易方达中证海外中国互联网 50 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：招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。

基金托管人招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 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 44

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 44
7.11 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
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 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 46
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 47
10.8 其他重大事件 54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 55
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 55
§12 备查文件目录 56
12.1 备查文件目录 56
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）
场内简称	中概互联、中概互联网 ETF 易方达
基金主代码	513050
交易代码	513050
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2017 年 1 月 4 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,554,432,720.00 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	2017 年 1 月 18 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进行投资，即参考中证海外中国互联网 50 指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据中证海外中国互联网 50 指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。当市场流动性不足等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品进行替代。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率，本基金可投资指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在 3%以内。
业绩比较基准	中证海外中国互联网 50 指数
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	400-61-95555
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400 881 8088	400-61-95555
传真	020-38798812	0755-83195201
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	510627；510623；519031	518040
法定代表人	吴欣荣	缪建民

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	无	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		无	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		无	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
邮政编码		无	无

2.5 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

2.6 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	432,324,191.67
本期利润	-15,608,206,756.99
加权平均基金份额本期利润	-0.4900

本期加权平均净值利润率	-38.88%
本期基金份额净值增长率	-33.25%
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	-528,484,213.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0158
期末基金资产净值	33,025,948,506.48
期末基金份额净值	0.9842
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	-1.58%

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

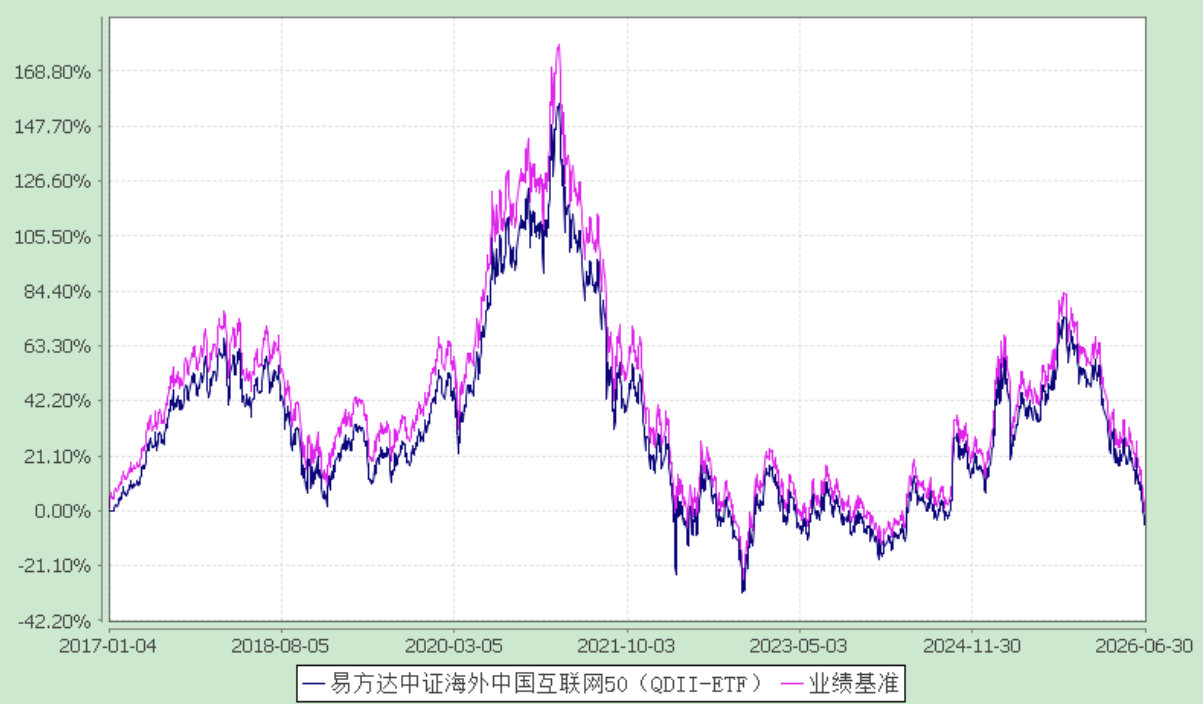
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-16.58%	2.06%	-17.01%	2.05%	0.43%	0.01%
过去六个月	-33.25%	1.95%	-33.36%	1.94%	0.11%	0.01%
过去一年	-28.40%	1.78%	-28.21%	1.78%	-0.19%	0.00%
过去三年	1.72%	1.96%	1.43%	1.96%	0.29%	0.00%
过去五年	-48.97%	2.46%	-50.63%	2.48%	1.66%	-0.02%
过去七年	-18.68%	2.31%	-20.47%	2.34%	1.79%	-0.03%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.58%	2.15%	3.67%	2.17%	-5.25%	-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

