

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55

7.12 投资组合报告附注.....	55
§ 8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
§ 9 开放式基金份额变动.....	58
§ 10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
§ 12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300ETF
场内简称	HS300ETF、沪深 300ETF 易方达
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	68,424,767,476.00 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	2013 年 3 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取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。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228

传真	020-38798812	021-60635778
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码	510620; 519031	100033
法定代表人	吴欣荣	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼；广东省珠海市 横琴新区荣粤道 188 号 6 层

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	7,158,374,121.44
本期利润	5,756,145,170.08
加权平均基金份额本期利润	0.0870
本期加权平均净值利润率	2.29%
本期基金份额净值增长率	1.31%
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	129,604,906,811.33
期末可供分配基金份额利润	1.8941
期末基金资产净值	266,515,701,949.73
期末基金份额净值	3.8950

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	99.75%

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	3.30%	0.58%	2.50%	0.58%	0.80%	0.00%
过去三个月	2.34%	1.10%	1.25%	1.10%	1.09%	0.00%
过去六个月	1.31%	1.02%	0.03%	1.02%	1.28%	0.00%
过去一年	17.14%	1.38%	13.71%	1.38%	3.43%	0.00%
过去三年	-5.23%	1.10%	-12.24%	1.10%	7.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	99.75%	1.35%	50.07%	1.36%	49.68%	-0.01%

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2013 年 3 月 6 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 99.75%，同期业绩比较基准收益率为 50.07%。

§ 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、易方达中证 500ETF、易方达中证海外	2016-04-16	-	20 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资

	中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企 ETF 联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达中证 500ETF 联接、易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证军工 ETF 的基金经理, 指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				发展部产品经理, 易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理, 易方达沪深 300ETF 联接、易方达中证 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 联接、易方达中证 A500ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接的基金经理, 指数研究部总经理、指数投资决策委员会委员	2022-12-15	-	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。
鲍杰	本基金的基金经理助理, 易方达中证沪港深 300ETF、易方达中证电信主题 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达中证电信主题 ETF 联接发起式、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式 (自 2023 年 10 月 17 日至 2025 年 06 月 25 日)、易方达深证 50ETF、易方达中证红利低波动 ETF、易方达中证沪港深 300ETF 联接发起式、易方达深证 50ETF 联接发起式、易方达中证汽车零部件主题 ETF、易方达中证红利低波动 ETF 联接发起式、易方达恒生港股通高股息低波动 ETF、易方达中证汽车零部件主	2024-10-19	-	8 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任中国农业银行总行私人银行部产品经理, 易方达基金管理有限公司研究员, 易方达中证全指证券公司 ETF 的基金经理。

<p>题 ETF 联接发起式、易方达中证港股通高股息投资指数发起式、易方达中证红利价值 ETF 的基金经理，易方达中证长江保护主题 ETF、易方达恒生国企 ETF 联接（QDII）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达中证国企一带一路 ETF（自 2022 年 09 月 10 日至 2025 年 04 月 28 日）、易方达恒生港股通高股息低波动 ETF 联接发起式的基金经理助理</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

本基金跟踪沪深 300 指数，该指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具有代表性的 300 只证券组成，以综合反映沪深市场上市公司证券的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

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

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

沪深 300 指数作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，聚集 A 股最核心的权益资产，涵盖了各行业龙头，指数表现跟中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关，与

A 股大盘走势基本保持一致。报告期内指数中的银行、有色金属、通信、医药生物等行业的成份股涨幅居前，对沪深 300 指数收益贡献较大，而食品饮料、电力设备、煤炭、石油化工等行业的成份股表现落后，拖累了指数的表现。报告期内沪深 300 指数上涨 0.03%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 3.8950 元，本报告期份额净值增长率为 1.31%，同期业绩比较基准收益率为 0.03%。年化跟踪误差 0.37%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济稳中有进的发展态势和成效，为完成全年目标打下了较好基础。上半年中国经济顶住压力、稳定增长，保持稳中有进、稳中向好的发展态势，充分展示了中国经济的抗压能力和强大韧性。展望下一阶段，这种发展态势会得以保持，中国经济仍将迎来较好的发展机遇，2025 年中国经济增速将继续在全球主要经济体中保持领先，并有望走出价格收缩区间。同时我们也看到中国新质生产力在加快发展，不断创造更多新经济增长点。经济转型升级和产业结构优化也在持续推进。尽管外部环境的挑战仍存，但国内一系列逆周期调节政策能有效对冲外部的不确定性，宏观政策协同发力，将为经济稳定运行保驾护航。今年以来，我国实行了更加积极有为的宏观政策，发挥了托底作用。中国的政策“工具箱”丰富，预计下半年宏观政策也会加快推出，会继续为经济稳定运行发挥关键支撑作用。基于以上的这些支撑因素，我们判断中国经济下半年会继续保持稳中有进、稳中向好的发展态势。A 股在多重政策红利与产业升级动能的共振下有望企稳向上。在宏观经济政策支持、流动性充裕和利率低位的背景下，A 股市场或将呈现结构性上涨特征。

指数的长期收益表现取决于其成份股盈利的长期增长情况，沪深 300 指数作为 A 股市场的核心宽基指数，涵盖了中国经济中主要行业的龙头企业，这些企业的盈利会随着整体经济的增长而相应增长。长期来看沪深 300 指数表现与 GDP 增速基本一致，是分享中国经济增长的有效工具。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的各行业龙头优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，沪深 300 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 1,329,817,365.91 元。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,317,772,405.36	1,536,113,492.83
结算备付金		220,277,463.89	333,015,992.49
存出保证金		188,188,118.16	251,423,227.86
交易性金融资产	6.4.7.2	264,982,433,793.58	245,625,261,923.78
其中：股票投资		264,982,433,793.58	245,625,261,923.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		274,062,178.12	270,096,513.73
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		266,982,733,959.11	248,015,911,150.69
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		374,411,679.79	234,057,796.33

