

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 期末投资目标基金明细	44
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
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	53
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	53

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.13	投资组合报告附注	53
§ 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
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	55
§ 9	开放式基金份额变动	56
§ 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	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
§ 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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金		
基金简称	易方达中证 500ETF 联接		
基金主代码	007028		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 3 月 20 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	1,638,292,163.53 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	易方达中证 500ETF 联接 A	易方达中证 500ETF 联接 C	易方达中证 500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	007028	007029	022913
报告期末下属分级基金的份额总额	993,396,139.71 份	565,102,507.92 份	79,793,515.90 份

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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510580
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 14 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证 500ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。本基金可投资于标的指数成份股、备选成份

	股（含存托凭证），以更好的跟踪业绩比较基准。为更好地实现投资目标，本基金可投资存托凭证。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衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于易方达中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，为更好地实现投资目标，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，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。为更好地实现投资目标，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 500 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国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	中国证券报
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	易方达基金管理有限公司	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

§ 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）		
	易方达中证 500ETF 联接 A	易方达中证 500ETF 联接 C	易方达中证 500ETF 联接 Y
本期已实现收益	82,808,608.50	49,776,912.42	6,456,181.15
本期利润	339,675,144.84	185,944,854.48	21,216,915.25
加权平均基金份额本期利润	0.3632	0.3146	0.3072
本期加权平均净值利润率	18.51%	16.17%	15.64%
本期基金份额净值增长率	21.39%	21.33%	21.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		

	易方达中证 500ETF 联接 A	易方达中证 500ETF 联接 C	易方达中证 500ETF 联接 Y
期末可供分配利润	410,052,432.07	226,500,474.13	32,933,145.94
期末可供分配基金份额利润	0.4128	0.4008	0.4127
期末基金资产净值	2,137,470,176.85	1,206,718,333.63	171,684,249.94
期末基金份额净值	2.1517	2.1354	2.1516
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	易方达中证 500ETF 联接 A	易方达中证 500ETF 联接 C	易方达中证 500ETF 联接 Y
基金份额累计净值增长率	115.17%	113.54%	53.67%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.00%	1.56%	17.61%	1.56%	1.39%	0.00%
过去六个月	21.39%	1.57%	19.93%	1.58%	1.46%	-0.01%
过去一年	53.61%	1.35%	49.68%	1.35%	3.93%	0.00%
过去三年	56.24%	1.40%	48.15%	1.41%	8.09%	-0.01%
过去五年	47.52%	1.28%	31.61%	1.30%	15.91%	-0.02%
过去七年	122.26%	1.28%	78.59%	1.29%	43.67%	-0.01%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	115.17%	1.26%	61.07%	1.31%	54.10%	-0.05%

易方达中证 500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.98%	1.56%	17.61%	1.56%	1.37%	0.00%
过去六个月	21.33%	1.57%	19.93%	1.58%	1.40%	-0.01%
过去一年	53.46%	1.35%	49.68%	1.35%	3.78%	0.00%
过去三年	55.78%	1.40%	48.15%	1.41%	7.63%	-0.01%
过去五年	46.79%	1.28%	31.61%	1.30%	15.18%	-0.02%
过去七年	120.69%	1.28%	78.59%	1.29%	42.10%	-0.01%

过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	113.54%	1.25%	61.07%	1.31%	52.47%	-0.06%

易方达中证 500ETF 联接 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.00%	1.56%	17.61%	1.56%	1.39%	0.00%
过去六个月	21.39%	1.57%	19.93%	1.58%	1.46%	-0.01%
过去一年	53.61%	1.35%	49.68%	1.35%	3.93%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	53.67%	1.33%	48.05%	1.33%	5.62%	0.00%

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

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达中证 500ETF 联接 A

(2019 年 3 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达中证 500ETF 联接 C

(2019 年 3 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达中证 500ETF 联接 Y

(2024 年 12 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日)



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

§ 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、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企 ETF 联接（QDII）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）、易方达奥明日经 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	2019-03-20	-	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。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF（自 2023 年 07 月 11 日至 2026 年 02 月 10 日）、易	2022-12-17	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业

方达上证科创板成长 ETF（自 2023 年 08 月 23 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达上证科创板 100ETF（自 2023 年 11 月 08 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF 的基金经理，指数研究发展部总经理、指数投资决策委员会委员				指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 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 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。

4.3 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

本基金为易方达中证 500ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证 500ETF 跟踪中证 500 指数，该指数由沪深市场中剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后，剔除过去一年日均成交金额排名后 20% 的证券，再选取过去一年日均总市值排名靠前的 500 只证券组成，以综合反映中国沪深市场中小市值公司的整体表现。

2026 年上半年，中国经济在外部环境更趋复杂严峻、全球供应链深度重构与国内结构调整持续深化的大背景下，保持战略定力，宏观政策加力提效、靠前发力，存量政策与增量政策协同共振，推动“两重”“两新”政策扩围落地，加快超长期特别国债与专项债实物工作量形成，经济运行整体延续回升向好、质效双升的良好态势。面对全球贸易壁垒持续升级、地缘政治博弈复杂化，以及国内房地产市场延续筑底调整、部分传统行业经营压力犹存等困难挑战，中国政府坚持稳中求进工作总基调，统筹扩大内需和深化供给侧结构性改革，工业生产保持较强韧性，就业物价总体平稳，消费市场渐进回暖，有效投资稳步扩大，出口结构持续优化，新质生产力加速培育壮大，经济结构优化升级步伐加快。上半年我国 GDP 为 69.6 万亿元，按不变价格计算，同比增长 4.7%，上半年经济增速延续了稳中向好的发展态势，经济高质量发展取得新进展，充分彰显了中国经济的韧性与潜力。上半年宏观经济的平稳运行有效夯实了资本市场的基本面，为 A 股市场平稳运行筑牢了根基，有效提振了市场长期发展信心，为资本市场估值修复、结构优化提供了坚实支撑。同时，国内人工智能、高端芯片、先进制造等领域技术突破持续落地，科技创新产业集群加速成型，海内外投资者对中国硬核科技实力、产业升级潜力的认知持续深化，推动优质中国资产迎来系统性价值重估。

