

易方达北证 50 成份指数证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42

7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§ 11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录	48
11.2 存放地点	48
11.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达北证 50 成份指数证券投资基金	
基金简称	易方达北证 50 成份指数	
基金主代码	017515	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 27 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	418,483,243.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达北证 50 成份指数 A	易方达北证 50 成份指数 C
下属分级基金的交易代码	017515	017516
报告期末下属分级基金的份额总额	115,428,697.31 份	303,054,546.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股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，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的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 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，主要投资策略包括资产配置策略、股票（含存托凭证）投资策略、债券和货币市场工具投资策略、股指期货和股票期权投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。
业绩比较基准	北证 50 成份指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	王玉	方圆
	联系电话	020-85102688	95559

负责人	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38798812	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		510620；519031	200336
法定代表人		刘晓艳	任德奇

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	易方达基金管理有限公司	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

§ 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）	
	易方达北证 50 成份指数 A	易方达北证 50 成份指数 C
本期已实现收益	-3,600,683.17	-9,365,957.41
本期利润	-33,438,181.92	-67,131,225.44
加权平均基金份额本期利润	-0.3350	-0.3218
本期加权平均净值利润率	-39.68%	-38.88%

本期基金份额净值增长率	-32.30%	-32.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达北证 50 成份指数 A	易方达北证 50 成份指数 C
期末可供分配利润	-31,446,872.90	-83,544,932.99
期末可供分配基金份额利润	-0.2724	-0.2757
期末基金资产净值	83,981,824.41	219,509,613.20
期末基金份额净值	0.7276	0.7243
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达北证 50 成份指数 A	易方达北证 50 成份指数 C
基金份额累计净值增长率	-27.24%	-27.57%

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

易方达北证 50 成份指数 A

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	-7.54%	1.43%	-7.71%	1.42%	0.17%	0.01%
过去三个月	-14.78%	1.47%	-15.40%	1.47%	0.62%	0.00%
过去六个月	-32.30%	2.19%	-33.01%	2.20%	0.71%	-0.01%
过去一年	-18.82%	2.22%	-19.33%	2.26%	0.51%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-27.24%	1.87%	-23.30%	1.93%	-3.94%	-0.06%

易方达北证 50 成份指数 C

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	-7.57%	1.43%	-7.71%	1.42%	0.14%	0.01%
过去三个月	-14.85%	1.47%	-15.40%	1.47%	0.55%	0.00%
过去六个月	-32.41%	2.19%	-33.01%	2.20%	0.60%	-0.01%
过去一年	-19.07%	2.22%	-19.33%	2.26%	0.26%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	-27.57%	1.87%	-23.30%	1.93%	-4.27%	-0.06%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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

易方达北证 50 成份指数证券投资基金
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
(2022 年 12 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达北证 50 成份指数 A



易方达北证 50 成份指数 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-27.24%，同期业绩比较基准收益率为-23.30%；C 类基金份额净值增长率为-27.57%，同期业绩比较基准收益率为-23.30%。

§ 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		
庞亚平	本基金的基金经理，易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证	2022-12-27	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量

	500ETF 联接发起式、易方达中证 500ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证光伏产业指数发起式（自 2023 年 04 月 11 日至 2024 年 05 月 06 日）、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 100ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接的基金经理，指数研究部总经理				投资部总监。
宋 钊 贤	本基金的基金经理助理，易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、易方达中证红利 ETF、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）、易方达中证香港证券投资主题 ETF、易方达中证石化产业 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证现代农业主题 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达中证装备产业 ETF、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达中证全指建筑材料 ETF、易方达中证装备产业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证沪港深 300ETF（自 2021 年 09 月 18 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达中证龙头企业指数、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达 MSCI 美国 50ETF（QDII）、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证 A50ETF 的基金经理助理	2023-01-18	-	10 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投资支持专员、研究员、投资经理助理、投资经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确

定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金跟踪北证 50 成份指数，该指数由北京证券交易所规模大、流动性好的最具市场代表性的 50 只上市公司证券组成，以综合反映北京证券交易所上市证券的整体表现。本基金主要采取完全复

