

易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	14
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末投资目标基金明细	46
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62
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	62
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	62
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	62

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.13	投资组合报告附注	62
§ 8	基金份额持有人信息	64
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9	开放式基金份额变动	65
§ 10	重大事件揭示	65
10.1	基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4	基金投资策略的改变	66
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	66
10.8	其他重大事件	68
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
§ 12	备查文件目录	70
12.1	备查文件目录	70
12.2	存放地点	70
12.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	易方达中证 A500ETF 联接		
基金主代码	022459		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 11 日		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,055,614,599.44 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 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	022459	022460	022930
报告期末下属分级基金的份额总额	3,035,880,119.89 份	1,692,095,781.09 份	327,638,698.46 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159361
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 19 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	交通银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证 A500ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证 A500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票（含存托凭证）投资策略、债券和货币市场工具投资策略、衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业

	务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 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目标 ETF 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标的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，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。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，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	方圆
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38798812	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18 号

	珠海市横琴新区荣粤道188号6层	
邮政编码	510627; 510623; 519031	200336
法定代表人	吴欣荣	任德奇

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 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
本期已实现收益	108,930,910.27	73,182,633.25	12,076,114.00
本期利润	409,188,993.53	254,473,684.06	43,299,153.93
加权平均基金份额本期利润	0.1585	0.1433	0.1529
本期加权平均净值利润率	12.25%	11.13%	11.82%
本期基金份额净值增长率	12.23%	12.12%	12.23%
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 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
期末可供分配利润	344,630,456.19	185,387,301.30	37,184,260.73
期末可供分配基金份额利润	0.1135	0.1096	0.1135
期末基金资产净值	4,193,959,967.09	2,329,892,901.91	452,610,027.00
期末基金份额净值	1.3815	1.3769	1.3814
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
基金份额累计净值增长率	38.15%	37.69%	38.13%

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 A500ETF 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	14.49%	1.33%	13.54%	1.34%	0.95%	-0.01%
过去六个月	12.23%	1.22%	11.34%	1.22%	0.89%	0.00%
过去一年	37.05%	1.08%	34.41%	1.09%	2.64%	-0.01%
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	38.15%	1.04%	28.42%	1.07%	9.73%	-0.03%

易方达中证 A500ETF 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	14.42%	1.33%	13.54%	1.34%	0.88%	-0.01%
过去六个月	12.12%	1.22%	11.34%	1.22%	0.78%	0.00%
过去一年	36.77%	1.08%	34.41%	1.09%	2.36%	-0.01%
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	37.69%	1.04%	28.42%	1.07%	9.27%	-0.03%

易方达中证 A500ETF 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	14.48%	1.33%	13.54%	1.34%	0.94%	-0.01%
过去六个月	12.23%	1.22%	11.34%	1.22%	0.89%	0.00%
过去一年	37.04%	1.08%	34.41%	1.09%	2.63%	-0.01%
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	38.13%	1.06%	33.93%	1.06%	4.20%	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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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 A500ETF 联接 A

(2024 年 11 月 11 日至 2026 年 6 月 30 日)



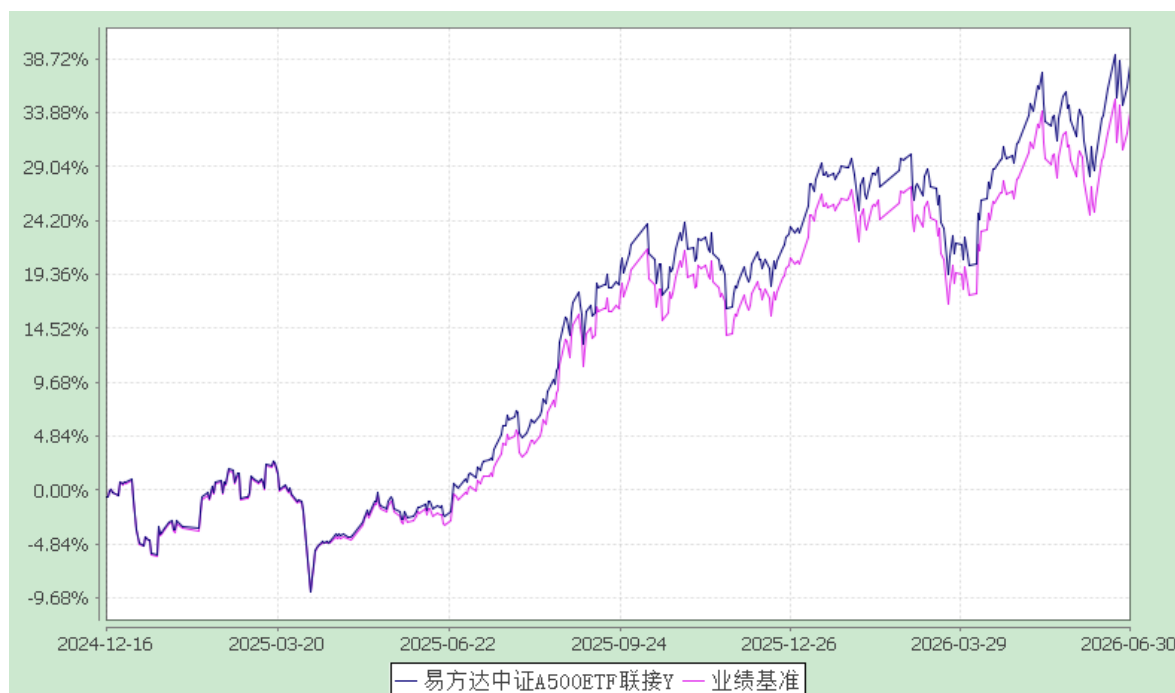
易方达中证 A500ETF 联接 C

(2024 年 11 月 11 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达中证 A500ETF 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		
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 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF（自 2023 年 07 月 11 日至 2026 年 02 月 10 日）、易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、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	2024-11-11	-	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。
张湛	本基金的基金经理助理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50ETF 联接、易方	2024-12-07	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达中证新能源 ETF、易方达中证内地低碳经济主题

