

易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
§ 8	基金份额持有人信息	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§ 9	开放式基金份额变动	51
§ 10	重大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	53
§ 11	备查文件目录	54
11.1	备查文件目录	54
11.2	存放地点	54
11.3	查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500 增强策略 ETF
场内简称	增强 500、中证 500ETF 增强
基金主代码	563030
交易代码	563030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 2 月 17 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	262,169,000.00 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	2023 年 3 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>股票（含存托凭证）投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。</p> <p>此外，为更好地实现投资目标，本基金将综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。同时，本基金可投资股指期货、股票期权和国债期货。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，并可根据相关法律法规参与融资业务。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。
--	--

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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	韩鑫普
	联系电话	020-85102688	0755-82943666
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95565
传真		020-38798812	0755-82960794
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
邮政编码		510620； 519031	518000
法定代表人		刘晓艳	霍达

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-18,904,328.54
本期利润	-8,483,807.25
加权平均基金份额本期利润	-0.0300
本期加权平均净值利润率	-3.41%
本期基金份额净值增长率	-3.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-34,988,765.08
期末可供分配基金份额利润	-0.1335
期末基金资产净值	227,180,234.92
期末基金份额净值	0.8665
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.35%

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

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

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

3.2 基金净值表现

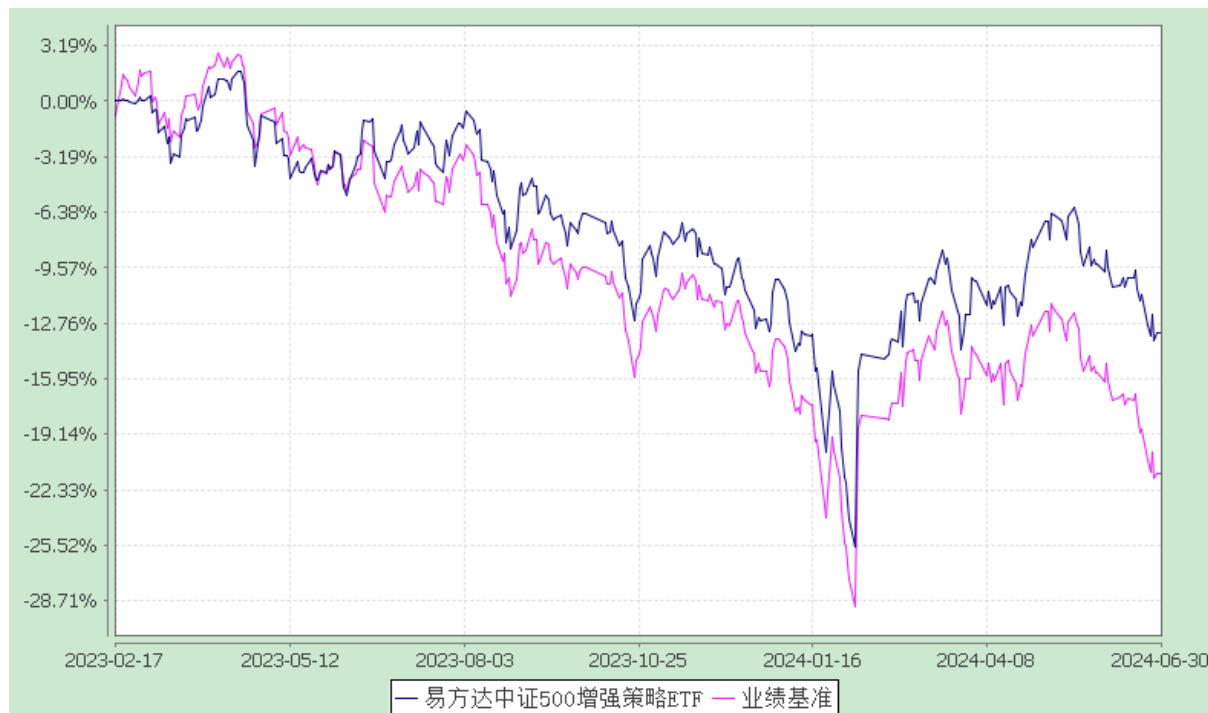
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.37%	0.90%	-6.89%	0.96%	2.52%	-0.06%
过去三个月	-1.24%	1.08%	-6.50%	1.14%	5.26%	-0.06%
过去六个月	-3.41%	1.53%	-8.96%	1.61%	5.55%	-0.08%
过去一年	-11.14%	1.23%	-17.60%	1.27%	6.46%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-13.35%	1.12%	-21.41%	1.17%	8.06%	-0.05%

