

易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 期末投资目标基金明细	50
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.4 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	51
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.7 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	65
7.8 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	66
7.9 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	66
7.10 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	66
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66

7.13 投资组合报告附注	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	72
§ 11 备查文件目录	73
11.1 备查文件目录	73
11.2 存放地点	73
11.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	易方达中证 A500ETF 联接		
基金主代码	022459		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 11 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	5,241,044,193.74 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	022459	022460	022930
报告期末下属分级基金的份额总额	2,640,420,387.54 份	2,533,498,025.86 份	67,125,780.34 份

注：自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159361
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 19 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

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	本基金为易方达中证 A500ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证 A500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，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，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票（含存托凭证）投资策略、债券和货币市场

	工具投资策略、衍生品投资策略、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	中证 A500 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 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股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 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	方圆
	联系电话	020-85102688	95559
	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；	中国（上海）长宁区仙霞路18 号

	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	
邮政编码	510620; 519031	200336
法定代表人	吴欣荣	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	中国证券报
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 (2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日)		
	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
本期已实现收益	11,314,515.47	10,577,094.81	227,328.74
本期利润	66,743,776.71	62,724,515.78	1,942,675.78
加权平均基金份额本期利润	0.0249	0.0197	0.0377
本期加权平均净值利润率	2.54%	2.01%	3.84%
本期基金份额净值增长率	1.58%	1.48%	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
期末可供分配利润	2,959,155.62	-359,509.80	73,928.00
期末可供分配基金份额利润	0.0011	-0.0001	0.0011
期末基金资产净值	2,661,478,248.41	2,550,440,192.72	67,659,817.71
期末基金份额净值	1.0080	1.0067	1.0080
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
基金份额累计净值增长率	0.80%	0.67%	0.79%

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

易方达中证 A500ETF 联接 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	3.41%	0.57%	2.68%	0.57%	0.73%	0.00%
过去三个月	1.84%	1.14%	0.83%	1.14%	1.01%	0.00%
过去六个月	1.58%	1.05%	0.49%	1.05%	1.09%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.80%	0.98%	-4.45%	1.05%	5.25%	-0.07%

易方达中证 A500ETF 联接 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	3.39%	0.57%	2.68%	0.57%	0.71%	0.00%
过去三个月	1.78%	1.14%	0.83%	1.14%	0.95%	0.00%
过去六个月	1.48%	1.05%	0.49%	1.05%	0.99%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.67%	0.98%	-4.45%	1.05%	5.12%	-0.07%

易方达中证 A500ETF 联接 Y

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	3.41%	0.57%	2.68%	0.57%	0.73%	0.00%
过去三个月	1.84%	1.14%	0.83%	1.14%	1.01%	0.00%
过去六个月	1.58%	1.05%	0.49%	1.05%	1.09%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.79%	1.02%	-0.35%	1.02%	1.14%	0.00%

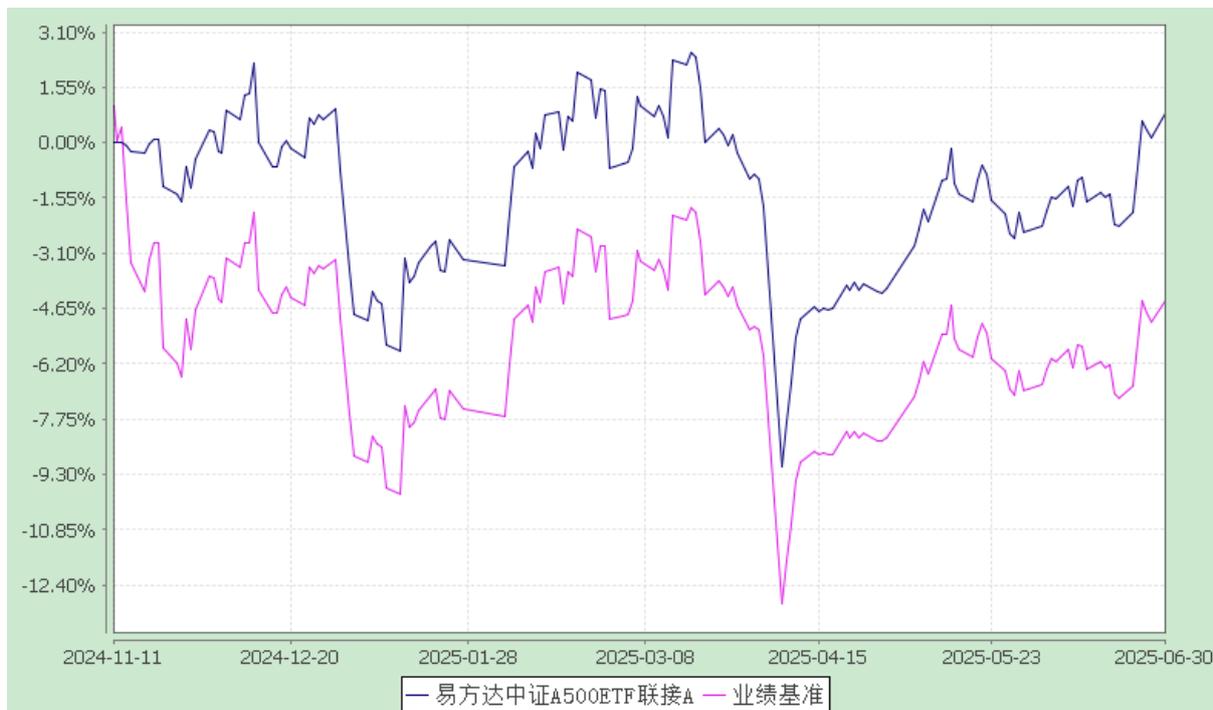
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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

易方达中证 A500ETF 联接 A

(2024 年 11 月 11 日至 2025 年 6 月 30 日)



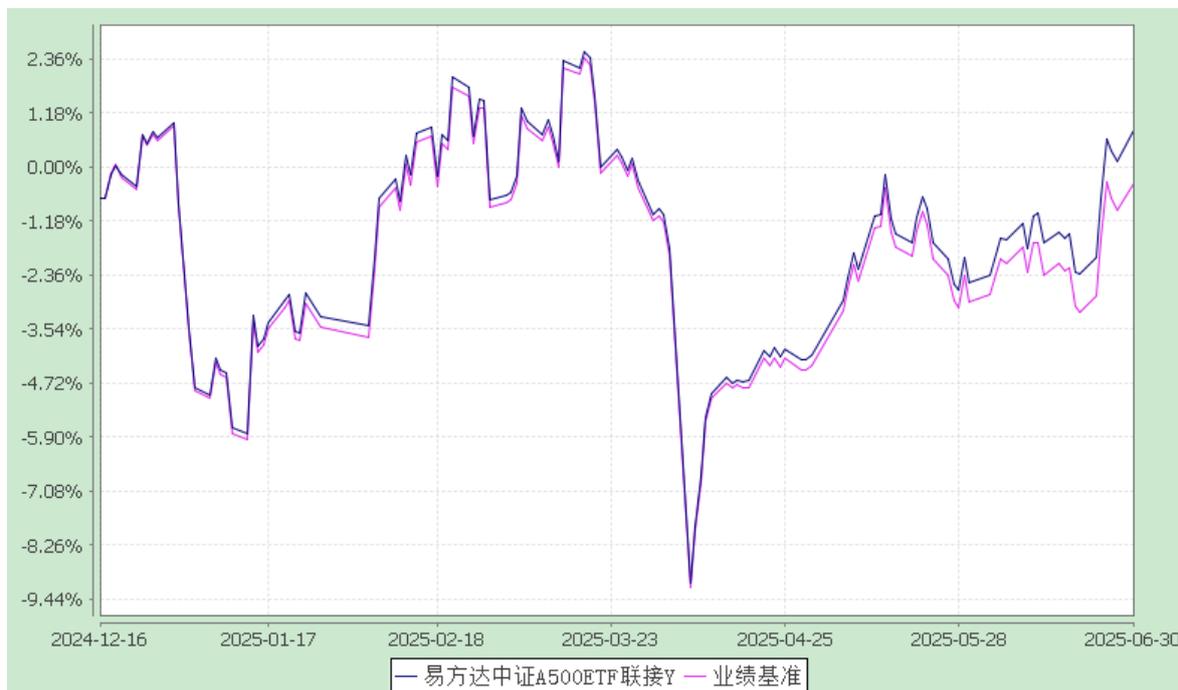
易方达中证 A500ETF 联接 C

(2024 年 11 月 11 日至 2025 年 6 月 30 日)