达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接、易方达中证医疗 ETF 联接、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、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、易方达国证港股通科技 ETF 的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII)、易方达上证科创板 100ETF (自 2023 年 12 月 02 日至 2026 年 01 月 05 日)、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式 (自 2024 年 08 月 31 日至 2026 年 01 月 05 日)、易方达创业板 ETF、易方达中证 A500ETF、易方达中证 A50 增强策略 ETF 的基金经理助理				ETF、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证新能源 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 A500ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达中证 A500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证 A500ETF 跟踪中证 A500 指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。

2026 年上半年，A 股市场在全球宏观环境与国内政策调控的双重影响下，走出了一波结构分化显著的行情。从全球宏观背景来看，年初市场延续复苏与降息交易的乐观预期，但随后地缘政治冲突引发的油价波动对全球风险资产形成阶段性冲击。进入二季度，随着地缘局势缓和，市场焦点重新回到产业基本面，AI 产业趋势成为全球资本市场的核心主线。结构上，科技板块成为上半年最亮眼的方向，成交活跃度持续攀升，市场关注度高度集中，成交占比已接近历史极值水平。但值得注意的是，本轮科技行情并非单纯的估值扩张，而是有着较为扎实的基本面支撑，上市公司盈利兑现度较高，工业企业利润数据也印证了这一趋势。与此同时，市场内部呈现明显的 K 型分化。以 TMT 为代表的科技成长方向景气度最高，上游资源品次之，中游制造与公用事业居中，消费板块表现相对偏弱。整体来看，上半年 A 股在政策引导下保持了稳健运行，结构性机会突出，但随着部分板块估值与交易拥挤度升至高位，市场风险也在逐步累积，后续行情的演绎将更加依赖基本面的持续验证。受众多因素影响，中证 A500 指数 2026 年上半年上涨 11.91%。

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 1.3815 元，本报告期份额净值增长率为 12.23%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；C 类基金份额净值为 1.3769 元，本报告期份额净值增长率为 12.12%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；Y 类基金份额净值为 1.3814 元，本报告期份额净值增长率为 12.23%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。年化跟踪误差 0.36%，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

在基本面修复、政策支持、估值相对低位的三重支撑下，2026 年下半年 A 股市场有望走出行情扩散、稳步回升的态势。一是经济基本面稳步修复，企业盈利边际改善。经过前期深度调整，我国经济已逐步走出底部区间，多数行业景气度回升，企业经营状况持续向好，盈利能力稳步修复。以人工智能、半导体为代表的科技制造领域产业趋势明确，相关产业链保持较高景气水平，为市场提供了坚实的业绩支撑。与此同时，传统制造业、消费服务等领域也呈现温和复苏态势，经济内生动力不断增强，整体向好的基本面为资本市场运行奠定了稳固基础。二是政策环境持续优化，制度红利不断释放。稳增长政策持续发力，财政与货币政策协同配合，在扩大有效需求、支持科技创新、防范化解风险等方面发挥了积极作用。资本市场改革纵深推进，制度体系不断完善，市场生态持续优化，投资者信心稳步恢复。下半年随着各项政策措施落地见效，政策效应将进一步显现，为市场平稳健康发展提供有力保障。三是整体估值处于低位，修复空间较为充足。经历前期调整后，市场整体估值水平已回落至历史相对低位，安全边际显著提升，下行空间有限。各类风险因素已得到较为充分的释放，市场情绪处于底部区域，随着积极因素逐步积累，市场有望迎来估值修复行情。同时，前期市场结构性分化较为显著，下半年有望呈现更为均衡的发展格局，更多板块将迎来投资机会。

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业绩比较基准的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

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 A500ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 A500ETF 联接 C:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 A500ETF 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，基金托管人在易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，易方达基金管理有限公司在易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	365,996,784.64	303,179,097.79

结算备付金		20,791,220.16	15,771,961.18
存出保证金		9,603,126.13	4,877,779.93
交易性金融资产	6.4.7.2	6,603,226,837.85	4,917,033,682.43
其中：股票投资		137,559,694.51	78,022,074.24
基金投资		6,415,010,594.86	4,788,776,704.08
债券投资		50,656,548.48	50,234,904.11
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		7,923,314.53	62,958,383.60
应收股利		-	-
应收申购款		44,490,761.88	52,629,153.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	6,415,471.70	2,257,497.00
资产总计		7,058,447,516.89	5,358,707,555.80
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		45,001,662.88	-
应付清算款		2,159,690.20	152,578.47
应付赎回款		32,803,625.15	195,205,535.46
应付管理人报酬		71,742.46	58,774.65
应付托管费		23,914.15	19,591.56
应付销售服务费		368,328.85	347,876.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,420,376.48	1,796,452.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	135,280.72	218,489.30
负债合计		81,984,620.89	197,799,297.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,055,614,599.44	4,196,503,452.83
未分配利润	6.4.7.8	1,920,848,296.56	964,404,805.27
净资产合计		6,976,462,896.00	5,160,908,258.10
负债和净资产总计		7,058,447,516.89	5,358,707,555.80

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.3815 元，C 类基金份额净值 1.3769 元，Y 类基金份额净值 1.3814 元；基金份额总额 5,055,614,599.44 份，下属分级基金的份额总额分别为：

A 类基金份额总额 3,035,880,119.89 份，C 类基金份额总额 1,692,095,781.09 份，Y 类基金份额总额 327,638,698.46 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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		710,500,634.00	135,173,474.09
1.利息收入		639,703.82	712,249.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	639,703.82	712,249.98
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）		196,144,419.56	24,961,591.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	17,005,069.87	-438,481.87
基金投资收益	6.4.7.11	170,817,990.03	28,354,463.91
债券投资收益	6.4.7.12	341,500.85	4,577.58
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	6,640,082.86	-4,516,203.46
股利收益	6.4.7.15	1,339,775.95	1,557,235.33
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	512,772,174.00	109,292,029.25
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	944,336.62	207,603.37
减：二、营业总支出		3,538,802.48	3,762,505.82
1. 管理人报酬		389,712.08	360,986.18
2. 托管费		129,904.00	120,328.70
3. 销售服务费		2,264,037.54	3,110,989.41
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		32,689.77	-
其中：卖出回购金融资产支出		32,689.77	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		639,075.33	89,817.77
8. 其他费用	6.4.7.19	83,383.76	80,383.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		706,961,831.52	131,410,968.27