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 500 增强策略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
 （2023 年 2 月 17 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-13.35%，同期业绩比较基准收益率为-21.41%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
官 泽 帆	本基金的基金经理,易方达中证 500 量化增强的基金经理, 量化投资部总经理助理	2023-02-17	-	14 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师, 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司数量化研究员、基金经理助理, 易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理, 易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达易百智能量化策略混合的基金经理。
张 湛	本基金的基金经理, 易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数 (LOF)、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证新能源 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接发起式、易方达中证医疗 ETF 联接发起式、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、易方达中证新能源 ETF 联接发起式的基金经理, 易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII)、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF 的基金经理助理	2023-02-17	-	15 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理, 易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证物联网主题 ETF 的基金经理。
徐 德 晖	本基金的基金经理助理, 量化研究员	2023-03-25	-	7 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司指数与量化研究员。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 31 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，5 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾本报告期，国内经济整体运行平稳，上半年国内生产总值，按不变价计算，同比增长 5.0%，但国内有效需求不足，经济回升向好基础仍需巩固：社会消费品零售总额上半年同比增长 3.7%，但 6 月份单月同比增长 2.0%，低于市场一致预期，低于前值 3.7%；从房地产投资与商品房销售数据来看，增速仍在下降；外需向好，出口是需求侧的主要向上动力，上半年出口总额同比增长 6.9%，出

口对经济增长的贡献率约为 13.9%。

市场表现方面，上半年市场整体先跌后涨，呈现震荡趋势，上证指数、沪深 300 的涨跌幅分别为-0.25%、0.89%，但中小盘指数普遍跌幅较大，中证 500 指数下跌 8.96%，中证 1000 指数下跌 16.84%，中证 2000 指数下跌 23.28%。行业表现结构分化特征明显，从申万行业指数来看，银行、煤炭、公用事业涨幅均超过两位数，分别为 17.02%、11.96%、11.76%；综合、计算机、商贸零售、社会服务的跌幅较大，均超过 24%，同时超过半数行业指数今年以来录得负收益。从风格表现的角度来看，市场整体风险偏好明显下降，防御类的估值因子、低波因子、红利因子等年初至今的表现明显领先于其他风格，小盘明显弱于大盘。综合来看，大盘价值的表现最好，小盘成长下跌幅度最大。

在此期间，作为指数增强型 ETF 基金，管理人在组合管理过程中，以基准指数的构成为基础，严格控制组合在行业与风格上的相对偏离，采用多因子量化选股模型对个股进行超低配，在兼顾 ETF 产品特性的基础上，减少系统性风格冲击，获取较为稳健的超额收益。

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 0.8665 元，本报告期份额净值增长率为-3.41%，同期业绩比较基准收益率为-8.96%。年化跟踪误差 2.79%，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

展望下一阶段，下半年出口大概率将保持较高增速，内需可能仍将面临一定的压力，但新一轮设备更新与财政加快基建等政策逐渐发力，或将对冲部分压力，经济基本面继续弱波动。股票市场方面，首先，高行业景气度的投资机会相对稀缺，在当前稳定资本市场预期的政策导向下，存量资金或将继续持有红利低波类标的；其次，部分风险偏好较高的资金仍可能继续追逐热门主题，例如算力、人工智能等，但需要关注企业未来业绩兑现情况；最后，需要注意下半年来自海外的宏观事件冲击，例如美联储降息对市场风格的冲击，美国总统大选对地缘政治风险的影响。

综上，下一阶段基金运作管理仍将迎来诸多方面的挑战，管理人将继续严格遵照多因子量化增强的投资模式进行操作，同时结合采用长期有效的基本面量化模型进行选股，配置稳健的策略模型，以顺应市场风格变换，为投资人创造持续稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

行估值及净值计算的复核责任。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券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。