易方达中证 A500ETF 联接 Y

(2024 年 12 月 16 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2024 年 11 月 11 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.本基金于 2024 年 11 月 20 日变更为易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基

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

4.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为-4.45%；C 类基金份额净值增长率为 0.67%，同期业绩比较基准收益率为-4.45%；Y 类基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为-0.35%。

§ 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，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、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、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	2024-11-11	-	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。
张湛	本基金的基金经理助理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物	2024-12-07	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，

<p>科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证新能源 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50ETF 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF(QDII)、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接发起式、易方达中证医疗 ETF 联接发起式、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、易方达中证新能源 ETF 联接发起式、易方达中证全指证券公司 ETF 的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式、易方达创业板 ETF、易方达中证 A500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 的基金经理助理</p>				<p>易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证 500 增强策略 ETF 的基金经理。</p>
---	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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

本基金为易方达中证 A500ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达中证 A500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证 A500ETF 跟踪中证 A500 指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。

2025 年上半年国民经济整体运行平稳，高质量发展取得实质性进展，以新质生产力为引领的新增长动能持续成长壮大。根据国家统计局初步核算，2025 年上半年国内生产总值达 66.1 万亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%。分结构来看，工业生产增长较快，尤其是高技术制造业等新兴产业增长趋势较好。2025 年上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.4%，其中，高技术制造业增加值增长 9.5%，3D 打印设备、新能源汽车、工业机器人等创新产品产量同比分别增长 43.1%、36.2%、35.6%。服务业增长较快，现代服务业发展趋势较好。2025 年上半年服务业增加值同比增长 5.5%，其中，信息传输、软件和信息技术服务业增加值增长 11.1%，体现了新一批信息技术应用的持续落地。此外，消费市场增速有所回升，2025 年上半年社会消费品零售总额 24.5 万亿元，同比增长 5.0%。固定资产投资继续扩大，扣除房地产开发投资，2025 年上半年全国固定资产投资增长 6.6%，其中制造业投资增长 7.5%。全国新建商品房销售面积 4.6 亿平方米，下降 3.5%；新建商品房销售额 4.4 万亿元，下降 5.5%，均较去年同期明显收窄。从 A 股市场表现来看，上半年风险偏好整体震荡上行，投资者信心得到显著增强，人工智能、创新药、机器人等新一批中国优势产业的快速发展推动了相关板块的预期持续上升。2025 年上半年，在风险偏好改善和盈利预期修复的共同推动下，中证 A500 指数上涨 0.47%。

本报告期涵盖本基金的建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作。在基金的正常运作期，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，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，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 1.0080 元，本报告期份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%；C 类基金份额净值为 1.0067 元，本报告期份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%；Y 类基金份额净值为 1.0080 元，本报告期份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。年化跟踪误差 0.36%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济方面，随着积极有为的宏观政策持续落地，社会信心有望持续回升，各项经济数据有望保持稳中向好的趋势。当前，尽管外部贸易和地缘环境仍然存在一定挑战，但国内积极有为的政策措施有效缓解了外部压力，尤其是新动能持续增长，新质生产力发展呈现多点开花的趋势。以人工智能、创新药、机器人等为代表的产业不仅在底层创新能力上取得进展，也在国际市场中持续验证了自身的竞争力。此外，信用周期的逐步回升、地产数据的持续改善及各项增量政策的落地也有望推动企业盈利系统性回升，带来市场风险偏好的持续改善。

中长期来看，我国正处在经济增长动能转型升级的关键节点，电子、电力设备、医药生物、计算机等行业正在形成一批新的中国优势企业，其基础创新能力和国际市场竞争力有望不断提升，从而为经济增长带来更明显的助力。中证 A500 指数从行业均衡视角反映 A 股代表性公司整体表现，提升对宏观经济结构调整及产业转型升级的表征性。中证 A500 指数细分行业覆盖度广，纳入更加多元的细分领域龙头公司，包含较多新质生产力代表行业，成长属性较强。一方面受益于信用周期修复、企业盈利筑底回升等积极因素带来的市场风险偏好持续改善，另一方面受益于创新产业带来的结构增长动能持续增强，其中长期配置价值值得关注。

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

易方达中证 A500ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 A500ETF 联接 C:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 A500ETF 联接 Y: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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资运作、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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接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：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	301,037,194.39	342,927,858.61
结算备付金		15,017,237.50	81,468,266.66
存出保证金		7,466,774.94	13,449,631.57
交易性金融资产	6.4.7.2	4,960,354,181.69	6,005,862,883.63
其中：股票投资		128,469,714.70	125,941,913.44
基金投资		4,831,881,366.79	5,879,920,970.19
债券投资		3,100.20	-
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		25,988,320.42	39,251,321.80
应收股利		-	-
应收申购款		8,633,094.86	35,856,688.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		5,318,496,803.80	6,518,816,651.21
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		-	-
应付赎回款		38,325,903.15	67,617,274.80
应付管理人报酬		55,555.34	104,061.89
应付托管费		18,518.43	34,687.30
应付销售服务费		435,784.61	690,102.59
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	210,778.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	82,783.43	346,461.30
负债合计		38,918,544.96	69,003,365.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,241,044,193.74	6,501,100,071.41
未分配利润	6.4.7.8	38,534,065.10	-51,286,786.10
净资产合计		5,279,578,258.84	6,449,813,285.31
负债和净资产总计		5,318,496,803.80	6,518,816,651.21

注：1.本基金合同生效日为 2024 年 11 月 11 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 11 月 11 日至 2024 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0080 元，C 类基金份额净值 1.0067 元，Y 类基金份额净值 1.0080 元；基金份额总额 5,241,044,193.74 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 2,640,420,387.54 份，C 类基金份额总额 2,533,498,025.86 份，Y 类基金份额总额 67,125,780.34 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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
一、营业总收入		135,173,474.09
1.利息收入		712,249.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	712,249.98
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,961,591.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-438,481.87
基金投资收益	6.4.7.11	28,354,463.91
债券投资收益	6.4.7.12	4,577.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-4,516,203.46
股利收益	6.4.7.15	1,557,235.33
其他投资收益		-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	109,292,029.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	207,603.37
减：二、营业总支出		3,762,505.82
1. 管理人报酬		360,986.18
2. 托管费		120,328.70
3. 销售服务费		3,110,989.41
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	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		89,817.77
8. 其他费用	6.4.7.19	80,383.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		131,410,968.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		131,410,968.27
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		131,410,968.27

注：本基金合同生效日为 2024 年 11 月 11 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	6,501,100,071.41	-51,286,786.10	6,449,813,285.31
二、本期期初净资产	6,501,100,071.41	-51,286,786.10	6,449,813,285.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,260,055,877.67	89,820,851.20	-1,170,235,026.47
（一）、综合收益总额	-	131,410,968.27	131,410,968.27
（二）、本期基金份额交易产生的	-1,260,055,877.67	-41,590,117.07	-1,301,645,994.74

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	2,814,404,825.61	-64,195,065.39	2,750,209,760.22
2.基金赎回款	-4,074,460,703.28	22,604,948.32	-4,051,855,754.96
（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	5,241,044,193.74	38,534,065.10	5,279,578,258.84

注：本基金合同生效日为 2024 年 11 月 11 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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 A500 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[2024]1440 号《关于准予易方达中证 A500 指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 A500 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 A500 指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,989,966,558.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,844,619.99 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。

自 2024 年 11 月 20 日起，易方达中证 A500 指数证券投资基金变更为易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相

关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉

入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合以下有关基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准：

(1) 本基金可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于 0 元时，基金管理人可进行收益分配，累计报酬率计算方式详见招募说明书；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行 1 次收益分配；

