

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56

7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500ETF
场内简称	ZZ500ETF、中证 500ETF 易方达
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	954,168,341.00 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	2015 年 9 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制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 0.2% 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，为更好地实现投资目标，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，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,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	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 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	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510620； 519031	100140
法定代表人		吴欣荣	廖林

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
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

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

§ 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	65,883,002.66
本期利润	133,326,815.15
加权平均基金份额本期利润	0.1270
本期加权平均净值利润率	4.39%
本期基金份额净值增长率	4.57%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	367,722,947.14
期末可供分配基金份额利润	0.3854
期末基金资产净值	2,864,766,486.72
期末基金份额净值	3.0024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.73%

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。

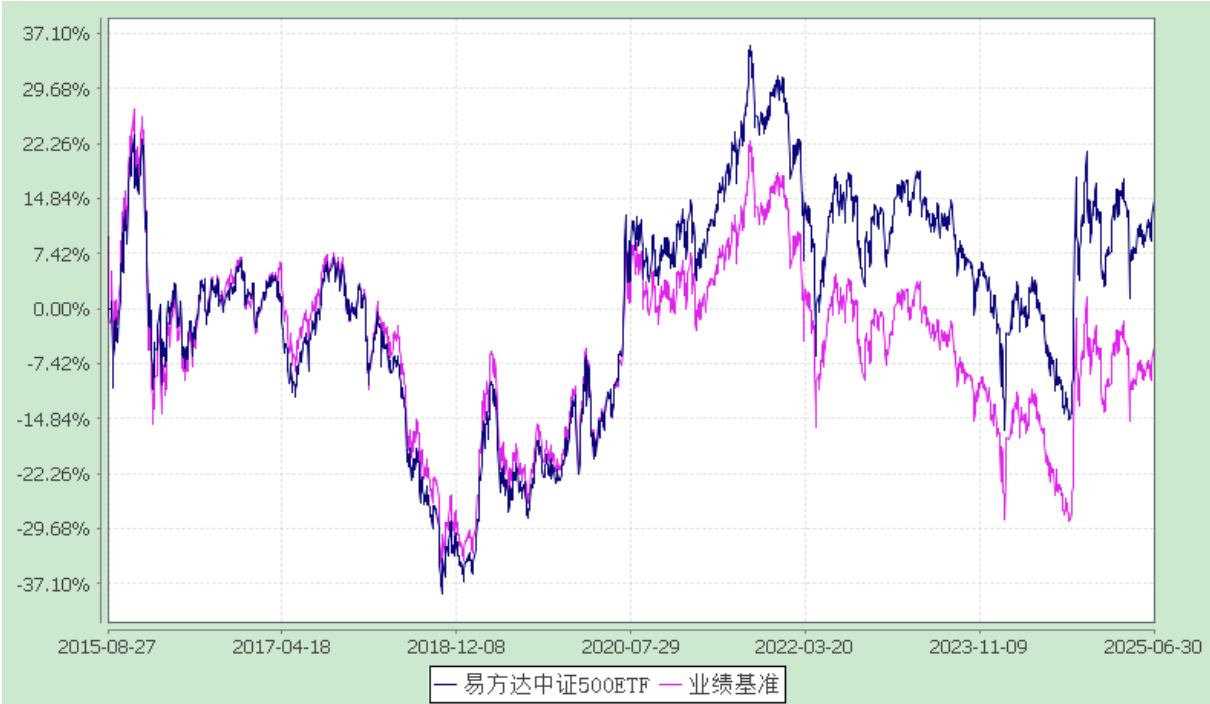
3.2 基金净值表现

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	5.10%	0.78%	4.31%	0.79%	0.79%	-0.01%
过去三个月	2.14%	1.50%	0.98%	1.50%	1.16%	0.00%
过去六个月	4.57%	1.35%	3.31%	1.36%	1.26%	-0.01%
过去一年	22.14%	1.72%	19.68%	1.72%	2.46%	0.00%
过去三年	-1.92%	1.35%	-8.35%	1.35%	6.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.73%	1.41%	-5.18%	1.48%	19.91%	-0.07%

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 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
(2015 年 8 月 27 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 14.73%，同期业绩比较基准收益率为 -5.18%。

§ 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		
余海燕	本基金的基金经理,易方达沪深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF 联接、易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证海外	2016-04-16	-	20 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资

	中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企 ETF 联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达中证 500ETF 联接、易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证军工 ETF 的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头 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、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接的基金经理，指数研究部总经理、指数投资决策委员会委员	2022-12-17	-	16 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、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。

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 38 次，其中 31 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，7 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

本基金跟踪中证 500 指数，该指数由沪深市场中剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后，剔除过去一年日均成交金额排名前 20% 的证券，再选取过去一年日均总市值排名靠前的 500 只证券组成，以综合反映中国沪深市场中小市值公司的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2025 年上半年，国际环境复杂多变，国际经贸秩序遭受重创，不稳定性、不确定性增加。面对复杂局面，中国政府实施了更加积极有为的宏观政策，中国宏观经济在颇具挑战的国内外环境中展现出一定的韧性，中国经济整体呈现温和复苏态势。随着一揽子存量政策和增量政策继续发力显效，稳经济促发展效果显现，工业生产保持较快增长态势，国内需求稳步扩大，消费支撑作用显著，投资需求稳中有升，净出口延续平稳增长态势，新质生产力培育壮大，助推经济高质量发展。中国主要经济指标好于预期，高质量发展扎实推进，经济保持了稳中有进、稳中向好的发展态势，充分展现了我国经济的韧性和活力。上半年我国 GDP 为 660536 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%，其中一季度增长 5.4%，二季度增长 5.2%，上半年的增速比去年同期和全年均提升了 0.3 个百分点，反映了今年以来中国经济保持平稳向好的态势。上半年中国经济的稳步向好为股市提供了基本面支撑，增强了投资者信心，推动了 A 股市场震荡上行。此外年初以来 DeepSeek 在全球人工智能领域

的脱颖而出，让海内外投资者对中国科技创新能力有了新的认识，也带动了中国资产的价值重估。

资本市场方面，A 股市场整体表现受到宏观经济和政策环境的影响，呈现出较大的波动态势以及明显的结构性行情。一季度聚焦科技成长风格的汽车、TMT、机械设备板块表现优异，代表周期价值风格的煤炭、石油化工、房地产、非银金融等板块表现相对比较落后。二季度受“关税风暴”冲击，4 月初全球股市普遍大幅下跌，A 股市场在中央汇金公司增持稳市之后，迅速止跌回稳。随后整体市场呈现震荡分化格局，临近季末时市场情绪有所回暖，在大金融等板块带动下，上证指数一度创出年内新高。报告期内从市场主流指数的表现来看，代表小盘成长风格的北证 50、中证 2000 等指数表现较好，而代表大盘价值风格的沪深 300 指数、上证 50 指数表现相对较为平淡。受益于行业景气度改善的有色金属、军工、以及低估值的银行等板块表现优异，此外新消费、创新药板块表现抢眼，受益于出海等因素，创新药板块业绩增长潜力被市场看好。而煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、证券等行业表现相对较落后。

中证 500 指数作为 A 股中小盘股的代表指数，其行业分布较为均衡，以周期型与成长型行业并重，其收益表现会受到 A 股整体市场走势、市场风格以及不同行业基本面状况的影响。报告期内指数中电子、医药生物、计算机、传媒、国防军工、有色金属等行业的成份股涨幅居前，对中证 500 指数收益贡献较大，而煤炭、商贸零售、交通运输、轻工制造等行业的成份股表现不佳，拖累了指数的表现。报告期内中证 500 指数上涨 3.31%。