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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,222,190.62	14,965,074.62
结算备付金		6,672,901.57	1,290,765.15
存出保证金		886,485.82	1,520,255.90
交易性金融资产	6.4.7.2	212,555,135.93	259,982,224.93
其中：股票投资		212,555,135.93	259,807,216.87
基金投资		-	-
债券投资		-	175,008.06
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		8,940.54	720,742.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,409.12	-
资产总计		227,421,063.60	278,479,062.80
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		95,559.15	117,639.61
应付托管费		19,111.81	23,527.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	126,157.72	90,961.52
负债合计		240,828.68	232,129.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	262,169,000.00	310,169,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-34,988,765.08	-31,922,066.47
净资产合计		227,180,234.92	278,246,933.53
负债和净资产总计		227,421,063.60	278,479,062.80

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 2 月 17 日至 2023 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8665 元，基金份额总额 262,169,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 17 日（基 金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,565,916.96	-9,385,313.12
1.利息收入		148,232.51	990,106.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	148,232.51	990,106.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,236,801.28	-7,652,238.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-21,158,806.24	-12,274,037.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	36,293.80	10,362.79

资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	148,518.93	-332.33
股利收益	6.4.7.14	2,737,192.23	4,611,768.54
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	10,420,521.29	-3,608,968.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	102,130.52	885,787.18
减：二、营业总支出		917,890.29	1,456,227.06
1. 管理人报酬		619,425.74	1,138,813.65
2. 托管费		123,885.18	227,762.77
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		536.41	0.36
8. 其他费用	6.4.7.18	174,042.96	89,650.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,483,807.25	-10,841,540.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,483,807.25	-10,841,540.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,483,807.25	-10,841,540.18

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日，上年度可比期间为 2023 年 2 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	310,169,000.00	-31,922,066.47	278,246,933.53
二、本期期初净资产	310,169,000.00	-31,922,066.47	278,246,933.53

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,000,000.00	-3,066,698.61	-51,066,698.61
（一）、综合收益总额	-	-8,483,807.25	-8,483,807.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-48,000,000.00	5,417,108.64	-42,582,891.36
其中：1.基金申购款	21,000,000.00	-3,560,686.04	17,439,313.96
2.基金赎回款	-69,000,000.00	8,977,794.68	-60,022,205.32
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	262,169,000.00	-34,988,765.08	227,180,234.92
项目	上年度可比期间 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,142,669,000.00	-	1,142,669,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-714,000,000.00	-10,659,530.32	-724,659,530.32
（一）、综合收益总额	-	-10,841,540.18	-10,841,540.18
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-714,000,000.00	182,009.86	-713,817,990.14
其中：1.基金申购款	88,500,000.00	-2,757,007.51	85,742,992.49
2.基金赎回款	-802,500,000.00	2,939,017.37	-799,560,982.63
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	428,669,000.00	-10,659,530.32	418,009,469.68

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日，上年度可比期间为 2023 年 2 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 增强策略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[2022]2597 号《关于准予易方达中证 500 增强策略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 500 增强策略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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,142,669,000.00 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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核

算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,222,190.62
等于：本金	7,219,113.86

加：应计利息	3,076.76
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	7,222,190.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	223,139,327.92	-	212,555,135.93	-10,584,191.99
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	223,139,327.92	-	212,555,135.93	-10,584,191.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,329,120.00	-	-	-
IC2409	6,329,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,329,120.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	7	6,825,280.00	496,160.00
合计	-	-	-	496,160.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	496,160.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

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

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,705.64

其中：交易所市场	26,705.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,452.08
合计	126,157.72

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	310,169,000.00	310,169,000.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-69,000,000.00	-69,000,000.00
本期末	262,169,000.00	262,169,000.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,898,630.04	-19,023,436.43	-31,922,066.47
本期期初	-12,898,630.04	-19,023,436.43	-31,922,066.47
本期利润	-18,904,328.54	10,420,521.29	-8,483,807.25
本期基金份额交易产生的变动数	3,767,618.45	1,649,490.19	5,417,108.64
其中：基金申购款	-1,382,382.14	-2,178,303.90	-3,560,686.04
基金赎回款	5,150,000.59	3,827,794.09	8,977,794.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,035,340.13	-6,953,424.95	-34,988,765.08

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	105,303.27
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	42,428.60	
其他	500.64	
合计	148,232.51	

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,655,518.10
股票投资收益——赎回差价收入	-2,503,288.14
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	-21,158,806.24