资本市场方面，上半年 A 股市场整体呈现“先抑后扬、震荡上行、结构分化显著”的运行特征，投资者情绪在政策托底与科技突破的双重提振下逐步修复。一季度地缘冲突成为市场最大外部变量，能源与安全主线领涨、高估值成长板块承压；二季度受益于人工智能大模型商业化加速落地及算力基建政策持续催化，科技成长主线持续领涨，人工智能、算力芯片、数字经济、高端装备等科技板块持续走强，成长风格占据市场主导。报告期内，从市场主流指数表现来看，代表科技创新方向的科创 50、科创创业 50、创业板指等成长风格指数在科技行情驱动下表现领先，中证 500、中证 1000 等中小盘指数亦有较好表现，沪深 300 指数表现稳健，而上证 50、中证红利等价值风格指数表现则相对落后。行业层面，受益于 AI 硬件及应用等产业政策密集催化、景气度持续向好的电子、通信等板块表现亮眼；而商贸零售、保险、农林牧渔、食品饮料、房地产链、社会服务等板块受制于需求恢复偏缓及行业周期下行压力，整体表现相对落后。

中证 500 指数作为 A 股中小盘股的代表指数，其行业分布较为均衡，以周期型与成长型行业并重，其收益表现会受到 A 股整体市场走势、市场风格以及不同行业基本面状况的影响。报告期内指数中的电子、通信、机械设备、建筑建材、电力设备、基础化工等行业的成份股涨幅居前，对中证 500 指数收益贡献较大，而计算机、汽车、非银金融、传媒、钢铁等行业的成份股表现不佳。报告期内中证 500 指数上涨 20.97%。

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，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 2.1517 元，本报告期份额净值增长率为 21.39%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；C 类基金份额净值为 2.1354 元，本报告期份额净值增长率为 21.33%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；Y 类基金份额净值为 2.1516 元，本报告期份额净值增长率为 21.39%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。年化跟踪误差 0.73%，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

2026 年上半年，中国经济增速延续了稳中向好的发展态势，经济高质量发展取得新进展，彰显了中国经济的强大韧性。上半年宏观经济的平稳运行为下半年持续健康发展奠定了坚实基础，新质生产力加速培育壮大，人工智能、商业航天、低空经济、人形机器人等前沿领域加速突破，高技术制造业与装备制造业持续领跑，经济转型升级和产业结构优化向纵深推进，为“十五五”良好开局积蓄了充沛动能。展望 2026 年下半年，中国经济高质量发展的态势有望持续巩固，经济增速将继续在全球主要经济体中保持领先。随着宏观政策逆周期与跨周期调节协同发力，已出台的一揽子存量政策和增量政策效果将进一步显现，超长期特别国债与专项债资金加速落地见效，预计下半年基建投资和制造业投资将保持较强韧性，消费市场在居民收入改善与促消费政策扩围加力的双重支撑下有望持续回暖，出口在产业链优势与新兴市场开拓的共同作用下将保持较强竞争力。国内物价水平有望在需求持续修复与基数效应的叠加下实现温和回升，企业盈利空间逐步改善，经济有望彻底走出价格收缩区间。尽管外部环境不确定性依然突出，全球经济复苏乏力、地缘政治博弈复杂化、贸易摩擦反复等因素仍构成扰动，但中国政策“工具箱”储备充足，财政政策、货币政策、产业政策协同发力空间较大，预计下半年宏观政策将继续精准发力、靠前发力，有效对冲外部风险挑战，为经济稳定运行提供坚实保障。新质生产力加速释放也将持续催生新产业、新业态、新经济增长点，为经济高质量发展注入源源不断的内生动力。

资本市场方面，A 股市场在基本面持续修复、政策红利密集释放、流动性环境整体充裕的多重

共振下，有望延续震荡上行格局。下半年，随着美联储降息周期可能开启、全球流动性环境趋于改善，外资回流 A 股市场的动能有望增强，叠加国内中长期资金持续入市，市场资金面整体偏宽松。从结构上看，A 股市场或将延续结构性行情特征，成长与价值风格轮动有望更加均衡。科技成长板块在人工智能商业化加速落地、算力基建持续投入、半导体国产替代深化等因素驱动下，仍有较大演绎空间，但板块内部分化可能加大，具备核心技术突破和真实业绩支撑的优质标的有望胜出；受益于经济复苏预期升温及物价水平温和回升，消费板块中的新消费、医药等细分领域配置价值凸显；顺周期方向，随着稳增长政策持续加码，银行、非银金融等板块估值修复行情仍有空间；高股息红利资产在利率低位环境下仍将受到长期资金青睐。整体而言，在宏观经济平稳运行、产业升级趋势明确、资本市场改革深化推进的背景下，A 股市场有望在下半年走出更加稳健的结构性上涨行情。在中国经济迈向复苏、货币政策宽松、信用环境改善的宏观背景下，中小市值公司有望迎来较强的盈利复苏预期，作为 A 股中小盘股的代表指数，中证 500 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 500ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500ETF 联接 C:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500ETF 联接 Y:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	179,838,457.54	74,449,176.61
结算备付金		16,528,692.88	7,267,212.93
存出保证金		11,369,161.39	3,701,391.41
交易性金融资产	6.4.7.2	3,296,852,531.30	2,044,051,634.98
其中：股票投资		45,553,257.80	32,340.00