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		706,961,831.52	131,410,968.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		706,961,831.52	131,410,968.27

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	4,196,503,452.83	964,404,805.27	5,160,908,258.10
二、本期期初净资产	4,196,503,452.83	964,404,805.27	5,160,908,258.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	859,111,146.61	956,443,491.29	1,815,554,637.90
（一）、综合收益总额	-	706,961,831.52	706,961,831.52
（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）	859,111,146.61	249,481,659.77	1,108,592,806.38
其中：1.基金申购款	4,805,251,155.80	1,408,840,776.34	6,214,091,932.14
2.基金赎回款	-3,946,140,009.19	-1,159,359,116.57	-5,105,499,125.76
（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	5,055,614,599.44	1,920,848,296.56	6,976,462,896.00
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	6,501,100,071.41	-51,286,786.10	6,449,813,285.31

二、本期期初净资产	6,501,100,071.41	-51,286,786.10	6,449,813,285.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,260,055,877.67	89,820,851.20	-1,170,235,026.47
（一）、综合收益总额	-	131,410,968.27	131,410,968.27
（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）	-1,260,055,877.67	-41,590,117.07	-1,301,645,994.74
其中：1.基金申购款	2,814,404,825.61	-64,195,065.39	2,750,209,760.22
2.基金赎回款	-4,074,460,703.28	22,604,948.32	-4,051,855,754.96
（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	5,241,044,193.74	38,534,065.10	5,279,578,258.84

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 A500 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[2024]1440 号《关于准予易方达中证 A500 指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 A500 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 A500 指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,989,966,558.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,844,619.99 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

自 2024 年 11 月 20 日起，易方达中证 A500 指数证券投资基金变更为易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》, 中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰, 由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 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。

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	365,996,784.64

等于：本金	365,967,349.50
加：应计利息	29,435.14
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	365,996,784.64

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		116,502,212.63	-	137,559,694.51	21,057,481.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	21,999.95	0.58	22,000.53	-
	银行间市场	49,901,150.00	624,547.95	50,634,547.95	108,850.00
	合计	49,923,149.95	624,548.53	50,656,548.48	108,850.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		5,203,623,107.12	-	6,415,010,594.86	1,211,387,487.74
其他		-	-	-	-
合计		5,370,048,469.70	624,548.53	6,603,226,837.85	1,232,553,819.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	73,135,120.00	-	-	-
IC2607	20,677,000.00	-	-	-
IF2607	35,224,320.00	-	-	-
IF2609	17,233,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	73,135,120.00	-	-	-

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
IC2607	IC2607	12	21,427,680.00	750,680.00
IF2607	IF2607	24	35,438,400.00	214,080.00
IF2609	IF2609	12	17,459,280.00	225,480.00
合计	-	-	-	1,190,240.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,190,240.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	6,415,471.70
待摊费用	-
合计	6,415,471.70

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	5,925.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	54,971.57
其中：交易所市场	54,409.07
银行间市场	562.50
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	135,280.72

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 A500ETF 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	2,313,790,728.77	2,313,790,728.77
本期申购	2,875,523,843.21	2,875,523,843.21
本期赎回（以“-”号填列）	-2,153,434,452.09	-2,153,434,452.09
本期末	3,035,880,119.89	3,035,880,119.89

易方达中证 A500ETF 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	1,700,545,661.71	1,700,545,661.71
本期申购	1,712,523,304.34	1,712,523,304.34
本期赎回（以“-”号填列）	-1,720,973,184.96	-1,720,973,184.96
本期末	1,692,095,781.09	1,692,095,781.09

易方达中证 A500ETF 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	182,167,062.35	182,167,062.35
本期申购	217,204,008.25	217,204,008.25
本期赎回（以“-”号填列）	-71,732,372.14	-71,732,372.14
本期末	327,638,698.46	327,638,698.46

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 A500ETF 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	164,128,416.10	370,260,232.86	534,388,648.96
本期期初	164,128,416.10	370,260,232.86	534,388,648.96
本期利润	108,930,910.27	300,258,083.26	409,188,993.53
本期基金份额交易产生的变动数	71,571,129.82	142,931,074.89	214,502,204.71
其中：基金申购款	267,789,658.48	584,831,970.76	852,621,629.24
基金赎回款	-196,218,528.66	-441,900,895.87	-638,119,424.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	344,630,456.19	813,449,391.01	1,158,079,847.20

易方达中证 A500ETF 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	116,268,044.44	271,681,040.04	387,949,084.48
本期期初	116,268,044.44	271,681,040.04	387,949,084.48
本期利润	73,182,633.25	181,291,050.81	254,473,684.06
本期基金份额交易产生的变动数	-4,063,376.39	-562,271.33	-4,625,647.72
其中：基金申购款	147,142,686.17	347,240,151.03	494,382,837.20
基金赎回款	-151,206,062.56	-347,802,422.36	-499,008,484.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	185,387,301.30	452,409,819.52	637,797,120.82

易方达中证 A500ETF 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	12,916,862.30	29,150,209.53	42,067,071.83
本期期初	12,916,862.30	29,150,209.53	42,067,071.83

本期利润	12,076,114.00	31,223,039.93	43,299,153.93
本期基金份额交易产生的变动数	12,191,284.43	27,413,818.35	39,605,102.78
其中：基金申购款	19,049,907.70	42,786,402.20	61,836,309.90
基金赎回款	-6,858,623.27	-15,372,583.85	-22,231,207.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,184,260.73	87,787,067.81	124,971,328.54

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	519,494.63
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	98,906.32
其他	21,302.87
合计	639,703.82

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	10,612,599.69
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	6,392,470.18
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	17,005,069.87

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	60,087,171.01
减：卖出股票成本总额	49,263,290.26
减：交易费用	211,281.06
买卖股票差价收入	10,612,599.69

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	1,991,477,100.00

减：现金支付申购款总额	1,032,947,630.98
减：申购股票成本总额	952,136,998.84
减：交易费用	-
申购差价收入	6,392,470.18

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	1,105,541,802.60
减：卖出/赎回基金成本总额	929,542,729.34
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	5,126,186.60
减：交易费用	54,896.63
基金投资收益	170,817,990.03

