股份	3,000	26,400.00	0.02
748	601698	中国卫通	2,300	26,266.00	0.02
749	300869	康泰医学	800	26,056.00	0.02
750	688006	杭可科技	593	25,955.61	0.02
751	600307	酒钢宏兴	15,500	25,575.00	0.02
752	601828	美凯龙	5,420	25,419.80	0.02
753	603638	艾迪精密	1,700	25,364.00	0.02
754	688819	天能股份	673	24,726.02	0.02



755	002242	九阳股份	1,500	24,720.00	0.02
756	600339	中油工程	8,200	24,436.00	0.02
757	002399	海普瑞	1,900	24,415.00	0.02
758	000031	大悦城	6,400	24,064.00	0.02
759	600623	华谊集团	3,700	23,384.00	0.02
760	600928	西安银行	6,600	23,232.00	0.02
761	002146	荣盛发展	10,700	23,219.00	0.02
762	600764	中国海防	1,000	22,960.00	0.02
763	600648	外高桥	1,900	22,705.00	0.02
764	688088	虹软科技	990	22,284.90	0.02
765	002653	海思科	1,000	22,250.00	0.02
766	601969	海南矿业	3,000	22,230.00	0.02
767	603719	良品铺子	600	22,122.00	0.02
768	600006	东风汽车	3,900	21,762.00	0.02
769	600787	中储股份	4,300	21,371.00	0.02
770	000869	张裕 A	700	21,168.00	0.02
771	002563	森马服饰	4,000	20,960.00	0.02
772	000961	中南建设	9,500	20,805.00	0.02
773	600377	宁沪高速	2,500	20,550.00	0.01
774	000553	安道麦 A	2,200	19,910.00	0.01
775	601298	青岛港	3,500	19,635.00	0.01
776	601869	长飞光纤	600	19,578.00	0.01
777	000062	深圳华强	1,600	19,536.00	0.01
778	601139	深圳燃气	2,900	18,966.00	0.01
779	600350	山东高速	3,300	18,777.00	0.01
780	002945	华林证券	1,300	17,134.00	0.01
781	601228	广州港	5,300	16,695.00	0.01
782	600299	安迪苏	2,000	16,520.00	0.01
783	001872	招商港口	1,100	15,796.00	0.01
784	603355	莱克电气	560	15,702.40	0.01
785	601158	重庆水务	2,900	14,877.00	0.01
786	001289	龙源电力	800	14,616.00	0.01
787	600956	新天绿能	1,500	14,460.00	0.01
788	300741	华宝股份	600	14,118.00	0.01
789	603868	飞科电器	200	13,466.00	0.01
790	603786	科博达	200	13,166.00	0.01
791	600927	永安期货	800	12,896.00	0.01
792	600917	重庆燃气	1,600	12,736.00	0.01
793	001227	兰州银行	3,100	11,687.00	0.01
794	600032	浙江新能	1,000	11,490.00	0.01
795	688772	珠海冠宇	601	11,202.64	0.01
796	002901	大博医疗	300	10,209.00	0.01
797	301311	昆船智能	356	5,646.16	0.00
798	301290	东星医疗	123	4,320.99	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	7,751,315.00	7.69
2	000858	五粮液	4,219,697.00	4.19
3	000333	美的集团	3,050,655.00	3.03
4	300760	迈瑞医疗	2,871,703.00	2.85
5	300059	东方财富	2,800,212.00	2.78
6	002594	比亚迪	2,552,901.00	2.53
7	300274	阳光电源	2,099,640.00	2.08
8	002415	海康威视	2,015,753.00	2.00
9	002475	立讯精密	1,979,515.00	1.96
10	000651	格力电器	1,925,006.00	1.91
11	002714	牧原股份	1,911,722.82	1.90
12	000725	京东方 A	1,841,101.00	1.83
13	000568	泸州老窖	1,799,866.00	1.79
14	002466	天齐锂业	1,709,847.53	1.70
15	000661	长春高新	1,706,289.00	1.69
16	000792	盐湖股份	1,646,137.00	1.63
17	300124	汇川技术	1,628,424.00	1.62
18	002812	恩捷股份	1,625,188.00	1.61
19	300014	亿纬锂能	1,607,201.00	1.59
20	002142	宁波银行	1,584,337.00	1.57