易方达中证海外中国互联网 50 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

(2017 年 1 月 4 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		
余海燕	本基金的基金经理，易方达沪深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF 联接、易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF、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	2017-01-04	-	21 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

	（QDII）、易方达中证 500ETF 联接、易方达奥明日经 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、易方达上证 50 指数（LOF）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				有限公司投资发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
刘依姗	本基金的基金经理，易方达奥明日经 225ETF（QDII）、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达恒生港股通汽车主题 ETF、易方达中证港股通医疗主题 ETF、易方达恒生港股通汽车主题 ETF 联接发起式、易方达中证港股通医疗主题 ETF 联接发起式、易方达中证香港证券投资主题（港股通）ETF 的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2025-04-11	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任领航投资香港有限公司项目经理高级助理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理助理、研究员。
李栩	本基金的基金经理助理，易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证 2000ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式（自 2023 年 09 月 19 日至 2026 年 04 月 10 日）、易方达国证信息技术创新主题 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业	2022-09-10	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员、指数投资部总经理助理，易方达

	ETF、易方达上证科创板芯片 ETF 联接发起式、易方达国证新能源电池 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证半导体材料设备主题 ETF、易方达上证科创板芯片 ETF、易方达上证科创板芯片设计主题 ETF、易方达中证电池主题 ETF、易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式、易方达中证电池主题 ETF 联接发起式的基金经理，易方达国证信息技术创新主题 ETF 联接发起式、易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式（自 2024 年 05 月 18 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证 A50ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF 联接发起式、易方达中证半导体材料设备主题 ETF 联接发起式的基金经理助理，指数研究发展部总经理助理				中证物联网主题 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后

监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统中的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证海外中国互联网 50 指数，该指数由中证指数有限公司编制，旨在反映境外上市中国互联网企业的整体表现。中证海外中国互联网 50 指数从在香港及其他海外交易所上市的中国互联网企业中，选取总市值及流动性综合排名最好的 50 家公司，并每半年度定期调整。若同一家公司的国外市场证券和香港市场证券同时入选，则优先纳入香港市场证券。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。

中证海外中国互联网 50 指数的走势，与全球金融条件和中国宏观经济形势以及企业基本面密切相关。回顾 2026 年上半年，全球金融条件方面，美联储 4 次议息会议均决定维持联邦基金利率目标区间在 3.50%至 3.75%之间不变，为连续四次暂停调整利率。利率点阵图显示降息预期持续延后，6 月点阵图显著转鹰，半数票委预计年内存在加息可能。全球范围内，中东地缘冲突升级推升油价，再通胀预期升温，主要经济体货币政策立场趋于收紧、分化加剧。中国宏观经济形势方面，一季度经济在韧性中呈现结构性修复，居民消费价格指数（CPI）同比显著回升，3 月制造业采购经理指数（PMI）重返荣枯线以上；二季度修复动能放缓，工业生产者出厂价格指数（PPI）由负转正但内需偏弱致传导不畅，5 月 PMI 回落至临界点，房地产市场调整压力延续。政策层面，全国两会确立 4.5%–5%经济增长预期目标，积极财政政策加力提效；4 月中央政治局会议明确稳定和增强资本市场信心，着力扩大内需、推动消费升级。总体而言，上半年经济呈现“先修复后转弱”的结构性分化格局，复苏基础仍待巩固，政策协同下边际趋稳态势仍在蓄力。市场表现方面，中概互联网行业受美联储议息表态显著转鹰、降息预期持续延后压制成长股估值中枢、国内内需修复节奏偏弱拖累平台盈利改善、企业 AI 资本开支持续高增引发短期盈利兑现担忧、板块内头部公司业绩修复节奏分化等多重因