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,500,188.57	31,734,511.67
应付托管费		10,833,396.17	10,578,170.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,275,675.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	49,286,744.85	58,137,348.62
负债合计		467,032,009.38	335,783,503.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	136,910,795,138.40	128,244,158,830.89
未分配利润	6.4.7.8	129,604,906,811.33	119,435,968,816.75
净资产合计		266,515,701,949.73	247,680,127,647.64
负债和净资产总计		266,982,733,959.11	248,015,911,150.69

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.8950 元，基金份额总额 68,424,767,476.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,021,361,947.70	4,929,915,726.24
1.利息收入		3,612,198.71	15,364,098.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,612,198.71	1,661,453.69
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		-	13,702,644.56
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,416,091,930.19	1,080,536,468.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,921,954,124.89	-502,064,573.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,670,303.72	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	28,318,554.27	5,610,478.24
股利收益	6.4.7.14	3,450,148,947.31	1,576,990,563.69
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,402,228,951.36	3,824,479,201.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,886,770.16	9,535,957.22
减：二、营业总支出		265,216,777.62	135,745,616.94
1. 管理人报酬		186,777,698.08	88,410,457.06
2. 托管费		62,259,232.67	29,470,152.42
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		222,025.79	69,620.62
8. 其他费用	6.4.7.18	15,957,821.08	17,795,386.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,756,145,170.08	4,794,170,109.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,756,145,170.08	4,794,170,109.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,756,145,170.08	4,794,170,109.30

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	128,244,158,830.89	119,435,968,816.75	247,680,127,647.64
二、本期期初净资产	128,244,158,830.89	119,435,968,816.75	247,680,127,647.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,666,636,307.51	10,168,937,994.58	18,835,574,302.09
（一）、综合收益总额	-	5,756,145,170.08	5,756,145,170.08
（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）	8,666,636,307.51	5,742,610,190.41	14,409,246,497.92

其中：1.基金申购款	27,701,795,011.64	23,065,823,602.37	50,767,618,614.01
2.基金赎回款	-19,035,158,704.13	-17,323,213,411.96	-36,358,372,116.09
(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)	-	-1,329,817,365.91	-1,329,817,365.91
四、本期期末净资产	136,910,795,138.40	129,604,906,811.33	266,515,701,949.73
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	29,141,215,244.00	19,647,027,810.98	48,788,243,054.98
二、本期期初净资产	29,141,215,244.00	19,647,027,810.98	48,788,243,054.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	53,284,000,000.00	38,484,232,338.81	91,768,232,338.81
(一)、综合收益总额	-	4,794,170,109.30	4,794,170,109.30
(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)	53,284,000,000.00	33,690,062,229.51	86,974,062,229.51
其中：1.基金申购款	59,164,000,000.00	37,880,697,688.20	97,044,697,688.20
2.基金赎回款	-5,880,000,000.00	-4,190,635,458.69	-10,070,635,458.69
(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	82,425,215,244.00	58,131,260,149.79	140,556,475,393.79

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1762 号《关于核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的批复》核准,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《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 43,605.00 份基金份额。本基金为交易型开放式(ETF)、发起式基金,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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金已于 2024 年 9 月 20 日进行了基金份额合并,合并比例为 0.49977589。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号

《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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	1,317,772,405.36
等于：本金	1,317,666,454.08
加：应计利息	105,951.28
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	1,317,772,405.36

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	238,360,933,431.82	-	264,982,433,793.58	26,621,500,361.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	238,360,933,431.82	-	264,982,433,793.58	26,621,500,361.76

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	1,431,972,568.57	-	-	-
IF2509	429,892,288.57	-	-	-
IF2512	1,002,080,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,431,972,568.57	-	-	-

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
IF2509	IF2509	378	440,785,800.00	10,893,511.43
IF2512	IF2512	888	1,027,398,240.00	25,317,960.00
合计	-	-	-	36,211,471.43
减:可抵销期货暂收款	-	-	-	36,211,471.43
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	3,463,502.85
其中: 交易所市场	3,463,502.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	103,890.38
应付替代款	45,716,103.62
可退替代款	3,248.00
合计	49,286,744.85

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	64,093,388,464.00	128,244,158,830.89
本期申购	13,844,700,000.00	27,701,795,011.64
本期赎回（以“-”号填列）	-9,513,320,988.00	-19,035,158,704.13
本期末	68,424,767,476.00	136,910,795,138.40

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	182,985,624,540.00	-63,549,655,723.25	119,435,968,816.75
本期期初	182,985,624,540.00	-63,549,655,723.25	119,435,968,816.75
本期利润	7,158,374,121.44	-1,402,228,951.36	5,756,145,170.08
本期基金份额交易产生的变动数	12,594,376,087.96	-6,851,765,897.55	5,742,610,190.41
其中：基金申购款	40,118,815,157.61	-17,052,991,555.24	23,065,823,602.37
基金赎回款	-27,524,439,069.65	10,201,225,657.69	-17,323,213,411.96
本期已分配利润	-1,329,817,365.91	-	-1,329,817,365.91
本期末	201,408,557,383.49	-71,803,650,572.16	129,604,906,811.33

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	1,887,672.62
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	1,699,895.42	
其他	24,630.67	
合计	3,612,198.71	

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	1,905,793,873.33
股票投资收益——赎回差价收入	2,016,160,251.56	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	3,921,954,124.89	

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	23,362,331,604.28
减：卖出股票成本总额	21,437,259,354.46
减：交易费用	19,278,376.49
买卖股票差价收入	1,905,793,873.33

注：交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 401,913.49 元。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	35,598,776,526.51
减：现金支付赎回款总额	12,971,281,731.51
减：赎回股票成本总额	20,611,334,543.44
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,016,160,251.56

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	26,796.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,643,507.60
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	15,670,303.72

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	480,103,752.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	464,161,577.95
减：应计利息总额	279,933.73