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 3.0024 元，本报告期份额净值增长率为 4.57%，同期业绩比较基准收益率为 3.31%。年化跟踪误差 0.42%，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

上半年经济稳中有进的发展态势和成效，为完成全年目标打下了较好基础。上半年中国经济顶住压力、稳定增长，保持稳中有进、稳中向好的发展态势，充分展示了中国经济的抗压能力和强大韧性。展望下一阶段，这种发展态势会得以保持，中国经济仍将迎来较好的发展机遇，2025 年中国经济增速将继续在全球主要经济体中保持领先，并有望走出价格收缩区间。同时我们也看到中国新质生产力在加快发展，不断创造更多新经济增长点。经济转型升级和产业结构优化也在持续推进。尽管外部环境的挑战仍存，但国内一系列逆周期调节政策能有效对冲外部的不确定性，宏观政策协同发力，将为经济稳定运行保驾护航。今年以来，我国实行了更加积极有为的宏观政策，发挥了托

底作用。中国的政策“工具箱”丰富，预计下半年宏观政策也会加快推出，会继续为经济稳定运行发挥关键支撑作用。基于以上的这些支撑因素，我们判断中国经济下半年会继续保持稳中有进、稳中向好的发展态势。A 股在多重政策红利与产业升级动能的共振下有望企稳向上。在宏观经济政策支持、流动性充裕和利率低位的背景下，A 股市场或将呈现结构性上涨特征。在中国经济迈向复苏、货币政策宽松、信用环境改善的宏观背景下，中小市值公司有望迎来较强的盈利复苏预期，作为 A 股中小盘股的代表指数，中证 500 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

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，为投资者分享中国中小市值公司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程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	80,783,439.99	83,479,390.62
结算备付金		31,548,611.13	19,747,264.15
存出保证金		14,894,490.70	13,614,107.10
交易性金融资产	6.4.7.2	2,740,547,633.18	3,051,739,550.78
其中：股票投资		2,740,547,633.18	3,051,739,550.78
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		10,522,089.55	34,658,729.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,878,296,264.55	3,203,239,042.62
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,737,392.14	30,767,684.31
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		349,635.14	436,352.06
应付托管费		116,545.01	145,450.68
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,612.30	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	4,304,593.24	5,168,867.02
负债合计		13,529,777.83	36,518,354.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,497,043,539.58	2,886,450,799.10
未分配利润	6.4.7.8	367,722,947.14	280,269,889.45
净资产合计		2,864,766,486.72	3,166,720,688.55
负债和净资产总计		2,878,296,264.55	3,203,239,042.62

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.0024 元，基金份额总额 954,168,341.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		136,691,427.88	-187,663,121.27
1.利息收入		295,871.90	1,694,921.97

其中：存款利息收入	6.4.7.9	295,871.90	333,525.50
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		-	1,361,396.47
2.投资收益（损失以“-”填列）		67,686,551.36	-58,613,198.37
其中：股票投资收益	6.4.7.10	23,467,688.89	-86,971,311.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	336,853.65	117,473.25
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	16,212,926.72	-5,452,235.90
股利收益	6.4.7.14	27,669,082.10	33,692,875.81
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	67,443,812.49	-131,937,885.27
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	1,265,192.13	1,193,040.40
减：二、营业总支出		3,364,612.73	2,959,846.78
1. 管理人报酬		2,257,676.93	1,863,627.27
2. 托管费		752,558.99	621,209.05
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		58,387.92	4,904.00
8. 其他费用	6.4.7.18	295,988.89	470,106.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		133,326,815.15	-190,622,968.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		133,326,815.15	-190,622,968.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		133,326,815.15	-190,622,968.05

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	2,886,450,799.10	280,269,889.45	3,166,720,688.55
二、本期期初净资产	2,886,450,799.10	280,269,889.45	3,166,720,688.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-389,407,259.52	87,453,057.69	-301,954,201.83
（一）、综合收益总额	-	133,326,815.15	133,326,815.15
（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）	-389,407,259.52	-45,873,757.46	-435,281,016.98
其中：1.基金申购款	542,239,140.77	60,908,699.88	603,147,840.65
2.基金赎回款	-931,646,400.29	-106,782,457.34	-1,038,428,857.63
（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	2,497,043,539.58	367,722,947.14	2,864,766,486.72
项目	上年度可比期间 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	2,283,099,809.66	42,005,182.96	2,325,104,992.62
二、本期期初净资产	2,283,099,809.66	42,005,182.96	2,325,104,992.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	387,442,890.20	-203,894,959.75	183,547,930.45
（一）、综合收益总额	-	-190,622,968.05	-190,622,968.05
（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）	387,442,890.20	-13,271,991.70	374,170,898.50
其中：1.基金申购	767,097,983.89	-17,731,988.08	749,365,995.81

款			
2.基金赎回款	-379,655,093.69	4,459,996.38	-375,195,097.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	2,670,542,699.86	-161,889,776.79	2,508,652,923.07

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：吴欣荣，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 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[2014]999 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2015]2176 号《关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金延期募集备案的回函》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 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,259,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,000.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金已于 2015 年 9 月 9 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.15409267。

本基金已于 2021 年 7 月 16 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 10，即每 1 份基金份额拆成 10 份。

本基金已于 2024 年 8 月 30 日进行了基金份额合并，合并比例为 0.24798687。

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>》、中国证券投资基金业协会(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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	80,783,439.99
等于：本金	80,776,358.74
加：应计利息	7,081.25
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	80,783,439.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,659,914,486.96	-	2,740,547,633.18	80,633,146.22
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		2,659,914,486.96	-	2,740,547,633.18	80,633,146.22

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 2025 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	120,124,440.00	-	-	-
IC2509	52,550,520.00	-	-	-
IC2512	67,573,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	120,124,440.00	-	-	-

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
IC2509	IC2509	45	51,982,200.00	-568,320.00

IC2512	IC2512	62	70,129,440.00	2,555,520.00
合计	-	-	-	1,987,200.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,987,200.00
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

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 2025 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	98,506.32
其中：交易所市场	98,506.32
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付替代款	4,121,784.36
合计	4,304,593.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,102,968,341.00	2,886,450,799.10
本期申购	207,200,000.00	542,239,140.77

本期赎回（以“-”号填列）	-356,000,000.00	-931,646,400.29
本期末	954,168,341.00	2,497,043,539.58

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	2,287,330,184.37	-2,007,060,294.92	280,269,889.45
本期期初	2,287,330,184.37	-2,007,060,294.92	280,269,889.45
本期利润	65,883,002.66	67,443,812.49	133,326,815.15
本期基金份额交易产生的变动数	-313,937,305.44	268,063,547.98	-45,873,757.46
其中：基金申购款	433,820,803.11	-372,912,103.23	60,908,699.88
基金赎回款	-747,758,108.55	640,975,651.21	-106,782,457.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,039,275,881.59	-1,671,552,934.45	367,722,947.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	139,105.27
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	156,212.66
其他	553.97
合计	295,871.90

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,161,824.39
股票投资收益——赎回差价收入	7,305,864.50
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	23,467,688.89