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	217,535,671.05
减：卖出股票成本总额	236,012,924.82
减：交易费用	178,264.33
买卖股票差价收入	-18,655,518.10

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	60,022,205.32
减：现金支付赎回款总额	25,641,709.32
减：赎回股票成本总额	36,883,784.14
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,503,288.14

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	40.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	36,253.08
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	36,293.80

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	225,311.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	188,996.49
减：应计利息总额	53.28
减：交易费用	8.92
买卖债券差价收入	36,253.08

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	148,518.93

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,737,192.23
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,737,192.23

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	9,803,561.29
——股票投资	9,803,561.29
——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	616,960.00
——权证投资	-
——期货投资	616,960.00
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	10,420,521.29

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	102,130.52
合计	102,130.52

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	84,535.36
合计	174,042.96

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
招商证券股份有限公司	基金托管人、申购赎回代办证券公司
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

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年2月17日（基金合同生效 日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	619,425.74	1,138,813.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	128,415.78	174,445.70
应支付基金管理人的净管理费	491,009.96	964,367.95

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年2月17日（基金合同 生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	123,885.18	227,762.77

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	4,022,500.00	1.5343%	1,046,600.00	0.3374%

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

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	新股网下发行	872	75,829.12
上年度可比期间 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	新股网下发行	6,018	151,954.50
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	新股网下发行	2,289	60,315.15

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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	587	6,973.56	11,141.26	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	157	7,057.15	10,351.01	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	569	40,097.24	106,977.69	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	390	6,318.00	6,224.40	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月以内	新股流通受限	18.65	18.65	1,138	21,223.70	21,223.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	127	2,368.55	2,368.55	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	107	3,105.14	2,713.52	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	45	3,260.70	3,062.70	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	141	3,666.00	5,286.09	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	159	3,049.62	3,602.94	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月以内	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股流通	23.35	25.13	109	2,545.15	2,739.17	-

				受限						
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	410	9,290.60	6,514.90	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	88	7,652.48	15,393.84	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	502	7,876.38	9,432.58	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投

资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，理论上其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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.06%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	175,008.06
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	175,008.06

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金

资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,222,190.62	-	-	-	7,222,190.62
结算备付金	6,672,901.57	-	-	-	6,672,901.57
存出保证金	886,485.82	-	-	-	886,485.82
交易性金融资产	-	-	-	212,555,135.93	212,555,135.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	8,940.54	8,940.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	14,781,578.01	-	-	212,639,485.59	227,421,063.60
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	-	-	-	95,559.15	95,559.15
应付托管费	-	-	-	19,111.81	19,111.81
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	-	-	-	126,157.72	126,157.72
负债总计	-	-	-	240,828.68	240,828.68
利率敏感度缺口	14,781,578.01	-	-	212,398,656.91	227,180,234.92
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,965,074.62	-	-	-	14,965,074.62
结算备付金	1,290,765.15	-	-	-	1,290,765.15
存出保证金	1,520,255.90	-	-	-	1,520,255.90
交易性金融资产	-	175,008.06	-	259,807,216.87	259,982,224.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	720,742.20	720,742.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,776,095.67	175,008.06	-	260,527,959.07	278,479,062.80
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	-	-	-	117,639.61	117,639.61
应付托管费	-	-	-	23,527.91	23,527.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.23	0.23

应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	90,961.52	90,961.52
负债总计	-	-	232,129.27	232,129.27
利率敏感度缺口	17,776,095.67	175,008.06	260,295,829.80	278,246,933.53

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	212,555,135.93	93.56	259,807,216.87	93.37
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	212,555,135.93	93.56	259,807,216.87	93.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	10,420,614.78	12,840,763.06
2.业绩比较基准下降 5%	-10,420,614.78	-12,840,763.06	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	212,202,851.27
第二层次	45,200.81
第三层次	307,083.85
合计	212,555,135.93

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	212,555,135.93	93.46
	其中：股票	212,555,135.93	93.46
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	13,895,092.19	6.11
8	其他各项资产	970,835.48	0.43
9	合计	227,421,063.60	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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	965,306.00	0.42
B	采矿业	10,414,593.00	4.58
C	制造业	115,992,699.56	51.06