5、本基金可以根据实际情况在其他日期进行收益评价，在符合上述有关基金分红条件的情形下，本基金可进行收益分配；

6、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

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

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	301,037,194.39
等于：本金	301,010,762.41
加：应计利息	26,431.98
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	301,037,194.39

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	126,573,974.42	-	128,469,714.70	1,895,740.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,100.00	0.20	3,100.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,100.00	0.20	3,100.20
资产支持证券	-	-	-	-

基金	4,745,503,667.17	-	4,831,881,366.79	86,377,699.62
其他	-	-	-	-
合计	4,872,080,741.59	0.20	4,960,354,181.69	88,273,439.90

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	52,023,940.00	-	-	-
IC2509	13,351,600.00	-	-	-
IF2509	38,672,340.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	52,023,940.00	-	-	-

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	12	13,861,920.00	510,320.00
IF2509	IF2509	34	39,647,400.00	975,060.00
合计	-	-	-	1,485,380.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,485,380.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

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	691.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,708.09
其中：交易所市场	7,708.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	82,783.43

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 A500ETF 联接 A

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	2,650,893,853.01	2,650,893,853.01
本期申购	1,434,866,030.98	1,434,866,030.98
本期赎回（以“-”号填列）	-1,445,339,496.45	-1,445,339,496.45
本期末	2,640,420,387.54	2,640,420,387.54

易方达中证 A500ETF 联接 C

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	3,834,990,534.01	3,834,990,534.01
本期申购	1,321,411,559.69	1,321,411,559.69
本期赎回（以“-”号填列）	-2,622,904,067.84	-2,622,904,067.84
本期末	2,533,498,025.86	2,533,498,025.86

易方达中证 A500ETF 联接 Y

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	15,215,684.39	15,215,684.39
本期申购	58,127,234.94	58,127,234.94
本期赎回（以“-”号填列）	-6,217,138.99	-6,217,138.99
本期末	67,125,780.34	67,125,780.34

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

易方达中证 A500ETF 联接 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	-8,774,306.09	-11,698,870.79	-20,473,176.88
本期期初	-8,774,306.09	-11,698,870.79	-20,473,176.88
本期利润	11,314,515.47	55,429,261.24	66,743,776.71
本期基金份额交易产生的变动数	418,946.24	-25,631,685.20	-25,212,738.96
其中：基金申购款	-2,151,316.03	-33,047,782.20	-35,199,098.23
基金赎回款	2,570,262.27	7,416,097.00	9,986,359.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,959,155.62	18,098,705.25	21,057,860.87

易方达中证 A500ETF 联接 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	-13,778,951.13	-16,916,819.44	-30,695,770.57
本期期初	-13,778,951.13	-16,916,819.44	-30,695,770.57
本期利润	10,577,094.81	52,147,420.97	62,724,515.78
本期基金份额交易产生的变动数	2,842,346.52	-17,928,924.87	-15,086,578.35
其中：基金申购款	-3,250,805.63	-24,389,507.61	-27,640,313.24
基金赎回款	6,093,152.15	6,460,582.74	12,553,734.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-359,509.80	17,301,676.66	16,942,166.86

易方达中证 A500ETF 联接 Y

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	-50,691.93	-67,146.72	-117,838.65
本期期初	-50,691.93	-67,146.72	-117,838.65
本期利润	227,328.74	1,715,347.04	1,942,675.78
本期基金份额交易产生的变动数	-102,708.81	-1,188,090.95	-1,290,799.76
其中：基金申购款	-107,354.23	-1,248,299.69	-1,355,653.92
基金赎回款	4,645.42	60,208.74	64,854.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,928.00	460,109.37	534,037.37

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	576,390.68
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	124,119.07
其他	11,740.23
合计	712,249.98

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	3,183,277.67
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-3,621,759.54
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-438,481.87

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	11,498,035.19
减：卖出股票成本总额	8,266,732.76
减：交易费用	48,024.76
买卖股票差价收入	3,183,277.67

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
申购基金份额总额	574,862,700.00
减：现金支付申购款总额	336,775,362.10
减：申购股票成本总额	241,709,097.44
减：交易费用	-
申购差价收入	-3,621,759.54

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,932,861,946.76
减：卖出/赎回基金成本总额	1,903,554,770.02
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	865,034.26
减：交易费用	87,678.57
基金投资收益	28,354,463.91

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	2.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,575.17
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	4,577.58

6.4.7.12.2 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	30,378.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,800.00

减：应计利息总额	2.21
减：交易费用	1.22
买卖债券差价收入	4,575.17

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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	-4,516,203.46

6.4.7.15 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	1,557,235.33
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,557,235.33

6.4.7.16 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	105,138,809.25
——股票投资	4,557,147.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	100,581,661.72
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	4,153,220.00
——权证投资	-
——期货投资	4,153,220.00
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	109,292,029.25

6.4.7.17 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	207,603.37
合计	207,603.37

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	6,000.00
合计	80,383.76

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
易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	191,098.00	0.07%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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	19.10	0.07%	5.64	0.07%

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.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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
当期发生的基金应支付的管理费	360,986.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,885,844.37
应支付基金管理人的净管理费	-1,524,858.19

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若

为负数，则取 0) 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 为调整后的前一日的基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

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、公休日等，支付日期顺延。

2. 对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

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
当期发生的基金应支付的托管费	120,328.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0) 的 0.05% 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 为调整后的前一日的基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

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			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达中证 A500ETF联接A	易方达中证 A500ETF联接C	易方达中证 A500ETF联接Y	合计

易方达基金管理有限 公司	-	59,564.98	-	59,564.98
交通银行	-	1,876,284.60	-	1,876,284.60
广发证券	-	2,665.64	-	2,665.64
合计	-	1,938,515.22	-	1,938,515.22

注：本基金 A 类基金份额、Y 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 0.20%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

易方达中证 A500ETF 联接 A

无。

易方达中证 A500ETF 联接 C

无。

易方达中证 A500ETF 联接 Y

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 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	301,037,194.39	576,390.68

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

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

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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 4,902,974,497 份和 6,064,274,928 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 35.13% 和 38.83%。本基金在报告期内因赎回目标 ETF 基金份额而持有托管人交通银行发行的 A 股交通银行。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有交通银行发行的 A 股交通银行 111,300 股（2024 年 12 月 31 日:111,300 股），占本基金净值比例为 0.02%（2024 年 12 月 31 日:0.01%）。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证 A500ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 A500ETF 联接 C

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 A500ETF 联接 Y

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	349	9,620.72	15,781.78	-
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	-

30159 5	太力 科技	2025-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	17.05	29.10	196	3,341. 80	5,703. 60	-
30160 2	超研 股份	2025-0 1-15	6 个月	新股 流通 受限	6.70	24.80	658	4,408. 60	16,318 .40	-
30163 6	泽润 新能	2025-0 4-30	6 个月	新股 流通 受限	33.06	47.46	128	4,231. 68	6,074. 88	-
30165 8	首航 新能	2025-0 3-26	6 个月	新股 流通 受限	11.80	22.98	437	5,156. 60	10,042 .26	-
30166 2	宏工 科技	2025-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	26.60	82.50	143	3,803. 80	11,797 .50	-
30166 5	泰禾 股份	2025-0 4-02	6 个月	新股 流通 受限	10.27	22.39	393	4,036. 11	8,799. 27	-
30167 8	新恒 汇	2025-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	12.80	44.54	382	4,889. 60	17,014 .28	-
60301 4	威高 血净	2025-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	26.50	32.68	205	5,432. 50	6,699. 40	-
60307 2	天和 磁材	2024-1 2-24	6 个月	新股 流通 受限	12.30	54.45	226	2,779. 80	12,305 .70	-
60312 0	肯特 催化	2025-0 4-09	6 个月	新股 流通 受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172. 95	-
60312 4	江南 新材	2025-0 3-12	6 个月	新股 流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075. 28	-
60320 2	天有 为	2025-0 4-16	6 个月	新股 流通 受限	93.50	90.66	166	15,521 .00	15,049 .56	-
60321 0	泰鸿 万立	2025-0 4-01	6 个月	新股 流通 受限	8.60	15.61	286	2,459. 60	4,464. 46	-
60325 7	中国 瑞林	2025-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600. 56	2,922. 66	-
60327 1	永杰 新材	2025-0 3-04	6 个月	新股 流通	20.60	35.08	126	2,595. 60	4,420. 08	-

