

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：二〇二六年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500E、沪港深 500ETF 易方达
基金主代码	517010
交易代码	517010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 3 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	87,144,188.00 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	2021 年 8 月 12 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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 3% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

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	姓名	王玉	郭明

负责人	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		广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层；广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层；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		510627；510623；519031	100140
法定代表人		吴欣荣	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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

§ 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,440,950.93
本期利润	-722,416.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0083
本期加权平均净值利润率	-0.72%
本期基金份额净值增长率	-0.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	9,999,501.42
期末可供分配基金份额利润	0.1147
期末基金资产净值	98,202,548.59
期末基金份额净值	1.1269
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.69%

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
过去三个月	4.35%	1.12%	3.40%	1.10%	0.95%	0.02%
过去六个月	-0.77%	1.10%	-1.67%	1.08%	0.90%	0.02%
过去一年	14.13%	1.00%	11.89%	0.98%	2.24%	0.02%
过去三年	34.51%	1.11%	25.55%	1.11%	8.96%	0.00%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.69%	1.12%	-0.81%	1.14%	13.50%	-0.02%

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

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021 年 8 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日)



§ 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 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		
刘 越 洲	本基金的基金经理，易方达中证电 信主题 ETF、易方达中证电信主题 ETF 联接发起式、易方达中证新能 源 ETF 联接发起式、易方达中证新 能源 ETF、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证沪港 深 500ETF 联接发起式、易方达中 证石化产业 ETF、易方达中小企业 100 指数（LOF）、易方达中证稀有	2025- 11-29	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾 任易方达基金管理有限公司研究员。

	金属主题 ETF 的基金经理，易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证家电龙头 ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证 A500 增强策略 ETF、易方达国证石油天然气 ETF 的基金经理助理				
李博扬	本基金的基金经理助理，易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证龙头企业指数（自 2024 年 06 月 08 日至 2026 年 04 月 10 日）、易方达上证 180ETF、易方达上证 180ETF 联接、易方达上证科创板综合 ETF、易方达上证科创板人工智能 ETF 联接、易方达上证科创板 200ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式、易方达创业板 50ETF、易方达上证科创板新能源 ETF、易方达上证科创板 200ETF 联接、易方达上证 580ETF、易方达上证 580ETF 联接、易方达创业板 50ETF 联接、易方达上证科创板人工智能 ETF 的基金经理，易方达恒生 ETF(QDII)、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式（自 2024 年 09 月 14 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证沪深港黄金产业股票指数发起式（自 2024 年 11 月 22 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF、易方达上证科创板综合增强策略 ETF、易方达中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理助理	2024-09-14	2026-01-06	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任南方基金管理股份有限公司量化交易员、量化及指数研究员，易方达基金管理有限公司研究员。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，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 64 次，均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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证沪港深 500 指数，该指数选取沪港深交易所上市的互联互通范围内流动性较好、市值较大的 500 只股票作为指数样本，以反映沪港深三地上市大市值企业证券的整体表现。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。

中证沪港深 500 指数成份股聚焦内地和香港证券市场中的大市值龙头企业，各市场和大类行业权重分布较为均衡，对沪港深市场整体具有较强的代表性。指数表现同时受到沪深 A 股市场和港股市场总体走势的影响，与中国宏观经济形势和全球金融条件密切相关。

2026 年上半年，国内宏观经济呈温和修复、结构分化态势。在国际形势复杂多变，世界经济增长总体放缓的大背景下，国内整体经济运行保持韧性，上半年 GDP 同比增长 4.7%，增速符合全年经济增长预期目标。其中，生产端韧性凸显，高技术制造、装备制造保持扩张；需求端呈现分化，外贸出口增速亮眼，但内需消费、房地产投资及固定资产投资复苏节奏平缓，内生动能仍待巩固。

全球金融条件方面，上半年全球地缘局势持续波动，局部冲突反复扰动全球能源与大宗商品价格，受此影响市场开始定价美联储加息预期，美债利率持续上行。本报告期内，中证沪港深 500 指数下跌 1.67%。

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 1.1269 元，本报告期份额净值增长率为-0.77%，同期业绩比较基准收益率为-1.67%。年化跟踪误差 1.15%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内稳增长、促转型政策料将持续释放效能，支撑宏观经济延续修复走势。伴随人工智能、数字技术产业浪潮持续演进，高技术制造、数字经济等新兴赛道有望维持扩张节奏，持续赋能实体经济转型升级，推动产业结构进一步优化，新动能引领作用有望继续凸显。但另一方面，外部整体环境偏于复杂，多重扰动因素持续存在。海外主要经济体复苏节奏偏弱，全球经济增长动力或持续走弱。与此同时，局部地缘局势反复波动，叠加全球贸易保护态势延续，各类风险因素相互交织，进一步抬高了全球宏观环境的波动水平。综合来看，下半年 A 股及港股市场有望维持结构性行情，但市场整体或将延续震荡走势。

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标的指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为长期看好 A 股、港股核心资产投资前景的投资者提供方便、高效的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融

估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,732,739.19	1,472,979.03

结算备付金		885,911.78	928,196.81
存出保证金		350,818.73	340,091.50
交易性金融资产	6.4.7.2	95,101,319.33	96,203,727.42
其中：股票投资		95,101,319.33	96,203,727.42
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		-	2,582.52
应收股利		154,648.66	86,815.77
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		98,285,930.32	99,034,393.05
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		7.92	98.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,167.53	12,604.62
应付托管费		4,055.83	4,201.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,126.29	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	61,024.16	43,531.89
负债合计		83,381.73	60,436.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	87,144,188.00	87,144,188.00
未分配利润	6.4.7.8	11,058,360.59	11,829,768.57
净资产合计		98,202,548.59	98,973,956.57
负债和净资产总计		98,285,930.32	99,034,393.05

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1269 元，基金份额总额 87,144,188.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-500,753.15	6,131,119.62
1.利息收入		8,950.26	5,955.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,950.26	5,955.88
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）		2,652,961.82	1,666,427.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,309,249.63	663,996.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-1,759.81	5,799.78
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	300,594.73	-31,772.94
股利收益	6.4.7.14	1,044,877.27	1,028,404.94
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	-3,163,366.98	4,468,655.86
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	701.75	-9,920.06
减：二、营业总支出		221,662.90	206,141.12
1. 管理人报酬		74,201.81	51,591.63
2. 托管费		24,733.89	17,197.21
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		1,083.15	105.07
8. 其他费用	6.4.7.18	121,644.05	137,247.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-722,416.05	5,924,978.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-722,416.05	5,924,978.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-722,416.05	5,924,978.50
----------	--	-------------	--------------