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,816,356.00	3.44
E	建筑业	2,947,312.00	1.30
F	批发和零售业	1,040,164.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	4,465,660.00	1.97
H	住宿和餐饮业	1,184,365.00	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,271,597.22	4.52
J	金融业	13,703,534.90	6.03
K	房地产业	2,324,436.00	1.02
L	租赁和商务服务业	1,217,159.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,465,296.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,394,490.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	1,616,424.00	0.71
S	综合	-	-
	合计	176,819,392.68	77.83

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,500,968.00	1.10
C	制造业	19,669,899.64	8.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,174,790.00	0.52
F	批发和零售业	999,459.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,706,737.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,338,619.51	2.35
J	金融业	2,625,714.00	1.16

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	680,686.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	1,032,645.70	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	6,224.40	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,735,743.25	15.73

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

7.3.1 期末指数投资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	300502	新易盛	28,900	3,050,395.00	1.34
2	002384	东山精密	120,300	2,490,210.00	1.10
3	600066	宇通客车	88,600	2,285,880.00	1.01
4	002340	格林美	353,700	2,253,069.00	0.99
5	601058	赛轮轮胎	156,500	2,191,000.00	0.96
6	601233	桐昆股份	135,300	2,159,388.00	0.95
7	002273	水晶光电	121,700	2,066,466.00	0.91
8	002028	思源电气	30,600	2,047,140.00	0.90
9	688169	石头科技	5,102	2,003,045.20	0.88
10	000423	东阿阿胶	31,500	1,971,900.00	0.87
11	300394	天孚通信	22,080	1,952,313.60	0.86
12	000630	铜陵有色	533,500	1,925,935.00	0.85
13	601128	常熟银行	254,160	1,923,991.20	0.85
14	603160	汇顶科技	27,900	1,918,125.00	0.84
15	300207	欣旺达	124,200	1,884,114.00	0.83
16	002128	电投能源	89,000	1,877,900.00	0.83
17	002532	天山铝业	231,500	1,877,465.00	0.83
18	688099	晶晨股份	31,295	1,856,419.40	0.82
19	002353	杰瑞股份	52,700	1,848,716.00	0.81
20	002138	顺络电子	66,700	1,831,582.00	0.81
21	600988	赤峰黄金	111,500	1,821,910.00	0.80

22	601555	东吴证券	306,100	1,805,990.00	0.79
23	601577	长沙银行	220,100	1,800,418.00	0.79
24	002078	太阳纸业	127,300	1,775,835.00	0.78
25	600642	申能股份	199,800	1,764,234.00	0.78
26	601108	财通证券	264,870	1,750,790.70	0.77
27	002517	恺英网络	182,100	1,739,055.00	0.77
28	002008	大族激光	83,600	1,738,880.00	0.77
29	300866	安克创新	24,266	1,727,981.86	0.76
30	688180	君实生物	59,162	1,718,656.10	0.76
31	000683	远兴能源	248,400	1,716,444.00	0.76
32	300054	鼎龙股份	75,600	1,714,608.00	0.75
33	000703	恒逸石化	237,100	1,681,039.00	0.74
34	600885	宏发股份	59,800	1,655,264.00	0.73
35	601615	明阳智能	174,800	1,650,112.00	0.73
36	000738	航发控制	81,900	1,643,733.00	0.72
37	600038	中直股份	39,900	1,640,289.00	0.72
38	002155	湖南黄金	90,500	1,638,050.00	0.72
39	600021	上海电力	164,100	1,622,949.00	0.71
40	600521	华海药业	95,100	1,621,455.00	0.71
41	300677	英科医疗	60,200	1,613,962.00	0.71
42	000400	许继电气	46,900	1,613,829.00	0.71
43	002025	航天电器	34,300	1,590,834.00	0.70
44	300001	特锐德	79,000	1,589,480.00	0.70
45	300529	健帆生物	58,300	1,586,343.00	0.70
46	601717	郑煤机	106,400	1,574,720.00	0.69
47	000883	湖北能源	261,300	1,570,413.00	0.69
48	601666	平煤股份	139,600	1,563,520.00	0.69
49	000830	鲁西化工	133,900	1,551,901.00	0.68
50	603893	瑞芯微	26,100	1,544,337.00	0.68
51	000598	兴蓉环境	204,600	1,538,592.00	0.68
52	600141	兴发集团	79,600	1,518,768.00	0.67
53	688065	凯赛生物	33,378	1,515,027.42	0.67
54	300251	光线传媒	179,800	1,512,118.00	0.67
55	600970	中材国际	124,400	1,500,264.00	0.66
56	300724	捷佳伟创	27,700	1,496,077.00	0.66
57	000728	国元证券	246,000	1,490,760.00	0.66
58	002064	华峰化学	207,900	1,490,643.00	0.66
59	603568	伟明环保	71,200	1,465,296.00	0.64
60	600516	方大炭素	338,700	1,459,797.00	0.64
61	600820	隧道股份	221,600	1,447,048.00	0.64
62	300285	国瓷材料	80,700	1,440,495.00	0.63
63	002939	长城证券	214,300	1,435,810.00	0.63
64	688188	柏楚电子	7,694	1,419,927.70	0.63
65	600499	科达制造	167,200	1,409,496.00	0.62