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	344,644.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,143.52
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	341,500.85

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,719,379.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,718,135.16
减：应计利息总额	4,319.25
减：交易费用	68.51
买卖债券差价收入	-3,143.52

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	6,640,082.86

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	1,339,775.95
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,339,775.95

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	512,378,104.00
——股票投资	11,542,206.30
——债券投资	55,000.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	500,780,897.70
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	394,070.00
——权证投资	-
——期货投资	394,070.00
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	512,772,174.00

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	944,336.62
合计	944,336.62

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	9,000.00
合计	83,383.76

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
交通银行股份有限公司	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 A500 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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,987,200.68	0.18%	191,098.00	0.07%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	198.74	0.18%	182.50	0.34%
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	19.10	0.07%	5.64	0.07%

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	389,712.08	360,986.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,933,604.89	1,885,844.37
应支付基金管理人的净管理费	-1,543,892.81	-1,524,858.19

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 为调整后的前一日的基金资产净值。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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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	129,904.00	120,328.70

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 为调整后的前一日的基金资产净值。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 A500ETF联接A	易方达中证 A500ETF联接C	易方达中证 A500ETF联接Y	合计

易方达基金管理有限公司	-	60,046.59	-	60,046.59
交通银行	-	659,089.00	-	659,089.00
广发证券	-	3,365.24	-	3,365.24
易方达财富	-	7,379.77	-	7,379.77
合计	-	729,880.60	-	729,880.60
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 A500ETF联接A	易方达中证 A500ETF联接C	易方达中证 A500ETF联接Y	合计
易方达基金管理有限公司	-	59,564.98	-	59,564.98
交通银行	-	1,876,284.60	-	1,876,284.60
广发证券	-	2,665.64	-	2,665.64
合计	-	1,938,515.22	-	1,938,515.22

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 0.20%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

易方达中证 A500ETF 联接 A

无。

易方达中证 A500ETF 联接 C

无。

易方达中证 A500ETF 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
交通银行-活期存款	365,996,784.64	519,494.63	301,037,194.39	576,390.68

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
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
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

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 4,680,781,171 份和 3,942,028,897 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 24.72%和 14.14%。本基金在报告期内因赎回目标 ETF 基金份额而持有托管人交通银行发行的 A 股交通银行。于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有交通银行发行的 A 股交通银行 111,300 股（2025 年 12 月 31 日：111,300 股），占本基金净值比例为 0.01%（2025 年 12 月 31 日：0.02%）。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证 A500ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 A500ETF 联接 C

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 A500ETF 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
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

				受限						
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
60328	林平	2026-0	6 个月	新股	37.88	34.87	46	1,742.	1,604.	-

4	发展	2-03		流通受限				48	02	
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-

688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
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	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月以内	新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
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	-
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.39	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(股)	成本总额	估值总额	
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	851	361,021.03	748,480.03	-

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 45,001,662.88 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
250431	25 农发 31	2026-07-14	101.27	474,000	48,001,551.46
合计				474,000	48,001,551.46

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

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目标 ETF 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标的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	50,634,547.95	50,234,904.11
合计	50,634,547.95	50,234,904.11

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	22,000.53	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	22,000.53	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	365,996,784.64	-	-	-	365,996,784.64
结算备付金	20,791,220.16	-	-	-	20,791,220.16

存出保证金	9,603,126.13	-	-	-	9,603,126.13
交易性金融资产	50,634,547.95	-	22,000.53	6,552,570,289.37	6,603,226,837.85
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,923,314.53	7,923,314.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	44,490,761.88	44,490,761.88
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	6,415,471.70	6,415,471.70
资产总计	447,025,678.88	-	22,000.53	6,611,399,837.48	7,058,447,516.89
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	45,001,662.88	-	-	-	45,001,662.88
应付清算款	-	-	-	2,159,690.20	2,159,690.20
应付赎回款	-	-	-	32,803,625.15	32,803,625.15
应付管理人报酬	-	-	-	71,742.46	71,742.46
应付托管费	-	-	-	23,914.15	23,914.15
应付销售服务费	-	-	-	368,328.85	368,328.85
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,420,376.48	1,420,376.48
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	135,280.72	135,280.72
负债总计	45,001,662.88	-	-	36,982,958.01	81,984,620.89
利率敏感度缺口	402,024,016.00	-	22,000.53	6,574,416,879.47	6,976,462,896.00
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	303,179,097.79	-	-	-	303,179,097.79

					9
结算备付金	15,771,961.18	-	-	-	15,771,961.18
存出保证金	4,877,779.93	-	-	-	4,877,779.93
交易性金融资产	50,234,904.11	-	-	4,866,798,778.32	4,917,033,682.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	62,958,383.60	62,958,383.60
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	52,629,153.87	52,629,153.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,257,497.00	2,257,497.00
资产总计	374,063,743.01	-	-	4,984,643,812.79	5,358,707,555.80
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	-	-	-	152,578.47	152,578.47
应付赎回款	-	-	-	195,205,535.46	195,205,535.46
应付管理人报酬	-	-	-	58,774.65	58,774.65
应付托管费	-	-	-	19,591.56	19,591.56
应付销售服务费	-	-	-	347,876.03	347,876.03
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,796,452.23	1,796,452.23
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	218,489.30	218,489.30
负债总计	-	-	-	197,799,297.70	197,799,297.70
利率敏感度缺口	374,063,743.01	-	-	4,786,844,515.09	5,160,908,258.10

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	22,226.80	83,463.91
	2.市场利率上升 25 个基点	-22,207.08	-83,185.97

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	137,559,694.51	1.97	78,022,074.24	1.51
交易性金融资产—基金投资	6,415,010,594.86	91.95	4,788,776,704.08	92.79
交易性金融资产—债券投资	22,000.53	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	6,552,592,289.90	93.92	4,866,798,778.32	94.30

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%	344,346,009.69	232,318,524.24
	2.业绩比较基准下降 5%	-344,346,009.69	-232,318,524.24

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	6,534,919,102.58
第二层次	52,265,287.95
第三层次	16,042,447.32
合计	6,603,226,837.85

