易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 37
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权益投资明细 37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 37
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 37

7.11 投资组合报告附注 38
§8 基金份额持有人信息 38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 38
8.2 期末上市基金前十名持有人 39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 39
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 39
§9 开放式基金份额变动 39
§10 重大事件揭示 40
10.1 基金份额持有人大会决议 40
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 40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 40
10.4 基金投资策略的改变 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 40
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 40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 40
10.8 其他重大事件 43
§11 影响投资者决策的其他重要信息 46
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 46
§12 备查文件目录 46
12.1 备查文件目录 46
12.2 存放地点 46
12.3 查阅方式 47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	易方达日兴资管日经 225ETF（QDII）
场内简称	225ETF、日经 225ETF 易方达
基金主代码	513000
交易代码	513000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 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	799,411,379.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 6 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，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 3%以内，主要投资策略包括标的 ETF 投资策略、股票投资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	日经 225 指数收益率(使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，因此，本基金的业绩表现与日经 225 指数的表现密切相关，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。此外，本基金主要投资于日本等境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及日本等境外市场的风险。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	The Northern Trust Company
	中文	无	美国北美信托银行
注册地址		无	美国伊利诺伊州芝加哥南拉萨尔街 50 号
办公地址		无	美国伊利诺伊州芝加哥南拉萨尔街 50 号
邮政编码		无	60603

2.5 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

2.6 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	14,396,888.59
本期利润	132,038,007.06
加权平均基金份额本期利润	0.1636
本期加权平均净值利润率	11.59%
本期基金份额净值增长率	9.15%
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	281,424,143.14
期末可供分配基金份额利润	0.3520
期末基金资产净值	1,244,083,132.68
期末基金份额净值	1.5562
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	55.62%

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	5.86%	0.75%	6.07%	0.73%	-0.21%	0.02%
过去三个月	16.39%	1.77%	16.59%	1.79%	-0.20%	-0.02%
过去六个月	9.15%	1.46%	8.86%	1.48%	0.29%	-0.02%
过去一年	13.48%	1.54%	13.39%	1.68%	0.09%	-0.14%
过去三年	58.28%	1.28%	54.83%	1.35%	3.45%	-0.07%
自基金合同生效起至今	55.62%	1.28%	48.54%	1.32%	7.08%	-0.04%

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

易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 6 月 12 日至 2025 年 6 月 30 日)

注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 55.62%，同期业绩比较基准收益率为 48.54%。

§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 500ETF、	2019-06-12	-	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

	易方达中证海外中国互联网 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				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。
刘依姗	本基金的基金经理，易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2024-11-27	-	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任领航投资香港有限公司项目经理高级助理，易方达资产管理（香港）有限公司研究员、基金经理助理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，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相应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，通过投资交易系统中的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪日经 225 指数，该指数由日本经济新闻社编制，是反映日本股市表现的代表性指数之一。日经 225 指数选取东京交易所主板成交量最活跃、流通市值最高的 225 只股票，根据调整后价格赋予指数权重，并每年度定期调整。报告期内本基金主要通过投资日兴资管日经 225ETF（Listed Index Fund 225）来实现对基准指数的跟踪，力求基金净值增长率与业绩比较基准增长率相当。

回顾 2025 年上半年，全球金融条件方面，美联储在上半年的四次议息会议上均选择暂停调整利率，将联邦基金利率目标区间维持在 4.25%至 4.50%之间。日本央行则在 1 月加息 25 个基点，正式开启货币政策正常化进程，并在后续会议中将进一步的行动与通胀及经济数据挂钩，同时放缓了缩减购债的步伐。日本经济方面，上半年延续了温和复苏的态势。关键的“春斗”谈判实现了 5.46%的薪资增幅，连续两年突破 5%的历史性水平，这为“工资-消费”的良性循环注入了强大动力，有效支撑了消费市场的稳健增长。市场表现方面，一季度因加息及外部关税政策影响而震荡回调，但进入

二季度，在经济温和复苏及地缘政治局势缓和的推动下重拾升势。本报告期内，日经 225 指数先跌后升，震荡走高。

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，坚持既定的投资策略，紧密跟踪业绩比较基准，力求跟踪误差最小化。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5562 元，本报告期份额净值增长率为 9.15%，同期业绩比较基准收益率为 8.86%。年化跟踪误差 2.00%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，尽管面临外部不确定性，但工资与通胀的良性循环预计将保持稳固，为日本内需提供关键支撑。政策上，日本央行将稳步推进货币正常化，其加息及缩减资产负债表的计划将是市场焦点。此外，东京证券交易所推动的企业治理改革仍在深化，促使企业更加注重股东回报，如增加派息和股票回购，这将持续吸引长期价值投资者。在全球投资者寻求分散美元资产敞口、寻找新的增长点的背景下，估值相对合理、企业盈利稳健且拥有结构性改革故事的日本市场，有望继续吸引国际资本的持续流入。