				受限						
60338 2	海阳 科技	2025-0 6-05	6 个月	新股 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207. 50	2,350. 95	-
60340 0	华之 杰	2025-0 6-12	6 个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133. 16	2,497. 17	-
60340 9	汇通 控股	2025-0 2-25	6 个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	100	2,418. 00	3,332. 00	-
68841 1	海博 思创	2025-0 1-20	6 个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	560	10,852 .80	46,754 .40	-
68854 5	兴福 电子	2025-0 1-15	6 个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	994	11,609 .92	26,788 .30	-
68858 3	思看 科技	2025-0 1-08	6 个月	新股 流通 受限	33.46	79.68	227	5,855. 50	18,087 .36	-
68875 5	汉邦 科技	2025-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	22.77	39.33	203	4,622. 31	7,983. 99	-
68875 8	赛分 科技	2025-0 1-02	6 个月	新股 流通 受限	4.32	16.97	777	3,356. 64	13,185 .69	-
68877 5	影石 创新	2025-0 6-04	6 个月	新股 流通 受限	47.27	124.16	573	27,085 .71	71,143 .68	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
12325 7	安克 转债	2025-0 6-16	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.01	31	3,100. 00	3,100. 20	-

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。

本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。

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	3,100.20	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	3,100.20	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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	301,037,194.39	-	-	-	301,037,194.39
结算备付金	15,017,237.50	-	-	-	15,017,237.50
存出保证金	7,466,774.94	-	-	-	7,466,774.94
交易性金融资产	-	-	3,100.20	4,960,351,081.49	4,960,354,181.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	25,988,320.42	25,988,320.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	8,633,094.86	8,633,094.86
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	323,521,206.83	-	3,100.20	4,994,972,496.77	5,318,496,803.80
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	38,325,903.15	38,325,903.15
应付管理人报酬	-	-	-	55,555.34	55,555.34
应付托管费	-	-	-	18,518.43	18,518.43
应付销售服务费	-	-	-	435,784.61	435,784.61
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	-	-	-	82,783.43	82,783.43
负债总计	-	-	-	38,918,544.96	38,918,544.96
利率敏感度缺口	323,521,206.83	-	3,100.20	4,956,053,951.81	5,279,578,258.84
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	342,927,858.61	-	-	-	342,927,858.61
结算备付金	81,468,266.66	-	-	-	81,468,266.66
存出保证金	13,449,631.57	-	-	-	13,449,631.57
交易性金融资产	-	-	-	6,005,862,883.63	6,005,862,883.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	39,251,321.80	39,251,321.80
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	35,856,688.94	35,856,688.94

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	437,845,756.84	-	-	6,080,970,894.37	6,518,816,651.21
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	-	-	-	67,617,274.80	67,617,274.80
应付管理人报酬	-	-	-	104,061.89	104,061.89
应付托管费	-	-	-	34,687.30	34,687.30
应付销售服务费	-	-	-	690,102.59	690,102.59
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	210,778.02	210,778.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	346,461.30	346,461.30
负债总计	-	-	-	69,003,365.90	69,003,365.90
利率敏感度缺口	437,845,756.84	-	-	-6,011,967,528.47	6,449,813,285.31

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。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、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	128,469,714.70	2.43	125,941,913.44	1.95
交易性金融资产—基金投资	4,831,881,366.79	91.52	5,879,920,970.19	91.16
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	4,960,351,081.49	93.95	6,005,862,883.63	93.12

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%	94,671,430.25	25,503,050.06
2.业绩比较基准下降 5%	-94,671,430.25	-25,503,050.06	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	4,959,886,159.77
第二层次	18,485.74
第三层次	449,536.18
合计	4,960,354,181.69

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	128,469,714.70	2.42
	其中：股票	128,469,714.70	2.42
2	基金投资	4,831,881,366.79	90.85
3	固定收益投资	3,100.20	0.00
	其中：债券	3,100.20	0.00
	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	316,054,431.89	5.94
8	其他各项资产	42,088,190.22	0.79
9	合计	5,318,496,803.80	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	4,831,881,366.79	91.52

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	841,830.60	0.02
B	采矿业	5,734,107.00	0.11
C	制造业	78,359,623.56	1.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,442,190.00	0.07
E	建筑业	2,109,290.00	0.04
F	批发和零售业	905,405.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,126,385.00	0.08
H	住宿和餐饮业	94,584.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,595,298.21	0.16
J	金融业	18,628,463.00	0.35
K	房地产业	1,347,175.79	0.03
L	租赁和商务服务业	1,452,981.20	0.03

M	科学研究和技术服务业	1,397,525.66	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	288,762.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	101,286.00	0.00
Q	卫生和社会工作	559,747.68	0.01
R	文化、体育和娱乐业	485,060.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	128,469,714.70	2.43

7.4 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	300750	宁德时代	17,700	4,464,294.00	0.08
2	600519	贵州茅台	3,000	4,228,560.00	0.08
3	601318	中国平安	51,600	2,862,768.00	0.05
4	600036	招商银行	59,300	2,724,835.00	0.05
5	000333	美的集团	33,000	2,382,600.00	0.05
6	002594	比亚迪	6,100	2,024,651.00	0.04
7	300059	东方财富	84,800	1,961,424.00	0.04
8	601166	兴业银行	79,600	1,857,864.00	0.04
9	600900	长江电力	58,600	1,766,204.00	0.03
10	000858	五粮液	13,000	1,545,700.00	0.03
11	601899	紫金矿业	78,900	1,538,550.00	0.03
12	000651	格力电器	30,100	1,352,092.00	0.03
13	600030	中信证券	46,800	1,292,616.00	0.02
14	601398	工商银行	167,900	1,274,361.00	0.02
15	002475	立讯精密	34,000	1,179,460.00	0.02
16	600276	恒瑞医药	21,400	1,110,660.00	0.02
17	000725	京东方 A	246,300	982,737.00	0.02
18	002371	北方华创	2,100	928,641.00	0.02
19	300760	迈瑞医疗	4,063	913,159.25	0.02
20	601288	农业银行	152,900	899,052.00	0.02
21	601328	交通银行	111,300	890,400.00	0.02
22	300308	中际旭创	6,000	875,160.00	0.02
23	300502	新易盛	6,660	845,953.20	0.02
24	600887	伊利股份	30,300	844,764.00	0.02
25	688981	中芯国际	9,524	839,731.08	0.02
26	600919	江苏银行	70,300	839,382.00	0.02
27	603259	药明康德	12,000	834,600.00	0.02

28	300124	汇川技术	12,700	820,039.00	0.02
29	601816	京沪高铁	140,600	808,450.00	0.02
30	002352	顺丰控股	16,200	789,912.00	0.01
31	000001	平安银行	65,100	785,757.00	0.01
32	600000	浦发银行	56,200	780,056.00	0.01
33	002714	牧原股份	18,300	768,783.00	0.01
34	002230	科大讯飞	15,500	742,140.00	0.01
35	000063	中兴通讯	21,600	701,784.00	0.01
36	002415	海康威视	24,800	687,704.00	0.01
37	300274	阳光电源	9,720	658,724.40	0.01
38	601088	中国神华	15,800	640,532.00	0.01
39	688041	海光信息	4,454	629,305.66	0.01
40	601601	中国太保	16,400	615,164.00	0.01
41	688256	寒武纪	986	593,079.00	0.01
42	300476	胜宏科技	4,300	577,834.00	0.01
43	601728	中国电信	74,400	576,600.00	0.01
44	601668	中国建筑	99,000	571,230.00	0.01
45	000338	潍柴动力	36,300	558,294.00	0.01
46	000568	泸州老窖	4,900	555,660.00	0.01
47	000100	TCL 科技	125,900	545,147.00	0.01
48	601127	赛力斯	3,900	523,848.00	0.01
49	603501	豪威集团	4,100	523,365.00	0.01
50	600031	三一重工	28,400	509,780.00	0.01
51	002027	分众传媒	67,800	494,940.00	0.01
52	603019	中科曙光	7,000	492,800.00	0.01
53	600309	万华化学	9,000	488,340.00	0.01
54	600941	中国移动	4,300	483,965.00	0.01
55	601857	中国石油	54,300	464,265.00	0.01
56	601919	中远海控	30,200	454,208.00	0.01
57	688008	澜起科技	5,484	449,688.00	0.01
58	600690	海尔智家	18,000	446,040.00	0.01
59	600660	福耀玻璃	7,700	438,977.00	0.01
60	601012	隆基绿能	29,000	435,580.00	0.01
61	600406	国电南瑞	19,200	430,272.00	0.01
62	000425	徐工机械	55,200	428,904.00	0.01
63	000625	长安汽车	33,324	425,214.24	0.01
64	000792	盐湖股份	24,800	423,584.00	0.01
65	601766	中国中车	58,300	410,432.00	0.01
66	300033	同花顺	1,500	409,515.00	0.01
67	603986	兆易创新	3,200	404,896.00	0.01
68	002625	光启技术	10,100	403,798.00	0.01
69	600050	中国联通	74,900	399,966.00	0.01
70	002050	三花智控	15,000	395,700.00	0.01