66	002203	海亮股份	176,200	1,406,076.00	0.62
67	600637	东方明珠	229,700	1,396,576.00	0.61
68	600763	通策医疗	25,800	1,394,490.00	0.61
69	688002	睿创微纳	49,837	1,393,940.89	0.61
70	601966	玲珑轮胎	75,600	1,388,772.00	0.61
71	600399	抚顺特钢	243,300	1,369,779.00	0.60
72	002019	亿帆医药	110,700	1,368,252.00	0.60
73	002120	韵达股份	176,200	1,363,788.00	0.60
74	603885	吉祥航空	123,800	1,360,562.00	0.60
75	603486	科沃斯	28,800	1,358,784.00	0.60
76	688029	南微医学	22,002	1,354,443.12	0.60
77	600737	中粮糖业	139,700	1,339,723.00	0.59
78	601636	旗滨集团	207,400	1,337,730.00	0.59
79	600801	华新水泥	96,800	1,331,000.00	0.59
80	600008	首创环保	492,600	1,320,168.00	0.58
81	003031	中瓷电子	28,480	1,316,915.20	0.58
82	002557	洽洽食品	45,800	1,291,102.00	0.57
83	002683	广东宏大	63,500	1,278,255.00	0.56
84	600862	中航高科	65,800	1,235,724.00	0.54
85	000709	河钢股份	636,400	1,234,616.00	0.54
86	300558	贝达药业	37,700	1,227,135.00	0.54
87	600663	陆家嘴	138,700	1,223,334.00	0.54
88	600153	建发股份	136,300	1,217,159.00	0.54
89	600529	山东药玻	47,900	1,213,786.00	0.53
90	603737	三棵树	32,940	1,194,733.80	0.53
91	001203	大中矿业	124,200	1,193,562.00	0.53
92	600258	首旅酒店	95,900	1,184,365.00	0.52
93	603786	科博达	18,400	1,180,360.00	0.52
94	600872	中炬高新	51,000	1,157,190.00	0.51
95	300682	朗新集团	134,500	1,144,595.00	0.50
96	000887	中鼎股份	93,300	1,141,992.00	0.50
97	002945	华林证券	112,100	1,118,758.00	0.49
98	688516	奥特维	26,537	1,109,511.97	0.49
99	600208	新湖中宝	696,900	1,101,102.00	0.48
100	603517	绝味食品	70,700	1,088,780.00	0.48
101	603317	天味食品	93,220	1,063,640.20	0.47
102	002531	天顺风能	117,100	1,046,874.00	0.46
103	600859	王府井	88,600	1,040,164.00	0.46
104	300383	光环新网	121,900	1,030,055.00	0.45
105	603056	德邦股份	78,100	1,023,110.00	0.45
106	600155	华创云信	170,600	1,008,246.00	0.44
107	000998	隆平高科	98,200	965,306.00	0.42
108	000825	太钢不锈	274,500	927,810.00	0.41
109	002653	海思科	29,600	908,720.00	0.40