日经 225 指数是日本股市最具代表性的基准指数之一，其成份股涵盖东京证券交易所最具流动性与行业代表性的 225 家蓝筹企业，是观察日本整体经济和核心产业景气度的重要窗口。在中长期维度上，日经 225 指数的走势与日本经济摆脱通缩、走向复苏的进程紧密相连，尤其在近年企业治理改革和全球供应链重构的背景下，其表现已显著超越日本名义 GDP 增速，并重新吸引了全球投资者的目光。在全球资产配置日益多元化的今天，日经 225 指数产品为投资者提供了直接分享日本经济复苏红利以及其在全球产业链中优势地位的便捷渠道。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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：易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	11,478,030.83	31,666,840.25
结算备付金		8,411,471.37	5,386,996.06
存出保证金		1,452,418.16	2,402,913.07
交易性金融资产	6.4.7.2	1,250,631,716.26	579,470,282.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		1,250,631,716.26	579,470,282.58
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		-	769.50
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		1,271,973,636.62	618,927,801.46
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		6,424.95	2,378,604.91
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		203,518.47	102,768.24
应付托管费		50,879.60	25,692.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		316,921.48	292,074.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	27,312,759.44	315,367.42
负债合计		27,890,503.94	3,114,506.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	799,411,379.00	431,911,379.00
未分配利润	6.4.7.8	444,671,753.68	183,901,915.47
净资产合计		1,244,083,132.68	615,813,294.47
负债和净资产总计		1,271,973,636.62	618,927,801.46

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5562 元，基金份额总额 799,411,379.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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		133,608,796.17	26,826,193.63
1.利息收入		36,936.18	95,809.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,936.18	95,809.69
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）		21,381,776.25	6,469,132.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	21,664,550.17	879,572.43
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
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	-282,773.92	5,589,560.43
股利收益	6.4.7.15	-	-
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	117,641,118.47	20,248,247.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-9,313,760.51	-3,453,800.79
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,862,725.78	3,466,804.76
减：二、营业总支出		1,570,789.11	965,488.42
1．管理人报酬		1,119,737.51	680,242.58
2．托管费		279,934.39	170,060.65
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	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		77,889.08	26,023.91
8．其他费用	6.4.7.19	93,228.13	89,161.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**132,038,007.06**	**25,860,705.21**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**132,038,007.06**	**25,860,705.21**

五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**132,038,007.06**	**25,860,705.21**

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	431,911,379.00	183,901,915.47	615,813,294.47
二、本期期初净资产	431,911,379.00	183,901,915.47	615,813,294.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	367,500,000.00	260,769,838.21	628,269,838.21
（一）、综合收益总额	-	132,038,007.06	132,038,007.06
（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）	367,500,000.00	128,731,831.15	496,231,831.15
其中：1.基金申购款	637,000,000.00	250,255,898.04	887,255,898.04
2.基金赎回款	-269,500,000.00	-121,524,066.89	-391,024,066.89
（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	799,411,379.00	444,671,753.68	1,244,083,132.68
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	300,411,379.00	87,150,425.66	387,561,804.66
二、本期期初净资产	300,411,379.00	87,150,425.66	387,561,804.66

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	293,000,000.00	133,237,836.88	426,237,836.88
（一）、综合收益总额	-	25,860,705.21	25,860,705.21
（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）	293,000,000.00	107,377,131.67	400,377,131.67
其中：1.基金申购款	331,500,000.00	121,277,357.78	452,777,357.78
2.基金赎回款	-38,500,000.00	-13,900,226.11	-52,400,226.11
（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	593,411,379.00	220,388,262.54	813,799,641.54

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

易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]922 号《关于准予易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》于 2019 年 6 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 508,411,379.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,879.00 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，境外资产托管人为美国北美信托银行。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外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)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	11,478,030.83
等于：本金	11,476,446.08
加：应计利息	1,584.75
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	11,478,030.83

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		-	-	-	-
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		1,088,435,208.02	-	1,250,631,716.26	162,196,508.24
其他		-	-	-	-
合计		1,088,435,208.02	-	1,250,631,716.26	162,196,508.24

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

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	18,957,879.50	-	-	-
NKU5	18,957,879.50	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,957,879.50	-	-	-

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

NKU5	NIKKEI 225 (OSE) Sep25	10	20,090,529.40	1,132,649.90
合计	-	-	-	1,132,649.90
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,132,649.90
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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,483.46
应付替代款	27,227,931.74
其他应付款	4,344.24
合计	27,312,759.44