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	137,559,694.51	1.95
	其中：股票	137,559,694.51	1.95
2	基金投资	6,415,010,594.86	90.88
3	固定收益投资	50,656,548.48	0.72
	其中：债券	50,656,548.48	0.72
	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	386,788,004.80	5.48
8	其他各项资产	68,432,674.24	0.97
9	合计	7,058,447,516.89	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 A500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	6,415,010,594.86	91.95

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	294,696.64	0.00
B	采矿业	5,674,025.82	0.08
C	制造业	97,783,767.08	1.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,944,668.44	0.06
E	建筑业	1,718,873.00	0.02
F	批发和零售业	965,000.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,161,580.46	0.05
H	住宿和餐饮业	67,648.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,040,980.78	0.10
J	金融业	13,141,153.72	0.19
K	房地产业	698,657.61	0.01
L	租赁和商务服务业	785,058.20	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,565,665.50	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	186,796.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27,360.00	0.00
Q	卫生和社会工作	176,774.66	0.00
R	文化、体育和娱乐业	64,220.00	0.00
S	综合	262,768.00	0.00
	合计	137,559,694.51	1.97

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	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.11
2	600519	贵州茅台	2,700	3,200,823.00	0.05
3	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.04
4	300750	宁德时代	7,600	2,986,876.00	0.04
5	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.04
6	300308	中际旭创	1,924	2,443,480.00	0.04

7	603986	兆易创新	2,900	2,363,500.00	0.03
8	300502	新易盛	3,800	2,306,600.00	0.03
9	601318	中国平安	45,800	2,186,492.00	0.03
10	688256	寒武纪	1,351	2,155,588.05	0.03
11	600036	招商银行	53,200	1,888,600.00	0.03
12	601899	紫金矿业	70,900	1,782,426.00	0.03
13	002371	北方华创	1,900	1,680,664.00	0.02
14	600183	生益科技	9,200	1,595,280.00	0.02
15	688008	澜起科技	4,930	1,527,807.00	0.02
16	688012	中微公司	3,223	1,509,975.50	0.02
17	688041	海光信息	3,998	1,480,459.40	0.02
18	600900	长江电力	52,600	1,392,322.00	0.02
19	688981	中芯国际	8,599	1,365,693.18	0.02
20	603259	药明康德	10,600	1,319,806.00	0.02
21	600030	中信证券	42,000	1,206,660.00	0.02
22	601166	兴业银行	72,800	1,205,568.00	0.02
23	600176	中国巨石	15,100	1,100,488.00	0.02
24	000333	美的集团	13,415	1,013,234.95	0.01
25	600276	恒瑞医药	19,200	999,168.00	0.01
26	002384	东山精密	3,800	996,930.00	0.01
27	601398	工商银行	139,100	983,437.00	0.01
28	002475	立讯精密	13,300	936,320.00	0.01
29	600487	亨通光电	8,500	929,390.00	0.01
30	601211	国泰海通	48,600	884,520.00	0.01
31	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
32	000725	京东方 A	93,200	808,976.00	0.01
33	688498	源杰科技	427	805,322.00	0.01
34	688525	佰维存储	1,622	802,452.06	0.01
35	301308	江波龙	1,100	774,180.00	0.01
36	601288	农业银行	123,600	750,252.00	0.01
37	688072	拓荆科技	851	748,480.03	0.01
38	601328	交通银行	111,300	715,659.00	0.01
39	600522	中天科技	11,700	709,956.00	0.01
40	603019	中科曙光	6,300	675,549.00	0.01
41	688521	芯原股份	1,809	671,392.26	0.01
42	300059	东方财富	32,344	659,170.72	0.01
43	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.01
44	603993	洛阳钼业	37,500	658,125.00	0.01
45	600150	中国船舶	19,416	656,066.64	0.01
46	600887	伊利股份	27,200	651,712.00	0.01
47	300604	长川科技	1,900	648,698.00	0.01
48	600584	长电科技	6,200	642,010.00	0.01
49	300408	三环集团	3,800	634,220.00	0.01
50	300274	阳光电源	3,820	607,456.40	0.01

51	002594	比亚迪	7,600	605,720.00	0.01
52	600549	厦门钨业	7,000	596,400.00	0.01
53	688347	华虹宏力	1,753	589,533.90	0.01
54	002463	沪电股份	3,800	580,640.00	0.01
55	601816	京沪高铁	126,200	571,686.00	0.01
56	300394	天孚通信	1,868	565,406.24	0.01
57	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
58	600309	万华化学	8,100	554,121.00	0.01
59	002916	深南电路	1,200	549,480.00	0.01
60	688120	华海清科	1,702	548,350.36	0.01
61	600111	北方稀土	10,900	523,745.00	0.01
62	300857	协创数据	1,500	509,850.00	0.01
63	600000	浦发银行	57,300	493,353.00	0.01
64	600089	特变电工	21,700	488,250.00	0.01
65	002281	光迅科技	1,900	488,186.00	0.01
66	601857	中国石油	55,700	483,476.00	0.01
67	300223	北京君正	1,900	472,910.00	0.01
68	601088	中国神华	11,800	460,672.00	0.01
69	600031	三一重工	25,500	440,640.00	0.01
70	000651	格力电器	11,400	427,500.00	0.01
71	000858	五粮液	5,700	421,800.00	0.01
72	300475	香农芯创	1,400	420,000.00	0.01
73	601601	中国太保	14,700	419,244.00	0.01
74	600460	士兰微	7,300	399,018.00	0.01
75	600406	国电南瑞	17,300	395,305.00	0.01
76	601668	中国建筑	88,800	385,392.00	0.01
77	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.01
78	300124	汇川技术	5,700	378,081.00	0.01
79	000338	潍柴动力	13,324	363,079.00	0.01
80	601919	中远海控	27,000	358,020.00	0.01
81	601872	招商轮船	20,300	356,671.00	0.01
82	601988	中国银行	61,600	352,352.00	0.01
83	000988	华工科技	1,900	350,759.00	0.01
84	600660	福耀玻璃	6,900	348,036.00	0.00
85	601728	中国电信	66,800	346,692.00	0.00
86	601012	隆基绿能	26,100	342,432.00	0.00
87	603501	豪威集团	3,600	341,460.00	0.00
88	601225	陕西煤业	16,700	339,845.00	0.00
89	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
90	600941	中国移动	3,900	335,907.00	0.00
91	002028	思源电气	1,900	328,700.00	0.00
92	600690	海尔智家	16,100	328,601.00	0.00
93	002415	海康威视	9,500	324,900.00	0.00
94	688777	中控技术	2,722	319,835.00	0.00