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	87,144,188.00	11,829,768.57	98,973,956.57
二、本期期初净资产	87,144,188.00	11,829,768.57	98,973,956.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	-771,407.98	-771,407.98
（一）、综合收益总额	-	-722,416.05	-722,416.05
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	0.00	-48,991.93	-48,991.93
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	861,824.72	6,861,824.72
2.基金赎回款	-6,000,000.00	-910,816.65	-6,910,816.65
（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	87,144,188.00	11,058,360.59	98,202,548.59
项目	上年度可比期间 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	75,144,188.00	-7,256,812.11	67,887,375.89
二、本期期初净资产	75,144,188.00	-7,256,812.11	67,887,375.89
三、本期增减变动额（减少以“-”	0.00	6,309,535.12	6,309,535.12

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	5,924,978.50	5,924,978.50
(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)	0.00	384,556.62	384,556.62
其中: 1.基金申购款	6,000,000.00	-241,267.26	5,758,732.74
2.基金赎回款	-6,000,000.00	625,823.88	-5,374,176.12
(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	75,144,188.00	-947,276.99	74,196,911.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]234 号《关于准予易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,144,188.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,188.00 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。

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>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》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。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规

定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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]127 号《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,732,739.19

等于：本金	1,732,580.75
加：应计利息	158.44
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	1,732,739.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		87,431,938.01	-	95,101,319.33	7,669,381.32
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		87,431,938.01	-	95,101,319.33	7,669,381.32

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 2026 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,845,080.00	-	-	-
IF2609	2,845,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,845,080.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2609	IF2609	2	2,909,880.00	64,800.00
合计	-	-	-	64,800.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	64,800.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	872.43
其中：交易所市场	872.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	60,151.73
合计	61,024.16

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,144,188.00	87,144,188.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	87,144,188.00	87,144,188.00

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	7,565,508.27	4,264,260.30	11,829,768.57
本期期初	7,565,508.27	4,264,260.30	11,829,768.57
本期利润	2,440,950.93	-3,163,366.98	-722,416.05
本期基金份额交易产生的变动数	-6,957.78	-42,034.15	-48,991.93
其中：基金申购款	557,949.78	303,874.94	861,824.72
基金赎回款	-564,907.56	-345,909.09	-910,816.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,999,501.42	1,058,859.17	11,058,360.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		3,206.05
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		5,735.39
其他		8.82
合计		8,950.26

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,056,726.76
股票投资收益——赎回差价收入	252,522.87
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	1,309,249.63

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,869,027.53
减：卖出股票成本总额	9,795,335.49
减：交易费用	16,965.28
买卖股票差价收入	1,056,726.76

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	6,910,816.65
减：现金支付赎回款总额	4,523,347.65
减：赎回股票成本总额	2,134,946.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	252,522.87

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,759.81
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	-1,759.81

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	55,138.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,736.58
减：应计利息总额	159.60
减：交易费用	2.27
买卖债券差价收入	-1,759.81

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	300,594.73

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,044,877.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,044,877.27

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-3,161,326.98
——股票投资	-3,161,326.98
——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	-2,040.00
——权证投资	-
——期货投资	-2,040.00
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,163,366.98

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	701.75
合计	701.75

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	10,563.16
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	1,665.72
银行汇划费	319.23
其他	69,424.36
合计	121,644.05

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、关联关系

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
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	25,576.90	0.11%	-	-

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 2026年1月1日至2026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	2.56	0.11%	2.56	0.29%
关联方名称	上年度可比期间 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
-	-	-	-	-

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

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	74,201.81	51,591.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,262.51	1,227.04
应支付基金管理人的净管理费	72,939.30	50,364.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,733.89	17,197.21

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金

托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30 日
报告期初持有的基金份额	33,000,000.00	33,000,000.00
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	33,000,000.00	33,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	37.8683%	43.9156%

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	38,151,000.00	43.7792%	40,189,700.00	46.1186%
------------------------------------	---------------	----------	---------------	----------

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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,732,739.19	3,206.05	1,506,788.07	2,899.06

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

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、托管人工商银行发行的港股工商银行和托管人工商银行发行的 A 股工商银行。于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 5,700 股（2025 年 12 月 31 日：5,700 股），占本基金净值比例为 0.14%（2025 年 12 月 31 日：0.13%）；持有工商银行发行的港股工商银行 177,000 股（2025 年 12 月 31 日：177,000 股），占本基金净值比例为 1.01%（2025 年 12 月 31 日：1.02%）；持有工商银行发行的 A 股工商银行 62,700 股（2025 年 12 月 31 日：62,600 股），占本基金净值比例为 0.45%（2025 年 12 月 31 日：0.50%）。

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（2026 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
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	416	103,053.51	346,112.00	-

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 2026 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 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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%(2025 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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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。本基金可通过港股通投资香港市场，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。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，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 2026 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	1,732,739.19	-	-	-	1,732,739.19
结算备付金	885,911.78	-	-	-	885,911.78
存出保证金	350,818.73	-	-	-	350,818.73
交易性金融资产	-	-	-	95,101,319.33	95,101,319.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	154,648.66	154,648.66
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	2,969,469.70	-	-	95,316,460.62	98,285,930.32
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	-	-	-	7.92	7.92
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	12,167.53	12,167.53
应付托管费	-	-	-	4,055.83	4,055.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,126.29	6,126.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	61,024.16	61,024.16
负债总计	-	-	-	83,381.73	83,381.73
利率敏感度缺口	2,969,469.70	-	-	95,233,078.89	98,202,548.59
上年度末 2025 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	1,472,979.03	-	-	-	1,472,979.03
结算备付金	928,196.81	-	-	-	928,196.81
存出保证金	340,091.50	-	-	-	340,091.50
交易性金融资产	-	-	-	96,203,727.42	96,203,727.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,582.52	2,582.52
应收股利	-	-	-	86,815.77	86,815.77
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,741,267.34	-	-	96,293,125.71	99,034,393.05
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	-	-	-	98.42	98.42
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	12,604.62	12,604.62
应付托管费	-	-	-	4,201.55	4,201.55
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	-	-	-	43,531.89	43,531.89
负债总计	-	-	-	60,436.48	60,436.48
利率敏感度缺口	2,741,267.34	-	-	96,232,689.23	98,973,956.57