制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2024 年上半年，在新一轮稳增长宏观政策效应持续释放、内需及外需均有所改善、工业生产保持较快增长速度等积极因素的带动下，我国国民经济运行总体平稳，转型升级稳步推进，内生增长动力持续培育。按不变价格计算，上半年我国国内生产总值同比增长 5.0%。工业生产实现较快增长，全国规模以上工业增加值上半年同比增长 6.0%，其中高技术制造业和装备制造业的增速均快于全部规模以上工业。社会消费品零售、固定资产投资和货物进出口均保持同比增长态势，居民人均可支配收入继续增长。与此同时，我国经济发展仍然面临着诸多内外部挑战。国内大循环不够顺畅、有效需求不足、重点领域风险隐患较多等突出问题有待破局。外部环境更趋严峻复杂，国际层面的风险因素明显增多。

资本市场方面，国务院《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（新“国九条”）和一系列资本市场配套政策举措“组合拳”的推出，有望重塑资本市场生态，切实维护市场秩序和投资者合法权益，筑牢资本市场健康稳定发展的基础，形成促进资本市场高质量发展的合力。上半年 A 股市场整体呈现宽幅震荡的走势。为深入贯彻落实中央金融工作会议精神和新“国九条”要求，北京证券交易所针对性地修订完善公开发行并上市、重大资产重组、股份减持、分红、退市等方面涉及的 6 项配套业务规则，并向市场公开征求意见。本次修订有利于完善北交所市场基础制度体系，加强对各类违法违规行为的监管，强化北交所服务创新型中小企业的市场定位，从而推进北交所市场高质量建设。受市场风格变化及流动性承压等因素影响，上半年北证 50 成份指数下跌 34.52%，收益率表现弱于 A 股大盘。

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 A 类基金份额净值为 0.7276 元，本报告期份额净值增长率为-32.30%，同期业绩比较基准收益率为-33.01%；C 类基金份额净值为 0.7243 元，本报告期份额净值增长率为-32.41%，同期业绩比较基准收益率为-33.01%。年化跟踪误差 0.69%，在合同规定的目标控制范围内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，我国各领域进一步全面深化改革的实施方案有望落地。中共二十届三中全

会提出高水平社会主义市场经济体制是中国式现代化的重要保障，高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务，对进一步全面深化改革做出系统部署。宏观调控政策方面，在落实好上半年已出台各项稳增长政策的基础上，积极的财政政策将更好地发力见效，稳健的货币政策将坚持灵活适度、精准有效，保持流动性合理充裕。政策聚焦关键环节发力，有望不断增强经济发展内生动力，提高内外循环的质量和水平。另一方面，当前经济运行中面临的主要风险需要有针对性地防范化解。综合来看，我国超大规模市场和完备的产业链蕴含强大的发展动能，经济运行面临的有利条件强于不利因素，宏观政策注重精准发力、加大逆周期调节力度，将巩固实体经济平稳运行的良好态势，同时有力推动新质生产力的不断发展，为完成全年经济社会发展目标提供关键助力。

指数成份公司的盈利是指数基金收益的直接来源，未来随着新一轮深化改革红利的逐步释放，符合高质量发展导向和新质生产力培育方向的 A 股各领域上市公司将迎来中长期发展机遇，财务业绩有望持续增长，为相关指数的上行提供动力。随着资本市场改革进入新的阶段，作为多层次资本市场中的关键一环，北交所将在支持中小企业科技创新、服务新质生产力发展中发挥更重要的作用，更多具备技术和品牌竞争力、成长潜力强的专精特新企业有望登陆北交所市场，助力提升北交所市场的投资价值。

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，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达北证 50 成份指数 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达北证 50 成份指数 C: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

本报告期内，基金托管人在易方达北证 50 成份指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达北证 50 成份指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达北证 50 成份指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：易方达北证 50 成份指数证券投资基金