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	431,911,379.00	431,911,379.00
本期申购	637,000,000.00	637,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-269,500,000.00	-269,500,000.00
本期末	799,411,379.00	799,411,379.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	145,726,862.23	38,175,053.24	183,901,915.47
本期期初	145,726,862.23	38,175,053.24	183,901,915.47
本期利润	14,396,888.59	117,641,118.47	132,038,007.06
本期基金份额交易产生的变动数	121,300,392.32	7,431,438.83	128,731,831.15
其中：基金申购款	212,609,301.59	37,646,596.45	250,255,898.04
基金赎回款	-91,308,909.27	-30,215,157.62	-121,524,066.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	281,424,143.14	163,247,610.54	444,671,753.68

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	36,936.18
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	-
其他	-
合计	36,936.18

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

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	366,953,055.02
减：卖出/赎回基金成本总额	344,377,853.13
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	657,530.15
减：交易费用	253,121.57
基金投资收益	21,664,550.17

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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
期货投资收益	-282,773.92

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

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	116,880,608.87
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	116,880,608.87
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	760,509.60
——权证投资	-
——期货投资	760,509.60
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	117,641,118.47

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	-
替代损益收入	3,862,725.78
合计	3,862,725.78

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。

6.4.7.18 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	20,976.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	6,978.30
银行汇划费	5,766.37
合计	93,228.13

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
美国北美信托银行	境外托管人
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,119,737.51	680,242.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	40,283.99	18,710.50
应支付基金管理人的净管理费	1,079,453.52	661,532.08

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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首日起5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、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，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	279,934.39	170,060.65

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×0.05%÷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首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	15,006,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	15,006,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.5288%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

		例		
广发证券股份有限公司	151,283.00	0.0189%	148,300.00	0.0343%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北美信托-活期存款	2,234,124.60	-6,835.17	11,500,465.57	-1,146.32
中国工商银行-活期存款	9,243,906.23	43,771.35	96,264,554.10	96,956.01

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和美国北美信托银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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。

本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，因此，本基金的业绩表现与日经 225 指数的表现密切相关，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。此外，本基金主要投资于日本等境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及日本等境外市场的风险。

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。本基金在境内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；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。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。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

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	11,478,030.83	-	-	-	11,478,030.83
结算备付金	8,411,471.37	-	-	-	8,411,471.37
存出保证金	1,452,418.16	-	-	-	1,452,418.16
交易性金融资产	-	-	-	1,250,631,716.26	1,250,631,716.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	21,341,920.36	-	-	1,250,631,716.26	1,271,973,636.62
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	-	-	-	6,424.95	6,424.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	203,518.47	203,518.47
应付托管费	-	-	-	50,879.60	50,879.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	316,921.48	316,921.48
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	27,312,759.44	27,312,759.44
负债总计	-	-	-	27,890,503.94	27,890,503.94
利率敏感度缺口	21,341,920.36	-	-	1,222,741,212.32	1,244,083,132.68
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	31,666,840.25	-	-	-	31,666,840.25
结算备付金	5,386,996.06	-	-	-	5,386,996.06
存出保证金	2,402,913.07	-	-	-	2,402,913.07
交易性金融资产	-	-	-	579,470,282.58	579,470,282.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	769.50	769.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,456,749.38	-	-	579,471,052.08	618,927,801.46
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	-	-	-	2,378,604.91	2,378,604.91
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	102,768.24	102,768.24
应付托管费	-	-	-	25,692.02	25,692.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	292,074.40	292,074.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	315,367.42	315,367.42
负债总计	-	-	-	3,114,506.99	3,114,506.99
利率敏感度缺口	39,456,749.38	-	-	576,356,545.09	615,813,294.47

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

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
货币资金	-	-	2,268,050.96	2,268,050.96
结算备付金	-	-	8,411,471.37	8,411,471.37
存出保证金	-	-	1,452,418.16	1,452,418.16
交易性金融资产	-	-	1,250,631,716.26	1,250,631,716.26
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	**-**	**-**	**1,262,763,656.75**	**1,262,763,656.75**
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	**-**	**-**	**-**	**-**
资产负债表外汇风险敞口净额	**-**	**-**	**1,262,763,656.75**	**1,262,763,656.75**

项目	**上年度末** **2024年12月31日**			
	美元 **折合人民币**	**港币** **折合人民币**	**其他币种** **折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	23,838,404.16	23,838,404.16
结算备付金	-	-	5,386,996.06	5,386,996.06
存出保证金	-	-	2,402,913.07	2,402,913.07
交易性金融资产	-	-	579,465,969.49	579,465,969.49
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	**-**	**-**	**611,094,282.78**	**611,094,282.78**
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	2,378,604.91	2,378,604.91
应付赎回款	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-
负债合计	**-**	**-**	**2,378,604.91**	**2,378,604.91**
资产负债表外汇风险敞口净额	**-**	**-**	**608,715,677.87**	**608,715,677.87**