减：交易费用	18,733.05
买卖债券差价收入	15,643,507.60

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	28,318,554.27

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,450,148,947.31
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,450,148,947.31

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	-1,357,174,322.79
——股票投资	-1,357,174,322.79
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-45,054,628.57
——权证投资	-
——期货投资	-45,054,628.57
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	-1,402,228,951.36

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	1,139,393.39
替代损益收入	2,747,376.77
合计	3,886,770.16

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	44,383.01
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	15,821,858.53
银行汇划费	24,572.17
银行间账户维护费	7,500.00
合计	15,957,821.08

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

根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2025 年 7 月 31 日（场内）、2025 年 8 月 1 日（场外）登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.410 元。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金 联接基金	该基金是本基金的联接基金
-------------------------------------	--------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	18,039,487,637.92	35.54%	47,742,382,551.43	86.60%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,804,068.71	36.05%	1,238,996.95	35.77%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	4,774,532.34	86.60%	1,264,547.41	93.25%

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

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	186,777,698.08	88,410,457.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,518,009.86	3,958,239.11
应支付基金管理人的净管理费	166,259,688.22	84,452,217.95

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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	62,259,232.67	29,470,152.42

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五

个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费 率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收利 息余额
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费 率 (%)	利息收入	期末证券出 借业务余额	期末应收利 息余额
广发证券	1,278,457,94 5.60	1.65~6.00	3.13	1,305,862.71	62,446,466.6 0	23,095.53

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年6月30 日	2024年1月1日至2024年6月30 日
报告期初持有的基金份额	57,440,243.00	114,932,000.00
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	57,440,243.00	114,932,000.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0839%	0.1394%
---------------------	---------	---------

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例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	4,592,607,619.00	6.7119%	4,938,763,028.00	7.7056%
广发证券股份有限公司	8,360,164.00	0.0122%	6,588,067.00	0.0103%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	1,317,772,405.36	1,887,672.62	791,548,384.58	625,714.73

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设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	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

份有限公司					
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
万联证券股份有限公司	837023	芭薇股份	新股发行	200	1,154.00

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，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，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券和托管人建设银行发行的 A 股建设银行。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 37,492,872 股（2024 年 12 月 31 日:35,250,572 股），占本基金净值比例为 0.24%(2024 年 12 月 31 日:0.23%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 107,680,664 股（2024 年 12 月 31 日:79,972,159 股），占本基金净值比例为 0.38%(2024 年 12 月 31 日:0.28%)。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润分 配合计	备注
		场 内	场 外					
1	2025-04-29	2025- 04-30	2025- 04-30	0.190	1,329,817,36 5.91	-	1,329,817,36 5.91	-
合计				0.190	1,329,817,36 5.91	-	1,329,817,36 5.91	-

注：（1）本基金同时具备场内权益登记日和场外权益登记日，且两权益登记日不为同一天，上表中权益登记日为场内权益登记日，场外权益登记日为 2025 年 4 月 30 日。

（2）本基金同时具备场内除息日和场外除息日，两除息日为同一天。

(3) 根据相关法规以及本基金收益分配政策, 本基金向截至 2025 年 7 月 31 日(场内)、2025 年 8 月 1 日(场外) 登记在册的全体持有人进行利润分配, 每 10 份基金份额派发红利 0.410 元。

6.4.12 期末(2025 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月以内	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
30153	浙江	2025-0	6 个月	新股	4.92	18.99	734	3,611.	13,938	-

5	华远	3-18		流通受限				28	.66	
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-

603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
001965	招商公路	2025-03-07	6 个月	大宗交易流通受限	12.14	11.82	2,400,000	29,136,000.00	28,368,000.00	-
603019	中科曙光	2025-04-21	6 个月	大宗交易流通受限	58.55	67.44	2,100,000	122,955,000.00	141,624,000.00	-

603019	中科曙光	2025-04-24	6 个月	大宗交易流通受限	57.05	67.40	1,500,000	85,575,000.00	101,100,000.00	-
603019	中科曙光	2025-04-25	6 个月	大宗交易流通受限	55.85	67.38	1,600,000	89,360,000.00	107,808,000.00	-
603260	合盛硅业	2025-03-18	6 个月	大宗交易流通受限	50.15	46.25	500,000	25,075,000.00	23,125,000.00	-
603260	合盛硅业	2025-03-19	6 个月	大宗交易流通受限	49.86	46.25	497,000	24,780,420.00	22,986,250.00	-
600760	中航沈飞	2025-06-27	6 个月	非公开发行流通受限	50.00	55.18	4,274,000	213,700,000.00	235,839,320.00	-
688271	联影医疗	2025-03-24	6 个月	询价转让流通受限	108.66	124.63	351,108	38,151,395.28	43,758,590.04	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2025 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,317,772,405.36	-	-	-	1,317,772,405.36
结算备付金	220,277,463.89	-	-	-	220,277,463.89
存出保证金	188,188,118.16	-	-	-	188,188,118.16
交易性金融资产	-	-	-	264,982,433,793.58	264,982,433,793.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	274,062,178.12	274,062,178.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,726,237,987.41	-	-	265,256,495,971.70	266,982,733,959.11
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	-	-	-	374,411,679.79	374,411,679.79

					9
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,500,188.57	32,500,188.57
应付托管费	-	-	-	10,833,396.17	10,833,396.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	49,286,744.85	49,286,744.85
负债总计	-	-	-	467,032,009.38	467,032,009.38
利率敏感度缺口	1,726,237,987.41	-	-	264,789,463,962.32	266,515,701,949.73
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	1,536,113,492.83	-	-	-	1,536,113,492.83
结算备付金	333,015,992.49	-	-	-	333,015,992.49
存出保证金	251,423,227.86	-	-	-	251,423,227.86
交易性金融资产	-	-	-	245,625,261,923.78	245,625,261,923.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	270,096,513.73	270,096,513.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,120,552,713.18	-	-	245,895,358,437.51	248,015,911,150.69
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	-	-	-	234,057,796.33	234,057,796.33
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	31,734,511.67	31,734,511.67
应付托管费	-	-	-	10,578,170.56	10,578,170.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,275,675.87	1,275,675.87
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	58,137,348.62	58,137,348.62
负债总计	-	-	-	335,783,503.05	335,783,503.05
利率敏感度缺口	2,120,552,713.18	-	-	245,559,574,934.46	247,680,127,647.64