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

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港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			
	2026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				
交易性金融资产	-	36,067,367.43	-	36,067,367.43
资产合计	-	36,067,367.43	-	36,067,367.43
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	36,067,367.43	-	36,067,367.43
项目	上年度末			
	2025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				
交易性金融资产	-	43,608,017.13	-	43,608,017.13
资产合计	-	43,608,017.13	-	43,608,017.13
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险	-	43,608,017.13	-	43,608,017.13

敞口净额				
------	--	--	--	--

6.4.13.4.2 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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-1,803,368.37	-2,180,400.86
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	1,803,368.37	2,180,400.86

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	95,101,319.33	96.84	96,203,727.42	97.20
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	95,101,319.33	96.84	96,203,727.42	97.20

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，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。

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	4,755,065.96	4,810,186.37
	2.业绩比较基准下降 5%	-4,755,065.96	-4,810,186.37

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	94,745,097.33
第二层次	356,222.00
第三层次	-
合计	95,101,319.33

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	95,101,319.33	96.76
	其中：股票	95,101,319.33	96.76
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	2,618,650.97	2.66
8	其他各项资产	565,960.02	0.58
9	合计	98,285,930.32	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 36,067,367.43 元，占净值比例 36.73%。

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	312,343.00	0.32
B	采矿业	2,624,388.37	2.67

C	制造业	38,512,895.21	39.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,407,175.00	1.43
E	建筑业	624,654.00	0.64
F	批发和零售业	93,531.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,334,502.92	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,022,565.71	3.08
J	金融业	9,837,276.91	10.02
K	房地产业	249,628.00	0.25
L	租赁和商务服务业	250,761.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	658,401.00	0.67
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	74,777.78	0.08
R	文化、体育和娱乐业	31,052.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	59,033,951.90	60.11

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	1,427,705.13	1.45
材料	577,868.02	0.59
工业	1,609,273.78	1.64
非必需消费品	6,171,794.73	6.28
必需消费品	673,146.22	0.69
保健	1,348,276.24	1.37
金融	13,427,390.42	13.67
信息技术	2,484,054.73	2.53
电信服务	6,262,558.19	6.38
公用事业	832,946.40	0.85
房地产	1,252,353.57	1.28
合计	36,067,367.43	36.73

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	13,000	4,852,936.27	4.94
2	00005	汇丰控股	35,200	4,521,740.78	4.60
3	09988	阿里巴巴－W	39,200	3,161,278.81	3.22
4	300308	中际旭创	2,200	2,794,000.00	2.85
5	300750	宁德时代	5,120	2,012,211.20	2.05
5	03750	宁德时代	200	121,944.42	0.12
6	00939	建设银行	245,000	1,717,253.63	1.75
6	601939	建设银行	16,395	157,883.85	0.16
7	300502	新易盛	2,732	1,658,324.00	1.69
8	601318	中国平安	20,600	983,444.00	1.00
8	02318	中国平安	15,000	665,092.16	0.68
9	01398	工商银行	177,000	988,505.44	1.01
9	601398	工商银行	62,700	443,289.00	0.45
10	600519	贵州茅台	1,200	1,422,588.00	1.45
11	00981	中芯国际	10,000	776,483.70	0.79
11	688981	中芯国际	3,808	604,786.56	0.62
12	01299	友邦保险	21,400	1,328,039.01	1.35
13	600036	招商银行	24,000	852,000.00	0.87
13	03968	招商银行	9,500	370,645.03	0.38
14	601899	紫金矿业	31,900	801,966.00	0.82
14	02899	紫金矿业	12,000	285,579.24	0.29
15	603986	兆易创新	1,300	1,059,500.00	1.08
16	00941	中国移动	12,500	826,751.03	0.84
16	600941	中国移动	1,700	146,421.00	0.15
17	01211	比亚迪股份	7,500	471,948.36	0.48
17	002594	比亚迪	5,300	422,410.00	0.43
18	688256	寒武纪	520	829,686.00	0.84
19	00388	香港交易所	2,600	819,737.49	0.83
20	000333	美的集团	9,400	709,982.00	0.72
20	00300	美的集团	1,300	93,264.90	0.09
21	00883	中国海洋石油	36,000	635,361.70	0.65
21	600938	中国海油	4,600	124,890.00	0.13
22	03690	美团－W	12,600	749,645.51	0.76
23	03988	中国银行	136,000	589,432.77	0.60
23	601988	中国银行	27,700	158,444.00	0.16
24	002371	北方华创	810	716,493.60	0.73
25	688008	澜起科技	2,308	715,249.20	0.73
26	002475	立讯精密	9,900	696,960.00	0.71
27	688041	海光信息	1,874	693,942.20	0.71
28	01810	小米集团－W	36,800	691,671.53	0.70
29	02888	渣打集团	3,600	661,626.65	0.67