71	600028	中国石化	69,900	394,236.00	0.01
72	300015	爱尔眼科	31,241	389,887.68	0.01
73	002463	沪电股份	9,000	383,220.00	0.01
74	002241	歌尔股份	16,400	382,448.00	0.01
75	601006	大秦铁路	57,900	382,140.00	0.01
76	688012	中微公司	2,096	382,100.80	0.01
77	300014	亿纬锂能	8,200	375,642.00	0.01
78	601985	中国核电	39,400	367,208.00	0.01
79	601225	陕西煤业	18,600	357,864.00	0.01
80	600104	上汽集团	22,200	356,310.00	0.01
81	000977	浪潮信息	6,900	351,072.00	0.01
82	600150	中国船舶	10,700	348,178.00	0.01
83	002384	东山精密	9,200	347,484.00	0.01
84	002179	中航光电	8,500	343,060.00	0.01
85	601988	中国银行	60,600	340,572.00	0.01
86	600418	江淮汽车	8,400	336,756.00	0.01
87	000538	云南白药	5,960	332,508.40	0.01
88	601628	中国人寿	8,000	329,520.00	0.01
89	000938	紫光股份	13,400	321,466.00	0.01
90	002049	紫光国微	4,840	318,762.40	0.01
91	000988	华工科技	6,700	314,967.00	0.01
92	605499	东鹏饮料	1,000	314,050.00	0.01
93	688271	联影医疗	2,455	313,601.70	0.01
94	603288	海天味业	8,000	311,280.00	0.01
95	600760	中航沈飞	5,300	310,686.00	0.01
96	688111	金山办公	1,109	310,575.45	0.01
97	002028	思源电气	4,200	306,222.00	0.01
98	600111	北方稀土	12,100	301,290.00	0.01
99	300408	三环集团	9,000	300,600.00	0.01
100	600938	中国海油	11,500	300,265.00	0.01
101	300433	蓝思科技	13,400	298,820.00	0.01
102	000002	万科 A	45,700	293,394.00	0.01
103	600905	三峡能源	68,500	291,810.00	0.01
104	601658	邮储银行	53,200	291,004.00	0.01
105	600089	特变电工	24,200	288,706.00	0.01
106	601888	中国中免	4,700	286,559.00	0.01
107	603993	洛阳钼业	33,700	283,754.00	0.01
108	600436	片仔癀	1,400	280,014.00	0.01
109	600048	保利发展	34,400	278,640.00	0.01
110	600547	山东黄金	8,700	277,791.00	0.01
111	600019	宝钢股份	42,000	276,780.00	0.01
112	601390	中国中铁	49,200	276,012.00	0.01
113	600415	小商品城	13,100	270,908.00	0.01

114	002422	科伦药业	7,500	269,400.00	0.01
115	300339	润和软件	5,300	269,399.00	0.01
116	601600	中国铝业	38,000	267,520.00	0.01
117	002456	欧菲光	22,300	264,255.00	0.01
118	002460	赣锋锂业	7,600	256,652.00	0.00
119	000768	中航西飞	9,300	254,262.00	0.00
120	601989	中国重工	54,600	253,344.00	0.00
121	300394	天孚通信	3,120	249,100.80	0.00
122	600585	海螺水泥	11,500	246,905.00	0.00
123	600893	航发动力	6,400	246,656.00	0.00
124	002252	上海莱士	35,600	244,572.00	0.00
125	600570	恒生电子	7,200	241,488.00	0.00
126	000157	中联重科	33,300	240,759.00	0.00
127	603799	华友钴业	6,500	240,630.00	0.00
128	000963	华东医药	5,900	238,124.00	0.00
129	002074	国轩高科	7,300	236,958.00	0.00
130	600584	长电科技	6,900	232,461.00	0.00
131	300442	润泽科技	4,600	227,838.00	0.00
132	000408	藏格矿业	5,300	226,151.00	0.00
133	301236	软通动力	4,100	224,024.00	0.00
134	601727	上海电气	30,300	223,917.00	0.00
135	000807	云铝股份	14,000	223,720.00	0.00
136	002517	恺英网络	11,500	222,065.00	0.00
137	002466	天齐锂业	6,900	221,076.00	0.00
138	002001	新和成	10,308	219,251.16	0.00
139	002340	格林美	34,400	218,440.00	0.00
140	000661	长春高新	2,200	218,196.00	0.00
141	600438	通威股份	12,900	216,075.00	0.00
142	002195	岩山科技	38,100	214,503.00	0.00
143	002558	巨人网络	9,100	214,305.00	0.00
144	001979	招商蛇口	24,327	213,347.79	0.00
145	000975	山金国际	11,200	212,128.00	0.00
146	002236	大华股份	13,300	211,204.00	0.00
147	300661	圣邦股份	2,860	208,122.20	0.00
148	002156	通富微电	8,100	207,522.00	0.00
149	600795	国电电力	42,700	206,668.00	0.00
150	600489	中金黄金	13,900	203,357.00	0.00
151	601669	中国电建	41,300	201,131.00	0.00
152	600988	赤峰黄金	8,000	199,040.00	0.00
153	300207	欣旺达	9,906	198,714.36	0.00
154	300251	光线传媒	9,800	198,646.00	0.00
155	601689	拓普集团	4,200	198,450.00	0.00
156	300418	昆仑万维	5,900	198,417.00	0.00

157	300347	泰格医药	3,700	197,284.00	0.00
158	002916	深南电路	1,820	196,214.20	0.00
159	002648	卫星化学	11,300	195,829.00	0.00
160	600010	包钢股份	108,500	194,215.00	0.00
161	002920	德赛西威	1,900	194,047.00	0.00
162	300782	卓胜微	2,700	192,699.00	0.00
163	000066	中国长城	13,000	192,400.00	0.00
164	300896	爱美客	1,100	192,291.00	0.00
165	003816	中国广核	52,800	192,192.00	0.00
166	000831	中国稀土	5,300	191,436.00	0.00
167	600009	上海机场	6,000	190,620.00	0.00
168	601100	恒立液压	2,600	187,200.00	0.00
169	600160	巨化股份	6,500	186,420.00	0.00
170	002273	水晶光电	9,300	185,721.00	0.00
171	002465	海格通信	13,300	185,402.00	0.00
172	302132	中航成飞	2,100	184,674.00	0.00
173	300450	先导智能	7,400	183,890.00	0.00
174	002601	龙佰集团	11,177	181,179.17	0.00
175	000786	北新建材	6,800	180,064.00	0.00
176	002555	三七互娱	10,400	179,816.00	0.00
177	000933	神火股份	10,600	176,384.00	0.00
178	002294	信立泰	3,725	176,304.25	0.00
179	601186	中国铁建	22,000	176,220.00	0.00
180	300017	网宿科技	16,400	175,808.00	0.00
181	600183	生益科技	5,800	174,870.00	0.00
182	688036	传音控股	2,185	174,144.50	0.00
183	002185	华天科技	17,200	173,720.00	0.00
184	600839	四川长虹	17,700	172,044.00	0.00
185	000630	铜陵有色	51,500	172,010.00	0.00
186	601360	三六零	16,800	171,360.00	0.00
187	300866	安克创新	1,500	170,400.00	0.00
188	600886	国投电力	11,500	169,510.00	0.00
189	600989	宝丰能源	10,500	169,470.00	0.00
190	002493	荣盛石化	20,400	168,912.00	0.00
191	000423	东阿阿胶	3,200	167,360.00	0.00
192	002129	TCL 中环	21,700	166,656.00	0.00
193	601058	赛轮轮胎	12,600	165,312.00	0.00
194	600115	中国东航	41,000	165,230.00	0.00
195	001965	招商公路	13,700	164,400.00	0.00
196	002709	天赐材料	9,000	163,080.00	0.00
197	002130	沃尔核材	6,800	161,976.00	0.00
198	300454	深信服	1,700	160,106.00	0.00
199	002595	豪迈科技	2,700	159,894.00	0.00