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	264,982,433,793.5 8	99.42	245,625,261,923.7 8	99.17
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	264,982,433,793.5 8	99.42	245,625,261,923.7 8	99.17

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%	13,242,349,689.25	12,282,037,491.33
2.业绩比较基准下降 5%	-13,242,349,689.25	-12,282,037,491.33	

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	264,277,359,666.60
第二层次	15,385.54
第三层次	705,058,741.44
合计	264,982,433,793.58

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	264,982,433,793.58	99.25
	其中：股票	264,982,433,793.58	99.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,538,049,869.25	0.58
8	其他各项资产	462,250,296.28	0.17
9	合计	266,982,733,959.11	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,611,667,100.84	0.98
B	采矿业	13,243,804,024.24	4.97
C	制造业	132,682,961,941.60	49.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,587,209,221.06	3.60
E	建筑业	4,970,948,066.63	1.87
F	批发和零售业	639,425,818.44	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	9,323,301,106.87	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,548,272,964.51	4.71
J	金融业	71,433,453,185.09	26.80
K	房地产业	1,954,694,984.85	0.73
L	租赁和商务服务业	2,412,646,568.59	0.91
M	科学研究和技术服务业	2,835,022,546.94	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	739,025,713.92	0.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	264,982,433,243.58	99.42

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,979,081	11,246,674,251.12	4.22
2	300750	宁德时代	33,541,336	8,459,795,765.92	3.17
3	601318	中国平安	136,672,207	7,582,574,044.36	2.85
4	600036	招商银行	157,200,293	7,223,353,463.35	2.71
5	601166	兴业银行	211,055,384	4,926,032,662.56	1.85
6	600900	长江电力	155,374,183	4,682,977,875.62	1.76
7	000333	美的集团	62,477,243	4,510,856,944.60	1.69
8	601899	紫金矿业	209,190,358	4,079,211,981.00	1.53
9	002594	比亚迪	11,489,439	3,813,459,698.49	1.43
10	300059	东方财富	160,561,906	3,713,796,885.78	1.39
11	600030	中信证券	123,950,784	3,423,520,654.08	1.28
12	601398	工商银行	445,137,025	3,378,590,019.75	1.27
13	600276	恒瑞医药	56,700,468	2,942,754,289.20	1.10
14	000858	五粮液	24,658,595	2,931,906,945.50	1.10
15	601211	国泰海通	143,483,611	2,749,145,986.76	1.03
16	601328	交通银行	338,781,023	2,710,248,184.00	1.02
17	000651	格力电器	56,902,247	2,556,048,935.24	0.96
18	601288	农业银行	405,437,193	2,383,970,694.84	0.89
19	600887	伊利股份	80,328,673	2,239,563,403.24	0.84
20	002475	立讯精密	64,422,297	2,234,809,482.93	0.84
21	688981	中芯国际	25,267,443	2,227,830,449.31	0.84
22	600919	江苏银行	186,456,111	2,226,285,965.34	0.84
23	603259	药明康德	31,769,934	2,209,598,909.70	0.83
24	601816	京沪高铁	372,799,262	2,143,595,756.50	0.80
25	600000	浦发银行	149,114,283	2,069,706,248.04	0.78
26	000725	京东方 A	466,389,123	1,860,892,600.77	0.70
27	002371	北方华创	4,058,072	1,794,520,019.12	0.67
28	300760	迈瑞医疗	7,700,221	1,730,624,669.75	0.65
29	601088	中国神华	41,878,270	1,697,745,065.80	0.64
30	688041	海光信息	11,796,598	1,666,741,331.42	0.63
31	300308	中际旭创	11,276,050	1,644,724,653.00	0.62
32	601601	中国太保	43,462,936	1,630,294,729.36	0.61
33	688256	寒武纪	2,674,194	1,608,527,691.00	0.60
34	300502	新易盛	12,594,580	1,599,763,551.60	0.60
35	300124	汇川技术	24,004,788	1,549,989,161.16	0.58
36	601728	中国电信	197,171,111	1,528,076,110.25	0.57
37	601668	中国建筑	262,371,350	1,513,882,689.50	0.57