素综合影响，本报告期内中证海外中国互联网 50 指数收跌 33.36%。

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。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9842 元，本报告期份额净值增长率为-33.25%，同期业绩比较基准收益率为-33.36%。年化跟踪误差 0.58%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

港股市场走势主要受到国内经济基本面状况和海外流动性环境两方面的共同影响。展望 2026 年下半年，在国内政策“稳中求进”的总基调下，经济有望延续温和修复态势，但内外需、新旧经济的结构性分化仍将延续，港股基本面修复呈现非对称特征，企业盈利温和改善的方向较为明确。全球金融条件方面，美联储降息时点进一步延后，6 月点阵图显著转鹰，高利率存续时间或长于预期，港元在联系汇率制度下持续承压；但全球主要央行宽松周期的大方向尚未根本逆转，若通胀边际回落、地缘冲突阶段性缓和，海外流动性仍有改善窗口。然而，中东局势演变、油价中枢高位及主要经济体增长差异仍构成外部不确定性。政策和资金面方面，在港股上市制度改革深化、“反内卷”政策推进与分红回购力度加大的背景下，优质企业赴港上市有望进一步提升市场资产质量与流动性水平。此外内地与香港互联互通机制的深化将继续引导南向资金流入，为市场提供稳定支撑，但需关注下半年解禁高峰对资金面的阶段性扰动。综合以上因素，港股市场下半年有望呈现震荡修复格局，结构性机会仍存。

中证海外中国互联网 50 指数的成份股是境外上市的中国互联网企业中总市值及流动性综合排名最好的头部公司，是中国数字经济和平台经济领域的代表性企业。伴随未来中国经济的企稳和消费的复苏，中国互联网公司也有望迎来持续、良性的发展局面。在全球指数化投资方兴未艾的今天，中证海外中国互联网 50 指数产品为境内投资者提供跨境投资的桥梁，未来仍将是分享中国科技互联网产业投资机遇的重要工具。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具

备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：易方达中证海外中国互联网 50 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	264,737,014.96	54,791,006.20
结算备付金		51,334,357.76	277,022,439.97
存出保证金		56,898,585.13	50,130,896.24
交易性金融资产	6.4.7.2	32,663,067,995.86	39,468,170,003.11
其中：股票投资		32,663,067,995.86	39,468,170,003.11
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		210,302,813.48	207,316,979.91
应收股利		82,138,501.28	2,084,825.58
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		33,328,479,268.47	40,059,516,151.01
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		19,562.38	172,586,547.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,529,706.75	20,564,292.39
应付托管费		5,843,235.60	6,854,764.15
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	6.4.7.6	279,138,257.26	975,444.98
负债合计		302,530,761.99	200,981,049.50
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	33,554,432,720.00	27,031,432,720.00
未分配利润	6.4.7.8	-528,484,213.52	12,827,102,381.51
净资产合计		33,025,948,506.48	39,858,535,101.51
负债和净资产总计		33,328,479,268.47	40,059,516,151.01

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9842 元，基金份额总额 33,554,432,720.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证海外中国互联网 50 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		-15,447,071,229.87	6,670,919,353.74
1.利息收入		1,116,287.63	2,155,344.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,116,287.63	2,155,344.55
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）		645,550,121.94	1,179,064,097.24
其中：股票投资收益	6.4.7.10	448,142,302.05	843,080,259.38
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-88,964,911.56	52,627,131.87
股利收益	6.4.7.15	286,372,731.45	283,356,705.99
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-16,040,530,948.66	5,557,363,493.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-32,251,253.83	48,749,846.12
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-20,955,436.95	-116,413,428.08
减：二、营业总支出		161,135,527.12	147,517,824.70
1．管理人报酬		119,498,268.78	105,774,528.65
2．托管费		39,832,756.27	36,493,422.35
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.18	-	-

7．税金及附加		52,169.45	322,842.37
8．其他费用	6.4.7.19	1,752,332.62	4,927,031.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-15,608,206,756.99**	**6,523,401,529.04**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-15,608,206,756.99**	**6,523,401,529.04**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		**-15,608,206,756.99**	**6,523,401,529.04**