基金投资		3,200,654,999.38	1,993,717,788.13
债券投资		50,644,274.12	50,301,506.85
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		7,771,885.01	86,633.85
应收股利		-	-
应收申购款		39,564,724.26	13,397,176.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	618,585.61
资产总计		3,551,925,452.38	2,143,571,811.97
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		3,618,394.11	-
应付赎回款		30,888,608.46	11,506,040.02
应付管理人报酬		34,253.73	16,988.21
应付托管费		11,417.92	5,662.72
应付销售服务费		94,312.16	56,064.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,275,332.58	699,964.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	130,373.00	156,552.89
负债合计		36,052,691.96	12,441,273.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,638,292,163.53	1,205,017,799.27
未分配利润	6.4.7.8	1,877,580,596.89	926,112,739.39
净资产合计		3,515,872,760.42	2,131,130,538.66
负债和净资产总计		3,551,925,452.38	2,143,571,811.97

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.1517 元，C 类基金份额净值 2.1354 元，Y 类基金份额净值 2.1516 元；基金份额总额 1,638,292,163.53 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 993,396,139.71 份，C 类基金份额总额 565,102,507.92 份，Y 类基金份额总额 79,793,515.90 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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		548,025,218.57	96,327,105.70
1.利息收入		322,681.53	251,084.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	322,681.53	251,084.69
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		138,802,683.41	25,333,249.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,000,206.04	74,444.97
基金投资收益	6.4.7.11	131,008,832.50	24,653,513.03
债券投资收益	6.4.7.12	329,767.27	-
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	8,311,663.74	604,994.67
股利收益	6.4.7.15	152,625.94	297.00
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	407,795,212.50	70,651,589.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,104,641.13	91,182.17
减：二、营业总支出		1,188,304.00	608,092.15
1. 管理人报酬		162,677.99	98,116.80
2. 托管费		54,226.03	32,705.56
3. 销售服务费		569,251.26	305,524.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		22,982.23	-
其中：卖出回购金融资产支出		22,982.23	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		299,095.55	90,992.57
8. 其他费用	6.4.7.19	80,070.94	80,752.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		546,836,914.57	95,719,013.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		546,836,914.57	95,719,013.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		546,836,914.57	95,719,013.55
----------	--	----------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	1,205,017,799.27	926,112,739.39	2,131,130,538.66
二、本期期初净资产	1,205,017,799.27	926,112,739.39	2,131,130,538.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	433,274,364.26	951,467,857.50	1,384,742,221.76
（一）、综合收益总额	-	546,836,914.57	546,836,914.57
（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）	433,274,364.26	404,630,942.93	837,905,307.19
其中：1.基金申购款	2,177,824,994.55	2,078,716,325.15	4,256,541,319.70
2.基金赎回款	-1,744,550,630.29	-1,674,085,382.22	-3,418,636,012.51
（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	1,638,292,163.53	1,877,580,596.89	3,515,872,760.42
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	1,695,059,081.11	575,546,215.98	2,270,605,297.09
二、本期期初净资产	1,695,059,081.11	575,546,215.98	2,270,605,297.09
三、本期增减变动额（减少以“-”	-215,184,757.88	13,912,240.36	-201,272,517.52

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	95,719,013.55	95,719,013.55
(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)	-215,184,757.88	-81,806,773.19	-296,991,531.07
其中: 1.基金申购款	431,147,467.19	147,175,315.72	578,322,782.91
2.基金赎回款	-646,332,225.07	-228,982,088.91	-875,314,313.98
(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	1,479,874,323.23	589,458,456.34	2,069,332,779.57

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：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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[2019]187 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,985,764,476.49 份基金份额，其中认购资金利息折合 684,687.28 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、

各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]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 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前,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% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)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。对在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，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	179,838,457.54
等于：本金	179,821,816.12

加：应计利息	16,641.42
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	179,838,457.54

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		43,559,655.65	-	45,553,257.80	1,993,602.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	49,993,627.97	621,274.15	50,644,274.12	29,372.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	49,993,627.97	621,274.15	50,644,274.12	29,372.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,263,016,922.51	-	3,200,654,999.38	937,638,076.87
其他		-	-	-	-
合计		2,356,570,206.13	621,274.15	3,296,852,531.30	939,661,051.02

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	86,637,320.00	-	-	-
IC2609	86,637,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	86,637,320.00	-	-	-

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
IC2609	IC2609	53	92,870,840.00	6,233,520.00
合计	-	-	-	6,233,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	6,233,520.00
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	21,019.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	35,961.74
其中：交易所市场	35,961.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88
合计	130,373.00

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 500ETF 联接 A

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	799,893,919.70	799,893,919.70
本期申购	826,682,093.39	826,682,093.39
本期赎回（以“-”号填列）	-633,179,873.38	-633,179,873.38
本期末	993,396,139.71	993,396,139.71

易方达中证 500ETF 联接 C

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	383,997,968.44	383,997,968.44
本期申购	1,258,718,892.19	1,258,718,892.19
本期赎回（以“-”号填列）	-1,077,614,352.71	-1,077,614,352.71
本期末	565,102,507.92	565,102,507.92

易方达中证 500ETF 联接 Y

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	21,125,911.13	21,125,911.13
本期申购	92,424,008.97	92,424,008.97
本期赎回（以“-”号填列）	-33,756,404.20	-33,756,404.20
本期末	79,793,515.90	79,793,515.90