38	600016	民生银行	315,249,510	1,497,435,172.50	0.56
39	002352	顺丰控股	30,598,852	1,492,000,023.52	0.56
40	000001	平安银行	123,218,944	1,487,252,654.08	0.56
41	002714	牧原股份	34,680,324	1,456,920,411.24	0.55
42	002230	科大讯飞	29,357,806	1,405,651,751.28	0.53
43	601127	赛力斯	10,392,700	1,395,947,464.00	0.52
44	603501	豪威集团	10,843,106	1,384,122,480.90	0.52
45	600031	三一重工	75,348,137	1,352,499,059.15	0.51
46	601229	上海银行	126,300,422	1,340,047,477.42	0.50
47	000063	中兴通讯	40,912,240	1,329,238,677.60	0.50
48	603019	中科曙光	18,776,348	1,306,306,899.20	0.49
49	002415	海康威视	46,914,328	1,300,934,315.44	0.49
50	600309	万华化学	23,931,510	1,298,523,732.60	0.49
51	600941	中国移动	11,452,842	1,289,017,367.10	0.48
52	601169	北京银行	187,946,003	1,283,671,200.49	0.48
53	300274	阳光电源	18,417,060	1,248,124,156.20	0.47
54	601857	中国石油	143,934,743	1,230,642,052.65	0.46
55	601919	中远海控	80,068,395	1,204,228,660.80	0.45
56	688008	澜起科技	14,537,952	1,192,112,064.00	0.45
57	600690	海尔智家	47,671,803	1,181,307,278.34	0.44
58	600660	福耀玻璃	20,343,632	1,159,790,460.32	0.44
59	601688	华泰证券	64,964,822	1,157,023,479.82	0.43
60	601012	隆基绿能	77,004,656	1,156,609,933.12	0.43
61	300498	温氏股份	67,608,120	1,154,746,689.60	0.43
62	002142	宁波银行	41,923,938	1,147,038,943.68	0.43
63	600406	国电南瑞	51,001,243	1,142,937,855.63	0.43
64	600809	山西汾酒	6,193,064	1,092,394,558.96	0.41
65	601766	中国中车	154,479,220	1,087,533,708.80	0.41
66	601138	工业富联	50,436,871	1,078,340,301.98	0.40
67	603986	兆易创新	8,438,813	1,067,763,008.89	0.40
68	000568	泸州老窖	9,359,476	1,061,364,578.40	0.40
69	600050	中国联通	198,525,800	1,060,127,772.00	0.40
70	000338	潍柴动力	68,818,619	1,058,430,360.22	0.40
71	600028	中国石化	185,229,651	1,044,695,231.64	0.39
72	000100	TCL 科技	238,502,265	1,032,714,807.45	0.39
73	688012	中微公司	5,605,145	1,021,817,933.50	0.38
74	601988	中国银行	181,795,055	1,021,688,209.10	0.38
75	601939	建设银行	107,680,664	1,016,505,468.16	0.38
76	601006	大秦铁路	153,515,564	1,013,202,722.40	0.38
77	600926	杭州银行	58,389,013	982,103,198.66	0.37
78	601818	光大银行	235,744,383	978,339,189.45	0.37
79	601985	中国核电	104,489,495	973,842,093.40	0.37
80	601225	陕西煤业	49,241,467	947,405,825.08	0.36

81	600104	上汽集团	58,801,455	943,763,352.75	0.35
82	002027	分众传媒	128,401,744	937,332,731.20	0.35
83	600150	中国船舶	28,395,704	923,996,208.16	0.35
84	601628	中国人寿	21,153,047	871,294,005.93	0.33
85	601009	南京银行	74,810,824	869,301,774.88	0.33
86	605499	东鹏饮料	2,664,965	836,932,258.25	0.31
87	688111	金山办公	2,967,089	830,933,274.45	0.31
88	600999	招商证券	47,140,285	829,197,613.15	0.31
89	603288	海天味业	21,182,235	824,200,763.85	0.31
90	600760	中航沈飞	14,294,044	823,214,299.28	0.31
91	000425	徐工机械	104,494,626	811,923,244.02	0.30
92	688271	联影医疗	6,336,049	808,274,953.38	0.30
93	000625	长安汽车	63,023,417	804,178,800.92	0.30
94	000792	盐湖股份	47,052,256	803,652,532.48	0.30
95	600111	北方稀土	32,147,620	800,475,738.00	0.30
96	600938	中国海油	30,381,528	793,261,696.08	0.30
97	600905	三峡能源	181,717,445	774,116,315.70	0.29
98	600436	片仔癀	3,864,895	773,017,648.95	0.29
99	601658	邮储银行	140,351,247	767,721,321.09	0.29
100	600089	特变电工	64,161,959	765,452,170.87	0.29
101	601888	中国中免	12,389,455	755,385,071.35	0.28
102	300033	同花顺	2,755,118	752,174,765.18	0.28
103	603993	洛阳钼业	89,236,422	751,370,673.24	0.28
104	002050	三花智控	28,436,780	750,162,256.40	0.28
105	300015	爱尔眼科	59,216,804	739,025,713.92	0.28
106	600048	保利发展	91,224,378	738,917,461.80	0.28
107	600019	宝钢股份	111,297,829	733,452,693.11	0.28
108	600547	山东黄金	22,954,675	732,942,772.75	0.28
109	601390	中国中铁	130,378,961	731,425,971.21	0.27
110	002463	沪电股份	17,111,200	728,594,896.00	0.27
111	002241	歌尔股份	31,045,003	723,969,469.96	0.27
112	600415	小商品城	34,812,803	719,928,766.04	0.27
113	300014	亿纬锂能	15,591,445	714,244,095.45	0.27
114	601825	沪农商行	73,489,300	712,846,210.00	0.27
115	601600	中国铝业	100,662,768	708,665,886.72	0.27
116	601989	中国重工	144,782,061	671,788,763.04	0.25
117	000977	浪潮信息	13,081,068	665,564,739.84	0.25
118	600585	海螺水泥	30,481,214	654,431,664.58	0.25
119	600893	航发动力	16,937,436	652,768,783.44	0.24
120	002179	中航光电	16,146,408	651,669,026.88	0.24
121	601838	成都银行	32,307,199	649,374,699.90	0.24
122	601916	浙商银行	191,528,200	649,280,598.00	0.24
123	600570	恒生电子	19,209,467	644,285,523.18	0.24