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-63,138,182.84	-30,435,783.89
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	63,138,182.84	30,435,783.89

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。本基金主要投资于单一标的 ETF，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股中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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	1,250,631,716.26	100.53	579,470,282.58	94.10
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	1,250,631,716.26	100.53	579,470,282.58	94.10

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%	62,531,585.81	28,973,298.47
	2.业绩比较基准下降 5%	-62,531,585.81	-28,973,298.47

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	1,250,631,716.26
第二层次	-
第三层次	-
合计	1,250,631,716.26

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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	1,250,631,716.26	98.32
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,889,502.20	1.56
8	其他各项资产	1,452,418.16	0.11
9	合计	1,271,973,636.62	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

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权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5 报告期内权益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 名的权益投资明细

本基金本报告期内未进行权益投资交易。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期内未进行权益投资交易。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期内未进行权益投资交易。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NIKKEI 225 (OSE) Sep25	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”适用于金融资产与金融负债相抵销的情形，故将“其他衍生工具期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为 1,132,649.90 元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	Listed Index Fund 225	ETF	开放式	Nikko Asset Management Co Ltd	1,250,631,716.26	100.53

7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

7.11.3 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	1,452,418.16
2	应收清算款	-
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	1,452,418.16

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

11,488	69,586.65	439,072,014.00	54.92%	360,339,365.00	45.08%

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	UBS AG	73,072,137.00	9.14%
2	BARCLAYS BANK PLC	67,918,799.00	8.50%
3	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	64,400,600.00	8.06%
4	香港上海汇丰银行有限公司	39,800,000.00	4.98%
5	蔡雪芳	26,466,300.00	3.31%
6	邱丕云	21,921,900.00	2.74%
7	上海洛书投资管理有限公司－洛书裕景天康私募证券投资基金	10,070,000.00	1.26%
8	高盛国际－自有资金	9,000,000.00	1.13%
9	百瑞信托有限责任公司－百瑞信托广发骐骥聚盈 ETF 轮动策略 FOF1 号集合资金信托计划	8,743,500.00	1.09%
10	中欧基金－民生银行－中欧基金磐玉 1 号集合资产管理计划	7,994,200.00	1.00%

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（2019 年 6 月 12 日）基金份额总额	508,411,379.00
本报告期期初基金份额总额	431,911,379.00

本报告期基金总申购份额	637,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	269,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	799,411,379.00

§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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Citigroup Global Markets Limited	1	-	-	125,358.36	49.52%	-
CLSA Limited	1	-	-	34,576.45	13.66%	-
Goldman Sachs	1	-	-	93,186.75	36.82%	-
BNP PARIBAS SECURITIES (ASIA) LIMITED	1	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金新增交易账户的证券经营机构为UBS Securities Asia Limited，无减少交易账户。

b）本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。本报告期内交易账户的开立标准如下：

1）交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2）研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3）提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4）法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5）价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训

服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6）其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c）本报告期内交易账户的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2）基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	626,796,410.96	49.53%
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	172,882,147.64	13.66%
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	465,933,174.35	36.81%
BNP PARIBAS SECURITIES (ASIA) LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong Inter	-	-	-	-	-	-	-	-

national Securities Company Limited								
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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 增加东北证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-06
2	关于易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 1 月 13 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的提示性公告	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	2025-01-08
3	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-10
4	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-15

5	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-16
6	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-17
7	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-20
8	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	中国证券报	2025-01-21
9	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
10	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
11	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-22
12	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-23
13	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示及停牌公告	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	2025-01-23
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-24
15	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）午间收盘溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-24
16	易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）溢价风险提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-24
17	关于易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 2 月 11 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的提示性公告	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	2025-02-06
18	关于易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 2 月 24 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的提示性公告	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	2025-02-19
19	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加	中国证券报、基金管理人	2025-02-27

	瑞银证券为一级交易商的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
20	关于易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 3 月 20 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的提示性公告	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	2025-03-17
21	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	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	2025-03-20
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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	中国证券报	2025-03-31
29	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
30	关于易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 4 月 29 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的提示性公告	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	2025-04-24
31	关于易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年 5 月 6 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的提示性公告	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	2025-04-28
32	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国海证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
33	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	2025-05-17

		电子披露网站	
34	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	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	2025-06-20

§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
机构	1	2025 年 04 月 08 日,2025 年 04 月 16 日	5,177,765.00	794,665,534.00	731,924,500.00	67,918,799.00	8.50%
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；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，基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并等情形，基金管理人经与基金托管人协商一致后有权直接终止本基金合同，基金将面临基金财产清算并终止的风险；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日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集的文件；

2.《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

3.《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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