200	300223	北京君正	2,300	159,160.00	0.00
201	600066	宇通客车	6,400	159,104.00	0.00
202	002085	万丰奥威	10,000	158,900.00	0.00
202	002131	利欧股份	45,400	158,900.00	0.00
204	300832	新产业	2,800	158,816.00	0.00
205	002281	光迅科技	3,200	157,824.00	0.00
206	300122	智飞生物	8,000	156,720.00	0.00
207	300002	神州泰岳	13,200	155,760.00	0.00
208	300058	蓝色光标	23,720	155,603.20	0.00
209	002532	天山铝业	18,700	155,397.00	0.00
210	002738	中矿资源	4,800	154,368.00	0.00
211	600426	华鲁恒升	7,100	153,857.00	0.00
212	002180	纳思达	6,700	153,698.00	0.00
213	300474	景嘉微	2,100	153,300.00	0.00
214	002223	鱼跃医疗	4,300	153,080.00	0.00
215	600196	复星医药	6,100	153,049.00	0.00
216	600029	南方航空	25,800	152,220.00	0.00
217	002138	顺络电子	5,400	151,848.00	0.00
218	601800	中国交建	17,000	151,130.00	0.00
219	002078	太阳纸业	11,200	150,752.00	0.00
220	002472	双环传动	4,500	150,705.00	0.00
221	600011	华能国际	21,100	150,654.00	0.00
222	002938	鹏鼎控股	4,700	150,541.00	0.00
223	000999	华润三九	4,810	150,456.80	0.00
224	002436	兴森科技	11,300	149,612.00	0.00
225	688169	石头科技	955	149,505.25	0.00
226	600674	川投能源	9,300	149,172.00	0.00
227	002410	广联达	11,100	148,851.00	0.00
228	300496	中科创达	2,600	148,772.00	0.00
229	002128	电投能源	7,500	148,350.00	0.00
230	688126	沪硅产业	7,896	147,813.12	0.00
231	000301	东方盛虹	17,700	147,441.00	0.00
232	688120	华海清科	871	146,937.70	0.00
233	300759	康龙化成	5,950	146,013.00	0.00
234	300136	信维通信	6,500	145,600.00	0.00
235	300346	南大光电	4,600	145,544.00	0.00
236	600487	亨通光电	9,500	145,350.00	0.00
237	300024	机器人	8,400	144,312.00	0.00
238	600346	恒力石化	10,100	144,026.00	0.00
239	002065	东华软件	15,000	144,000.00	0.00
240	002353	杰瑞股份	4,100	143,500.00	0.00
241	300054	鼎龙股份	5,000	143,400.00	0.00
242	300395	菲利华	2,800	143,080.00	0.00

243	000034	神州数码	3,800	143,032.00	0.00
244	002202	金风科技	13,900	142,475.00	0.00
245	601111	中国国航	18,000	142,020.00	0.00
246	600745	闻泰科技	4,200	140,826.00	0.00
247	688608	恒玄科技	403	140,235.94	0.00
248	000733	振华科技	2,800	140,140.00	0.00
249	600372	中航机载	11,600	139,896.00	0.00
250	600460	士兰微	5,600	138,992.00	0.00
251	601868	中国能建	62,100	138,483.00	0.00
252	002624	完美世界	9,100	138,047.00	0.00
253	688213	思特威	1,347	137,690.34	0.00
254	002271	东方雨虹	12,800	137,344.00	0.00
255	300383	光环新网	9,600	137,280.00	0.00
256	002008	大族激光	5,600	136,472.00	0.00
257	688777	中控技术	3,030	136,077.30	0.00
258	002405	四维图新	15,900	135,786.00	0.00
259	601117	中国化学	17,600	134,992.00	0.00
260	300604	长川科技	3,000	134,730.00	0.00
261	600741	华域汽车	7,600	134,140.00	0.00
262	600096	云天化	6,100	134,017.00	0.00
263	300037	新宙邦	3,800	133,760.00	0.00
264	601319	中国人保	15,300	133,263.00	0.00
265	601168	西部矿业	8,000	133,040.00	0.00
266	002459	晶澳科技	13,300	132,734.00	0.00
267	300012	华测检测	11,300	132,097.00	0.00
268	300459	汤姆猫	23,565	131,964.00	0.00
269	600879	航天电子	12,600	131,922.00	0.00
270	600256	广汇能源	21,800	131,236.00	0.00
271	000426	兴业银锡	8,300	131,140.00	0.00
272	600176	中国巨石	11,500	131,100.00	0.00
273	600588	用友网络	9,800	131,026.00	0.00
274	002155	湖南黄金	7,300	130,305.00	0.00
275	601633	长城汽车	6,000	128,880.00	0.00
276	601021	春秋航空	2,300	127,995.00	0.00
277	600219	南山铝业	33,400	127,922.00	0.00
278	300627	华测导航	3,640	127,400.00	0.00
279	300073	当升科技	2,900	127,223.00	0.00
280	688235	百济神州	544	127,100.16	0.00
281	600352	浙江龙盛	12,500	127,000.00	0.00
282	300253	卫宁健康	11,900	126,140.00	0.00
283	300628	亿联网络	3,600	125,136.00	0.00
284	600885	宏发股份	5,600	124,936.00	0.00
285	600482	中国动力	5,400	124,578.00	0.00

286	000617	中油资本	17,000	124,100.00	0.00
287	600039	四川路桥	12,500	123,750.00	0.00
288	300699	光威复材	3,900	123,513.00	0.00
289	000519	中兵红箭	5,600	122,584.00	0.00
290	002444	巨星科技	4,800	122,448.00	0.00
291	000932	华菱钢铁	27,800	122,320.00	0.00
292	688002	睿创微纳	1,747	121,800.84	0.00
293	300003	乐普医疗	8,800	121,264.00	0.00
294	002389	航天彩虹	4,700	120,320.00	0.00
295	688396	华润微	2,544	119,975.04	0.00
296	300001	特锐德	5,000	119,850.00	0.00
297	000878	云南铜业	9,400	119,568.00	0.00
298	300316	晶盛机电	4,400	119,460.00	0.00
299	600085	同仁堂	3,300	118,998.00	0.00
300	002414	高德红外	11,500	117,875.00	0.00
301	300142	沃森生物	10,700	117,700.00	0.00
302	600362	江西铜业	5,000	117,150.00	0.00
303	002007	华兰生物	7,400	115,958.00	0.00
304	601877	正泰电器	5,100	115,617.00	0.00
305	002821	凯莱英	1,300	114,725.00	0.00
306	688099	晶晨股份	1,614	114,610.14	0.00
307	002812	恩捷股份	3,910	114,523.90	0.00
308	300568	星源材质	9,000	114,120.00	0.00
309	688617	惠泰医疗	383	113,751.00	0.00
310	688506	百利天恒	384	113,710.08	0.00
311	688122	西部超导	2,178	112,994.64	0.00
312	002152	广电运通	8,325	111,888.00	0.00
313	300919	中伟股份	3,400	111,792.00	0.00
314	000400	许继电气	5,100	111,027.00	0.00
315	300315	掌趣科技	18,200	110,474.00	0.00
316	603392	万泰生物	1,800	109,800.00	0.00
317	000738	航发控制	5,290	109,767.50	0.00
318	600161	天坛生物	5,700	109,383.00	0.00
319	000623	吉林敖东	6,453	109,378.35	0.00
320	300413	芒果超媒	5,000	109,100.00	0.00
321	603129	春风动力	500	108,250.00	0.00
322	002044	美年健康	21,000	107,940.00	0.00
323	002318	久立特材	4,600	107,594.00	0.00
324	000009	中国宝安	12,100	107,448.00	0.00
325	600233	圆通速递	8,300	106,987.00	0.00
326	603596	伯特利	2,000	105,380.00	0.00
327	300757	罗博特科	700	104,979.00	0.00
328	600188	兖矿能源	8,600	104,662.00	0.00