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达中证 500ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	261,797,125.31	356,158,727.71	617,955,853.02
本期期初	261,797,125.31	356,158,727.71	617,955,853.02
本期利润	82,808,608.50	256,866,536.34	339,675,144.84
本期基金份额交易产生的变动数	65,446,698.26	120,996,341.02	186,443,039.28
其中：基金申购款	292,698,458.45	508,129,918.42	800,828,376.87
基金赎回款	-227,251,760.19	-387,133,577.40	-614,385,337.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	410,052,432.07	734,021,605.07	1,144,074,037.14

易方达中证 500ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,694,038.32	170,143,307.95	291,837,346.27
本期期初	121,694,038.32	170,143,307.95	291,837,346.27
本期利润	49,776,912.42	136,167,942.06	185,944,854.48
本期基金份额交易产生的变动数	55,029,523.39	108,804,101.57	163,833,624.96
其中：基金申购款	428,015,884.40	761,928,609.91	1,189,944,494.31
基金赎回款	-372,986,361.01	-653,124,508.34	-1,026,110,869.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	226,500,474.13	415,115,351.58	641,615,825.71

易方达中证 500ETF 联接 Y

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,913,366.49	9,406,173.61	16,319,540.10
本期期初	6,913,366.49	9,406,173.61	16,319,540.10
本期利润	6,456,181.15	14,760,734.10	21,216,915.25
本期基金份额交易产生的变动数	19,563,598.30	34,790,680.39	54,354,278.69
其中：基金申购款	31,950,328.77	55,993,125.20	87,943,453.97
基金赎回款	-12,386,730.47	-21,202,444.81	-33,589,175.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,933,145.94	58,957,588.10	91,890,734.04

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	248,042.84
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	73,752.69
其他	886.00
合计	322,681.53

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	-402,038.66
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-598,167.38
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,000,206.04

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	182,727,986.46
减：卖出股票成本总额	182,901,772.08
减：交易费用	228,253.04
买卖股票差价收入	-402,038.66

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	1,144,602,560.00
减：现金支付申购款总额	610,792,779.59
减：申购股票成本总额	534,407,947.79
减：交易费用	-
申购差价收入	-598,167.38

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	545,820,647.12
减：卖出/赎回基金成本总额	412,541,568.76
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	2,242,909.34
减：交易费用	27,336.52
基金投资收益	131,008,832.50

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	329,767.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	329,767.27

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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
股指期货投资收益	8,311,663.74

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	152,625.94
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	152,625.94

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	403,617,012.50
——股票投资	1,993,587.45
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——基金投资	401,623,425.05
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	4,178,200.00
——权证投资	-
——期货投资	4,178,200.00
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	407,795,212.50

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	1,104,641.13
合计	1,104,641.13

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	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	3.83
银行汇划费	6,675.23
合计	80,070.94

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

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		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	
	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	833,620,362.45	100.00%	118,014.00	0.27%

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	90,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期基金交易 成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易 成交总额的比例
广发证券	382,748,026.19	100.00%	-	-

6.4.10.1.6 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	83,364.39	100.00%	35,961.74	100.00%
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
广发证券	11.81	0.27%	5.68	0.43%

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	162,677.99	98,116.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	953,617.37	599,603.38
应支付基金管理人的净管理费	-790,939.38	-501,486.58

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理费每日计算，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。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	54,226.03	32,705.56

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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

基金托管费每日计算，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达中证500ETF 联接A	易方达中证500ETF 联接C	易方达中证500ETF 联接Y	合计
易方达基金管理有限	-	60,803.56	-	60,803.56

公司				
中国工商银行	-	10,466.54	-	10,466.54
广发证券	-	675.95	-	675.95
易方达财富	-	5,502.33	-	5,502.33
合计	-	77,448.38	-	77,448.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达中证500ETF 联接A	易方达中证500ETF 联接C	易方达中证500ETF 联接Y	合计
易方达基金管理有限公司	-	50,592.66	-	50,592.66
中国工商银行	-	4,923.99	-	4,923.99
广发证券	-	930.39	-	930.39
合计	-	56,447.04	-	56,447.04

注：本基金 A 类基金份额、Y 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，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。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			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		
	易方达中证500ETF联接A	易方达中证500ETF联接C	易方达中证500ETF联接Y	易方达中证500ETF联接A	易方达中证500ETF联接C	易方达中证500ETF联接Y
报告期初持有的基金份额	-	-	-	10,000,500.00	-	-
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	-	-	-	10,000,500.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-	-

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

易方达中证 500ETF 联接 A

无。

易方达中证 500ETF 联接 C

无。

易方达中证 500ETF 联接 Y

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	179,838,457.54	248,042.84	118,393,658.90	219,044.24

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

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
广发证券股份有限公司	920189	康美特	新股发行	200	1,628.00
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
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 677,487,670 份和 517,969,860 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 73.85%和 68.54%。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证 500ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500ETF 联接 C

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500ETF 联接 Y

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
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
92018	康美	2026-0	1 个月	新股	8.14	8.14	200	1,628.	1,628.	-

9	特	6-30	以内	流通受限				00	00	
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月以内	新股流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	130	13,000.00	13,000.14	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 ETF 联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于易方达中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 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	50,631,273.98	50,301,506.85
合计	50,631,273.98	50,301,506.85

- 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	上年度末

	2026年6月30日	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	13,000.14	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	13,000.14	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。