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	882,205,759.65

减：卖出股票成本总额	865,347,543.67
减：交易费用	696,391.59
买卖股票差价收入	16,161,824.39

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,038,428,857.63
减：现金支付赎回款总额	518,810,988.63
减：赎回股票成本总额	512,312,004.50
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,305,864.50

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	120.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	336,732.90
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	336,853.65

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,251,004.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,874,489.51
减：应计利息总额	39,136.96
减：交易费用	645.04
买卖债券差价收入	336,732.90

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	16,212,926.72

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	27,669,082.10
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	27,669,082.10

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	76,483,492.49
——股票投资	76,483,492.49
——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	-9,039,680.00
——权证投资	-
——期货投资	-9,039,680.00
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	67,443,812.49

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	1,265,192.13
合计	1,265,192.13

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	207,461.93
存托服务费	1,037.71
银行汇划费	3,186.69
合计	295,988.89

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
中国工商银行股份有限公司	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
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024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	294,481.00	0.02%	128,362.00	0.01%

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			
	2025年1月1日至2025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	29.45	0.02%	5.68	0.01%
关联方名称	上年度可比期间			
	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	77.02	0.06%	7.80	0.01%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.2024 年 7 月 1 日前，本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，本基金佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

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

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,257,676.93	1,863,627.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	45,254.85	-
应支付基金管理人的净管理费	2,212,422.08	1,863,627.27

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	752,558.99	621,209.05

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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

单位：人民币元

本期						
2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费 率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收利 息余额
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费 率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收利 息余额
广发证券	176,934,199.00	1.70~4.00	2.55	160,135.32	3,501,393.80	1,241.12

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	646,784,695.00	67.7852%	741,904,595.00	67.2644%
广发证券股份有限公司	669,712.00	0.0702%	331,528.00	0.0301%

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

定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	80,783,439.99	139,105.27	70,153,228.39	112,413.89

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
上年度可比期间 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
万联证券股份有限公司	837023	芭薇股份	新股发行	200	1,154.00

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

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（2025 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
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月以内	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-

				受限						
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
689009	九号公司	2025-03-18	6 个月	大宗交易流通受限	57.24	57.05	60,000	3,434,400.00	3,423,000.00	-
688521	芯原股份	2025-06-27	6 个月	非公开发行流通受限	72.68	85.49	42,187	3,066,151.16	3,606,566.63	-
300751	迈为股份	2025-05-16	6 个月	询价转让流通受限	68.31	65.11	117	7,992.27	7,617.87	-

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 2025 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 2025 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。

本基金属股票型基金, 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 2025 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%(2024 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业

发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2025 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 2025 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	80,783,439.99	-	-	-	80,783,439.99
结算备付金	31,548,611.13	-	-	-	31,548,611.13
存出保证金	14,894,490.70	-	-	-	14,894,490.70
交易性金融资产	-	-	-	2,740,547,633.18	2,740,547,633.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,522,089.55	10,522,089.55

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	127,226,541.82	-	-	2,751,069,722.73	2,878,296,264.55
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	-	-	-	8,737,392.14	8,737,392.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	349,635.14	349,635.14
应付托管费	-	-	-	116,545.01	116,545.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21,612.30	21,612.30
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,304,593.24	4,304,593.24
负债总计	-	-	-	13,529,777.83	13,529,777.83
利率敏感度缺口	127,226,541.82	-	-	2,737,539,944.90	2,864,766,486.72
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	83,479,390.62	-	-	-	83,479,390.62
结算备付金	19,747,264.15	-	-	-	19,747,264.15
存出保证金	13,614,107.10	-	-	-	13,614,107.10
交易性金融资产	-	-	-	3,051,739,550.78	3,051,739,550.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	34,658,729.97	34,658,729.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	116,840,761.87	-	-	3,086,398,280.75	3,203,239,042.62
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	-	-	-	30,767,684.31	30,767,684.31
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	436,352.06	436,352.06
应付托管费	-	-	-	145,450.68	145,450.68
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	-	-	-	5,168,867.02	5,168,867.02
负债总计	-	-	-	36,518,354.07	36,518,354.07
利率敏感度缺口	116,840,761.87	-	-	3,049,879,926.68	3,166,720,688.55

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,740,547,633.18	95.66	3,051,739,550.78	96.37
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	2,740,547,633.18	95.66	3,051,739,550.78	96.37

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	137,006,520.44	152,576,188.11
	2.业绩比较基准下降 5%	-137,006,520.44	-152,576,188.11

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	2,733,045,481.74
第二层次	15,385.54
第三层次	7,486,765.90
合计	2,740,547,633.18

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	2,740,547,633.18	95.21
	其中：股票	2,740,547,633.18	95.21

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	112,332,051.12	3.90
8	其他各项资产	25,416,580.25	0.88
9	合计	2,878,296,264.55	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	6,829,526.20	0.24
B	采矿业	97,873,345.05	3.42
C	制造业	1,736,355,707.66	60.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,258,013.53	3.08
E	建筑业	24,053,070.00	0.84
F	批发和零售业	60,074,626.36	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	45,549,335.32	1.59
H	住宿和餐饮业	7,336,131.18	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	254,208,928.41	8.87
J	金融业	269,326,856.92	9.40
K	房地产业	33,865,165.41	1.18
L	租赁和商务服务业	23,544,828.88	0.82
M	科学研究和技术服务业	18,568,791.22	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	11,486,806.52	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,619,384.00	0.20

Q	卫生和社会工作	12,601,348.12	0.44
R	文化、体育和娱乐业	38,479,712.00	1.34
S	综合	6,516,056.40	0.23
	合计	2,740,547,633.18	95.66

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	300476	胜宏科技	224,900	30,222,062.00	1.05
2	000988	华工科技	374,700	17,614,647.00	0.61
3	600988	赤峰黄金	619,100	15,403,208.00	0.54
4	300339	润和软件	296,200	15,055,846.00	0.53
5	002966	苏州银行	1,664,380	14,613,256.40	0.51
6	600839	四川长虹	1,374,220	13,357,418.40	0.47
7	601162	天风证券	2,642,700	13,028,511.00	0.45
8	601555	东吴证券	1,479,200	12,943,000.00	0.45
9	689009	九号公司	216,806	12,701,211.02	0.44
10	688521	芯原股份	134,611	12,525,482.63	0.44
11	002517	恺英网络	636,100	12,283,091.00	0.43
12	002340	格林美	1,908,600	12,119,610.00	0.42
13	002195	岩山科技	2,115,182	11,908,474.66	0.42
14	002558	巨人网络	503,800	11,864,490.00	0.41
15	603893	瑞芯微	77,700	11,799,522.00	0.41
16	002261	拓维信息	374,500	11,590,775.00	0.40
17	002156	通富微电	452,100	11,582,802.00	0.40
18	600487	亨通光电	734,300	11,234,790.00	0.39
19	600157	永泰能源	8,269,700	11,081,398.00	0.39
20	002797	第一创业	1,564,600	11,077,368.00	0.39
21	300251	光线传媒	546,000	11,067,420.00	0.39
22	300207	欣旺达	549,700	11,026,982.00	0.38
23	688608	恒玄科技	31,566	10,984,336.68	0.38
24	300803	指南针	133,910	10,801,180.60	0.38
25	000066	中国长城	720,100	10,657,480.00	0.37
26	688213	思特威	103,661	10,596,227.42	0.37
27	688777	中控技术	235,610	10,581,245.10	0.37
28	688120	华海清科	62,245	10,500,731.50	0.37
29	600096	云天化	475,400	10,444,538.00	0.36
30	600536	中国软件	221,494	10,359,274.38	0.36
31	002273	水晶光电	517,447	10,333,416.59	0.36
32	601168	西部矿业	620,640	10,321,243.20	0.36