329	600862	中航高科	4,000	104,320.00	0.00
330	600143	金发科技	10,100	104,131.00	0.00
331	002409	雅克科技	1,900	103,911.00	0.00
332	002841	视源股份	3,000	103,800.00	0.00
333	603606	东方电缆	2,000	103,420.00	0.00
334	300724	捷佳伟创	1,900	103,170.00	0.00
335	688072	拓荆科技	670	102,985.70	0.00
336	601618	中国中冶	34,200	101,916.00	0.00
337	002607	中公教育	33,100	101,286.00	0.00
338	688047	龙芯中科	758	101,109.62	0.00
339	000960	锡业股份	6,600	100,980.00	0.00
340	688578	艾力斯	1,078	100,297.12	0.00
341	300088	长信科技	16,800	100,128.00	0.00
342	601615	明阳智能	8,700	99,963.00	0.00
343	688223	晶科能源	19,170	99,492.30	0.00
344	002245	蔚蓝锂芯	7,700	98,791.00	0.00
345	300182	捷成股份	17,900	98,629.00	0.00
346	300558	贝达药业	1,700	98,515.00	0.00
347	300763	锦浪科技	1,700	97,563.00	0.00
348	000039	中集集团	12,400	97,464.00	0.00
349	002407	多氟多	7,980	97,276.20	0.00
350	002739	万达电影	8,500	97,155.00	0.00
351	601872	招商轮船	15,500	97,030.00	0.00
352	600515	海南机场	27,400	96,996.00	0.00
353	600845	宝信软件	4,100	96,842.00	0.00
354	600549	厦门钨业	4,600	96,232.00	0.00
355	603659	璞泰来	5,100	95,778.00	0.00
356	300068	南都电源	6,000	95,520.00	0.00
357	688266	泽璟制药	888	95,468.88	0.00
358	600895	张江高科	3,700	95,090.00	0.00
359	605117	德业股份	1,780	93,734.80	0.00
360	301358	湖南裕能	3,000	93,570.00	0.00
361	000887	中鼎股份	5,300	93,227.00	0.00
362	603087	甘李药业	1,700	93,126.00	0.00
363	002025	航天电器	1,800	92,538.00	0.00
364	300285	国瓷材料	5,300	91,955.00	0.00
365	603605	珀莱雅	1,100	91,069.00	0.00
366	688599	天合光能	6,264	91,015.92	0.00
367	300144	宋城演艺	10,600	90,630.00	0.00
368	600332	白云山	3,400	89,624.00	0.00
369	601216	君正集团	16,200	89,424.00	0.00
370	300296	利亚德	14,600	89,060.00	0.00
371	605589	圣泉集团	3,200	88,800.00	0.00

372	600392	盛和资源	6,700	88,239.00	0.00
373	002064	华峰化学	13,300	87,913.00	0.00
374	002497	雅化集团	7,700	87,780.00	0.00
375	601799	星宇股份	700	87,500.00	0.00
376	002312	川发龙蟒	7,600	87,248.00	0.00
377	688180	君实生物	2,534	86,105.32	0.00
378	600153	建发股份	8,300	86,071.00	0.00
379	601233	桐昆股份	8,100	85,860.00	0.00
380	600803	新奥股份	4,500	85,050.00	0.00
381	300676	华大基因	1,700	84,609.00	0.00
382	000830	鲁西化工	8,200	84,460.00	0.00
383	000683	博源化工	17,500	83,825.00	0.00
384	603979	金诚信	1,800	83,592.00	0.00
385	002439	启明星辰	5,200	83,148.00	0.00
386	002176	江特电机	11,400	82,764.00	0.00
387	600699	均胜电子	4,700	81,968.00	0.00
388	600177	雅戈尔	11,100	81,030.00	0.00
389	002244	滨江集团	8,300	80,925.00	0.00
390	603260	合盛硅业	1,700	80,580.00	0.00
391	002432	九安医疗	2,200	80,146.00	0.00
392	600521	华海药业	4,300	80,109.00	0.00
393	600398	海澜之家	11,500	80,040.00	0.00
394	600118	中国卫星	2,800	79,996.00	0.00
395	000629	钒钛股份	31,200	79,872.00	0.00
396	002145	中核钛白	19,200	79,680.00	0.00
397	601238	广汽集团	10,600	79,394.00	0.00
398	600316	洪都航空	2,100	79,170.00	0.00
399	000708	中信特钢	6,730	79,144.80	0.00
400	002603	以岭药业	5,600	78,960.00	0.00
401	300567	精测电子	1,300	78,793.00	0.00
402	000818	航锦科技	3,500	78,750.00	0.00
403	600704	物产中大	14,900	78,523.00	0.00
404	600038	中直股份	2,000	77,620.00	0.00
405	600497	驰宏锌锗	14,600	77,234.00	0.00
406	600018	上港集团	13,400	76,514.00	0.00
407	601567	三星医疗	3,400	76,228.00	0.00
408	600141	兴发集团	3,700	75,961.00	0.00
409	600765	中航重机	4,500	75,960.00	0.00
410	601677	明泰铝业	6,000	74,520.00	0.00
411	300390	天华新能	3,900	74,373.00	0.00
412	000563	陕国投 A	20,600	73,542.00	0.00
413	300529	健帆生物	3,400	73,338.00	0.00
414	000998	隆平高科	7,416	73,047.60	0.00

415	300601	康泰生物	4,800	72,912.00	0.00
416	688188	柏楚电子	553	72,807.98	0.00
417	600637	东方明珠	9,700	72,459.00	0.00
418	000547	航天发展	8,600	72,240.00	0.00
419	601607	上海医药	4,000	71,520.00	0.00
420	600498	烽火通信	3,400	71,502.00	0.00
421	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
422	603939	益丰药房	2,900	70,963.00	0.00
423	600529	山东药玻	3,200	70,848.00	0.00
424	002756	永兴材料	2,200	69,850.00	0.00
425	600486	扬农化工	1,200	69,600.00	0.00
426	300751	迈为股份	1,000	69,560.00	0.00
427	600026	中远海能	6,700	69,211.00	0.00
428	601018	宁波港	18,600	68,076.00	0.00
429	002544	普天科技	2,900	68,005.00	0.00
430	300438	鹏辉能源	2,400	66,264.00	0.00
431	688303	大全能源	3,083	65,729.56	0.00
432	300070	碧水源	14,600	65,700.00	0.00
433	600563	法拉电子	600	65,454.00	0.00
434	002120	韵达股份	9,700	64,990.00	0.00
435	603806	福斯特	5,000	64,800.00	0.00
436	002508	老板电器	3,400	64,634.00	0.00
437	300457	赢合科技	2,800	64,400.00	0.00
438	603486	科沃斯	1,100	64,053.00	0.00
439	600820	隧道股份	10,500	64,050.00	0.00
440	600008	首创环保	21,100	63,722.00	0.00
441	688009	中国通号	12,389	63,679.46	0.00
442	002831	裕同科技	2,700	63,234.00	0.00
443	603568	伟明环保	3,300	62,964.00	0.00
444	000032	深桑达 A	3,100	62,713.00	0.00
445	600516	方大炭素	13,500	62,640.00	0.00
446	600998	九州通	12,100	62,194.00	0.00
447	300573	兴齐眼药	1,200	62,148.00	0.00
448	600763	通策医疗	1,500	61,920.00	0.00
449	600166	福田汽车	22,800	61,788.00	0.00
450	603816	顾家家居	2,400	61,248.00	0.00
451	600170	上海建工	25,500	60,945.00	0.00
452	000069	华侨城 A	27,000	60,750.00	0.00
453	605358	立昂微	2,600	60,580.00	0.00
454	600208	衢州发展	20,400	60,384.00	0.00
455	601179	中国西电	9,800	60,172.00	0.00
456	600312	平高电气	3,900	60,021.00	0.00
457	000967	盈峰环境	8,500	59,075.00	0.00