95	601985	中国核电	35,400	319,662.00	0.00
96	002851	麦格米特	1,900	317,642.00	0.00
97	603799	华友钴业	6,500	313,690.00	0.00
98	300033	同花顺	1,300	313,300.00	0.00
99	000100	TCL 科技	53,200	309,624.00	0.00
100	300757	罗博特科	500	309,500.00	0.00
101	600160	巨化股份	5,800	307,458.00	0.00
102	300433	蓝思科技	5,700	305,862.00	0.00
103	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
104	002353	杰瑞股份	1,900	289,750.00	0.00
105	002156	通富微电	3,800	288,306.00	0.00
106	002008	大族激光	1,900	285,209.00	0.00
107	688126	沪硅产业	7,106	283,458.34	0.00
108	600362	江西铜业	6,500	281,450.00	0.00
109	601600	中国铝业	34,100	280,302.00	0.00
110	600938	中国海油	10,300	279,645.00	0.00
111	600028	中国石化	62,700	279,642.00	0.00
112	000063	中兴通讯	7,600	275,044.00	0.00
113	605589	圣泉集团	4,300	273,351.00	0.00
114	300661	圣邦股份	1,900	272,612.00	0.00
115	601766	中国中车	52,300	271,960.00	0.00
116	600050	中国联通	67,200	268,800.00	0.00
117	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
118	002714	牧原股份	7,600	265,924.00	0.00
119	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
120	300760	迈瑞医疗	1,900	258,077.00	0.00
121	601628	中国人寿	7,200	254,520.00	0.00
122	300395	菲利华	1,900	254,087.00	0.00
123	300567	精测电子	800	254,080.00	0.00
124	688002	睿创微纳	1,617	250,133.73	0.00
125	002050	三花智控	5,700	249,831.00	0.00
126	002460	赣锋锂业	3,800	248,520.00	0.00
127	000001	平安银行	24,700	248,235.00	0.00
128	601100	恒立液压	2,300	247,388.00	0.00
129	300014	亿纬锂能	3,800	247,114.00	0.00
130	600879	航天电子	11,400	242,706.00	0.00
131	601179	中国西电	16,100	240,212.00	0.00
132	603288	海天味业	7,200	238,752.00	0.00
133	601006	大秦铁路	51,200	236,032.00	0.00
134	601658	邮储银行	47,400	233,682.00	0.00
135	002230	科大讯飞	5,700	232,788.00	0.00
136	688017	绿的谐波	552	230,658.72	0.00
137	605117	德业股份	2,172	230,622.96	0.00
138	688469	芯联集成	21,629	229,483.69	0.00

139	000792	盐湖股份	7,600	229,444.00	0.00
140	600905	三峡能源	61,500	228,165.00	0.00
141	300136	信维通信	1,900	226,575.00	0.00
142	600489	中金黄金	12,500	225,625.00	0.00
143	601888	中国中免	4,200	225,582.00	0.00
144	688396	华润微	2,285	222,901.75	0.00
145	600893	航发动力	5,700	218,538.00	0.00
146	600673	东阳光	6,500	218,270.00	0.00
147	600010	宝钢股份	97,200	216,756.00	0.00
148	688271	联影医疗	2,126	215,214.98	0.00
149	601127	赛力斯	3,500	214,375.00	0.00
150	002602	世纪华通	15,200	214,320.00	0.00
151	688111	金山办公	996	212,197.80	0.00
152	601689	拓普集团	3,700	208,754.00	0.00
153	600118	中国卫星	2,500	205,125.00	0.00
154	600019	宝钢股份	37,500	203,625.00	0.00
155	600760	中航沈飞	4,900	201,390.00	0.00
156	300054	鼎龙股份	1,900	201,343.00	0.00
157	002938	鹏鼎控股	1,900	200,222.00	0.00
158	300751	迈为股份	700	197,722.00	0.00
159	002709	天赐材料	3,800	195,434.00	0.00
160	601168	西部矿业	7,200	195,408.00	0.00
161	002436	兴森科技	3,800	193,610.00	0.00
162	600104	上汽集团	19,800	193,248.00	0.00
163	600989	宝丰能源	9,500	193,135.00	0.00
164	600875	东方电气	6,600	189,882.00	0.00
165	601727	上海电气	27,100	189,700.00	0.00
166	600988	赤峰黄金	7,200	189,504.00	0.00
167	600026	中远海能	10,500	188,370.00	0.00
168	688099	晶晨股份	1,820	187,278.00	0.00
169	600885	宏发股份	5,361	184,900.89	0.00
170	600667	太极实业	6,300	183,834.00	0.00
171	601390	中国中铁	44,000	183,480.00	0.00
172	000657	中钨高新	1,900	181,868.00	0.00
173	002202	金风科技	7,600	181,640.00	0.00
174	600547	山东黄金	7,800	180,102.00	0.00
175	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
176	600795	国电电力	38,300	178,861.00	0.00
177	600392	盛和资源	6,000	178,620.00	0.00
178	002352	顺丰控股	5,700	178,182.00	0.00
179	300390	天华新能	1,900	177,669.00	0.00
180	300037	新宙邦	1,900	176,415.00	0.00
181	300346	南大光电	1,900	176,035.00	0.00
182	600418	江淮汽车	6,800	175,644.00	0.00