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	17,024,669.28	16,565,734.81
结算备付金		489,551.22	1,156,875.37
存出保证金		266,087.99	137,207.49
交易性金融资产	6.4.7.2	287,259,054.21	259,459,725.16
其中：股票投资		287,259,054.21	259,459,725.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	13,187,981.18
应收股利		-	-
应收申购款		1,185,599.94	759,183.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		306,224,962.64	291,266,707.93
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		588.21	-
应付赎回款		2,404,550.51	16,419,300.34
应付管理人报酬		132,649.81	131,627.05
应付托管费		26,529.96	26,325.43
应付销售服务费		58,421.51	51,244.46
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	110,785.03	251,404.45
负债合计		2,733,525.03	16,879,901.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	418,483,243.50	255,762,007.27
未分配利润	6.4.7.8	-114,991,805.89	18,624,798.93
净资产合计		303,491,437.61	274,386,806.20
负债和净资产总计		306,224,962.64	291,266,707.93

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.7276 元，C 类基金份额净值 0.7243 元；基金份额总额 418,483,243.50 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 115,428,697.31 份，C 类基金份额总额 303,054,546.19 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达北证 50 成份指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-99,460,946.03	-17,416,926.76
1.利息收入		56,350.62	398,366.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	56,350.62	362,475.89
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		-	35,890.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,094,037.51	-681,047.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-15,122,628.38	-3,107,306.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	3,028,590.87	2,426,258.18
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	-87,602,766.78	-17,150,296.05

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	179,507.64	16,050.95
减：二、营业总支出		1,108,461.33	821,378.46
1. 管理人报酬		634,135.14	476,973.70
2. 托管费		126,827.00	95,394.70
3. 销售服务费		255,235.43	157,707.33
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	92,263.76	91,302.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-100,569,407.36	-18,238,305.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-100,569,407.36	-18,238,305.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-100,569,407.36	-18,238,305.22

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达北证 50 成份指数证券投资基金

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	255,762,007.27	18,624,798.93	274,386,806.20
二、本期期初净资产	255,762,007.27	18,624,798.93	274,386,806.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	162,721,236.23	-133,616,604.82	29,104,631.41
（一）、综合收益总额	-	-100,569,407.36	-100,569,407.36
（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）	162,721,236.23	-33,047,197.46	129,674,038.77

其中：1.基金申购款	653,913,054.50	-109,410,600.22	544,502,454.28
2.基金赎回款	-491,191,818.27	76,363,402.76	-414,828,415.51
（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	418,483,243.50	-114,991,805.89	303,491,437.61
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	499,265,655.71	37,278.83	499,302,934.54
二、本期期初净资产	499,265,655.71	37,278.83	499,302,934.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-255,116,871.19	-25,522,549.46	-280,639,420.65
（一）、综合收益总额	-	-18,238,305.22	-18,238,305.22
（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）	-255,116,871.19	-7,284,244.24	-262,401,115.43
其中：1.基金申购款	240,716,292.56	-13,044,382.44	227,671,910.12
2.基金赎回款	-495,833,163.75	5,760,138.20	-490,073,025.55
（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	244,148,784.52	-25,485,270.63	218,663,513.89

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

易方达北证 50 成份指数证券投资基金(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]2986 号《关于准予易方达北证 50 成份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《易方达北证 50 成份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,《易方达北证 50 成份指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 499,265,655.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 134,704.80 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	17,024,669.28
等于：本金	17,023,068.87
加：应计利息	1,600.41
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	17,024,669.28

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		348,051,080.51	-	287,259,054.21	-60,792,026.30
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		348,051,080.51	-	287,259,054.21	-60,792,026.30

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末无其他资产。

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	21,277.43
其中：交易所市场	21,277.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	110,785.03

6.4.7.7 实收基金

易方达北证 50 成份指数 A

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	97,144,164.32	97,144,164.32
本期申购	65,342,290.15	65,342,290.15
本期赎回（以“-”号填列）	-47,057,757.16	-47,057,757.16
本期末	115,428,697.31	115,428,697.31

易方达北证 50 成份指数 C

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	158,617,842.95	158,617,842.95
本期申购	588,570,764.35	588,570,764.35
本期赎回（以“-”号填列）	-444,134,061.11	-444,134,061.11
本期末	303,054,546.19	303,054,546.19

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达北证 50 成份指数 A

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	-1,050,185.91	8,316,923.96	7,266,738.05
本期期初	-1,050,185.91	8,316,923.96	7,266,738.05
本期利润	-3,600,683.17	-29,837,498.75	-33,438,181.92
本期基金份额交易产生的变动数	-480,571.25	-4,794,857.78	-5,275,429.03
其中：基金申购款	-1,028,005.84	-9,423,950.14	-10,451,955.98
基金赎回款	547,434.59	4,629,092.36	5,176,526.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,131,440.33	-26,315,432.57	-31,446,872.90