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	179,838,457.54	-	-	-	179,838,457.54
结算备付金	16,528,692.88	-	-	-	16,528,692.88
存出保证金	11,369,161.39	-	-	-	11,369,161.39
交易性金融资产	50,631,273.98	-	13,000.14	3,246,208,257.18	3,296,852,531.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,771,885.01	7,771,885.01
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	39,564,724.26	39,564,724.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	258,367,585.79	-	13,000.14	3,293,544,866.45	3,551,925,452.38
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	-	-	-	3,618,394.11	3,618,394.11
应付赎回款	-	-	-	30,888,608.46	30,888,608.46
应付管理人报酬	-	-	-	34,253.73	34,253.73
应付托管费	-	-	-	11,417.92	11,417.92
应付销售服务费	-	-	-	94,312.16	94,312.16
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,275,332.58	1,275,332.58
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	130,373.00	130,373.00
负债总计	-	-	-	36,052,691.96	36,052,691.96
利率敏感度缺口	258,367,585.79	-	13,000.14	3,257,492,174.49	3,515,872,760.42

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	74,449,176.61	-	-	-	74,449,176.61
结算备付金	7,267,212.93	-	-	-	7,267,212.93
存出保证金	3,701,391.41	-	-	-	3,701,391.41
交易性金融资产	50,301,506.85	-	-	1,993,750,128.13	2,044,051,634.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	86,633.85	86,633.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,397,176.58	13,397,176.58
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	618,585.61	618,585.61
资产总计	135,719,287.80	-	-	2,007,852,524.17	2,143,571,811.97
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,506,040.02	11,506,040.02
应付管理人报酬	-	-	-	16,988.21	16,988.21
应付托管费	-	-	-	5,662.72	5,662.72
应付销售服务费	-	-	-	56,064.61	56,064.61
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	699,964.86	699,964.86
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	156,552.89	156,552.89
负债总计	-	-	-	12,441,273.31	12,441,273.31
利率敏感度缺口	135,719,287.80	-	-	1,995,411,250.86	2,131,130,538.66

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

假设	除市场利率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.市场利率下降 25 个基点	8,482.31	69,743.70
	2.市场利率上升 25 个基点	-8,471.08	-69,609.17

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	45,553,257.80	1.30	32,340.00	0.00
交易性金融资产—基金投资	3,200,654,999.38	91.03	1,993,717,788.13	93.55
交易性金融资产—债券投资	13,000.14	0.00	-	-
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	3,246,221,257.32	92.33	1,993,750,128.13	93.55

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%	170,519,189.92	102,649,107.58
	2.业绩比较基准下降 5%	-170,519,189.92	-102,649,107.58

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	3,246,198,289.18
第二层次	50,654,242.12
第三层次	-
合计	3,296,852,531.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	45,553,257.80	1.28
	其中：股票	45,553,257.80	1.28
2	基金投资	3,200,654,999.38	90.11
3	固定收益投资	50,644,274.12	1.43
	其中：债券	50,644,274.12	1.43
	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	196,367,150.42	5.53
8	其他各项资产	58,705,770.66	1.65
9	合计	3,551,925,452.38	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产 净值比例
----	------	------	------	-----	---------	---------------

						(%)
1	易方达中证 500 交易型 开放式指数 证券投资基金	股票型	交易型开 放式 (ETF)	易方达基金管理 有限公司	3,200,654,999.38	91.03

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	156,068.00	0.00
B	采矿业	2,309,277.00	0.07
C	制造业	31,216,347.00	0.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,007,792.00	0.06
E	建筑业	443,887.00	0.01
F	批发和零售业	602,682.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	901,287.00	0.03
H	住宿和餐饮业	104,342.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,873,239.20	0.08
J	金融业	3,890,843.60	0.11
K	房地产业	344,152.00	0.01
L	租赁和商务服务业	137,982.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	177,150.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	98,252.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	289,957.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	45,553,257.80	1.30

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
----	------	------	-------	------	---------------

1	688347	华虹宏力	5,800	1,950,540.00	0.06
2	688120	华海清科	5,800	1,868,644.00	0.05
3	600378	昊华科技	15,100	1,138,238.00	0.03
4	600141	兴发集团	22,700	1,066,219.00	0.03
5	688002	睿创微纳	5,800	897,202.00	0.03
6	600498	烽火通信	12,000	883,200.00	0.03
7	688777	中控技术	5,800	681,500.00	0.02
8	688313	仕佳光子	3,600	664,740.00	0.02
9	688578	艾力斯	5,800	633,360.00	0.02
10	688213	思特威	5,800	621,006.00	0.02
11	688099	晶晨股份	5,800	596,820.00	0.02
12	600879	航天电子	26,100	555,669.00	0.02
13	688469	芯联集成	50,000	530,500.00	0.02
14	688676	金盘科技	5,800	490,912.00	0.01
15	600105	永鼎股份	7,200	485,856.00	0.01
16	688172	燕东微	5,800	485,228.00	0.01
17	603256	宏和科技	1,800	477,594.00	0.01
18	600988	赤峰黄金	17,400	457,968.00	0.01
19	605358	立昂微	5,800	450,080.00	0.01
20	600392	盛和资源	14,500	431,665.00	0.01
21	688385	复旦微电	5,800	413,482.00	0.01
22	600601	方正科技	29,700	411,048.00	0.01
23	600885	宏发股份	11,600	400,084.00	0.01
24	601179	中国西电	26,100	389,412.00	0.01
25	605589	圣泉集团	5,800	368,706.00	0.01
26	688122	西部超导	5,800	364,298.00	0.01
27	600497	驰宏锌锗	29,700	359,667.00	0.01
28	600157	永泰能源	215,200	346,472.00	0.01
29	603659	璞泰来	11,600	335,588.00	0.01
30	600909	华安证券	29,700	329,967.00	0.01
31	600143	金发科技	21,000	324,450.00	0.01
32	600352	浙江龙盛	26,100	316,071.00	0.01
33	601233	桐昆股份	14,500	313,925.00	0.01
34	601555	东吴证券	38,400	304,128.00	0.01
35	603179	新泉股份	5,800	287,970.00	0.01
36	688387	信科移动	14,500	287,680.00	0.01
37	603156	养元饮品	5,800	284,606.00	0.01
38	603650	彤程新材	2,900	284,142.00	0.01
39	601108	财通证券	32,600	281,990.00	0.01
40	688065	凯赛生物	5,800	277,530.00	0.01
41	601198	东兴证券	20,300	275,877.00	0.01
42	601991	大唐发电	37,700	266,916.00	0.01
43	688187	时代电气	3,600	247,176.00	0.01
44	600707	彩虹股份	14,500	244,905.00	0.01