124	600958	东方证券	66,403,480	642,785,686.40	0.24
125	603799	华友钴业	17,301,558	640,503,677.16	0.24
126	600015	华夏银行	80,846,370	639,494,786.70	0.24
127	000538	云南白药	11,317,260	631,389,935.40	0.24
128	000776	广发证券	37,492,872	630,255,178.32	0.24
129	601336	新华保险	10,616,618	621,072,153.00	0.23
130	002311	海大集团	10,587,162	620,301,821.58	0.23
131	600584	长电科技	18,201,432	613,206,244.08	0.23
132	000938	紫光股份	25,483,347	611,345,494.53	0.23
133	002028	思源电气	7,908,800	576,630,608.00	0.22
134	000166	申万宏源	114,468,872	574,633,737.44	0.22
135	600438	通威股份	34,295,431	574,448,469.25	0.22
136	601998	中信银行	67,302,839	572,074,131.50	0.21
137	300408	三环集团	17,049,441	569,451,329.40	0.21
138	002049	紫光国微	8,639,009	568,965,132.74	0.21
139	300433	蓝思科技	25,328,186	564,818,547.80	0.21
140	601077	渝农商行	78,610,400	561,278,256.00	0.21
141	000002	万科 A	86,440,000	554,944,800.00	0.21
142	600795	国电电力	113,265,357	548,204,327.88	0.21
143	601377	兴业证券	87,738,305	543,100,107.95	0.20
144	600489	中金黄金	36,936,628	540,382,867.64	0.20
145	601669	中国电建	109,380,922	532,685,090.14	0.20
146	601995	中金公司	14,851,900	525,163,184.00	0.20
147	601689	拓普集团	11,021,387	520,760,535.75	0.20
148	600010	包钢股份	287,580,980	514,769,954.20	0.19
149	002422	科伦药业	14,204,608	510,229,519.36	0.19
150	600009	上海机场	15,805,755	502,148,836.35	0.19
151	002304	洋河股份	7,653,756	494,049,949.80	0.19
152	600160	巨化股份	17,156,000	492,034,080.00	0.18
153	601100	恒立液压	6,809,309	490,270,248.00	0.18
154	002460	赣锋锂业	14,343,259	484,371,856.43	0.18
155	000768	中航西飞	17,677,117	483,292,378.78	0.18
156	601881	中国银河	27,590,185	473,171,672.75	0.18
157	300394	天孚通信	5,918,528	472,535,275.52	0.18
158	601186	中国铁建	58,434,077	468,056,956.77	0.18
159	688036	传音控股	5,843,995	465,766,401.50	0.17
160	600183	生益科技	15,428,328	465,164,089.20	0.17
161	002252	上海莱士	67,445,575	463,351,100.25	0.17
162	000157	中联重科	63,071,052	456,003,705.96	0.17
163	601360	三六零	44,447,722	453,366,764.40	0.17
164	600989	宝丰能源	27,934,167	450,857,455.38	0.17
165	600886	国投电力	30,500,751	449,581,069.74	0.17
166	000963	华东医药	11,124,885	449,000,358.60	0.17

167	601788	光大证券	24,819,160	446,248,496.80	0.17
168	002074	国轩高科	13,742,200	446,071,812.00	0.17
169	601058	赛轮轮胎	33,394,024	438,129,594.88	0.16
170	600115	中国东航	108,669,379	437,937,597.37	0.16
171	300442	润泽科技	8,752,920	433,532,127.60	0.16
172	000408	藏格矿业	9,988,599	426,213,519.33	0.16
173	000807	云铝股份	26,414,300	422,100,514.00	0.16
174	002736	国信证券	36,622,223	421,888,008.96	0.16
175	002466	天齐锂业	13,125,378	420,537,111.12	0.16
176	600066	宇通客车	16,880,700	419,654,202.00	0.16
177	688169	石头科技	2,652,160	415,195,648.00	0.16
178	002001	新和成	19,506,431	414,901,787.37	0.16
179	601901	方正证券	52,341,485	414,021,146.35	0.16
180	000661	长春高新	4,132,596	409,870,871.28	0.15
181	600426	华鲁恒升	18,863,256	408,766,757.52	0.15
182	600196	复星医药	16,147,998	405,153,269.82	0.15
183	600029	南方航空	68,470,222	403,974,309.80	0.15
184	001979	招商蛇口	46,035,489	403,731,238.53	0.15
185	601800	中国交建	45,190,411	401,742,753.79	0.15
186	000975	山金国际	21,154,960	400,674,942.40	0.15
187	002236	大华股份	25,153,943	399,444,614.84	0.15
188	300661	圣邦股份	5,486,164	399,228,154.28	0.15
189	600011	华能国际	55,856,400	398,814,696.00	0.15
190	600674	川投能源	24,774,300	397,379,772.00	0.15
191	601066	中信建投	16,506,445	396,980,002.25	0.15
192	301236	软通动力	7,260,968	396,739,291.52	0.15
193	688126	沪硅产业	20,928,926	391,789,494.72	0.15
194	600346	恒力石化	26,808,904	382,294,971.04	0.14
195	601878	浙商证券	34,844,674	380,155,393.34	0.14
196	601111	中国国航	47,609,903	375,642,134.67	0.14
197	300418	昆仑万维	11,146,735	374,864,698.05	0.14
198	002648	卫星化学	21,388,138	370,656,431.54	0.14
199	600372	中航机载	30,731,465	370,621,467.90	0.14
200	603369	今世缘	9,514,463	370,398,044.59	0.14
201	002916	深南电路	3,416,961	368,382,565.41	0.14
202	601868	中国能建	164,746,300	367,384,249.00	0.14
203	600460	士兰微	14,793,700	367,179,634.00	0.14
204	003816	中国广核	99,897,900	363,628,356.00	0.14
205	002920	德赛西威	3,555,000	363,072,150.00	0.14
206	601117	中国化学	46,556,808	357,090,717.36	0.13
207	601319	中国人保	40,560,000	353,277,600.00	0.13
208	600741	华域汽车	20,011,871	353,209,523.15	0.13
209	300347	泰格医药	6,556,901	349,613,961.32	0.13