易方达北证 50 成份指数 C

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	-2,142,135.93	13,500,196.81	11,358,060.88
本期期初	-2,142,135.93	13,500,196.81	11,358,060.88
本期利润	-9,365,957.41	-57,765,268.03	-67,131,225.44
本期基金份额交易产生的变动数	-3,117,721.06	-24,654,047.37	-27,771,768.43
其中：基金申购款	-12,257,345.33	-86,701,298.91	-98,958,644.24
基金赎回款	9,139,624.27	62,047,251.54	71,186,875.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,625,814.40	-68,919,118.59	-83,544,932.99

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	51,745.55

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	2,430.36
其他	2,174.71
合计	56,350.62

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	-15,122,628.38
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-15,122,628.38

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	123,102,893.78
减：卖出股票成本总额	138,075,462.33
减：交易费用	150,059.83
买卖股票差价收入	-15,122,628.38

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	3,028,590.87
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	3,028,590.87

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	-87,602,766.78
——股票投资	-87,602,766.78
——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	-
——权证投资	-
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	-87,602,766.78

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	179,507.64
合计	179,507.64

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	-
银行汇划费	2,756.16
合计	92,263.76

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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	376,580,451.94	100.00%	277,081,059.53	100.00%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	37,660.84	100.00%	21,277.43	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

广发证券	166,261.64	100.00%	80,299.54	100.00%
------	------------	---------	-----------	---------

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。本报告期及上年度可比期间该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	634,135.14	476,973.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	232,412.59	176,354.07
应支付基金管理人的净管理费	401,722.55	300,619.63

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，逐日累计至每月月末，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，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休假等，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1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,827.00	95,394.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。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，逐日累计至每月月末，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，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达北证 50 成份 指数 A	易方达北证 50 成份指数 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	11,100.11	11,100.11
交通银行	-	13,757.78	13,757.78
广发证券	-	844.46	844.46
合计	-	25,702.35	25,702.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达北证50成份 指数A	易方达北证50成份指数C	合计
易方达基金管理有限公司	-	15,632.14	15,632.14
交通银行	-	42,366.62	42,366.62
广发证券	-	674.23	674.23
合计	-	58,672.99	58,672.99

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休假等，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

易方达北证 50 成份指数 A

无。

易方达北证 50 成份指数 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	17,024,669.28	51,745.55	14,780,961.75	147,866.82

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

易方达北证 50 成份指数 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达北证 50 成份指数 C

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	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约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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	17,024,669.28	-	-	-	17,024,669.28
结算备付金	489,551.22	-	-	-	489,551.22
存出保证金	266,087.99	-	-	-	266,087.99
交易性金融资产	-	-	-	287,259,054.21	287,259,054.2

					1
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,185,599.94	1,185,599.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,780,308.49	-	-	288,444,654.15	306,224,962.64
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	-	-	-	588.21	588.21
应付赎回款	-	-	-	2,404,550.51	2,404,550.51
应付管理人报酬	-	-	-	132,649.81	132,649.81
应付托管费	-	-	-	26,529.96	26,529.96
应付销售服务费	-	-	-	58,421.51	58,421.51
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	-	-	-	110,785.03	110,785.03
负债总计	-	-	-	2,733,525.03	2,733,525.03
利率敏感度缺口	17,780,308.49	-	-	285,711,129.12	303,491,437.61
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	16,565,734.81	-	-	-	16,565,734.81
结算备付金	1,156,875.37	-	-	-	1,156,875.37
存出保证金	137,207.49	-	-	-	137,207.49

交易性金融资产	-	-	-	259,459,725.16	259,459,725.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	13,187,981.18	13,187,981.18
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	759,183.92	759,183.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,859,817.67	-	-	273,406,890.26	291,266,707.93
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	-	-	-	16,419,300.34	16,419,300.34
应付管理人报酬	-	-	-	131,627.05	131,627.05
应付托管费	-	-	-	26,325.43	26,325.43
应付销售服务费	-	-	-	51,244.46	51,244.46
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	-	-	-	251,404.45	251,404.45
负债总计	-	-	-	16,879,901.73	16,879,901.73
利率敏感度缺口	17,859,817.67	-	-	256,526,988.53	274,386,806.20