45	600060	海信视像	8,700	242,469.00	0.01
46	688297	中无人机	5,800	240,990.00	0.01
47	603606	东方电缆	5,800	240,758.00	0.01
48	688568	中科星图	5,800	240,526.00	0.01
49	603688	石英股份	2,900	239,569.00	0.01
50	601665	齐鲁银行	41,300	238,301.00	0.01
51	601162	天风证券	70,300	236,911.00	0.01
52	600884	杉杉股份	17,400	235,770.00	0.01
53	603345	安井食品	2,900	232,551.00	0.01
54	600109	国金证券	26,100	229,158.00	0.01
55	601099	太平洋	67,400	227,138.00	0.01
56	689009	九号公司	5,800	221,270.00	0.01
57	601696	中银证券	17,400	220,110.00	0.01
58	603379	三美股份	2,900	220,081.00	0.01
59	600021	上海电力	14,500	218,515.00	0.01
60	603308	应流股份	3,600	217,440.00	0.01
61	600711	盛屯矿业	19,800	217,206.00	0.01
62	600298	安琪酵母	5,800	209,960.00	0.01
63	601016	节能风电	53,800	208,744.00	0.01
64	601577	长沙银行	23,900	208,169.00	0.01
65	601128	常熟银行	35,580	207,075.60	0.01
66	688599	天合光能	14,500	204,740.00	0.01
67	688166	博瑞医药	5,800	203,058.00	0.01
68	601615	明阳智能	17,400	201,318.00	0.01
69	688728	格科微	9,400	197,776.00	0.01
70	688180	君实生物	5,800	196,156.00	0.01
71	603806	福斯特	11,600	194,764.00	0.01
72	600699	均胜电子	8,700	188,007.00	0.01
73	600171	上海贝岭	5,800	185,252.00	0.01
74	603160	汇顶科技	2,900	178,959.00	0.01
75	600642	申能股份	20,300	177,219.00	0.01
76	603728	鸣志电器	2,900	176,668.00	0.01
77	600177	雅戈尔	23,200	174,696.00	0.00
78	603605	珀莱雅	2,900	173,768.00	0.00
79	603920	世运电路	3,600	172,944.00	0.00
80	603979	金诚信	2,900	171,187.00	0.00
81	603225	新凤鸣	8,700	170,955.00	0.00
82	600637	东方明珠	20,300	168,693.00	0.00
83	600521	华海药业	11,600	167,040.00	0.00
84	601699	潞安环能	11,600	165,648.00	0.00
85	600516	方大炭素	26,800	165,356.00	0.00
86	603087	甘李药业	2,900	164,604.00	0.00
87	600536	中国软件	5,800	163,096.00	0.00
88	600985	淮北矿业	11,600	162,980.00	0.00

89	601717	中创智领	11,600	161,356.00	0.00
90	600499	科达制造	11,600	160,080.00	0.00
91	600862	中航高科	8,700	156,861.00	0.00
92	600369	西南证券	38,400	154,368.00	0.00
93	600312	平高电气	8,700	153,642.00	0.00
94	601958	金钼股份	5,400	151,794.00	0.00
95	601001	晋控煤业	8,700	151,293.00	0.00
96	601212	白银有色	29,700	150,876.00	0.00
97	600863	华能蒙电	31,900	149,930.00	0.00
98	600765	中航重机	11,600	149,872.00	0.00
99	600873	梅花生物	20,300	149,205.00	0.00
100	601997	贵阳银行	29,000	148,770.00	0.00
101	603486	科沃斯	2,900	147,175.00	0.00
102	600486	扬农化工	2,900	147,030.00	0.00
103	603699	纽威股份	2,900	145,870.00	0.00
104	601216	君正集团	32,600	145,396.00	0.00
105	688538	和辉光电	55,800	145,080.00	0.00
106	603596	伯特利	5,800	144,072.00	0.00
107	600737	中粮糖业	11,600	143,028.00	0.00
108	603077	和邦生物	61,600	142,912.00	0.00
109	600256	广汇能源	28,800	142,272.00	0.00
110	600704	物产中大	29,700	140,184.00	0.00
111	688561	奇安信	5,800	139,084.00	0.00
112	603298	杭叉集团	5,800	138,388.00	0.00
112	603766	隆鑫通用	11,600	138,388.00	0.00
114	600153	建发股份	17,400	137,982.00	0.00
115	601990	南京证券	21,000	137,970.00	0.00
116	600166	福田汽车	47,100	137,061.00	0.00
117	603568	伟明环保	8,700	133,806.00	0.00
118	600901	江苏金租	23,200	133,400.00	0.00
119	600348	华阳股份	17,400	133,110.00	0.00
120	600578	京能电力	20,300	130,935.00	0.00
121	600332	白云山	6,500	130,260.00	0.00
122	600435	北方导航	11,600	129,920.00	0.00
123	603816	顾家家居	5,800	129,688.00	0.00
124	601611	中国核建	11,600	129,340.00	0.00
125	688772	珠海冠宇	6,500	127,595.00	0.00
126	600398	海澜之家	23,900	124,997.00	0.00
127	601000	唐山港	29,700	123,255.00	0.00
128	603338	浙江鼎力	2,900	123,250.00	0.00
129	603341	龙旗科技	2,900	123,221.00	0.00
130	600562	国睿科技	5,800	123,076.00	0.00
131	600008	首创环保	44,200	120,224.00	0.00
132	600132	重庆啤酒	2,900	119,770.00	0.00