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证海外中国互联网 50 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	27,031,432,720.00	12,827,102,381.51	39,858,535,101.51
二、本期期初净资产	27,031,432,720.00	12,827,102,381.51	39,858,535,101.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,523,000,000.00	-13,355,586,595.03	-6,832,586,595.03
（一）、综合收益总额	-	-15,608,206,756.99	-15,608,206,756.99
（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）	6,523,000,000.00	2,252,620,161.96	8,775,620,161.96
其中：1.基金申购款	9,555,000,000.00	2,970,201,077.20	12,525,201,077.20
2.基金赎回款	-3,032,000,000.00	-717,580,915.24	-3,749,580,915.24
（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	33,554,432,720.00	-528,484,213.52	33,025,948,506.48
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	31,365,432,720.00	4,969,268,285.85	36,334,701,005.85
二、本期期初净资产	31,365,432,720.00	4,969,268,285.85	36,334,701,005.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,878,000,000.00	4,201,228,075.18	-2,676,771,924.82
（一）、综合收益总额	-	6,523,401,529.04	6,523,401,529.04
（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）	-6,878,000,000.00	-2,322,173,453.86	-9,200,173,453.86
其中：1.基金申购款	1,484,000,000.00	593,382,866.15	2,077,382,866.15
2.基金赎回款	-8,362,000,000.00	-2,915,556,320.01	-11,277,556,320.01
（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	24,487,432,720.00	9,170,496,361.03	33,657,929,081.03

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：齐昕

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证海外中国互联网 50 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[2015]281 号《关于准予易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2194 号《关于易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证海外中国互联网 50 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，《易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 4 日正

式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 301,432,720.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 720.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

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)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》、国务院令第 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。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收企业所得税；

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

(2)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	264,737,014.96
等于：本金	264,714,112.61
加：应计利息	22,902.35
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	264,737,014.96

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		44,784,619,870.16	-	32,663,067,995.86	-12,121,551,874.30
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		44,784,619,870.16	-	32,663,067,995.86	-12,121,551,874.30

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	334,539,726.76	-	-	-
HCTN6	334,539,726.76	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	334,539,726.76	-	-	-

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
HCTN6	HSTECH Futures Jul26	1,731	335,872,975.17	1,333,248.41
合计	-	-	-	1,333,248.41
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,333,248.41
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	414,224.27
其中：交易所市场	414,224.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,550.68

应付替代款	278,633,482.31
合计	279,138,257.26

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	27,031,432,720.00	27,031,432,720.00
本期申购	9,555,000,000.00	9,555,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,032,000,000.00	-3,032,000,000.00
本期末	33,554,432,720.00	33,554,432,720.00

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	-772,247,279.82	13,599,349,661.33	12,827,102,381.51
本期期初	-772,247,279.82	13,599,349,661.33	12,827,102,381.51
本期利润	432,324,191.67	-16,040,530,948.66	-15,608,206,756.99
本期基金份额交易产生的变动数	-87,129,064.76	2,339,749,226.72	2,252,620,161.96
其中：基金申购款	-104,816,234.40	3,075,017,311.60	2,970,201,077.20
基金赎回款	17,687,169.64	-735,268,084.88	-717,580,915.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-427,052,152.91	-101,432,060.61	-528,484,213.52

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	471,361.74
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	643,022.91
其他	1,902.98
合计	1,116,287.63

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	448,142,302.05

股票投资收益——赎回差价收入	-
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	448,142,302.05

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	7,987,016,610.37
减：卖出股票成本总额	7,509,885,313.18
减：交易费用	28,988,995.14
买卖股票差价收入	448,142,302.05

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
期货投资收益	-88,964,911.56

6.4.7.15 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	286,372,731.45
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	286,372,731.45

6.4.7.16 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	-16,041,606,467.84
——股票投资	-16,041,606,467.84

——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	1,075,519.18
——权证投资	-
——期货投资	1,075,519.18
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	-16,040,530,948.66

6.4.7.17 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	-20,955,436.95
合计	-20,955,436.95

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

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	31,043.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	1,050,354.73
银行汇划费	14,588.41
其他	596,838.80
合计	1,752,332.62

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
招商银行股份有限公司	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司	境外托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	119,498,268.78	105,774,528.65
其中：应支付销售机构的客	1,784,907.80	1,261,498.85