210	600588	用友网络	26,024,467	347,947,123.79	0.13
211	600176	中国巨石	30,507,564	347,786,229.60	0.13
212	601021	春秋航空	6,208,100	345,480,765.00	0.13
213	301269	华大九天	2,782,500	344,696,100.00	0.13
214	002601	龙佰集团	21,210,700	343,825,447.00	0.13
215	000786	北新建材	12,867,000	340,718,160.00	0.13
216	601633	长城汽车	15,854,081	340,545,659.88	0.13
217	600219	南山铝业	88,495,700	338,938,531.00	0.13
218	300896	爱美客	1,938,439	338,858,521.59	0.13
219	300782	卓胜微	4,745,100	338,657,787.00	0.13
220	302132	中航成飞	3,772,422	331,746,790.68	0.12
221	600482	中国动力	14,303,400	329,979,438.00	0.12
222	600039	四川路桥	33,171,363	328,396,493.70	0.12
223	000630	铜陵有色	97,496,800	325,639,312.00	0.12
224	000895	双汇发展	13,194,600	322,080,186.00	0.12
225	002493	荣盛石化	38,584,400	319,478,832.00	0.12
226	688396	华润微	6,713,957	316,630,212.12	0.12
227	002129	TCL 中环	41,066,025	315,387,072.00	0.12
228	603296	华勤技术	3,904,706	315,031,680.08	0.12
229	600085	同仁堂	8,716,243	314,307,722.58	0.12
230	600600	青岛啤酒	4,492,276	312,033,490.96	0.12
231	001965	招商公路	25,983,250	311,367,000.00	0.12
232	601877	正泰电器	13,641,830	309,260,286.10	0.12
233	600362	江西铜业	13,171,968	308,619,210.24	0.12
234	002709	天赐材料	17,030,200	308,587,224.00	0.12
235	002600	领益智造	35,596,645	305,775,180.55	0.11
236	688506	百利天恒	1,027,510	304,266,261.20	0.11
237	300122	智飞生物	15,202,207	297,811,235.13	0.11
238	603392	万泰生物	4,810,621	293,447,881.00	0.11
239	002180	纳思达	12,642,500	290,018,950.00	0.11
240	600161	天坛生物	15,068,745	289,169,216.55	0.11
241	002938	鹏鼎控股	8,840,227	283,152,470.81	0.11
242	300832	新产业	4,980,481	282,492,882.32	0.11
243	600233	圆通速递	21,885,900	282,109,251.00	0.11
244	000301	东方盛虹	33,572,600	279,659,758.00	0.10
245	000596	古井贡酒	2,094,008	278,817,165.20	0.10
246	600188	兖矿能源	22,717,220	276,468,567.40	0.10
247	300759	康龙化成	11,239,069	275,806,753.26	0.10
248	688047	龙芯中科	2,055,019	274,118,984.41	0.10
249	600023	浙能电力	51,085,000	270,750,500.00	0.10
250	601618	中国中冶	90,699,042	270,283,145.16	0.10
251	000876	新希望	28,736,790	269,551,090.20	0.10
252	000999	华润三九	8,487,137	265,477,645.36	0.10

253	688223	晶科能源	50,823,154	263,772,169.26	0.10
254	600845	宝信软件	10,998,263	259,778,972.06	0.10
255	600875	东方电气	15,498,556	259,445,827.44	0.10
256	600515	海南机场	72,627,538	257,101,484.52	0.10
257	601872	招商轮船	41,006,443	256,700,333.18	0.10
258	600027	华电国际	46,689,900	255,393,753.00	0.10
259	601898	中煤能源	23,250,139	254,356,520.66	0.10
260	002459	晶澳科技	25,234,749	251,842,795.02	0.09
261	600061	国投资本	32,492,448	244,343,208.96	0.09
262	688599	天合光能	16,615,050	241,416,676.50	0.09
263	605117	德业股份	4,584,175	241,402,655.50	0.09
264	600332	白云山	8,936,628	235,569,514.08	0.09
265	000617	中油资本	32,120,500	234,479,650.00	0.09
266	000983	山西焦煤	36,046,371	230,696,774.40	0.09
267	601799	星宇股份	1,830,119	228,764,875.00	0.09
268	600918	中泰证券	35,395,000	227,589,850.00	0.09
269	300316	晶盛机电	8,319,800	225,882,570.00	0.08
270	300999	金龙鱼	7,574,700	223,680,891.00	0.08
271	300628	亿联网络	6,416,670	223,043,449.20	0.08
272	600803	新奥股份	11,788,900	222,810,210.00	0.08
273	601698	中国卫通	10,753,660	220,127,420.20	0.08
274	600025	华能水电	22,862,700	218,338,785.00	0.08
275	603260	合盛硅业	4,522,800	213,234,170.00	0.08
276	601059	信达证券	12,346,860	211,131,306.00	0.08
277	601238	广汽集团	28,126,671	210,668,765.79	0.08
278	300413	芒果超媒	9,517,100	207,663,122.00	0.08
279	600018	上港集团	35,475,468	202,564,922.28	0.08
280	601607	上海医药	10,650,068	190,423,215.84	0.07
281	600026	中远海能	17,668,600	182,516,638.00	0.07
282	688303	大全能源	8,148,663	173,729,495.16	0.07
283	603806	福斯特	13,256,030	171,798,148.80	0.06
284	688472	阿特斯	18,747,417	171,538,865.55	0.06
285	688009	中国通号	32,912,463	169,170,059.82	0.06
286	603195	公牛集团	3,476,544	167,743,248.00	0.06
287	601699	潞安环能	15,198,010	160,339,005.50	0.06
288	601236	红塔证券	17,990,322	152,378,027.34	0.06
289	000708	中信特钢	12,819,400	150,756,144.00	0.06
290	601865	福莱特	9,673,200	147,129,372.00	0.06
291	688187	时代电气	3,339,691	142,437,821.15	0.05
292	601136	首创证券	6,947,489	138,116,081.32	0.05
293	603833	欧派家居	2,341,393	132,171,634.85	0.05
294	688082	盛美上海	1,131,336	128,904,423.84	0.05
295	601808	中海油服	7,529,800	103,610,048.00	0.04