133	603119	浙江荣泰	1,800	119,412.00	0.00
134	600483	福能股份	11,600	118,204.00	0.00
135	600170	上海建工	52,900	117,438.00	0.00
136	600208	衢州发展	41,300	116,879.00	0.00
137	600535	天士力	8,700	115,101.00	0.00
138	601106	中国一重	34,800	114,840.00	0.00
139	600977	中国电影	8,700	112,404.00	0.00
140	600998	九州通	23,900	112,091.00	0.00
141	600282	南钢股份	23,900	109,701.00	0.00
142	600820	隧道股份	21,000	109,410.00	0.00
143	600380	健康元	11,600	109,272.00	0.00
144	600329	达仁堂	2,900	107,938.00	0.00
145	600995	南网储能	8,700	107,010.00	0.00
146	600390	五矿资本	23,200	105,792.00	0.00
147	600583	海油工程	21,000	105,630.00	0.00
148	600754	锦江酒店	5,800	104,342.00	0.00
149	603939	益丰药房	5,800	104,284.00	0.00
150	601666	平煤股份	14,500	103,675.00	0.00
151	600546	山煤国际	9,400	102,742.00	0.00
152	601399	国机重装	29,000	101,500.00	0.00
153	600595	中孚实业	18,000	101,160.00	0.00
154	601880	辽港股份	73,200	101,016.00	0.00
155	600316	洪都航空	3,600	100,584.00	0.00
156	600100	同方股份	14,400	98,640.00	0.00
157	600763	通策医疗	2,900	98,252.00	0.00
158	601567	三星电气	6,500	97,110.00	0.00
159	603885	吉祥航空	9,400	96,726.00	0.00
160	600967	内蒙一机	8,700	94,395.00	0.00
161	600816	建元信托	38,400	93,696.00	0.00
162	601156	东航物流	5,800	93,496.00	0.00
163	600602	云赛智联	5,800	93,264.00	0.00
164	603565	中谷物流	9,400	92,214.00	0.00
165	600906	财达证券	12,300	91,758.00	0.00
166	601865	福莱特	8,700	91,437.00	0.00
167	600801	华新建材	5,800	90,480.00	0.00
168	601155	新城控股	8,700	89,262.00	0.00
169	600126	杭钢股份	14,500	88,885.00	0.00
170	600970	中材国际	12,300	87,699.00	0.00
171	600095	湘财股份	11,600	87,348.00	0.00
172	603833	欧派家居	2,900	87,319.00	0.00
173	603233	大参林	5,800	87,174.00	0.00
174	601608	中信重工	18,100	86,337.00	0.00
175	603000	人民网	5,800	85,782.00	0.00
176	601118	海南橡胶	17,400	85,608.00	0.00

177	601866	中远海发	38,400	84,864.00	0.00
178	603858	步长制药	5,800	84,680.00	0.00
179	603658	安图生物	2,900	84,158.00	0.00
180	600871	石化油服	41,300	83,839.00	0.00
181	600131	国网信通	5,717	83,468.20	0.00
182	600655	豫园股份	20,300	83,433.00	0.00
183	600161	天坛生物	7,200	83,376.00	0.00
184	600517	国网英大	17,400	81,432.00	0.00
185	600582	天地科技	17,400	77,430.00	0.00
186	601928	凤凰传媒	8,700	76,473.00	0.00
187	600511	国药股份	2,900	75,516.00	0.00
188	601598	中国外运	15,200	75,392.00	0.00
189	600685	中船防务	2,900	73,776.00	0.00
190	600038	中直股份	2,900	73,341.00	0.00
191	600663	陆家嘴	11,600	72,848.00	0.00
192	600598	北大荒	6,500	70,460.00	0.00
193	603737	三棵树	2,920	70,372.00	0.00
194	600098	广州发展	11,600	68,556.00	0.00
195	600004	白云机场	9,400	68,244.00	0.00
196	600968	海油发展	20,300	67,599.00	0.00
197	603589	口子窖	3,600	67,248.00	0.00
198	601966	玲珑轮胎	6,500	66,235.00	0.00
199	600848	上海临港	8,700	65,163.00	0.00
200	600566	济川药业	2,900	64,351.00	0.00
201	601098	中南传媒	6,500	63,960.00	0.00
202	600295	鄂尔多斯	5,800	62,176.00	0.00
203	600688	上海石化	21,000	61,530.00	0.00
204	601236	红塔证券	9,000	61,380.00	0.00
205	688425	铁建重工	15,200	61,104.00	0.00
206	603899	晨光股份	2,900	59,827.00	0.00
207	600808	马钢股份	23,900	59,750.00	0.00
208	603529	爱玛科技	2,900	56,579.00	0.00
209	688349	三一重能	3,600	54,648.00	0.00
210	600363	联创光电	1,500	53,670.00	0.00
211	600339	中油工程	17,400	53,418.00	0.00
212	600764	中国海防	2,900	50,547.00	0.00
213	601139	深圳燃气	8,700	49,242.00	0.00
214	600062	华润双鹤	2,900	46,516.00	0.00
215	600032	浙江新能	6,500	45,825.00	0.00
216	601298	青岛港	5,400	43,470.00	0.00
217	600292	电投水电	3,600	43,344.00	0.00
218	600377	宁沪高速	3,600	41,652.00	0.00
219	601228	广州港	14,500	40,890.00	0.00
220	600350	山东高速	3,600	40,068.00	0.00