30	002384	东山精密	2,500	655,875.00	0.67
31	688012	中微公司	1,389	650,746.50	0.66
32	601288	农业银行	55,600	337,492.00	0.34
32	01288	农业银行	63,000	292,197.59	0.30
33	600900	长江电力	23,700	627,339.00	0.64
34	600030	中信证券	18,935	544,002.55	0.55
34	06030	中信证券	3,500	82,868.36	0.08
35	000725	京东方 A	70,400	611,072.00	0.62
36	603259	药明康德	4,800	597,648.00	0.61
37	601138	工业富联	7,700	555,555.00	0.57
38	601328	交通银行	51,700	332,431.00	0.34
38	03328	交通银行	36,000	210,744.97	0.21
39	601166	兴业银行	32,800	543,168.00	0.55
40	00857	中国石油股份	44,000	324,073.38	0.33
40	601857	中国石油	25,109	217,946.12	0.22
41	300059	东方财富	24,548	500,288.24	0.51
42	600183	生益科技	2,800	485,520.00	0.49
43	02628	中国人寿	15,000	347,333.15	0.35
43	601628	中国人寿	3,243	114,640.05	0.12
44	300274	阳光电源	2,840	451,616.80	0.46
45	01088	中国神华	7,000	243,923.58	0.25
45	601088	中国神华	5,300	206,912.00	0.21
46	600276	恒瑞医药	8,660	450,666.40	0.46
47	600487	亨通光电	4,000	437,360.00	0.45
48	300408	三环集团	2,600	433,940.00	0.44
49	300476	胜宏科技	1,200	415,716.00	0.42
50	601211	国泰海通	21,848	397,633.60	0.40
51	002463	沪电股份	2,600	397,280.00	0.40
52	300394	天孚通信	1,300	393,484.00	0.40
53	688525	佰维存储	768	379,952.64	0.39
54	01347	华虹宏力	2,000	373,823.92	0.38
55	301308	江波龙	500	351,900.00	0.36
56	000988	华工科技	1,900	350,759.00	0.36
57	688072	拓荆科技	416	346,112.00	0.35
58	600176	中国巨石	4,700	342,536.00	0.35
59	06160	百济神州	2,300	340,402.12	0.35
60	00669	创科实业	3,000	337,431.68	0.34
61	000651	格力电器	8,700	326,250.00	0.33
62	600522	中天科技	5,300	321,604.00	0.33
63	601601	中国太保	6,600	188,232.00	0.19
63	02601	中国太保	5,600	130,741.09	0.13
64	00001	长和	5,500	316,477.91	0.32
65	02388	中银香港	8,500	312,877.77	0.32
66	600919	江苏银行	28,400	306,152.00	0.31

67	603019	中科曙光	2,800	300,244.00	0.31
68	603993	洛阳钼业	16,900	296,595.00	0.30
69	600887	伊利股份	12,300	294,708.00	0.30
70	600150	中国船舶	8,705	294,141.95	0.30
71	00016	新鸿基地产	3,000	292,614.50	0.30
72	00386	中国石油化工股份	48,000	166,761.60	0.17
72	600028	中国石化	28,200	125,772.00	0.13
73	600584	长电科技	2,800	289,940.00	0.30
74	000338	潍柴动力	10,400	283,400.00	0.29
75	000858	五粮液	3,800	281,200.00	0.29
76	00992	联想集团	14,000	279,916.29	0.29
77	688521	芯原股份	751	278,726.14	0.28
78	601728	中国电信	30,100	156,219.00	0.16
78	00728	中国电信	28,000	103,843.84	0.11
79	601816	京沪高铁	56,900	257,757.00	0.26
80	02269	药明生物	8,500	255,440.56	0.26
81	600690	海尔智家	7,302	149,033.82	0.15
81	06690	海尔智家	5,800	100,651.05	0.10
82	600309	万华化学	3,600	246,276.00	0.25
83	300124	汇川技术	3,700	245,421.00	0.25
84	002415	海康威视	7,100	242,820.00	0.25
85	01801	信达生物	3,500	241,978.03	0.25
86	002916	深南电路	520	238,108.00	0.24
87	600111	北方稀土	4,900	235,445.00	0.24
88	000100	TCL 科技	40,290	234,487.80	0.24
89	601688	华泰证券	11,300	233,006.00	0.24
90	000063	中兴通讯	6,200	224,378.00	0.23
91	01024	快手-W	6,200	224,016.42	0.23
92	00002	中电控股	3,500	222,522.51	0.23
93	600000	浦发银行	25,793	222,077.73	0.23
94	600089	特变电工	9,790	220,275.00	0.22
95	09992	泡泡玛特	1,600	214,983.50	0.22
96	300433	蓝思科技	3,900	209,274.00	0.21
97	002028	思源电气	1,200	207,600.00	0.21
98	300223	北京君正	800	199,120.00	0.20
99	600031	三一重工	11,500	198,720.00	0.20
100	01109	华润置地	7,500	195,423.75	0.20
101	09987	百胜中国	700	194,312.01	0.20
102	00175	吉利汽车	13,000	190,368.79	0.19
103	002156	通富微电	2,500	189,675.00	0.19
104	000001	平安银行	18,800	188,940.00	0.19
105	002142	宁波银行	6,360	188,828.40	0.19
106	300014	亿纬锂能	2,900	188,587.00	0.19

107	002050	三花智控	4,300	188,469.00	0.19
108	600549	厦门钨业	2,200	187,440.00	0.19
109	002714	牧原股份	5,300	185,447.00	0.19
110	000792	盐湖股份	6,100	184,159.00	0.19
111	002353	杰瑞股份	1,200	183,000.00	0.19
112	600406	国电南瑞	7,776	177,681.60	0.18
113	00998	中信银行	18,000	103,965.44	0.11
113	601998	中信银行	10,300	71,379.00	0.07
114	02328	中国财险	14,000	174,126.90	0.18
115	601668	中国建筑	40,040	173,773.60	0.18
116	02020	安踏体育	2,800	172,789.34	0.18
117	01113	长实集团	4,500	172,676.43	0.18
118	000657	中钨高新	1,800	172,296.00	0.18
119	601658	邮储银行	21,400	105,502.00	0.11
119	01658	邮储银行	16,000	63,508.38	0.06
120	601229	上海银行	19,300	167,524.00	0.17
121	300760	迈瑞医疗	1,200	162,996.00	0.17
122	601919	中远海控	12,200	161,772.00	0.16
123	002602	世纪华通	11,400	160,740.00	0.16
124	688777	中控技术	1,365	160,387.50	0.16
125	600660	福耀玻璃	3,100	156,364.00	0.16
126	603501	豪威集团	1,645	156,028.25	0.16
127	600016	民生银行	48,076	154,804.72	0.16
128	601012	隆基绿能	11,768	154,396.16	0.16
129	601225	陕西煤业	7,500	152,625.00	0.16
130	600999	招商证券	7,200	151,920.00	0.15
131	002230	科大讯飞	3,700	151,108.00	0.15
132	00006	电能实业	3,000	148,782.62	0.15
133	09633	农夫山泉	4,200	144,530.19	0.15
134	002460	赣锋锂业	2,200	143,880.00	0.15
135	002352	顺丰控股	4,600	143,796.00	0.15
136	601985	中国核电	15,900	143,577.00	0.15
137	002709	天赐材料	2,784	143,181.12	0.15
138	603799	华友钴业	2,945	142,125.70	0.14
139	600926	杭州银行	9,800	141,610.00	0.14
140	601169	北京银行	28,700	140,630.00	0.14
141	000977	浪潮信息	2,000	140,000.00	0.14
142	01378	中国宏桥	8,000	139,384.90	0.14
143	600160	巨化股份	2,600	137,826.00	0.14
144	02423	贝壳-W	4,200	137,015.50	0.14
145	002938	鹏鼎控股	1,300	136,994.00	0.14
146	09868	小鹏集团-W	3,100	136,375.38	0.14
147	300033	同花顺	560	134,960.00	0.14
148	000776	广发证券	5,700	133,380.00	0.14