户维护费		
应支付基金管理人的净管理费	117,713,360.98	104,513,029.80

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.6%÷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。由基金管理人出具划款指令，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，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	39,832,756.27	36,493,422.35

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%÷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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人出具划款指令，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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	7,379,289,416.00	21.9920%	6,429,434,706.00	23.7850%
广发证券股份有限公司	5,681,428.00	0.0169%	165,760.00	0.0006%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
汇丰银行-活期存款	4,081,340.27	16,851.39	15,886,936.18	196,791.51
招商银行-活期存款	260,655,674.69	454,510.35	36,817,814.89	373,653.95

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司和香港上海汇丰银行有限公司保管，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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（香港）经纪有限公司	1276 HK	恒瑞医药	新股发行	219,800	8,896,867.57
广发证券（香港）经纪有限公司	3288 HK	海天味业	新股发行	41,600	1,380,243.32

注：广发证券（香港）经纪有限公司为本基金管理人股东的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有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 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。

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本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。本基金主要投资境外市场上市的企业，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 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，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金

资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	264,737,014.96	-	-	-	264,737,014.96
结算备付金	51,334,357.76	-	-	-	51,334,357.76
存出保证金	56,898,585.13	-	-	-	56,898,585.13
交易性金融资产	-	-	-	32,663,067,995.86	32,663,067,995.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	210,302,813.48	210,302,813.48
应收股利	-	-	-	82,138,501.28	82,138,501.28
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	372,969,957.85	-	-	32,955,509,310.62	33,328,479,268.47
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	-	-	-	19,562.38	19,562.38
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	17,529,706.75	17,529,706.75
应付托管费	-	-	-	5,843,235.60	5,843,235.60
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	-	-	-	279,138,257.26	279,138,257.26
负债总计	-	-	-	302,530,761.99	302,530,761.99
利率敏感度缺口	372,969,957.85	-	-	32,652,978,548.63	33,025,948,506.48
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	54,791,006.20	-	-	-	54,791,006.20
结算备付金	277,022,439.97	-	-	-	277,022,439.97
存出保证金	50,130,896.24	-	-	-	50,130,896.24
交易性金融资产	-	-	-	39,468,170,003.11	39,468,170,003.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	207,316,979.91	207,316,979.91
应收股利	-	-	-	2,084,825.58	2,084,825.58
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	381,944,342.41	-	-	39,677,571,808.60	40,059,516,151.01
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	-	-	-	172,586,547.98	172,586,547.98
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	20,564,292.39	20,564,292.39
应付托管费	-	-	-	6,854,764.15	6,854,764.15
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	-	-	-	975,444.98	975,444.98
负债总计	-	-	-	200,981,049.50	200,981,049.50
利率敏感度缺口	381,944,342.41	-	-	39,476,590,759.10	39,858,535,101.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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				
货币资金	93,257.03	108,761,256.52	-	108,854,513.55
结算备付金	7,900,664.23	43,426,510.86	-	51,327,175.09
存出保证金	-	56,814,661.15	-	56,814,661.15
交易性金融资产	3,401,364,520.54	29,261,703,475.32	-	32,663,067,995.86

衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	172,184,130.39	-	172,184,130.39
应收股利	12,659,596.57	-	-	12,659,596.57
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	**3,422,018,038.37**	**29,642,890,034.24**	**-**	**33,064,908,072.61**
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	**3,422,018,038.37**	**29,642,890,034.24**	**-**	**33,064,908,072.61**

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				
货币资金	6,600,612.19	165,949.53	-	6,766,561.72
结算备付金	8,063,823.13	117,996,751.36	-	126,060,574.49
存出保证金	-	49,975,392.24	-	49,975,392.24
交易性金融资产	4,107,627,663.18	35,360,542,339.93	-	39,468,170,003.11
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	207,316,979.91	-	207,316,979.91
应收股利	2,084,825.58	-	-	2,084,825.58
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	**4,124,376,924.08**	**35,735,997,412.97**	**-**	**39,860,374,337.05**
以外币计价的负债				
应付清算款	48,212,755.80	-	-	48,212,755.80
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	**48,212,755.80**	**-**	**-**	**48,212,755.80**
资产负债表外汇风险敞口净额	**4,076,164,168.28**	**35,735,997,412.97**	**-**	**39,812,161,581.25**