33	002465	海格通信	738,900	10,300,266.00	0.36
34	600879	航天电子	982,540	10,287,193.80	0.36
35	300450	先导智能	407,900	10,136,315.00	0.35
36	688235	百济神州	43,219	10,097,687.16	0.35
37	000831	中国稀土	276,100	9,972,732.00	0.35
38	601099	太平洋	2,537,500	9,972,375.00	0.35
39	600352	浙江龙盛	968,700	9,841,992.00	0.34
40	002294	信立泰	207,400	9,816,242.00	0.34
41	300017	网宿科技	910,700	9,762,704.00	0.34
42	000933	神火股份	586,500	9,759,360.00	0.34
43	600885	宏发股份	434,749	9,699,250.19	0.34
44	002185	华天科技	954,000	9,635,400.00	0.34
45	601108	财通证券	1,210,037	9,571,392.67	0.33
46	688617	惠泰医疗	31,782	9,439,254.00	0.33
47	688002	睿创微纳	135,022	9,413,733.84	0.33
48	601128	常熟银行	1,234,778	9,100,313.86	0.32
49	002130	沃尔核材	375,700	8,949,174.00	0.31
50	601577	长沙银行	898,400	8,930,096.00	0.31
51	600079	人福医药	425,200	8,920,696.00	0.31
52	002281	光迅科技	179,900	8,872,668.00	0.31
53	300454	深信服	94,140	8,866,105.20	0.31
54	688099	晶晨股份	124,543	8,843,798.43	0.31
55	002595	豪迈科技	149,300	8,841,546.00	0.31
56	002085	万丰奥威	553,400	8,793,526.00	0.31
57	688469	芯联集成	1,841,755	8,785,171.35	0.31
58	688122	西部超导	168,824	8,758,589.12	0.31
59	000423	东阿阿胶	167,400	8,755,020.00	0.31
60	000997	新大陆	269,410	8,723,495.80	0.30
61	300223	北京君正	125,900	8,712,280.00	0.30
62	603129	春风动力	40,200	8,703,300.00	0.30
63	002738	中矿资源	269,060	8,652,969.60	0.30
64	300058	蓝色光标	1,316,848	8,638,522.88	0.30
65	002532	天山铝业	1,038,500	8,629,935.00	0.30
66	300002	神州泰岳	730,200	8,616,360.00	0.30
67	000783	长江证券	1,235,400	8,561,322.00	0.30
68	300458	全志科技	215,080	8,536,525.20	0.30
69	300474	景嘉微	116,850	8,530,050.00	0.30
70	600109	国金证券	967,200	8,482,344.00	0.30
71	002472	双环传动	252,800	8,466,272.00	0.30
72	002138	顺络电子	299,900	8,433,188.00	0.29
73	002078	太阳纸业	623,920	8,397,963.20	0.29
74	603596	伯特利	158,502	8,351,470.38	0.29
75	002436	兴森科技	628,700	8,323,988.00	0.29

76	601933	永辉超市	1,689,500	8,278,550.00	0.29
77	002410	广联达	614,600	8,241,786.00	0.29
78	002851	麦格米特	163,100	8,177,834.00	0.29
79	300346	南大光电	257,700	8,153,628.00	0.28
80	300765	新诺威	157,300	8,130,837.00	0.28
81	600862	中航高科	311,020	8,111,401.60	0.28
82	600143	金发科技	785,400	8,097,474.00	0.28
83	688072	拓荆科技	52,539	8,075,769.69	0.28
84	300136	信维通信	360,500	8,075,200.00	0.28
85	601198	东兴证券	721,600	8,045,840.00	0.28
86	600580	卧龙电驱	406,776	8,041,961.52	0.28
87	688525	佰维存储	119,287	8,039,943.80	0.28
88	002850	科达利	71,000	8,035,070.00	0.28
89	002065	东华软件	834,900	8,015,040.00	0.28
90	300024	机器人	466,500	8,014,470.00	0.28
91	002353	杰瑞股份	228,850	8,009,750.00	0.28
92	300054	鼎龙股份	279,000	8,001,720.00	0.28
93	002223	鱼跃医疗	224,000	7,974,400.00	0.28
94	000034	神州数码	211,800	7,972,152.00	0.28
95	300395	菲利华	156,000	7,971,600.00	0.28
96	603606	东方电缆	154,000	7,963,340.00	0.28
97	600298	安琪酵母	226,350	7,960,729.50	0.28
98	600873	梅花生物	743,200	7,944,808.00	0.28
99	002202	金风科技	770,900	7,901,725.00	0.28
100	600363	联创光电	135,300	7,892,049.00	0.28
101	002673	西部证券	998,400	7,867,392.00	0.27
102	688578	艾力斯	84,517	7,863,461.68	0.27
103	300496	中科创达	137,295	7,856,019.90	0.27
104	601615	明阳智能	676,600	7,774,134.00	0.27
105	000728	国元证券	974,600	7,689,594.00	0.27
106	300857	协创数据	89,340	7,688,600.40	0.27
107	002624	完美世界	505,150	7,663,125.50	0.27
108	300383	光环新网	535,200	7,653,360.00	0.27
109	002008	大族激光	313,200	7,632,684.00	0.27
110	000021	深科技	406,410	7,616,123.40	0.27
111	300115	长盈精密	353,600	7,567,040.00	0.26
112	603659	璞泰来	397,400	7,463,172.00	0.26
113	600549	厦门钨业	354,900	7,424,508.00	0.26
114	600895	张江高科	287,900	7,399,030.00	0.26
115	688220	翱捷科技	94,277	7,381,889.10	0.26
116	603087	甘李药业	134,500	7,367,910.00	0.26
117	300604	长川科技	163,800	7,356,258.00	0.26
118	603160	汇顶科技	103,200	7,330,296.00	0.26