110	603826	坤彩科技	29,260	847,662.20	0.37
111	002595	豪迈科技	21,600	824,472.00	0.36
112	603444	吉比特	4,400	783,244.00	0.34
113	002153	石基信息	134,600	771,258.00	0.34
114	601696	中银证券	83,700	759,996.00	0.33
115	600377	宁沪高速	57,000	718,200.00	0.32
116	603345	安井食品	9,600	713,376.00	0.31
117	600109	国金证券	80,300	606,265.00	0.27
118	603218	日月股份	55,500	569,985.00	0.25
119	002465	海格通信	52,100	539,756.00	0.24
120	600315	上海家化	28,100	499,618.00	0.22
121	600985	淮北矿业	29,700	497,178.00	0.22
122	300776	帝尔激光	6,600	303,336.00	0.13
123	601168	西部矿业	13,800	247,710.00	0.11
124	000959	首钢股份	63,700	173,264.00	0.08
125	600546	山煤国际	9,100	133,042.00	0.06
126	002152	广电运通	12,000	125,520.00	0.06
127	600959	江苏有线	46,258	122,121.12	0.05
128	000933	神火股份	6,000	121,380.00	0.05
129	002563	森马服饰	19,300	112,133.00	0.05
130	603979	金诚信	1,800	90,954.00	0.04
131	601098	中南传媒	6,200	77,004.00	0.03
132	600699	均胜电子	4,900	72,618.00	0.03
133	600968	海油发展	17,600	72,512.00	0.03
134	600143	金发科技	9,900	65,439.00	0.03
135	300144	宋城演艺	3,400	27,302.00	0.01
136	000997	新大陆	600	8,346.00	0.00
137	601077	渝农商行	500	2,510.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	688076	诺泰生物	21,034	1,646,541.52	0.72
2	688018	乐鑫科技	12,681	1,251,361.08	0.55
3	600000	浦发银行	137,400	1,130,802.00	0.50
4	300679	电连技术	28,000	1,126,440.00	0.50
5	601601	中国太保	40,000	1,114,400.00	0.49
6	601919	中远海控	71,300	1,104,437.00	0.49
7	688139	海尔生物	29,336	1,091,299.20	0.48
8	688208	道通科技	45,141	1,089,703.74	0.48
9	603267	鸿远电子	31,600	1,077,560.00	0.47
10	688533	上声电子	40,483	1,047,295.21	0.46

11	688222	成都先导	90,982	1,032,645.70	0.45
12	688368	晶丰明源	18,336	1,015,814.40	0.45
13	688088	虹软科技	35,076	1,012,293.36	0.45
14	601808	中海油服	58,500	1,006,200.00	0.44
15	601001	晋控煤业	60,900	1,006,068.00	0.44
16	300783	三只松鼠	45,700	999,459.00	0.44
17	603348	文灿股份	36,000	996,840.00	0.44
18	601800	中国交建	108,100	966,414.00	0.43
19	603983	丸美股份	35,100	966,303.00	0.43
20	300841	康华生物	18,975	960,894.00	0.42
21	601137	博威合金	62,300	949,452.00	0.42
22	605305	中际联合	36,480	940,819.20	0.41
23	688050	爱博医疗	12,769	936,223.08	0.41
24	688408	中信博	10,083	928,442.64	0.41
25	688095	福昕软件	19,476	892,195.56	0.39
26	300896	爱美客	4,700	808,870.00	0.36
27	688016	心脉医疗	7,905	775,085.25	0.34
28	003038	鑫铂股份	51,840	765,676.80	0.34
29	688036	传音控股	9,552	731,110.08	0.32
30	002906	华阳集团	26,800	717,168.00	0.32
31	300662	科锐国际	42,200	680,686.00	0.30
32	688123	聚辰股份	10,249	623,446.67	0.27
33	002928	华夏航空	95,000	602,300.00	0.27
34	300031	宝通科技	40,400	580,548.00	0.26
35	300596	利安隆	21,100	572,443.00	0.25
36	688111	金山办公	2,438	554,645.00	0.24
37	000975	银泰黄金	30,000	488,700.00	0.22
38	601318	中国平安	9,200	380,512.00	0.17
39	600882	妙可蓝多	29,200	364,124.00	0.16
40	601886	江河集团	42,700	208,376.00	0.09
41	688595	芯海科技	5,535	166,050.00	0.07
42	301589	诺瓦星云	569	106,977.69	0.05
43	688586	江航装备	7,937	73,814.10	0.03
44	603285	键邦股份	1,265	23,592.25	0.01
45	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
46	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.01
47	688692	达梦数据	88	15,393.84	0.01
48	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
49	301565	中仑新材	587	11,141.26	0.00
50	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
51	301580	爱迪特	157	10,351.01	0.00
52	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
53	688709	成都华微	502	9,432.58	0.00
54	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00