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-1,653,245,403.63	-1,990,608,079.06
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	1,653,245,403.63	1,990,608,079.06

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	32,663,067,995.86	98.90	39,468,170,003.11	99.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	32,663,067,995.86	98.90	39,468,170,003.11	99.02

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,633,153,399.79	1,973,408,500.15
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,633,153,399.79	-1,973,408,500.15

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	32,663,067,995.86
第二层次	-
第三层次	-
合计	32,663,067,995.86

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	32,663,067,995.86	98.00
	其中：普通股	29,261,703,475.32	87.80
	存托凭证	3,401,364,520.54	10.21
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	316,071,372.72	0.95
8	其他各项资产	349,339,899.89	1.05
9	合计	33,328,479,268.47	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 23,188,045,225.84 元，占净值比例 70.21%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	29,261,703,475.32	88.60
美国	3,401,364,520.54	10.30
合计	32,663,067,995.86	98.90

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	417,557,526.49	1.26
非必需消费品	14,778,527,762.54	44.75
必需消费品	348,691,553.73	1.06
保健	-	-
金融	107,030,294.16	0.32
信息技术	1,757,011,084.90	5.32
电信服务	14,899,043,615.87	45.11
公用事业	-	-
房地产	355,206,158.17	1.08
合计	32,663,067,995.86	98.90

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	28,615,000	10,682,059,335.85	32.34
2	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港证券交易所	中国香港	101,235,792	8,164,147,032.09	24.72
3	PDD Holdings Inc.	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,468,264	2,321,421,556.90	7.03
4	Meituan	美团	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	31,902,490	1,898,060,176.73	5.75
5	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港证券交易所	中国香港	93,480,800	1,757,011,084.90	5.32
6	Netease, Inc.	网易公司	9999 HK	香港证券交易	中国香港	9,900,555	1,740,463,313.95	5.27

				所				
7	JD.com, Inc.	京东集团股份有限公司	9618 HK	香港证券交易所	中国香港	12,930,676	1,114,670,660.00	3.38
8	Baidu, Inc.	百度集团股份有限公司	9888 HK	香港证券交易所	中国香港	11,252,624	1,071,171,936.64	3.24
9	Trip.com Group Limited	携程集团有限公司	9961 HK	香港证券交易所	中国香港	3,372,299	912,679,608.37	2.76
10	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	香港证券交易所	中国香港	15,464,200	558,747,525.86	1.69
11	KE Holdings Inc.	贝壳控股有限公司	2423 HK	香港证券交易所	中国香港	10,888,300	355,206,158.17	1.08
12	Full Truck Alliance Co. Ltd.	满帮集团	YMM US	纽约证券交易所	美国	4,390,456	242,812,008.98	0.74
13	Bilibili Inc.	哔哩哔哩股份有限公司	9626 HK	香港证券交易所	中国香港	1,633,920	186,900,898.15	0.57
14	Jd Health International Inc.	京东健康股份有限公司	6618 HK	香港证券交易所	中国香港	6,526,650	186,160,825.80	0.56
15	Tencent Music Entertainment Group	腾讯音乐娱乐集团	TME US	纽约证券交易所	美国	3,252,143	184,952,673.34	0.56
16	Kanzhun Limited	看准科技有限公司	BZ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,993,531	174,745,517.51	0.53
17	TAL Education Group	好未来教育集团	TAL US	纽约证券交易所	美国	2,493,645	162,536,561.61	0.49
18	Vipshop Holdings Limited	唯品会控股有限公司	VIPS US	纽约证券交易所	美国	1,453,591	131,277,486.61	0.40
19	Kingsoft Corporation Limited	金山软件有限公司	3888 HK	香港证券交易所	中国香港	5,511,600	106,177,881.99	0.32
20	Alibaba	阿里健康	241 HK	香港证	中国香港	32,680,000	87,423,379.12	0.26