296	300979	华利集团	1,943,781	102,184,567.17	0.04
297	600377	宁沪高速	6,298,600	96,620,524.00	0.04
298	000800	一汽解放	12,496,700	85,727,362.00	0.03
299	001391	国货航	10,878,400	73,211,632.00	0.03
300	001289	龙源电力	1,938,904	31,371,466.72	0.01
301	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
302	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
303	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
304	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
305	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
306	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
307	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
308	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
309	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
310	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
311	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
312	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
313	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
314	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
315	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
316	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
317	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
318	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
319	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
320	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
321	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
322	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
323	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
324	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
325	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
326	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
327	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
328	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
329	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
330	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
331	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
332	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
333	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
334	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
335	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
336	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,860,140,597.77	0.75
2	601211	国泰海通	1,451,614,837.92	0.59
3	002594	比亚迪	1,091,257,321.53	0.44
4	000333	美的集团	930,821,244.00	0.38
5	002371	北方华创	771,389,755.48	0.31
6	601825	沪农商行	730,923,948.00	0.30
7	300059	东方财富	725,403,719.11	0.29
8	601166	兴业银行	627,434,760.00	0.25
9	000858	五粮液	624,554,394.13	0.25
10	601077	渝农商行	574,568,707.00	0.23
11	000651	格力电器	562,808,522.70	0.23
12	002230	科大讯飞	493,094,849.31	0.20
13	601009	南京银行	484,645,898.91	0.20
14	601058	赛轮轮胎	477,726,653.39	0.19
15	002475	立讯精密	464,006,251.24	0.19
16	300124	汇川技术	399,930,686.25	0.16
17	000725	京东方 A	396,565,281.00	0.16
18	301236	软通动力	393,630,267.51	0.16
19	300760	迈瑞医疗	350,949,823.66	0.14
20	601328	交通银行	332,714,233.85	0.13

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,487,858,960.21	0.60
2	600837	海通证券	1,304,534,437.32	0.53
3	002594	比亚迪	894,151,037.41	0.36
4	002371	北方华创	654,886,798.52	0.26
5	000333	美的集团	646,738,715.86	0.26
6	601988	中国银行	596,721,566.00	0.24
7	300059	东方财富	558,500,186.88	0.23
8	300124	汇川技术	522,958,418.81	0.21
9	000858	五粮液	424,006,431.64	0.17
10	601009	南京银行	407,530,643.07	0.16
11	000651	格力电器	403,223,322.95	0.16

12	002475	立讯精密	379,480,319.69	0.15
13	603019	中科曙光	367,608,529.81	0.15
14	600745	闻泰科技	362,949,659.97	0.15
15	002555	三七互娱	354,209,555.20	0.14
16	300450	先导智能	349,105,276.52	0.14
17	000725	京东方 A	313,013,388.05	0.13
18	002271	东方雨虹	300,528,069.87	0.12
19	300308	中际旭创	273,032,879.41	0.11
20	300760	迈瑞医疗	264,559,523.07	0.11

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	30,699,896,261.67
卖出股票收入（成交）总额	23,362,331,604.28

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,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。

本基金为指数型基金,上述主体所发行的证券系标的指数成份股,上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	188,188,118.16
2	应收清算款	274,062,178.12
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	462,250,296.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有限 公司—易方达沪深 300 交易型开放式指数发起 式证券投资基金联接基 金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
108,328	631,644.3 3	66,228,603, 753.00	96.79%	2,196,163,7 23.00	3.21%	4,592,607,6 19.00	6.71%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金资产管理有限责任公司	28,538,696,695.00	41.80%
2	中央汇金投资有限责任公司	27,355,388,757.00	40.07%
3	友邦人寿保险有限公司—分红	479,058,760.00	0.70%
4	易方达基金—中央汇金资产管理有限责 任公司—易方达基金—汇金资管单一资 产管理计划	254,000,077.00	0.37%
5	中国人寿再保险有限责任公司	203,314,703.00	0.30%
6	友邦人寿保险有限公司—传统	176,533,679.00	0.26%
7	北京诚通金控投资有限公司	154,427,250.00	0.23%

8	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	152,022,181.00	0.22%
9	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	142,216,725.00	0.21%
10	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	130,022,866.00	0.19%
11	中国建设银行股份有限公司—易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	4,592,607,619.00	6.73%

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	3,100.00	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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	10,002,600.00	0.0146%	不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,002,600.00	0.0146%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,104,307,415.00
本报告期期初基金份额总额	64,093,388,464.00
本报告期基金总申购份额	13,844,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,513,320,988.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	68,424,767,476.00

注：期初基金总份额包含场外份额 359,244,447 份；期末基金总份额包含场外份额 156,423,459 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 202,820,988 份。

§ 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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	
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	438,065,483.63	0.86%	43,806.81	0.88%	-
光大证券	2	363,995,535.62	0.72%	36,400.54	0.73%	-
广发证券	3	18,039,487,637.92	35.54%	1,804,068.71	36.05%	-
国泰海通	4	5,274,677,651.36	10.39%	527,475.13	10.54%	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	6,548,457,543.35	12.90%	654,892.90	13.09%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	5,057,074,773.29	9.96%	434,483.46	8.68%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	6,384,026,229.87	12.58%	638,448.92	12.76%	-
招商证券	4	7,148,880,948.06	14.08%	714,888.25	14.28%	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	1,503,008,268.59	2.96%	150,300.82	3.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

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

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
 - 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
 - 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
 - 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
 - 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。
- c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：
- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
 - 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	38,433,225.35	8.21%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	27,111,465.52	5.79%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	402,643,265.87	86.00%	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中航证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2025-01-21
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-27
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加红塔证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-12
5	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中山证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
7	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
11	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
12	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
13	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	证券时报	2025-03-31
14	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2025-04-11

		子披露网站	
15	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	证券时报	2025-04-22
16	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金场外份额暂停机构客户大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-25
17	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-26
18	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金场外份额恢复机构客户大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-30
19	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
20	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华西证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配中航沈飞（600760）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025年01月01日~2025年06月30日	19,607,770,466.00	8,930,926,229.00	0.00	28,538,696,695.00	41.71%
	2	2025年01月01日~2025年06月30日	27,355,388,757.00	0.00	0.00	27,355,388,757.00	39.98%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如场外个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金</p>							

合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照；

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日