149	00288	万洲国际	18,500	133,205.17	0.14
150	300442	润泽科技	1,600	132,912.00	0.14
151	00003	香港中华煤气	23,000	129,848.23	0.13
152	000425	徐工机械	15,900	128,631.00	0.13
153	000938	紫光股份	4,400	126,984.00	0.13
154	300498	温氏股份	10,300	126,896.00	0.13
155	002202	金风科技	5,300	126,670.00	0.13
156	601600	中国铝业	15,400	126,588.00	0.13
157	002080	中材科技	1,400	126,000.00	0.13
158	600460	士兰微	2,300	125,718.00	0.13
159	300661	圣邦股份	867	124,397.16	0.13
160	688126	沪硅产业	3,106	123,898.34	0.13
161	002600	领益智造	7,114	123,356.76	0.13
162	601766	中国中车	23,600	122,720.00	0.12
163	002466	天齐锂业	2,000	122,640.00	0.12
164	600050	中国联通	30,300	121,200.00	0.12
165	688249	晶合集成	2,049	120,952.47	0.12
166	02015	理想汽车－W	3,000	120,068.35	0.12
167	002837	英维克	1,500	119,340.00	0.12
168	02057	中通快递－W	800	119,234.54	0.12
169	002049	紫光国微	1,340	118,925.00	0.12
170	601009	南京银行	12,010	118,778.90	0.12
171	600188	兖矿能源	3,425	60,862.25	0.06
171	01171	兖矿能源	6,000	57,584.87	0.06
172	01519	极兔速递－W	15,800	114,725.03	0.12
173	002179	中航光电	2,456	113,467.20	0.12
174	601872	招商轮船	6,300	110,691.00	0.11
175	00267	中信股份	12,000	110,583.79	0.11
176	000568	泸州老窖	1,400	108,528.00	0.11
177	002241	歌尔股份	4,800	108,144.00	0.11
178	603288	海天味业	3,244	107,571.04	0.11
179	601100	恒立液压	1,000	107,560.00	0.11
180	601006	大秦铁路	23,072	106,361.92	0.11
181	688396	华润微	1,088	106,134.40	0.11
182	00066	港铁公司	4,000	105,963.10	0.11
183	601818	光大银行	36,000	104,040.00	0.11
184	000408	藏格矿业	1,500	103,980.00	0.11
185	688271	联影医疗	1,027	103,963.21	0.11
186	03692	翰森制药	4,000	102,905.80	0.10
187	600905	三峡能源	27,700	102,767.00	0.10
188	688082	盛美上海	237	102,384.00	0.10
189	605117	德业股份	963	102,251.34	0.10
190	00027	银河娱乐	4,000	102,210.96	0.10
191	601888	中国中免	1,900	102,049.00	0.10

192	600489	中金黄金	5,600	101,080.00	0.10
193	002625	光启技术	3,300	100,056.00	0.10
194	600893	航发动力	2,600	99,684.00	0.10
195	000630	铜陵有色	15,600	99,216.00	0.10
196	600809	山西汾酒	900	98,433.00	0.10
197	601127	赛力斯	1,600	98,000.00	0.10
198	600010	包钢股份	43,800	97,674.00	0.10
199	01093	石药集团	16,000	96,860.70	0.10
200	601689	拓普集团	1,715	96,760.30	0.10
201	600958	东方证券	10,128	95,608.32	0.10
202	000426	兴业银锡	2,900	95,584.00	0.10
203	601336	新华保险	1,600	95,456.00	0.10
204	002027	分众传媒	19,600	94,864.00	0.10
205	00688	中国海外发展	9,000	94,272.42	0.10
206	601168	西部矿业	3,400	92,276.00	0.09
207	600760	中航沈飞	2,240	92,064.00	0.09
208	600019	宝钢股份	16,900	91,767.00	0.09
209	600118	中国卫星	1,100	90,255.00	0.09
210	000807	云铝股份	4,000	88,560.00	0.09
211	01177	中国生物制药	23,000	88,097.03	0.09
212	600885	宏发股份	2,548	87,880.52	0.09
213	600989	宝丰能源	4,300	87,419.00	0.09
214	600104	上汽集团	8,900	86,864.00	0.09
215	601838	成都银行	4,900	86,730.00	0.09
216	600362	江西铜业	2,000	86,600.00	0.09
217	600875	东方电气	3,000	86,310.00	0.09
218	300450	先导智能	2,100	85,512.00	0.09
219	601727	上海电气	12,200	85,400.00	0.09
220	002001	新和成	3,000	85,260.00	0.09
221	002422	科伦药业	2,200	84,744.00	0.09
222	601825	沪农商行	11,200	83,888.00	0.09
223	02319	蒙牛乳业	6,000	83,849.82	0.09
224	603296	华勤技术	1,120	83,182.40	0.08
225	601995	中金公司	2,300	83,145.00	0.08
226	688183	生益电子	625	82,750.00	0.08
227	600418	江淮汽车	3,200	82,656.00	0.08
228	601390	中国中铁	19,800	82,566.00	0.08
229	688111	金山办公	387	82,450.35	0.08
230	000538	云南白药	1,740	82,423.80	0.08
231	01308	海丰国际	3,000	81,765.30	0.08
232	601377	兴业证券	13,420	81,056.80	0.08
233	600547	山东黄金	3,500	80,815.00	0.08
234	600795	国电电力	17,300	80,791.00	0.08
235	00020	商汤-W	69,000	80,306.13	0.08