	Health Information Technology Limited	信息技术有限公司		券交易所				
21	Tongcheng Travel Holdings Limited	同程旅行控股有限公司	780 HK	香港证券交易所	中国香港	7,080,400	73,734,680.23	0.22
22	Joyy Inc.	欢聚集团	JOYY US	纳斯达克证券交易所	美国	146,151	65,687,755.63	0.20
23	Qfin Holdings, Inc.	奇富科技股份有限公司	QFIN US	纳斯达克证券交易所	美国	507,213	54,616,862.71	0.17
24	ZhongAn Online P&C Insurance Co., Ltd.	众安在线财产保险股份有限公司	6060 HK	香港证券交易所	中国香港	6,705,100	52,413,431.45	0.16
25	Xd Inc.	心动有限公司	2400 HK	香港证券交易所	中国香港	1,236,000	47,771,987.10	0.14
26	China Ruyi Holdings Limited	中国儒意控股有限公司	136 HK	香港证券交易所	中国香港	36,760,000	47,572,568.02	0.14
27	East Buy Holding Limited	东方甄选控股有限公司	1797 HK	香港证券交易所	中国香港	2,351,000	46,107,480.51	0.14
28	Autohome Inc.	汽车之家	ATHM US	纽约证券交易所	美国	351,006	45,494,388.55	0.14
29	Meitu, Inc.	美图公司	1357 HK	香港证券交易所	中国香港	13,762,500	44,825,322.66	0.14
30	China Literature Limited	阅文集团	772 HK	香港证券交易所	中国香港	2,590,400	42,567,955.13	0.13
31	NetEase Cloud Music Inc.	网易云音乐股份有限公司	9899 HK	香港证券交易所	中国香港	439,900	39,315,532.42	0.12
32	Ping An Healthcar	平安健康医疗科技	1833 HK	香港证券交易	中国香港	4,783,500	28,999,868.30	0.09

	e And Technology Company Limited	有限公司		所				
33	Weibo Corporation	微博股份有限公司	WB US	纳斯达克证券交易所	美国	360,379	17,819,708.70	0.05
34	Damai Entertainment Holdings Limited	大麦娱乐控股有限公司	1060 HK	香港证券交易所	中国香港	44,320,000	17,514,831.88	0.05

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	6,771,504,211.99	16.99
2	Tencent Holdings Limited	700 HK	4,522,038,633.76	11.35
3	Xiaomi Corporation	1810 HK	1,022,071,246.27	2.56
4	Meituan	3690 HK	862,195,090.56	2.16
5	PDD Holdings Inc.	PDD US	729,522,914.33	1.83
6	Baidu, Inc.	9888 HK	385,718,062.12	0.97
7	Netease, Inc.	9999 HK	369,052,370.42	0.93
8	JD.com, Inc.	9618 HK	359,037,186.56	0.90
9	Kuaishou Technology	1024 HK	318,197,310.76	0.80
10	Trip.com Group Limited	9961 HK	240,738,117.02	0.60
11	KE Holdings Inc.	2423 HK	165,390,080.24	0.41
12	Bilibili Inc.	9626 HK	140,920,137.19	0.35
13	Jd Health International Inc.	6618 HK	119,035,032.82	0.30
14	Alibaba Health Information Technology Limited	241 HK	74,780,417.49	0.19
15	Meitu, Inc.	1357 HK	55,585,336.82	0.14
16	Tencent Music Entertainment Group	TME US	54,689,852.97	0.14
17	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	54,544,261.77	0.14
18	Tongcheng Travel Holdings	780 HK	51,458,272.46	0.13

	Limited			
19	Xd Inc.	2400 HK	45,829,187.23	0.11
20	China Ruyi Holdings Limited	136 HK	45,108,717.40	0.11

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	4,096,390,722.19	10.28
2	Tencent Holdings Limited	700 HK	1,841,609,009.57	4.62
3	Xiaomi Corporation	1810 HK	458,264,244.99	1.15
4	Meituan	3690 HK	359,394,430.34	0.90
5	Baidu, Inc.	9888 HK	340,690,165.73	0.85
6	JD.com, Inc.	9618 HK	332,169,395.99	0.83
7	Kuaishou Technology	1024 HK	131,811,042.41	0.33
8	KE Holdings Inc.	2423 HK	83,340,161.64	0.21
9	Jd Health International Inc.	6618 HK	63,727,431.36	0.16
10	PDD Holdings Inc.	PDD US	48,805,927.92	0.12
11	Bilibili Inc.	9626 HK	45,270,911.22	0.11
12	Alibaba Health Information Technology Limited	241 HK	33,218,309.13	0.08
13	Netease, Inc.	9999 HK	27,175,602.31	0.07
14	NetEase Cloud Music Inc.	9899 HK	24,784,542.96	0.06
15	Full Truck Alliance Co. Ltd.	YMM US	21,690,033.82	0.05
16	Tongcheng Travel Holdings Limited	780 HK	20,242,569.51	0.05
17	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	19,135,485.17	0.05
18	China Literature Limited	772 HK	9,851,609.62	0.02
19	ZhongAn Online P&C Insurance Co., Ltd.	6060 HK	9,475,468.61	0.02
20	Xd Inc.	2400 HK	6,095,931.04	0.02