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	6,150,558.00	6.10
2	000858	五粮液	3,443,776.00	3.42
3	300760	迈瑞医疗	2,514,197.00	2.49
4	000333	美的集团	2,487,620.00	2.47
5	300059	东方财富	2,183,403.00	2.17
6	002594	比亚迪	2,030,890.00	2.01

7	300274	阳光电源	1,879,496.00	1.86
8	002415	海康威视	1,652,351.00	1.64
9	002475	立讯精密	1,638,272.00	1.62
10	000651	格力电器	1,634,620.00	1.62
11	002466	天齐锂业	1,509,132.00	1.50
12	000661	长春高新	1,498,816.60	1.49
13	002714	牧原股份	1,493,416.00	1.48
14	000725	京东方 A	1,438,433.00	1.43
15	300124	汇川技术	1,425,722.00	1.41
16	000568	泸州老窖	1,398,023.00	1.39
17	002812	恩捷股份	1,396,425.00	1.39
18	002049	紫光国微	1,364,499.00	1.35
19	300014	亿纬锂能	1,333,521.00	1.32
20	000001	平安银行	1,256,551.00	1.25

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

#### 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	158,925,995.56
卖出股票收入（成交）总额	130,568,144.41

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货

合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

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

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	703,065.26
2	应收清算款	42,091.95
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	745,157.21

#### 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
836	139,843.1 1	89,358,519. 00	76.43%	27,550,324. 00	23.57%	61,802,743 .00	52.86%

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。

#### 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	国泰君安证券股份有限公司	9,357,184.00	8.00%
2	广发证券股份有限公司	5,404,361.00	4.62%
3	张招兴	5,000,000.00	4.28%
4	招商证券股份有限公司	3,106,766.00	2.66%
5	华泰证券股份有限公司	2,567,433.00	2.20%
6	邓玉良	2,213,600.00	1.89%

7	方正证券股份有限公司	2,153,900.00	1.84%
8	中信证券股份有限公司	1,752,962.00	1.50%
9	东方证券股份有限公司	1,554,667.00	1.33%
10	中信建投证券股份有限公司	966,943.00	0.83%
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	61,802,743.00	52.86%

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	68,908,843.00
本报告期基金总申购份额	258,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	210,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	116,908,843.00

## § 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 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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。

## 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

本基金自基金合同生效以来连续 4 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 27,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未因托管业务受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	24,036,393.50	8.35%	10,366.76	28.02%	-
华创证券	2	263,099,850.18	91.39%	26,313.91	71.12%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	735,629.00	0.26%	317.36	0.86%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 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	-	-	-	-	-	-
广发证券	49,502.99	8.38%	-	-	-	-
华创证券	541,212.39	91.62%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

#### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2022-01-07



		金电子披露网站	
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-01-21
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加天风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	2022-01-26
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报	2022-03-30
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华安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	2022-04-01
7	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	2022-04-11
8	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	2022-04-21
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-04-22
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金参与东方证券股份有限公司 A 股配股的公告	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	2022-04-30
11	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	2022-05-13
12	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
13	易方达基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	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	2022-06-18
14	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-07
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加江海证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-07-20
17	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华金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	2022-08-18
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证券报	2022-08-30

19	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	2022-09-21
20	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-10-26
21	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国金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	2022-12-21
22	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	2022-12-23
23	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加财达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	2022-12-29

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司—易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2022 年 01 月 01 日~2022 年 12 月 31 日	29,566,279.00	316,946,000.00	284,709,536.00	61,802,743.00	52.86%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

- 2.《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日