236	002812	恩捷股份	1,200	80,292.00	0.08
237	02382	舜宇光学科技	1,500	79,472.33	0.08
238	600096	云天化	2,600	79,040.00	0.08
239	600015	华夏银行	12,300	78,597.00	0.08
240	300316	晶盛机电	1,300	78,520.00	0.08
241	601669	中国电建	16,700	78,490.00	0.08
242	600585	海螺水泥	4,600	77,970.00	0.08
243	09626	哔哩哔哩－W	680	77,783.86	0.08
244	01038	长江基建集团	1,500	77,778.65	0.08
245	002648	卫星化学	3,294	77,376.06	0.08
246	000166	申万宏源	17,500	77,000.00	0.08
247	601916	浙商银行	29,170	76,717.10	0.08
248	09926	康方生物	1,000	76,475.83	0.08
249	601698	中国卫通	2,500	75,625.00	0.08
250	603893	瑞芯微	400	75,344.00	0.08
251	300015	爱尔眼科	9,053	74,777.78	0.08
252	300782	卓胜微	680	74,514.40	0.08
253	09660	地平线机器人－W	21,000	74,417.36	0.08
254	000066	中国长城	3,900	74,295.00	0.08
255	01997	九龙仓置业	4,000	74,278.40	0.08
256	06618	京东健康	2,600	74,160.27	0.08
257	601066	中信建投	2,533	73,634.31	0.07
258	600580	卧龙电驱	2,200	72,820.00	0.07
259	600346	恒力石化	4,100	72,611.00	0.07
260	603228	景旺电子	1,000	72,410.00	0.07
261	601868	中国能建	27,100	72,357.00	0.07
262	01208	五矿资源	12,000	72,332.84	0.07
263	600482	中国动力	2,200	72,160.00	0.07
264	002558	巨人网络	2,600	71,656.00	0.07
265	00083	信和置业	8,000	71,429.55	0.07
266	002311	海大集团	1,600	71,376.00	0.07
267	00788	中国铁塔	9,300	71,162.91	0.07
268	00019	太古股份公司 A	1,000	70,960.54	0.07
269	600895	张江高科	1,900	70,775.00	0.07
270	02331	李宁	5,500	70,317.81	0.07
271	605499	东鹏饮料	568	70,108.24	0.07
272	600066	宇通客车	2,600	69,706.00	0.07
273	600426	华鲁恒升	2,900	69,368.00	0.07
274	002340	格林美	10,400	68,744.00	0.07
275	000625	长安汽车	9,580	68,688.60	0.07
276	300418	昆仑万维	1,700	68,612.00	0.07
277	688036	传音控股	1,163	68,558.85	0.07
278	000933	神火股份	3,200	67,840.00	0.07

279	002532	天山铝业	6,300	67,599.00	0.07
280	600221	海航控股	49,800	67,230.00	0.07
281	000157	中联重科	9,600	66,912.00	0.07
282	688047	龙芯中科	431	66,662.77	0.07
283	000783	长江证券	6,800	66,300.00	0.07
284	600436	片仔癀	600	65,568.00	0.07
285	00291	华润啤酒	3,500	64,689.60	0.07
286	00012	恒基地产	3,000	64,620.12	0.07
287	600011	华能国际	8,500	64,515.00	0.07
288	600048	保利发展	13,900	64,357.00	0.07
289	300803	指南针	700	64,169.00	0.07
290	601555	东吴证券	8,079	63,985.68	0.07
291	603659	璞泰来	2,205	63,790.65	0.06
292	00762	中国联通	12,000	63,682.09	0.06
293	688506	百利天恒	215	63,216.45	0.06
294	600438	通威股份	5,200	62,972.00	0.06
295	601077	渝农商行	10,300	62,933.00	0.06
296	600115	中国东航	16,500	62,865.00	0.06
297	002236	大华股份	3,800	62,662.00	0.06
298	600570	恒生电子	2,957	62,658.83	0.06
299	600886	国投电力	4,700	62,557.00	0.06
300	002493	荣盛石化	5,800	62,350.00	0.06
301	300339	润和软件	1,600	61,616.00	0.06
302	02313	申洲国际	1,800	61,535.03	0.06
303	300759	康龙化成	2,100	60,753.00	0.06
304	002736	国信证券	6,000	59,940.00	0.06
305	003816	中国广核	15,200	59,432.00	0.06
306	601360	三六零	6,800	59,092.00	0.06
307	601058	赛轮轮胎	5,100	58,803.00	0.06
308	00836	华润电力	4,000	58,783.46	0.06
309	01530	三生制药	4,000	58,679.24	0.06
310	000301	东方盛虹	5,100	58,395.00	0.06
311	002074	国轩高科	2,100	57,771.00	0.06
312	601901	方正证券	8,000	57,600.00	0.06
313	600026	中远海能	3,200	57,408.00	0.06
314	601108	财通证券	6,600	57,090.00	0.06
315	02688	新奥能源	1,600	56,226.45	0.06
316	600196	复星医药	2,500	56,175.00	0.06
317	002601	龙佰集团	3,400	56,032.00	0.06
318	02018	瑞声科技	1,500	55,630.63	0.06
319	002128	电投能源	2,400	55,488.00	0.06
320	600009	上海机场	2,400	55,440.00	0.06
321	000768	中航西飞	2,700	55,296.00	0.06
322	601788	光大证券	3,800	54,834.00	0.06