55	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
56	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
57	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
58	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
59	688584	上海合晶	410	6,514.90	0.00
60	601033	永兴股份	390	6,224.40	0.00
61	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
62	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
63	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
64	603341	龙旗科技	141	5,286.09	0.00
65	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
66	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
67	603344	星德胜	159	3,602.94	0.00
68	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
69	603325	博隆技术	45	3,062.70	0.00
70	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
71	603381	永臻股份	109	2,739.17	0.00
72	603312	西典新能	107	2,713.52	0.00
73	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	2,640,712.00	0.95
2	688180	君实生物	2,553,816.34	0.92
3	002340	格林美	2,550,939.00	0.92
4	000423	东阿阿胶	2,289,369.00	0.82
5	300682	朗新集团	2,197,410.00	0.79
6	002517	恺英网络	2,177,976.00	0.78
7	002078	太阳纸业	2,174,334.00	0.78
8	002532	天山铝业	2,129,024.00	0.77
9	300207	欣旺达	2,037,503.00	0.73
10	600642	申能股份	2,036,843.00	0.73
11	002384	东山精密	2,012,797.00	0.72
12	000975	银泰黄金	1,977,017.00	0.71
13	000830	鲁西化工	1,934,281.00	0.70
14	600109	国金证券	1,927,125.00	0.69
15	600862	中航高科	1,911,113.00	0.69
16	002273	水晶光电	1,906,162.00	0.69

17	300776	帝尔激光	1,900,246.00	0.68
18	002463	沪电股份	1,897,114.00	0.68
19	000703	恒逸石化	1,896,187.00	0.68
20	000598	兴蓉环境	1,892,436.86	0.68

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	601168	西部矿业	2,917,966.00	1.05
2	300308	中际旭创	2,528,649.00	0.91
3	002223	鱼跃医疗	2,472,505.00	0.89
4	300017	网宿科技	2,370,397.00	0.85
5	000932	华菱钢铁	2,364,036.80	0.85
6	603939	益丰药房	2,231,044.40	0.80
7	000783	长江证券	2,229,781.00	0.80
8	000975	银泰黄金	2,188,599.00	0.79
9	002244	滨江集团	2,154,807.00	0.77
10	002463	沪电股份	2,135,847.00	0.77
11	300395	菲利华	2,120,697.00	0.76
12	600418	江淮汽车	2,074,660.00	0.75
13	603338	浙江鼎力	2,009,206.00	0.72
14	300394	天孚通信	1,965,373.00	0.71
15	600566	济川药业	1,955,317.40	0.70
16	000878	云南铜业	1,951,140.19	0.70
17	300568	星源材质	1,923,380.00	0.69
18	600161	天坛生物	1,907,540.00	0.69
19	300487	蓝晓科技	1,907,132.00	0.69
20	000997	新大陆	1,872,515.00	0.67

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	207,225,567.09
卖出股票收入（成交）总额	217,535,671.05

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	886,485.82
2	应收清算款	8,940.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	970,835.48

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
4,426	59,233.85	22,170,690.00	8.46%	239,998,310.00	91.54%

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	东方证券股份有限公司	7,106,990.00	2.71%
2	广发证券股份有限公司	4,022,500.00	1.53%
3	王琦	4,000,000.00	1.53%
4	方正证券股份有限公司	3,046,400.00	1.16%
5	广丰集团有限公司	2,700,000.00	1.03%
6	莫惠嫦	2,000,000.00	0.76%
7	赵丽娟	2,000,000.00	0.76%
8	周津锁	2,000,000.00	0.76%
9	花艳	1,741,700.00	0.66%
10	余贯虹	1,708,100.00	0.65%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 2 月 17 日）基金份额总额	1,142,669,000.00
本报告期期初基金份额总额	310,169,000.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	69,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	262,169,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
天风证券	2	35,497,325.51	8.38%	3,550.18	8.38%	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	387,880,962.53	91.62%	38,789.98	91.62%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	225,311.77	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-01-19
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-11
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加财通证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-18
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报	2024-03-29
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-20
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-30
9	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2024-06-05

	电子披露网站	
--	--------	--

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 500 增强策略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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证 500 增强策略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。

11.2 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。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日