119	300012	华测检测	626,200	7,320,278.00	0.26
120	603605	珀莱雅	88,400	7,318,636.00	0.26
121	000426	兴业银锡	462,900	7,313,820.00	0.26
122	002155	湖南黄金	406,933	7,263,754.05	0.25
123	000733	振华科技	144,800	7,247,240.00	0.25
124	600171	上海贝岭	211,100	7,230,175.00	0.25
125	300627	华测导航	203,560	7,124,600.00	0.25
126	688361	中科飞测	84,142	7,083,914.98	0.25
127	605589	圣泉集团	252,400	7,004,100.00	0.24
128	601216	君正集团	1,255,900	6,932,568.00	0.24
129	600392	盛和资源	521,783	6,871,882.11	0.24
130	300699	光威复材	216,600	6,859,722.00	0.24
131	000750	国海证券	1,664,230	6,856,627.60	0.24
132	601665	齐鲁银行	1,084,800	6,855,936.00	0.24
133	300037	新宙邦	194,680	6,852,736.00	0.24
134	002444	巨星科技	267,250	6,817,547.50	0.24
135	000519	中兵红箭	310,950	6,806,695.50	0.24
136	601997	贵阳银行	1,088,720	6,793,612.80	0.24
137	000932	华菱钢铁	1,543,080	6,789,552.00	0.24
138	000729	燕京啤酒	524,390	6,780,362.70	0.24
139	688180	君实生物	199,517	6,779,587.66	0.24
140	300003	乐普医疗	490,500	6,759,090.00	0.24
141	600153	建发股份	647,500	6,714,575.00	0.23
142	600060	海信视像	291,200	6,703,424.00	0.23
143	601717	郑煤机	401,506	6,673,029.72	0.23
144	601990	南京证券	822,900	6,649,032.00	0.23
145	601233	桐昆股份	626,400	6,639,840.00	0.23
146	000878	云南铜业	521,840	6,637,804.80	0.23
147	300073	当升科技	151,300	6,637,531.00	0.23
148	601696	中银证券	620,200	6,629,938.00	0.23
149	300001	特锐德	274,650	6,583,360.50	0.23
150	300142	沃森生物	595,800	6,553,800.00	0.23
151	688052	纳芯微	37,477	6,539,361.73	0.23
152	002821	凯莱英	74,100	6,539,325.00	0.23
153	600673	东阳光	560,280	6,516,056.40	0.23
154	002414	高德红外	635,700	6,515,925.00	0.23
155	603979	金诚信	139,600	6,483,024.00	0.23
156	600369	西南证券	1,483,700	6,454,095.00	0.23
157	002837	英维克	216,360	6,428,055.60	0.22
158	600699	均胜电子	367,460	6,408,502.40	0.22
159	002007	华兰生物	407,900	6,391,793.00	0.22
160	688027	国盾量子	23,184	6,375,831.84	0.22
161	300373	扬杰科技	121,500	6,305,850.00	0.22

162	600118	中国卫星	220,100	6,288,257.00	0.22
163	688065	凯赛生物	133,470	6,286,437.00	0.22
164	600177	雅戈尔	860,400	6,280,920.00	0.22
165	600521	华海药业	336,900	6,276,447.00	0.22
166	600398	海澜之家	894,085	6,222,831.60	0.22
167	000893	亚钾国际	206,300	6,217,882.00	0.22
168	002152	广电运通	462,430	6,215,059.20	0.22
169	603345	安井食品	76,200	6,128,004.00	0.21
170	600435	北方导航	392,860	6,124,687.40	0.21
171	600704	物产中大	1,159,300	6,109,511.00	0.21
172	300748	金力永磁	255,960	6,102,086.40	0.21
173	000738	航发控制	293,500	6,090,125.00	0.21
174	600909	华安证券	1,044,448	6,089,131.84	0.21
175	600316	洪都航空	160,720	6,059,144.00	0.21
176	688249	晶合集成	298,427	6,049,115.29	0.21
177	000623	吉林敖东	356,400	6,040,980.00	0.21
178	600497	驰宏锌锗	1,137,500	6,017,375.00	0.21
179	002044	美年健康	1,165,300	5,989,642.00	0.21
180	603179	新泉股份	127,200	5,974,584.00	0.21
181	002958	青农商行	1,654,500	5,972,745.00	0.21
182	000009	中国宝安	672,280	5,969,846.40	0.21
183	002318	久立特材	255,000	5,964,450.00	0.21
184	600765	中航重机	352,148	5,944,258.24	0.21
185	600038	中直股份	153,000	5,937,930.00	0.21
186	600141	兴发集团	287,188	5,895,969.64	0.21
187	688385	复旦微电	119,051	5,865,642.77	0.20
188	603228	景旺电子	139,566	5,839,441.44	0.20
189	002409	雅克科技	106,300	5,813,547.00	0.20
190	600562	国睿科技	184,600	5,813,054.00	0.20
191	000400	许继电气	265,880	5,788,207.60	0.20
192	000528	柳工	600,800	5,773,688.00	0.20
193	600155	华创云信	827,648	5,760,430.08	0.20
194	001696	宗申动力	256,100	5,749,445.00	0.20
195	002683	广东宏大	169,300	5,746,042.00	0.20
196	300919	中伟股份	174,000	5,721,120.00	0.20
197	688188	柏楚电子	43,331	5,704,959.46	0.20
198	300757	罗博特科	37,800	5,668,866.00	0.20
199	000960	锡业股份	367,940	5,629,482.00	0.20
200	300724	捷佳伟创	103,500	5,620,050.00	0.20
201	002607	中公教育	1,836,400	5,619,384.00	0.20
202	600637	东方明珠	750,724	5,607,908.28	0.20
203	600498	烽火通信	265,000	5,572,950.00	0.19
204	600884	杉杉股份	586,500	5,548,290.00	0.19

205	600563	法拉电子	50,742	5,535,444.78	0.19
206	300623	捷捷微电	185,600	5,530,880.00	0.19
207	603939	益丰药房	225,737	5,523,784.39	0.19
208	600529	山东药玻	247,300	5,475,222.00	0.19
209	300558	贝达药业	93,900	5,441,505.00	0.19
210	688568	中科星图	150,048	5,403,228.48	0.19
211	002739	万达电影	472,000	5,394,960.00	0.19
212	002841	视源股份	155,900	5,394,140.00	0.19
213	000039	中集集团	686,028	5,392,180.08	0.19
214	000415	渤海租赁	1,611,200	5,365,296.00	0.19
215	002653	海思科	125,300	5,290,166.00	0.18
216	301358	湖南裕能	168,700	5,261,753.00	0.18
217	600486	扬农化工	90,680	5,259,440.00	0.18
218	002926	华西证券	586,700	5,245,098.00	0.18
219	002025	航天电器	102,000	5,243,820.00	0.18
220	600901	江苏金租	862,380	5,226,022.80	0.18
221	002385	大北农	1,280,200	5,172,008.00	0.18
222	000887	中鼎股份	293,710	5,166,358.90	0.18
223	688017	绿的谐波	41,292	5,156,957.88	0.18
224	300285	国瓷材料	296,700	5,147,745.00	0.18
225	300763	锦浪科技	89,100	5,113,449.00	0.18
226	688114	华大智造	78,228	5,071,521.24	0.18
227	688582	芯动联科	75,261	5,057,539.20	0.18
228	002939	长城证券	600,200	5,029,676.00	0.18
229	300679	电连技术	110,500	5,014,490.00	0.18
230	300144	宋城演艺	586,100	5,011,155.00	0.17
231	002568	百润股份	195,100	4,996,511.00	0.17
232	600820	隧道股份	818,800	4,994,680.00	0.17
233	600863	内蒙华电	1,214,910	4,993,280.10	0.17
234	603486	科沃斯	85,500	4,978,665.00	0.17
235	000723	美锦能源	1,146,900	4,954,608.00	0.17
236	600132	重庆啤酒	89,900	4,953,490.00	0.17
237	600008	首创环保	1,639,500	4,951,290.00	0.17
238	002064	华峰化学	738,700	4,882,807.00	0.17
239	600390	五矿资本	836,900	4,879,127.00	0.17
240	002080	中材科技	250,200	4,878,900.00	0.17
241	000513	丽珠集团	135,286	4,875,707.44	0.17
242	600516	方大炭素	1,048,600	4,865,504.00	0.17
243	603568	伟明环保	254,219	4,850,498.52	0.17
244	002312	川发龙蟒	421,900	4,843,412.00	0.17
245	600998	九州通	938,067	4,821,664.38	0.17
246	688538	和辉光电	2,059,290	4,818,738.60	0.17
247	600763	通策医疗	116,654	4,815,477.12	0.17