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	16,746,389,773.77
卖出收入（成交）总额	7,987,016,610.37

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关

交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	HSTECH Futures Jul26	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”适用于金融资产与金融负债相抵销的情形，故将“其他衍生工具期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为 1,333,248.41 元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，拼多多在报告编制日前一年内曾受到中国国家市场监督管理总局（SAMR）、欧盟委员会（EU Commission）的处罚。携程集团有限公司在本报告期内被国家市场监督管理总局立案调查。

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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额

1	存出保证金	56,898,585.13
2	应收清算款	210,302,813.48
3	应收股利	82,138,501.28
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	349,339,899.89

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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		招商银行股份有限公司－易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数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
443,782	75,610.17	12,104,966,567.00	36.08%	21,449,466,153.00	63.92%	7,379,289,416.00	21.99%

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	182,700.00	0.0005%

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（2017 年 1 月 4 日）基金份额总额	301,432,720.00
本报告期期初基金份额总额	27,031,432,720.00
本报告期基金总申购份额	9,555,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,032,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,554,432,720.00

§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、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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
CLSA Limited	1	548,094,642.39	2.22%	102,349.85	4.01%	-
Huatai Financial Holding(Hong Kong) Limited	1	353,663,868.43	1.43%	69,480.92	2.72%	-
东吴证券	2	1,768,394,063.58	7.15%	176,839.41	6.93%	-
国联民生	2	5,258,268,746.97	21.26%	525,826.88	20.61%	-
华泰证券	3	9,864,572,753.04	39.88%	986,457.20	38.66%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	1,884,155,652.46	7.62%	188,415.59	7.38%	-
UBS Securities Asia Limited	1	562,114,616.17	2.27%	68,382.33	2.68%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	418,052,233.30	1.69%	83,610.46	3.28%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	1,697,382,597.04	6.86%	169,215.26	6.63%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	782,438,685.59	3.16%	99,992.78	3.92%	-
Goldman Sachs	1	1,596,268,525.20	6.45%	80,954.44	3.17%	-
China Galaxy International Securities (HK) Co., Ltd	1	-	-	-	-	-

CMB International Capital Corporation Limited	1	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易账户，新增交易账户的证券经营机构为 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited，新增交易单元的证券公司为财通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司。

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

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

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

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

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

5）价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

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

c）本报告期内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账户的证券经营机构。

2）基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holding(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China	-	-	-	-	-	-	-	-

Merchants Securities (HK) Co Ltd								
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
China Galaxy International Securities (HK) Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International	-	-	-	-	-	-	-	-

Capital Corporation Limited								
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司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	2026-01-05
2	关于旗下部分基金 2026 年 1 月 19 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2026-01-14
3	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	证券时报	2026-01-22

4	易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金午间收盘溢价风险提示公告	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	2026-03-06
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加金融街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	2026-03-20
6	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	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	2026-03-31
7	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
8	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	证券时报	2026-03-31
9	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	证券时报	2026-04-22
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	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	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	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	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	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	2026-06-26
13	易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金午间收盘溢价风险提示公告	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	2026-06-29
14	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 3 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2026-06-30

§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
招商银行股份有限公司－易方达中证海外中国互联网 50 交易	1	2026 年 01 月 01 日~2026 年 06 月 30 日	6,429,434,706.00	1,303,003,910.00	353,149,200.00	7,379,289,416.00	21.99%

型开放式指数证券投资基金联接基金							
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2.《易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3.《易方达中证海外中国互联网 50 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