221	601808	中海油服	3,600	38,916.00	0.00
222	601019	山东出版	5,800	37,120.00	0.00
223	600927	永安期货	2,900	36,105.00	0.00
224	601112	振石股份	1,800	32,814.00	0.00
225	600299	安迪苏	2,900	22,765.00	0.00
226	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
227	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
228	920189	康美特	200	1,628.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688525	佰维存储	15,128,444.10	0.71
2	688347	华虹宏力	13,012,762.97	0.61
3	600487	亨通光电	11,623,586.00	0.55
4	688002	睿创微纳	9,634,741.64	0.45
5	600879	航天电子	9,231,335.33	0.43
6	600988	赤峰黄金	9,025,603.00	0.42
7	600549	厦门钨业	8,807,403.00	0.41
8	688578	艾力斯	7,933,173.85	0.37
9	688213	思特威	7,854,926.87	0.37
10	688676	金盘科技	7,656,313.10	0.36
11	688099	晶晨股份	7,482,034.91	0.35
12	601168	西部矿业	6,925,378.00	0.32
13	600118	中国卫星	6,913,330.00	0.32
14	688777	中控技术	6,708,235.32	0.31
15	688122	西部超导	6,551,220.52	0.31
16	600580	卧龙电驱	6,366,142.00	0.30
17	688385	复旦微电	6,209,987.12	0.29
18	600498	烽火通信	5,812,968.00	0.27
19	601179	中国西电	5,666,908.00	0.27
20	688568	中科星图	5,434,997.56	0.26

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688525	佰维存储	6,081,042.85	0.29
2	600487	亨通光电	5,990,077.00	0.28
3	688347	华虹宏力	4,480,423.58	0.21

4	688002	睿创微纳	3,010,162.12	0.14
5	600549	厦门钨业	2,587,552.00	0.12
6	600988	赤峰黄金	2,359,774.00	0.11
7	600879	航天电子	2,285,428.00	0.11
8	688099	晶晨股份	2,233,989.41	0.10
9	688213	思特威	2,128,843.49	0.10
10	688777	中控技术	2,105,715.85	0.10
11	688578	艾力斯	2,072,392.50	0.10
12	688676	金盘科技	1,981,721.56	0.09
13	601168	西部矿业	1,884,152.00	0.09
14	600673	东阳光	1,832,173.00	0.09
15	600118	中国卫星	1,820,075.00	0.09
16	600498	烽火通信	1,702,256.00	0.08
17	601179	中国西电	1,611,955.00	0.08
18	600580	卧龙电驱	1,589,512.00	0.07
19	603228	景旺电子	1,510,095.00	0.07
20	688385	复旦微电	1,495,394.27	0.07

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

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	651,389,777.22
卖出股票收入（成交）总额	182,727,986.46

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

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	50,631,273.98	1.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	13,000.14	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,644,274.12	1.44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019785	25 国债 13	500,000	50,631,273.98	1.44
2	111025	圣泉转债	130	13,000.14	0.00

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,369,161.39
2	应收清算款	7,771,885.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,564,724.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,705,770.66

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达中证 500ETF 联接 A	179,018	5,549.14	8,359,261.04	0.84%	985,036,878.67	99.16%
易方达中证	82,249	6,870.63	60,761,103.54	10.75%	504,341,404.38	89.25%

500ETF 联接 C						
易方达中证 500ETF 联接 Y	18,709	4,264.98	0.00	0.00%	79,793,515.90	100.00 %
合计	279,976	5,851.55	69,120,364.58	4.22%	1,569,171,798.95	95.78%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达中证 500ETF 联接 A	340,432.60	0.0343%
	易方达中证 500ETF 联接 C	25,014.29	0.0044%
	易方达中证 500ETF 联接 Y	241,629.39	0.3028%
	合计	607,076.28	0.0371%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达中证 500ETF 联接 A	0~10
	易方达中证 500ETF 联接 C	0
	易方达中证 500ETF 联接 Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 500ETF 联接 A	0~10
	易方达中证 500ETF 联接 C	0
	易方达中证 500ETF 联接 Y	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	10,000,500.00	0.6104%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,500.00	0.6104%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500ETF 联接 A	易方达中证 500ETF 联接 C	易方达中证 500ETF 联接 Y
基金合同生效日 (2019 年 3 月 20 日) 基金份额总额	449,197,322.09	1,536,567,154.40	-
本报告期期初基金份额总额	799,893,919.70	383,997,968.44	21,125,911.13
本报告期基金总申购份额	826,682,093.39	1,258,718,892.19	92,424,008.97
减：本报告期基金总赎回份额	633,179,873.38	1,077,614,352.71	33,756,404.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	993,396,139.71	565,102,507.92	79,793,515.90

§ 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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	833,620,362.45	100.00%	83,364.39	100.00%	-
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	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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		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
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	90,000,000.00	100.00%	-	-	382,748,026.19	100.00%
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
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	中国证券报	2026-01-22
4	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2026-03-23

	迁移安排的联合提示性公告	电子披露网站	
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	中国证券报	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	中国证券报	2026-04-22
9	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
10	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
11	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
12	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

§ 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、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