248	000703	恒逸石化	818,400	4,812,192.00	0.17
249	688183	生益电子	93,737	4,799,334.40	0.17
250	600166	福田汽车	1,768,490	4,792,607.90	0.17
251	300487	蓝晓科技	94,350	4,745,805.00	0.17
252	600170	上海建工	1,984,700	4,743,433.00	0.17
253	002262	恩华药业	227,100	4,719,138.00	0.16
254	600208	衢州发展	1,583,200	4,686,272.00	0.16
255	601179	中国西电	763,200	4,686,048.00	0.16
256	002500	山西证券	802,090	4,684,205.60	0.16
257	603816	顾家家居	183,300	4,677,816.00	0.16
258	603589	口子窖	134,249	4,671,865.20	0.16
259	600312	平高电气	302,900	4,661,631.00	0.16
260	605358	立昂微	199,800	4,655,340.00	0.16
261	300676	华大基因	93,300	4,643,541.00	0.16
262	000683	博源化工	968,900	4,641,031.00	0.16
263	002203	海亮股份	446,400	4,606,848.00	0.16
264	600021	上海电力	524,100	4,606,839.00	0.16
265	601155	新城控股	336,700	4,606,056.00	0.16
266	600985	淮北矿业	400,700	4,543,938.00	0.16
267	600126	杭钢股份	502,500	4,522,500.00	0.16
268	002244	滨江集团	463,520	4,519,320.00	0.16
269	002432	九安医疗	123,800	4,510,034.00	0.16
270	600380	健康元	408,400	4,504,652.00	0.16
271	000403	派林生物	247,910	4,494,608.30	0.16
272	600583	海油工程	822,400	4,490,304.00	0.16
273	000591	太阳能	1,021,200	4,483,068.00	0.16
274	601000	唐山港	1,102,999	4,478,175.94	0.16
275	600348	华阳股份	671,545	4,472,489.70	0.16
276	688728	格科微	290,058	4,466,893.20	0.16
277	603338	浙江鼎力	94,200	4,465,080.00	0.16
278	000060	中金岭南	973,800	4,460,004.00	0.16
279	000629	钒钛股份	1,729,800	4,428,288.00	0.15
280	000921	海信家电	172,000	4,420,400.00	0.15
281	603885	吉祥航空	327,500	4,411,425.00	0.15
282	600872	中炬高新	232,100	4,409,900.00	0.15
283	688278	特宝生物	61,123	4,407,579.53	0.15
284	300567	精测电子	72,600	4,400,286.00	0.15
285	000830	鲁西化工	426,571	4,393,681.30	0.15
286	601991	大唐发电	1,384,000	4,387,280.00	0.15
287	002603	以岭药业	310,800	4,382,280.00	0.15
288	603379	三美股份	90,800	4,369,296.00	0.15
289	600535	天士力	277,618	4,344,721.70	0.15
290	002984	森麒麟	231,400	4,338,750.00	0.15

291	002439	启明星辰	271,100	4,334,889.00	0.15
292	600816	建元信托	1,466,200	4,325,290.00	0.15
293	002056	横店东磁	302,540	4,280,941.00	0.15
294	300146	汤臣倍健	380,400	4,275,696.00	0.15
295	600095	湘财股份	425,600	4,268,768.00	0.15
296	600970	中材国际	490,900	4,211,922.00	0.15
297	600499	科达制造	428,300	4,197,340.00	0.15
298	002423	中粮资本	343,200	4,197,336.00	0.15
299	000062	深圳华强	156,200	4,195,532.00	0.15
300	603927	中科软	216,584	4,188,734.56	0.15
301	601880	辽港股份	2,790,770	4,186,155.00	0.15
302	601016	节能风电	1,445,965	4,178,838.85	0.15
303	600685	中船防务	153,300	4,168,227.00	0.15
304	603000	人民网	205,750	4,158,207.50	0.15
305	000636	风华高科	301,316	4,140,081.84	0.14
306	301308	江波龙	47,300	4,138,277.00	0.14
307	300390	天华新能	216,510	4,128,845.70	0.14
308	601611	中国核建	448,900	4,125,391.00	0.14
309	000958	电投产融	600,700	4,108,788.00	0.14
310	600511	国药股份	140,790	4,105,436.40	0.14
311	601666	平煤股份	552,900	4,096,989.00	0.14
312	603298	杭叉集团	194,900	4,083,155.00	0.14
313	000563	陕国投 A	1,142,606	4,079,103.42	0.14
314	300212	易华录	187,320	4,076,083.20	0.14
315	600859	王府井	292,551	4,063,533.39	0.14
316	688297	中无人机	76,065	4,061,871.00	0.14
317	603737	三棵树	109,953	4,051,768.05	0.14
318	000155	川能动力	412,100	4,046,822.00	0.14
319	601456	国联民生	389,600	4,032,360.00	0.14
320	603077	和邦生物	2,301,190	4,027,082.50	0.14
321	600655	豫园股份	725,000	4,023,750.00	0.14
322	600004	白云机场	440,600	4,009,460.00	0.14
323	000598	兴蓉环境	555,610	4,005,948.10	0.14
324	688520	神州细胞	66,913	4,004,743.05	0.14
325	600483	福能股份	413,800	3,989,032.00	0.14
326	600325	华发股份	819,079	3,988,914.73	0.14
327	601966	玲珑轮胎	271,900	3,988,773.00	0.14
328	002773	康弘药业	137,500	3,983,375.00	0.14
329	603899	晨光股份	137,400	3,983,226.00	0.14
330	300677	英科医疗	168,000	3,978,240.00	0.14
331	603156	养元饮品	187,400	3,965,384.00	0.14
332	600131	国网信通	223,700	3,959,490.00	0.14
333	688301	奕瑞科技	45,126	3,953,488.86	0.14

334	601958	金钼股份	360,700	3,946,058.00	0.14
335	600378	昊华科技	144,400	3,908,908.00	0.14
336	000050	深天马 A	457,700	3,899,604.00	0.14
337	600663	陆家嘴	439,388	3,892,977.68	0.14
338	600282	南钢股份	918,400	3,857,280.00	0.13
339	000951	中国重汽	218,700	3,844,746.00	0.13
340	000987	越秀资本	560,385	3,844,241.10	0.13
341	002507	涪陵榨菜	300,420	3,842,371.80	0.13
342	300529	健帆生物	178,000	3,839,460.00	0.13
343	002756	永兴材料	120,600	3,829,050.00	0.13
344	600598	北大荒	265,110	3,822,886.20	0.13
345	600271	航天信息	413,700	3,822,588.00	0.13
346	600754	锦江酒店	169,700	3,808,068.00	0.13
347	601001	晋控煤业	311,400	3,805,308.00	0.13
348	300601	康泰生物	249,760	3,793,854.40	0.13
349	688234	天岳先进	64,566	3,780,339.30	0.13
350	000559	万向钱潮	491,500	3,759,975.00	0.13
351	600739	辽宁成大	341,800	3,759,800.00	0.13
352	600737	中粮糖业	397,771	3,758,935.95	0.13
353	301536	星辰科技	62,300	3,756,690.00	0.13
354	601918	新集能源	578,900	3,739,694.00	0.13
355	688363	华熙生物	72,373	3,716,353.55	0.13
356	600582	天地科技	615,930	3,689,420.70	0.13
357	002429	兆驰股份	842,300	3,689,274.00	0.13
358	603290	斯达半导	44,984	3,655,849.68	0.13
359	300751	迈为股份	52,517	3,652,561.87	0.13
360	601333	广深铁路	1,261,900	3,646,891.00	0.13
361	300070	碧水源	809,900	3,644,550.00	0.13
362	600566	济川药业	137,500	3,620,375.00	0.13
363	688772	珠海冠宇	253,201	3,618,242.29	0.13
364	002120	韵达股份	539,600	3,615,320.00	0.13
365	601866	中远海发	1,463,654	3,615,225.38	0.13
366	600764	中国海防	105,800	3,597,200.00	0.13
367	300735	光弘科技	143,200	3,594,320.00	0.13
368	601231	环旭电子	245,500	3,591,665.00	0.13
369	600867	通化东宝	437,500	3,587,500.00	0.13
370	603728	鸣志电器	62,000	3,563,140.00	0.12
371	003031	中瓷电子	66,840	3,556,556.40	0.12
372	300888	稳健医疗	86,520	3,555,972.00	0.12
373	002430	杭氧股份	182,900	3,551,918.00	0.12
374	603688	石英股份	100,800	3,550,176.00	0.12
375	600329	达仁堂	106,090	3,539,162.40	0.12
376	688778	厦钨新能	63,223	3,535,430.16	0.12