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	287,259,054.21	94.65	259,459,725.16	94.56
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	287,259,054.21	94.65	259,459,725.16	94.56

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%	15,119,114.62	13,655,786.28
	2.业绩比较基准下降 5%	-15,119,114.62	-13,655,786.28

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	287,259,054.21
第二层次	-
第三层次	-
合计	287,259,054.21

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

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	287,259,054.21	93.81

	其中：股票	287,259,054.21	93.81
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	17,514,220.50	5.72
8	其他各项资产	1,451,687.93	0.47
9	合计	306,224,962.64	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	252,775,574.43	83.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,548,797.57	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	4,325,796.09	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,904,600.94	7.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,704,285.18	1.88
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	287,259,054.21	94.65

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	835185	贝特瑞	1,644,862	30,232,563.56	9.96
2	832982	锦波生物	181,044	27,046,163.16	8.91
3	835368	连城数控	716,195	18,656,879.75	6.15
4	833575	康乐卫士	718,087	14,921,847.86	4.92
5	872808	曙光数创	307,313	11,871,501.19	3.91
6	430047	诺思兰德	845,619	11,745,647.91	3.87
7	834599	同力股份	1,160,119	9,014,124.63	2.97
8	836077	吉林碳谷	901,275	8,634,214.50	2.84
9	833819	颖泰生物	2,514,023	7,441,508.08	2.45
10	830809	安达科技	1,875,638	7,146,180.78	2.35
11	832491	奥迪威	577,289	6,840,874.65	2.25
12	873593	鼎智科技	343,687	6,457,878.73	2.13
13	430139	华岭股份	681,945	6,369,366.30	2.10
14	839493	并行科技	148,837	6,242,223.78	2.06
15	430418	苏轴股份	415,326	5,507,222.76	1.81
16	835640	富士达	385,016	5,124,562.96	1.69
17	838402	硅烷科技	647,276	4,537,404.76	1.50
18	836239	长虹能源	265,934	4,446,416.48	1.47
19	833171	国航远洋	1,141,371	4,325,796.09	1.43
20	832978	开特股份	452,163	4,300,070.13	1.42
21	830946	森萱医药	656,683	4,150,236.56	1.37
22	835985	海泰新能	791,026	4,137,065.98	1.36
23	830799	艾融软件	432,313	4,106,973.50	1.35
24	430510	丰光精密	269,060	4,097,783.80	1.35
25	831961	创远信科	438,123	4,070,162.67	1.34
26	835179	凯德石英	230,042	3,772,688.80	1.24
27	832566	梓潼宫	524,458	3,519,113.18	1.16
28	839167	同享科技	224,999	3,487,484.50	1.15
29	832225	利通科技	389,288	3,441,305.92	1.13

30	832089	禾昌聚合	385,110	3,308,094.90	1.09
31	833394	民士达	224,961	3,149,454.00	1.04
32	871753	天纺标	124,843	3,088,615.82	1.02
33	834021	流金科技	950,604	3,041,932.80	1.00
34	835305	云创数据	271,494	2,959,284.60	0.98
35	873576	天力复合	167,587	2,949,531.20	0.97
36	839680	广道数字	240,471	2,900,080.26	0.96
37	834033	康普化学	183,254	2,867,925.10	0.94
38	834682	球冠电缆	554,570	2,661,936.00	0.88
39	835670	数字人	272,216	2,654,106.00	0.87
40	873693	阿为特	111,494	2,617,879.12	0.86
41	873122	中纺标	70,732	2,615,669.36	0.86
42	832149	利尔达	648,549	2,548,797.57	0.84
43	833533	骏创科技	205,403	2,491,538.39	0.82
44	836720	井冈精密	292,613	2,308,716.57	0.76
45	832885	星辰科技	351,185	1,910,446.40	0.63
46	832278	鹿得医疗	362,895	1,770,927.60	0.58
47	838670	恒进感应	206,530	1,701,807.20	0.56
48	873726	卓兆点胶	83,917	1,443,372.40	0.48
49	839725	惠丰钻石	141,899	1,443,112.83	0.48
50	838171	邦德股份	121,959	1,180,563.12	0.39