323	601111	中国国航	9,000	54,450.00	0.06
324	01928	金沙中国有限公司	4,800	54,405.97	0.06
325	000975	山金国际	3,200	54,400.00	0.06
326	002595	豪迈科技	1,160	54,056.00	0.06
327	601456	国联民生	6,100	53,924.00	0.05
328	600029	南方航空	10,400	53,872.00	0.05
329	600415	小商品城	5,300	53,848.00	0.05
330	600674	川投能源	3,800	53,846.00	0.05
331	600219	南山铝业	13,300	53,067.00	0.05
332	00316	东方海外国际	500	52,981.55	0.05
333	601186	中国铁建	8,900	52,955.00	0.05
334	601881	中国银河	4,200	52,794.00	0.05
335	601877	正泰电器	2,100	52,647.00	0.05
336	600839	四川长虹	7,500	52,350.00	0.05
337	601117	中国化学	7,100	52,185.00	0.05
338	600233	圆通速递	3,300	51,975.00	0.05
339	301236	软通动力	1,200	50,940.00	0.05
340	600372	中航机载	4,662	50,582.70	0.05
341	601878	浙商证券	5,300	50,350.00	0.05
342	03808	中国重汽	1,500	50,210.88	0.05
343	01818	招金矿业	3,500	49,824.37	0.05
344	02268	药明合联	1,000	49,550.78	0.05
345	002920	德赛西威	600	48,900.00	0.05
346	601231	环旭电子	1,500	48,600.00	0.05
347	600741	华域汽车	3,100	48,112.00	0.05
348	000963	华东医药	1,700	47,804.00	0.05
349	301269	华大九天	400	47,768.00	0.05
350	00966	中国太平	3,000	46,953.81	0.05
351	000661	长春高新	700	46,620.00	0.05
352	002414	高德红外	3,514	46,595.64	0.05
353	002653	海思科	700	46,438.00	0.05
354	06862	海底捞	5,000	46,120.01	0.05
355	002304	洋河股份	1,200	45,780.00	0.05
356	001979	招商蛇口	7,000	45,010.00	0.05
357	000895	双汇发展	2,000	44,800.00	0.05
358	00135	昆仑能源	8,000	44,678.21	0.05
359	01209	华润万象生活	1,400	44,601.78	0.05
360	688728	格科微	2,117	44,541.68	0.05
361	01972	太古地产	2,400	42,816.04	0.04
362	601898	中煤能源	3,500	42,630.00	0.04
363	002078	太阳纸业	3,400	42,466.00	0.04
364	03888	金山软件	2,200	42,381.77	0.04
365	09863	零跑汽车	1,400	41,926.65	0.04

366	601319	中国人保	6,200	41,912.00	0.04
367	02618	京东物流	4,100	41,842.40	0.04
368	300866	安克创新	400	41,800.00	0.04
369	300919	中伟新材	940	41,125.00	0.04
370	600023	浙能电力	7,800	41,028.00	0.04
371	601021	春秋航空	900	41,022.00	0.04
372	002252	上海莱士	9,400	40,796.00	0.04
373	688599	天合光能	2,875	40,595.00	0.04
374	00270	粤海投资	6,000	40,439.69	0.04
375	603606	东方电缆	960	39,849.60	0.04
376	601800	中国交建	6,900	39,399.00	0.04
377	600039	四川路桥	5,020	39,256.40	0.04
378	000002	万科 A	13,200	39,072.00	0.04
379	000786	北新建材	2,100	37,989.00	0.04
380	002064	华峰化学	4,000	37,960.00	0.04
381	688223	晶科能源	7,988	37,943.00	0.04
382	06990	科伦博泰生物	100	37,886.15	0.04
383	01929	周大福	4,000	37,868.78	0.04
384	00241	阿里健康	14,000	37,451.88	0.04
385	03998	波司登	10,000	37,173.94	0.04
386	600588	用友网络	4,000	36,720.00	0.04
387	600600	青岛啤酒	700	36,561.00	0.04
388	00285	比亚迪电子	2,000	36,340.13	0.04
389	601633	长城汽车	2,400	36,216.00	0.04
390	603806	福斯特	2,152	36,132.08	0.04
391	00268	金蝶国际	7,000	35,992.71	0.04
392	001965	招商公路	3,900	35,724.00	0.04
393	00151	中国旺旺	12,000	35,332.61	0.04
394	002294	信立泰	1,100	35,079.00	0.04
395	302132	中航成飞	600	34,992.00	0.04
396	600642	申能股份	4,000	34,920.00	0.04
397	601699	潞安环能	2,400	34,272.00	0.03
398	600027	华电国际	7,700	34,265.00	0.03
399	00322	康师傅控股	4,000	33,977.68	0.03
400	601607	上海医药	2,200	33,880.00	0.03
401	300628	亿联网络	1,000	33,820.00	0.03
402	603260	合盛硅业	700	33,782.00	0.03
403	601618	中国中冶	13,800	33,672.00	0.03
404	000983	山西焦煤	5,800	33,640.00	0.03
405	300832	新产业	800	33,600.00	0.03
406	603369	今世缘	1,400	33,194.00	0.03
407	688169	石头科技	346	32,859.62	0.03
408	600061	国投资本	5,000	32,750.00	0.03
409	002459	晶澳科技	4,008	32,464.80	0.03

410	600918	中泰证券	6,100	32,452.00	0.03
411	000617	中油资本	4,900	32,291.00	0.03
412	600025	华能水电	3,600	32,004.00	0.03
413	000958	电投产融	5,600	31,584.00	0.03
414	00004	九龙仓集团	2,000	31,441.51	0.03
415	00960	龙湖集团	6,000	31,163.57	0.03
416	300251	光线传媒	2,800	31,052.00	0.03
417	601216	君正集团	6,900	30,774.00	0.03
418	601059	信达证券	1,900	30,761.00	0.03
419	02259	紫金黄金国际	400	30,746.67	0.03
420	688188	柏楚电子	286	30,516.20	0.03
421	600515	海南机场	11,100	30,414.00	0.03
422	06181	老铺黄金	100	30,086.57	0.03
423	600085	同仁堂	1,300	30,043.00	0.03
424	688187	时代电气	436	29,935.76	0.03
425	00384	中国燃气	6,600	29,693.99	0.03
426	688472	阿特斯	2,738	29,625.16	0.03
427	00780	同程旅行	2,800	29,158.96	0.03
428	000876	新希望	4,600	28,842.00	0.03
429	600803	新奥股份	1,800	28,440.00	0.03
430	02588	中银航空租赁	400	28,227.88	0.03
431	000999	华润三九	1,244	27,977.56	0.03
432	300999	金龙鱼	1,200	27,912.00	0.03
433	600018	上港集团	5,900	27,848.00	0.03
434	603195	公牛集团	706	27,639.90	0.03
435	002939	长城证券	3,300	27,522.00	0.03
436	300122	智飞生物	2,350	27,471.50	0.03
437	600845	宝信软件	1,643	27,323.09	0.03
438	300896	爱美客	300	26,160.00	0.03
439	000708	中信特钢	2,000	25,240.00	0.03
440	300765	石药创新	900	24,507.00	0.02
441	06969	思摩尔国际	4,000	24,388.88	0.02
442	000932	华菱钢铁	7,000	24,290.00	0.02
443	03311	中国建筑国际	4,000	24,215.17	0.02
444	01193	华润燃气	1,900	24,192.59	0.02
445	000987	越秀资本	3,063	23,952.66	0.02
446	000596	古井贡酒	300	23,940.00	0.02
447	688009	中国通号	5,004	23,819.04	0.02
448	601018	宁波港	7,500	23,625.00	0.02
449	02367	巨子生物	1,000	23,016.58	0.02
450	688303	大全能源	1,297	22,606.71	0.02
451	301165	锐捷网络	280	22,526.00	0.02
452	601238	广汽集团	4,300	21,844.00	0.02
453	00144	招商局港口	2,000	21,435.81	0.02