183	002179	中航光电	3,800	175,560.00	0.00
184	600585	海螺水泥	10,300	174,585.00	0.00
185	601669	中国电建	37,000	173,900.00	0.00
186	002080	中材科技	1,900	171,000.00	0.00
187	002407	多氟多	3,400	170,782.00	0.00
188	002185	华天科技	7,600	169,556.00	0.00
189	000425	徐工机械	20,900	169,081.00	0.00
190	002049	紫光国微	1,900	168,625.00	0.00
191	600141	兴发集团	3,587	168,481.39	0.00
192	600096	云天化	5,500	167,200.00	0.00
193	002600	领益智造	9,500	164,730.00	0.00
194	000938	紫光股份	5,700	164,502.00	0.00
195	300782	卓胜微	1,500	164,370.00	0.00
196	600346	恒力石化	9,100	161,161.00	0.00
197	601868	中国能建	60,200	160,734.00	0.00
198	600482	中国动力	4,900	160,720.00	0.00
199	300442	润泽科技	1,900	157,833.00	0.00
200	600497	驰宏锌锗	13,000	157,430.00	0.00
201	600580	卧龙电驱	4,700	155,570.00	0.00
202	002837	英维克	1,930	153,550.80	0.00
203	600426	华鲁恒升	6,400	153,088.00	0.00
204	600066	宇通客车	5,700	152,817.00	0.00
205	600157	永泰能源	93,800	151,018.00	0.00
206	600221	海航控股	110,500	149,175.00	0.00
207	600895	张江高科	4,000	149,000.00	0.00
208	000568	泸州老窖	1,900	147,288.00	0.00
209	300803	指南针	1,600	146,672.00	0.00
210	688036	传音控股	2,475	145,901.25	0.00
211	600711	盛屯矿业	13,300	145,901.00	0.00
212	002821	凯莱英	900	145,800.00	0.00
213	301358	湖南裕能	1,900	144,153.00	0.00
214	600011	华能国际	18,900	143,451.00	0.00
215	600048	保利发展	30,900	143,067.00	0.00
216	600143	金发科技	9,200	142,140.00	0.00
217	600436	片仔癀	1,300	142,064.00	0.00
218	600438	通威股份	11,600	140,476.00	0.00
219	605499	东鹏饮料	1,130	139,475.90	0.00
220	600115	中国东航	36,600	139,446.00	0.00
221	002138	顺络电子	1,900	138,890.00	0.00
222	600570	恒生电子	6,500	137,735.00	0.00
223	600886	国投电力	10,300	137,093.00	0.00
224	600352	浙江龙盛	11,200	135,632.00	0.00
225	002273	水晶光电	3,800	134,824.00	0.00
226	688047	龙芯中科	862	133,325.54	0.00

227	603659	璞泰来	4,600	133,078.00	0.00
228	000977	浪潮信息	1,900	133,000.00	0.00
229	000630	铜陵有色	20,900	132,924.00	0.00
230	601233	桐昆股份	6,100	132,065.00	0.00
231	000408	藏格矿业	1,900	131,708.00	0.00
232	300058	蓝色光标	9,520	130,995.20	0.00
233	601360	三六零	15,000	130,350.00	0.00
234	601058	赛轮轮胎	11,300	130,289.00	0.00
235	688213	思特威	1,211	129,661.77	0.00
236	002027	分众传媒	26,700	129,228.00	0.00
237	002241	歌尔股份	5,700	128,421.00	0.00
238	603129	春风动力	500	127,900.00	0.00
239	002812	恩捷股份	1,900	127,129.00	0.00
240	688578	艾力斯	1,161	126,781.20	0.00
241	000807	云铝股份	5,700	126,198.00	0.00
242	688235	百济神州	495	126,031.95	0.00
243	600226	亨通股份	13,100	125,629.00	0.00
244	000426	兴业银锡	3,800	125,248.00	0.00
245	600009	上海机场	5,400	124,740.00	0.00
246	300438	鹏辉能源	1,500	124,275.00	0.00
247	600196	复星医药	5,500	123,585.00	0.00
248	688122	西部超导	1,956	122,856.36	0.00
249	601111	中国国航	20,000	121,000.00	0.00
250	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
251	600029	南方航空	23,200	120,176.00	0.00
252	600415	小商品城	11,800	119,888.00	0.00
253	600674	川投能源	8,400	119,028.00	0.00
254	600219	南山铝业	29,600	118,104.00	0.00
255	601186	中国铁建	19,800	117,810.00	0.00
256	600233	圆通速递	7,400	116,550.00	0.00
257	002466	天齐锂业	1,900	116,508.00	0.00
258	601117	中国化学	15,800	116,130.00	0.00
259	601877	正泰电器	4,600	115,322.00	0.00
260	002625	光启技术	3,800	115,216.00	0.00
261	300316	晶盛机电	1,900	114,760.00	0.00
262	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
263	002756	永兴材料	2,000	113,280.00	0.00
264	600372	中航机载	10,400	112,840.00	0.00
265	002738	中矿资源	1,900	112,081.00	0.00
266	600839	四川长虹	15,900	110,982.00	0.00
267	603806	福斯特	6,600	110,814.00	0.00
268	000066	中国长城	5,700	108,585.00	0.00
269	002001	新和成	3,808	108,223.36	0.00
270	000733	振华科技	1,901	107,672.64	0.00