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	832982	锦波生物	36,480,876.07	13.30
2	835185	贝特瑞	20,609,437.97	7.51
3	835368	连城数控	13,275,967.23	4.84
4	872808	曙光数创	9,660,383.76	3.52
5	430047	诺思兰德	9,352,531.03	3.41
6	833575	康乐卫士	8,779,510.63	3.20
7	839493	并行科技	7,177,198.40	2.62
8	836077	吉林碳谷	6,796,440.81	2.48
9	834599	同力股份	6,618,264.25	2.41
10	873593	鼎智科技	5,464,669.15	1.99
11	832225	利通科技	5,343,835.92	1.95
12	833819	颖泰生物	5,334,234.44	1.94
13	832491	奥迪威	5,149,769.26	1.88
14	830809	安达科技	5,115,825.09	1.86

15	832978	开特股份	4,806,807.96	1.75
16	430139	华岭股份	4,527,905.08	1.65
17	873576	天力复合	4,353,278.47	1.59
18	430418	苏轴股份	3,928,138.60	1.43
19	838402	硅烷科技	3,873,461.51	1.41
20	873122	中纺标	3,799,696.53	1.38

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	872808	曙光数创	7,927,333.95	2.89
2	835185	贝特瑞	7,651,046.55	2.79
3	835368	连城数控	6,609,105.22	2.41
4	832735	德源药业	4,708,518.98	1.72
5	837344	三元基因	4,706,689.13	1.72
6	430047	诺思兰德	4,262,893.78	1.55
7	833575	康乐卫士	4,172,144.11	1.52
8	834261	一诺威	4,107,038.28	1.50
9	831152	昆工科技	3,846,811.20	1.40
10	832982	锦波生物	3,790,036.45	1.38
11	430476	海能技术	3,571,817.14	1.30
12	836077	吉林碳谷	3,179,656.39	1.16
13	834599	同力股份	3,090,059.21	1.13
14	832089	禾昌聚合	2,850,652.87	1.04
15	831305	海希通讯	2,717,644.64	0.99
16	830809	安达科技	2,639,730.95	0.96
17	833819	颖泰生物	2,587,744.16	0.94
18	832491	奥迪威	2,512,953.19	0.92
19	834033	康普化学	2,480,626.24	0.90
20	871981	晶赛科技	2,478,437.97	0.90

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	253,477,558.16
卖出股票收入（成交）总额	123,102,893.78

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	266,087.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,185,599.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,451,687.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达北证 50 成份指数 A	6,538	17,655.05	90,487.30	0.08%	115,338,210.01	99.92%
易方达北证 50 成	25,683	11,799.81	2,595,407.22	0.86%	300,459,138.97	99.14%

份指数 C						
合计	32,221	12,987.90	2,685,894.52	0.64%	415,797,348.98	99.36%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达北证 50 成份指数 A	499,174.76	0.4325%
	易方达北证 50 成份指数 C	86,980.32	0.0287%
	合计	586,155.08	0.1401%

8.3 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	份额级别	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	易方达北证 50 成份指数 A	0
	易方达北证 50 成份指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达北证 50 成份指数 A	10~50
	易方达北证 50 成份指数 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达北证 50 成份指数 A	易方达北证 50 成份指数 C
基金合同生效日（2022 年 12 月 27 日）基金份额总额	132,564,254.54	366,701,401.17
本报告期期初基金份额总额	97,144,164.32	158,617,842.95
本报告期基金总申购份额	65,342,290.15	588,570,764.35
减：本报告期基金总赎回份额	47,057,757.16	444,134,061.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	115,428,697.31	303,054,546.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	376,580,451.94	100.00%	37,660.84	100.00%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	易方达北证 50 成份指数证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制的公告	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	2024-01-05
2	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
3	易方达北证 50 成份指数证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制的公告	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	2024-03-06
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基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-20
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	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
7	易方达北证 50 成份指数证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制的公告	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	2024-05-28
8	易方达北证 50 成份指数证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制的公告	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	2024-06-08

§ 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北证 50 成份指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达北证 50 成份指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达北证 50 成份指数证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、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