458	601155	新城控股	4,300	58,824.00	0.00
459	300118	东方日升	6,100	58,438.00	0.00
460	002292	奥飞娱乐	6,000	58,320.00	0.00
461	601000	唐山港	14,200	57,652.00	0.00
462	603613	国联股份	2,400	56,856.00	0.00
463	603885	吉祥航空	4,200	56,574.00	0.00
464	600535	天士力	3,600	56,340.00	0.00
465	600323	瀚蓝环境	2,300	56,005.00	0.00
466	002572	索菲亚	3,900	54,639.00	0.00
467	002266	浙富控股	17,500	53,900.00	0.00
467	600499	科达制造	5,500	53,900.00	0.00
469	601880	辽港股份	35,900	53,850.00	0.00
470	688005	容百科技	2,397	53,501.04	0.00
471	300769	德方纳米	1,600	52,832.00	0.00
472	600859	王府井	3,800	52,782.00	0.00
473	603000	人民网	2,600	52,546.00	0.00
474	600511	国药股份	1,800	52,488.00	0.00
475	603899	晨光股份	1,800	52,182.00	0.00
476	600004	白云机场	5,700	51,870.00	0.00
477	603077	和邦生物	29,600	51,800.00	0.00
478	600655	豫园股份	9,300	51,615.00	0.00
479	601966	玲珑轮胎	3,500	51,345.00	0.00
480	600131	国网信通	2,900	51,330.00	0.00
481	600325	华发股份	10,500	51,135.00	0.00
482	603833	欧派家居	900	50,805.00	0.00
483	000035	中国天楹	11,700	50,193.00	0.00
484	600754	锦江酒店	2,200	49,368.00	0.00
485	002091	江苏国泰	6,500	47,255.00	0.00
486	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
487	600667	太极实业	7,100	46,718.00	0.00
488	601866	中远海发	18,800	46,436.00	0.00
489	600867	通化东宝	5,600	45,920.00	0.00
490	600258	首旅酒店	3,200	45,216.00	0.00
491	002372	伟星新材	4,300	44,548.00	0.00
492	600129	太极集团	1,900	40,489.00	0.00
493	601636	旗滨集团	7,700	38,577.00	0.00
494	001914	招商积余	3,000	37,110.00	0.00
495	688063	派能科技	823	37,100.84	0.00
496	600864	哈投股份	6,000	35,820.00	0.00
497	603650	彤程新材	1,100	35,365.00	0.00
498	688390	固德威	813	35,324.85	0.00
499	600315	上海家化	1,600	33,712.00	0.00
500	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00

501	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
502	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
503	600007	中国国贸	1,000	20,580.00	0.00
504	600335	国机汽车	2,900	18,705.00	0.00
505	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
506	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
507	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
508	301381	赛维时代	800	15,960.00	0.00
509	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	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

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	20,321,091.14	0.32

2	000333	美的集团	10,683,153.00	0.17
3	000858	五粮液	8,088,195.00	0.13
4	300059	东方财富	7,891,715.00	0.12
5	002594	比亚迪	6,624,404.00	0.10
6	000651	格力电器	5,582,046.00	0.09
7	002475	立讯精密	5,440,663.00	0.08
8	300760	迈瑞医疗	4,831,092.00	0.07
9	000725	京东方 A	4,332,111.00	0.07
10	300124	汇川技术	3,929,810.00	0.06
11	002714	牧原股份	3,175,998.00	0.05
12	000001	平安银行	3,031,293.00	0.05
13	002415	海康威视	3,024,731.00	0.05
14	000063	中兴通讯	2,992,356.00	0.05
15	300274	阳光电源	2,818,957.00	0.04
16	002352	顺丰控股	2,551,067.00	0.04
17	000568	泸州老窖	2,528,354.00	0.04
18	000100	TCL 科技	2,391,081.00	0.04
19	000338	潍柴动力	2,140,033.00	0.03
20	300308	中际旭创	2,137,530.00	0.03

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。

7.5.2 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	688775	影石创新	899,652.92	0.01
2	688981	中芯国际	328,377.68	0.01
3	688411	海博思创	307,696.85	0.00
4	688041	海光信息	260,889.75	0.00
5	301275	汉朔科技	258,997.00	0.00
6	688545	兴福电子	258,373.29	0.00
7	301458	钧崴电子	258,221.52	0.00
8	300750	宁德时代	248,410.00	0.00
9	601988	中国银行	208,260.00	0.00
10	603202	天有为	199,970.05	0.00
11	301535	浙江华远	198,302.18	0.00
12	301602	超研股份	177,666.60	0.00
13	301501	恒鑫生活	172,069.52	0.00
14	688758	赛分科技	164,139.69	0.00
15	301678	新恒汇	161,420.50	0.00
16	300124	汇川技术	159,603.00	0.00
17	301479	弘景光电	158,015.72	0.00
18	688583	思看科技	157,294.87	0.00

19	688012	中微公司	149,379.03	0.00
20	301658	首航新能	149,133.60	0.00

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。

7.5.3 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	247,946,483.93
卖出股票收入（成交）总额	11,498,035.19

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。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,100.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,100.20	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	123257	安克转债	31	3,100.20	0.00

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。本基金在出现大额净申赎等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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省上杭县住房和城乡建设局的处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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目标 ETF 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.13.2 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。

7.13.3 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	7,466,774.94
2	应收清算款	25,988,320.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,633,094.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,088,190.22

7.13.4 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。

7.13.5 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
易方达中证	83,691	31,549.63	447,177,043.78	16.94%	2,193,243,343.	83.06%

A500ETF 联接 A					76	
易方达中证 A500ETF 联接 C	60,580	41,820.70	33,086,840.84	1.31%	2,500,411,185.02	98.69%
易方达中证 A500ETF 联接 Y	9,082	7,391.08	0.00	0.00%	67,125,780.34	100.00%
合计	153,353	34,176.34	480,263,884.62	9.16%	4,760,780,309.12	90.84%

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	易方达中证 A500ETF 联接 A	3,299,691.42	0.1250%
	易方达中证 A500ETF 联接 C	148,900.18	0.0059%
	易方达中证 A500ETF 联接 Y	479,759.92	0.7147%
	合计	3,928,351.52	0.0750%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	易方达中证 A500ETF 联接 A	50~100
	易方达中证 A500ETF 联接 C	0
	易方达中证 A500ETF 联接 Y	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 A500ETF 联接 A	0
	易方达中证 A500ETF 联接 C	0
	易方达中证 A500ETF 联接 Y	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
----	--------------------	--------------------	--------------------

基金合同生效日 (2024 年 11 月 11 日) 基金份额总额	2,575,692,783.65	5,414,273,774.45	-
本报告期期初基金 份额总额	2,650,893,853.01	3,834,990,534.01	15,215,684.39
本报告期基金总申 购份额	1,434,866,030.98	1,321,411,559.69	58,127,234.94
减: 本报告期基金总 赎回份额	1,445,339,496.45	2,622,904,067.84	6,217,138.99
本报告期基金拆分 变动份额	-	-	-
本报告期期末基金 份额总额	2,640,420,387.54	2,533,498,025.86	67,125,780.34

§ 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	
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	191,098.00	0.07%	19.10	0.07%	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	5,732,252.83	2.23%	573.37	2.23%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
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	243,959,744.05	94.73%	24,397.45	94.73%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	6,670,242.81	2.59%	667.02	2.59%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	970,713.99	0.38%	97.07	0.38%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为长城证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券

有限责任公司、申万宏源证券有限公司、湘财证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	699,950,983.20	33.12%
国信	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	30,378.60	100.00 %	-	-	-	-	1,413,197,506.11	66.88%	
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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董事长变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
2	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更	中国证券报、基金管理人	2025-03-22

	公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
6	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
7	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-11
8	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	中国证券报	2025-04-22
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
10	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 A500 指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
3. 《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
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和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日