377	600258	首旅酒店	249,686	3,528,063.18	0.12
378	601098	中南传媒	267,900	3,514,848.00	0.12
379	603341	龙旗科技	86,400	3,510,432.00	0.12
380	600995	南网储能	357,200	3,493,416.00	0.12
381	601212	白银有色	1,102,600	3,451,138.00	0.12
382	600707	彩虹股份	534,200	3,450,932.00	0.12
383	688561	奇安信	100,949	3,430,247.02	0.12
384	000032	深桑达 A	169,000	3,418,870.00	0.12
385	688676	金盘科技	101,514	3,395,643.30	0.12
386	000027	深圳能源	531,196	3,389,030.48	0.12
387	600578	京能电力	747,500	3,356,275.00	0.12
388	603858	步长制药	205,800	3,342,192.00	0.12
389	002508	老板电器	175,500	3,336,255.00	0.12
390	000709	河钢股份	1,539,200	3,324,672.00	0.12
391	688318	财富趋势	28,863	3,316,935.96	0.12
392	002299	圣农发展	231,613	3,309,749.77	0.12
393	603529	爱玛科技	96,200	3,309,280.00	0.12
394	600906	财达证券	483,600	3,298,152.00	0.12
395	300573	兴齐眼药	63,580	3,292,808.20	0.11
396	301498	乖宝宠物	30,100	3,292,037.00	0.11
397	000967	盈峰环境	471,900	3,279,705.00	0.11
398	000883	湖北能源	725,500	3,272,005.00	0.11
399	600517	国网英大	638,500	3,256,350.00	0.11
400	002670	国盛金控	216,095	3,252,229.75	0.11
401	002831	裕同科技	138,840	3,251,632.80	0.11
402	600848	上海临港	356,700	3,235,269.00	0.11
403	600546	山煤国际	369,400	3,224,862.00	0.11
404	601399	国机重装	1,073,900	3,221,700.00	0.11
405	600959	江苏有线	930,250	3,200,060.00	0.11
406	601928	凤凰传媒	283,800	3,170,046.00	0.11
407	601156	东航物流	236,600	3,097,094.00	0.11
408	600968	海油发展	756,700	3,087,336.00	0.11
409	600808	马钢股份	891,940	3,077,193.00	0.11
410	300595	欧普康视	200,000	3,054,000.00	0.11
411	600528	中铁工业	413,276	3,049,976.88	0.11
412	000825	太钢不锈	849,500	3,049,705.00	0.11
413	000739	普洛药业	217,700	3,047,800.00	0.11
414	603225	新凤鸣	283,382	3,018,018.30	0.11
415	002572	索菲亚	215,100	3,013,551.00	0.11
416	601118	海南橡胶	637,000	3,006,640.00	0.10
417	601636	旗滨集团	599,900	3,005,499.00	0.10
418	301301	川宁生物	249,400	3,002,776.00	0.10
419	002266	浙富控股	971,350	2,991,758.00	0.10

420	603565	中谷物流	312,600	2,985,330.00	0.10
421	601608	中信重工	682,100	2,980,777.00	0.10
422	600977	中国电影	277,600	2,975,872.00	0.10
423	600801	华新水泥	250,568	2,966,725.12	0.10
424	000543	皖能电力	421,800	2,952,600.00	0.10
425	600871	石化油服	1,512,700	2,949,765.00	0.10
426	601598	中国外运	587,300	2,895,389.00	0.10
427	600062	华润双鹤	155,124	2,894,613.84	0.10
428	600056	中国医药	278,010	2,874,623.40	0.10
429	688387	信科移动	508,675	2,874,013.75	0.10
430	688563	航材股份	50,710	2,871,707.30	0.10
431	603650	彤程新材	89,000	2,861,350.00	0.10
432	601106	中国一重	1,021,400	2,859,920.00	0.10
433	000582	北部湾港	346,600	2,859,450.00	0.10
434	000785	居然智家	926,700	2,826,435.00	0.10
435	688702	盛科通信	46,203	2,822,079.24	0.10
436	300957	贝泰妮	62,700	2,772,594.00	0.10
437	603233	大参林	169,208	2,758,090.40	0.10
438	600925	苏能股份	512,600	2,680,898.00	0.09
439	600373	中文传媒	260,100	2,671,227.00	0.09
440	601965	中国汽研	149,800	2,658,950.00	0.09
441	002153	石基信息	304,556	2,637,454.96	0.09
442	000429	粤高速 A	194,400	2,591,352.00	0.09
443	000537	中绿电	307,600	2,571,536.00	0.09
444	600606	绿地控股	1,569,800	2,558,774.00	0.09
445	688281	华秦科技	40,954	2,478,126.54	0.09
446	002372	伟星新材	237,280	2,458,220.80	0.09
447	601568	北元集团	591,920	2,456,468.00	0.09
448	600098	广州发展	391,200	2,445,000.00	0.09
449	600361	创新新材	611,200	2,438,688.00	0.09
450	688425	铁建重工	596,028	2,431,794.24	0.08
451	001286	陕西能源	278,800	2,425,560.00	0.08
452	603658	安图生物	63,410	2,377,875.00	0.08
453	600612	老凤祥	47,700	2,373,075.00	0.08
454	003022	联泓新科	149,600	2,368,168.00	0.08
455	600688	上海石化	817,900	2,331,015.00	0.08
456	688349	三一重能	92,136	2,297,871.84	0.08
457	000937	冀中能源	394,200	2,266,650.00	0.08
458	301165	锐捷网络	35,940	2,208,872.40	0.08
459	601019	山东出版	233,200	2,208,404.00	0.08
460	000898	鞍钢股份	888,800	2,062,016.00	0.07
461	002608	江苏国信	280,900	2,058,997.00	0.07
462	688100	威胜信息	55,407	2,052,829.35	0.07