454	02282	美高梅中国	2,400	21,137.03	0.02
455	603392	万泰生物	780	21,036.60	0.02
456	300413	芒果超媒	1,400	20,482.00	0.02
457	09896	名创优品	1,000	20,480.41	0.02
458	001280	中国铀业	300	20,010.00	0.02
459	01876	百威亚太	3,500	18,543.54	0.02
460	601136	首创证券	1,100	15,345.00	0.02
461	300979	华利集团	500	14,875.00	0.02
462	600968	海油发展	4,100	13,653.00	0.01
463	601808	中海油服	1,200	12,972.00	0.01
464	301638	南网数字	500	12,025.00	0.01
465	601061	中信金属	1,100	11,847.00	0.01
466	001391	国货航	2,800	11,396.00	0.01
467	00293	国泰航空	1,000	11,273.78	0.01
468	601298	青岛港	1,400	11,270.00	0.01
469	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01
470	002945	华林证券	600	8,058.00	0.01
471	01364	古茗	400	7,344.46	0.01
472	301656	联合动力	400	6,892.00	0.01
473	09973	奇瑞汽车	300	6,342.15	0.01

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	00700	腾讯控股	506,539.44	0.51
2	09988	阿里巴巴-W	450,982.18	0.46
3	00005	汇丰控股	341,525.31	0.35
4	300308	中际旭创	300,240.00	0.30
5	688525	佰维存储	257,661.25	0.26
6	300502	新易盛	227,834.00	0.23
7	300750	宁德时代	219,219.00	0.22
8	002353	杰瑞股份	177,249.00	0.18
9	00939	建设银行	168,132.79	0.17
9	601939	建设银行	7,705.00	0.01
10	02318	中国平安	118,978.16	0.12
10	601318	中国平安	54,753.00	0.06
11	01299	友邦保险	168,110.47	0.17
12	002602	世纪华通	166,827.00	0.17
13	600519	贵州茅台	155,500.00	0.16
14	600549	厦门钨业	146,159.00	0.15
15	000657	中钨高新	145,174.00	0.15

16	00981	中芯国际	89,298.49	0.09
16	688981	中芯国际	46,714.00	0.05
17	01211	比亚迪股份	66,233.99	0.07
17	002594	比亚迪	62,971.00	0.06
18	01398	工商银行	102,159.32	0.10
18	601398	工商银行	22,236.00	0.02
19	000333	美的集团	100,709.00	0.10
19	00300	美的集团	22,980.80	0.02
20	688041	海光信息	112,326.00	0.11

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	00700	腾讯控股	553,545.46	0.56
2	09988	阿里巴巴-W	432,439.79	0.44
3	00005	汇丰控股	341,302.15	0.34
4	300308	中际旭创	286,459.00	0.29
5	02888	渣打集团	264,914.86	0.27
6	03988	中国银行	237,568.17	0.24
6	601988	中国银行	6,659.00	0.01
7	300750	宁德时代	223,018.00	0.23
8	00011	恒生银行	206,937.13	0.21
9	300502	新易盛	193,776.00	0.20
10	00939	建设银行	178,010.16	0.18
10	601939	建设银行	7,968.00	0.01
11	02318	中国平安	115,051.88	0.12
11	601318	中国平安	56,058.00	0.06
12	01299	友邦保险	162,607.36	0.16
13	601088	中国神华	96,842.00	0.10
13	01088	中国神华	57,817.77	0.06
14	600519	贵州茅台	150,476.00	0.15
15	00981	中芯国际	88,559.33	0.09
15	688981	中芯国际	46,180.00	0.05
16	000333	美的集团	111,342.00	0.11
16	00300	美的集团	22,699.67	0.02
17	01398	工商银行	104,031.51	0.11
17	601398	工商银行	22,375.00	0.02
18	01211	比亚迪股份	66,106.63	0.07
18	002594	比亚迪	55,586.00	0.06
19	03968	招商银行	64,683.98	0.07
19	600036	招商银行	42,422.00	0.04

20	01810	小米集团—W	106,967.21	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	11,631,590.51
卖出股票收入（成交）总额	10,869,027.53

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，中国工商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、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国建设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、中国人民银行的处罚。

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约定的备选股票库。

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	350,818.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	154,648.66
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	565,960.02

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		中国工商银行股份有限公司一易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
528	165,045.81	79,845,188.00	91.62%	7,299,000.00	8.38%	38,151,000.00	43.78%

注：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%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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（2021 年 8 月 3 日）基金份额总额	234,144,188.00
本报告期期初基金份额总额	87,144,188.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	87,144,188.00

§ 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 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡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、基金财产的诉讼事项；本报告期内无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	13,410,513.54	59.82%	1,341.22	59.83%	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	25,576.90	0.11%	2.56	0.11%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	8,980,339.95	40.06%	898.06	40.06%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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

- 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 基金租用或者通过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
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	56,896.18	100.00%	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国联民生证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-13
4	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年因港股通不提供服务	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2026-03-27

	暂停申购、赎回业务的公告	电子披露网站	
5	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
9	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
10	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-26
12	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 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	2026 年 01 月 01 日~2026 年 06 月 30 日	33,000,000.00	0.00	0.00	33,000,000.00	37.87 %
中国工商银行股份有限公司—易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2026 年 01 月 01 日~2026 年 06 月 30 日	40,189,700.00	2,757,400.00	4,796,100.00	38,151,000.00	43.78 %
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五十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会；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.中国证监会准予易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

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

二〇二六年八月三十一日