463	601139	深圳燃气	321,200	2,042,832.00	0.07
464	600339	中油工程	623,230	2,037,962.10	0.07
465	600032	浙江新能	269,000	2,033,640.00	0.07
466	603707	健友股份	180,066	2,007,735.90	0.07
467	688248	南网科技	63,636	2,001,988.56	0.07
468	600720	中交设计	256,600	1,983,518.00	0.07
469	000959	首钢股份	579,100	1,968,940.00	0.07
470	600928	西安银行	495,900	1,943,928.00	0.07
471	003035	南网能源	422,900	1,941,111.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	220,700	1,922,297.00	0.07
473	688475	萤石网络	59,162	1,864,786.24	0.07
474	688032	禾迈股份	18,643	1,861,689.98	0.06
475	002461	珠江啤酒	164,300	1,854,947.00	0.06
476	603556	海兴电力	72,100	1,836,387.00	0.06
477	601228	广州港	561,800	1,814,614.00	0.06
478	301267	华夏眼科	93,700	1,796,229.00	0.06
479	688172	燕东微	90,369	1,776,654.54	0.06
480	688375	国博电子	29,104	1,746,531.04	0.06
481	603786	科博达	30,400	1,684,464.00	0.06
482	600927	永安期货	108,400	1,605,404.00	0.06
483	601061	中信金属	200,500	1,585,955.00	0.06
484	002563	森马服饰	300,600	1,581,156.00	0.06
485	600007	中国国贸	74,700	1,537,326.00	0.05
486	000539	粤电力 A	331,500	1,505,010.00	0.05
487	600299	安迪苏	150,200	1,449,430.00	0.05
488	002945	华林证券	100,500	1,444,185.00	0.05
489	603826	坤彩科技	72,840	1,425,478.80	0.05
490	300140	节能环境	230,900	1,424,653.00	0.05
491	688819	天能股份	51,122	1,419,146.72	0.05
492	001213	中铁特货	330,900	1,343,454.00	0.05
493	601921	浙版传媒	165,000	1,329,900.00	0.05
494	601858	中国科传	58,400	1,135,880.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	32,328	1,002,491.28	0.03
496	601158	重庆水务	214,400	994,816.00	0.03
497	600956	新天绿能	114,600	884,712.00	0.03
498	001389	广合科技	14,400	846,288.00	0.03
499	688295	中复神鹰	37,188	773,510.40	0.03
500	603868	飞科电器	18,067	648,063.29	0.02
501	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
502	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
503	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
504	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
505	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00

506	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
507	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
508	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
509	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
510	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
511	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
512	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
513	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
514	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
515	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
516	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
517	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
518	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
519	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
520	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
521	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
522	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
523	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
524	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
525	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
526	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
527	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
528	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
529	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
530	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
531	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
532	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
533	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
534	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
535	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
536	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	688608	恒玄科技	12,047,086.57	0.38
2	688235	百济神州	11,444,535.00	0.36
3	000933	神火股份	10,300,285.80	0.33
4	601665	齐鲁银行	9,827,260.00	0.31
5	300450	先导智能	9,280,397.00	0.29
6	300454	深信服	8,836,123.80	0.28

7	002130	沃尔核材	8,764,986.00	0.28
8	300458	全志科技	8,661,495.20	0.27
9	600363	联创光电	8,281,398.00	0.26
10	300346	南大光电	8,028,474.78	0.25
11	002851	麦格米特	7,769,293.00	0.25
12	300857	协创数据	7,736,576.60	0.24
13	300115	长盈精密	7,621,329.00	0.24
14	600171	上海贝岭	7,033,087.00	0.22
15	605589	圣泉集团	6,977,263.04	0.22
16	002007	华兰生物	6,936,917.10	0.22
17	603659	璞泰来	6,854,985.00	0.22
18	300627	华测导航	6,659,638.80	0.21
19	688027	国盾量子	6,455,854.54	0.20
20	000528	柳工	6,085,496.70	0.19

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	002625	光启技术	30,654,951.40	0.97
2	600418	江淮汽车	28,102,589.03	0.89
3	002384	东山精密	22,743,167.14	0.72
4	301236	软通动力	16,545,264.24	0.52
5	300866	安克创新	13,132,563.30	0.41
6	302132	中航成飞	12,156,468.74	0.38
7	002128	电投能源	11,391,914.00	0.36
8	601665	齐鲁银行	9,729,929.00	0.31
9	688047	龙芯中科	9,004,060.19	0.28
10	002407	多氟多	7,286,058.20	0.23
11	300339	润和软件	7,221,139.00	0.23
12	300476	胜宏科技	6,874,215.00	0.22
13	000818	航锦科技	6,716,102.00	0.21
14	600642	申能股份	6,577,120.00	0.21
15	601567	三星医疗	6,264,030.00	0.20
16	002202	金风科技	6,159,086.00	0.19
17	000988	华工科技	6,142,282.00	0.19
18	688536	思瑞浦	6,060,396.38	0.19
19	000998	隆平高科	5,710,071.00	0.18
20	300395	菲利华	5,566,541.00	0.18

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	693,987,734.42
卖出股票收入（成交）总额	882,205,759.65

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管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华

人民共和国梅沙海关的处罚。苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理局江苏监管局的处罚。天风证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到杭州市西湖区人力资源和社会保障局处罚。

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。

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	14,894,490.70
2	应收清算款	10,522,089.55
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	25,416,580.25

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	688521	芯原股份	3,606,566.63	0.13	非公开发行流通受限
2	689009	九号公司	3,423,000.00	0.12	大宗交易流通受限

注：根据上海、深圳证券交易所发布的上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实

施细则，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有限 公司－易方达中证 500 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
17,986	53,050.61	789,121,845.00	82.70%	165,046,496.00	17.30%	646,784,695.00	67.79%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	48,671,365.00	5.10%
2	招商证券股份有限公司	8,518,987.00	0.89%
3	易方达颐和绝对收益多策略混合型养老金产品－中国工商银行股份有限公司	6,180,900.00	0.65%
4	中国移动通信集团有限公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	4,583,600.00	0.48%
5	易方达丰利股票型养老金产品－上海浦东发展银行股份有限公司	4,436,911.00	0.47%

6	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	3,941,800.00	0.41%
7	平安资管—中国银行—平安资产夏荷 18 号资产管理产品	3,810,400.00	0.40%
8	佛山市中科睿盈科技研究有限责任公司	3,347,178.00	0.35%
9	香港中央结算有限公司	3,178,642.00	0.33%
10	李传永	2,349,700.00	0.25%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	646,784,695.00	67.79%

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（2015 年 8 月 27 日）基金份额总额	295,259,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,102,968,341.00
本报告期基金总申购份额	207,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	356,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	954,168,341.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本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 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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	2	5,813,874.80	0.37%	581.36	0.37%	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	294,481.00	0.02%	29.45	0.02%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	818,231,856.28	52.57%	81,834.91	52.57%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	732,067,821.68	47.04%	73,211.08	47.03%	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c）本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

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

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	16,125,685.32	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部分 ETF 增加中航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	2025-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2025-01-21
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	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	2025-02-27
4	关于易方达基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同、托管协议的公告	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	2025-03-20

5	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	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	2025-03-22
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025-03-22
9	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	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	2025-03-25
10	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报	2025-03-31
12	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电子披露网站	2025-04-11
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2025-04-22
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025-05-17
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	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	2025-06-20
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配芯原股份（688521）非公开发行 A 股及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电子披露网站	2025-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期 初 份 额	申 购 份 额	赎 回 份 额	持有份 额	份额占 比

中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2025 年 01 月 01 日 ~2025 年 06 月 30 日	741,904,595.00	60,506,400.00	155,626,300.00	646,784,695.00	67.79 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如场外个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达中证 500 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 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇二五年八月三十日