271	603650	彤程新材	1,096	107,386.08	0.00
272	002920	德赛西威	1,300	105,950.00	0.00
273	300454	深信服	1,100	105,820.00	0.00
274	600741	华域汽车	6,800	105,536.00	0.00
275	000831	中国稀土	1,900	105,431.00	0.00
276	002558	巨人网络	3,800	104,728.00	0.00
277	688506	百利天恒	355	104,380.65	0.00
278	688676	金盘科技	1,186	100,383.04	0.00
279	688331	荣昌生物	765	99,648.90	0.00
280	002195	岩山科技	15,200	99,408.00	0.00
281	300496	中科创达	1,600	98,864.00	0.00
282	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
283	300474	景嘉微	1,600	96,768.00	0.00
284	601021	春秋航空	2,100	95,718.00	0.00
285	000625	长安汽车	13,324	95,533.08	0.00
286	002126	银轮股份	1,900	94,620.00	0.00
287	300015	爱尔眼科	11,441	94,502.66	0.00
288	603979	金诚信	1,600	94,448.00	0.00
289	300866	安克创新	900	94,050.00	0.00
290	002236	大华股份	5,700	93,993.00	0.00
291	000661	长春高新	1,400	93,240.00	0.00
292	688266	泽璟制药	797	92,978.02	0.00
293	000157	中联重科	13,300	92,701.00	0.00
294	601319	中国人保	13,700	92,612.00	0.00
295	002025	航天电器	1,200	91,464.00	0.00
296	002129	TCL 中环	7,600	91,352.00	0.00
297	300073	当升科技	1,900	91,276.00	0.00
298	300347	泰格医药	1,900	91,200.00	0.00
299	002456	欧菲光	9,600	90,816.00	0.00
300	600699	均胜电子	4,200	90,762.00	0.00
301	300763	锦浪科技	1,000	90,350.00	0.00
302	601615	明阳智能	7,800	90,246.00	0.00
303	000538	云南白药	1,900	90,003.00	0.00
304	002648	卫星化学	3,800	89,262.00	0.00
305	603606	东方电缆	2,140	88,831.40	0.00
306	002595	豪迈科技	1,900	88,540.00	0.00
307	601677	明泰铝业	5,300	87,980.00	0.00
308	002340	格林美	13,300	87,913.00	0.00
309	002128	电投能源	3,800	87,856.00	0.00
310	600039	四川路桥	11,200	87,584.00	0.00
311	601800	中国交建	15,300	87,363.00	0.00
312	000301	东方盛虹	7,600	87,020.00	0.00
313	000423	东阿阿胶	1,900	86,184.00	0.00
314	688599	天合光能	6,044	85,341.28	0.00

315	603087	甘李药业	1,500	85,140.00	0.00
316	688608	恒玄科技	508	84,932.52	0.00
317	300724	捷佳伟创	1,200	84,720.00	0.00
318	688169	石头科技	892	84,713.24	0.00
319	688223	晶科能源	17,664	83,904.00	0.00
320	300919	中伟新材	1,900	83,125.00	0.00
321	003816	中国广核	21,000	82,110.00	0.00
322	002493	荣盛石化	7,600	81,700.00	0.00
323	002532	天山铝业	7,600	81,548.00	0.00
324	601633	长城汽车	5,400	81,486.00	0.00
325	002131	利欧股份	17,100	81,225.00	0.00
326	000960	锡业股份	1,900	81,111.00	0.00
327	600588	用友网络	8,800	80,784.00	0.00
328	301236	软通动力	1,900	80,655.00	0.00
329	000933	神火股份	3,800	80,560.00	0.00
330	300832	新产业	1,900	79,800.00	0.00
331	688390	固德威	732	79,429.32	0.00
332	002472	双环传动	1,900	78,869.00	0.00
333	688180	君实生物	2,307	78,022.74	0.00
334	000768	中航西飞	3,800	77,824.00	0.00
335	002497	雅化集团	3,800	77,406.00	0.00
336	300450	先导智能	1,900	77,368.00	0.00
337	300418	昆仑万维	1,900	76,684.00	0.00
338	302132	中航成飞	1,300	75,816.00	0.00
339	300458	全志科技	1,900	74,974.00	0.00
340	601618	中国中冶	30,700	74,908.00	0.00
341	600516	方大炭素	12,100	74,657.00	0.00
342	600177	雅戈尔	9,900	74,547.00	0.00
343	300677	英科医疗	1,900	74,423.00	0.00
344	688188	柏楚电子	697	74,369.90	0.00
345	688065	凯赛生物	1,551	74,215.35	0.00
346	300017	网宿科技	5,700	74,157.00	0.00
347	601607	上海医药	4,800	73,920.00	0.00
348	300024	机器人	3,800	73,454.00	0.00
349	002422	科伦药业	1,900	73,188.00	0.00
350	300339	润和软件	1,900	73,169.00	0.00
351	002465	海格通信	5,700	72,789.00	0.00
352	000547	航天发展	3,800	72,770.00	0.00
353	603260	合盛硅业	1,500	72,390.00	0.00
354	300207	欣旺达	3,806	72,275.94	0.00
355	002130	沃尔核材	3,800	72,048.00	0.00
356	300001	特锐德	1,900	71,877.00	0.00
357	002555	三七互娱	3,800	71,706.00	0.00
358	300558	贝达药业	1,100	71,577.00	0.00

359	300568	星源材质	3,800	71,136.00	0.00
360	300342	天银机电	1,500	70,500.00	0.00
361	300972	万辰集团	400	69,364.00	0.00
362	688472	阿特斯	6,267	67,808.94	0.00
363	002271	东方雨虹	5,700	67,659.00	0.00
364	600499	科达制造	4,900	67,620.00	0.00
365	002831	裕同科技	1,900	67,564.00	0.00
366	600515	海南机场	24,600	67,404.00	0.00
367	603596	伯特利	2,712	67,366.08	0.00
368	600085	同仁堂	2,900	67,019.00	0.00
369	605090	九丰能源	1,800	66,906.00	0.00
370	688617	惠泰医疗	365	66,269.40	0.00
371	688005	容百科技	2,151	65,820.60	0.00
372	600862	中航高科	3,600	64,908.00	0.00
373	600521	华海药业	4,500	64,800.00	0.00
374	601216	君正集团	14,500	64,670.00	0.00
375	000975	山金国际	3,800	64,600.00	0.00
376	301550	斯菱智驱	700	64,001.00	0.00
377	603766	隆鑫通用	5,300	63,229.00	0.00
378	600803	新奥股份	4,000	63,200.00	0.00
379	600704	物产中大	13,300	62,776.00	0.00
380	002601	龙佰集团	3,800	62,624.00	0.00
381	600312	平高电气	3,500	61,810.00	0.00
382	002517	恺英网络	3,800	61,750.00	0.00
383	002294	信立泰	1,925	61,388.25	0.00
384	600018	上港集团	13,000	61,360.00	0.00
385	001979	招商蛇口	9,527	61,258.61	0.00
386	300896	爱美客	700	61,040.00	0.00
387	600765	中航重机	4,700	60,724.00	0.00
388	000878	云南铜业	3,800	60,344.00	0.00
389	688116	天奈科技	1,576	60,203.20	0.00
390	600332	白云山	3,000	60,120.00	0.00
391	603605	珀莱雅	1,000	59,920.00	0.00
392	600153	建发股份	7,500	59,475.00	0.00
393	600166	福田汽车	20,400	59,364.00	0.00
394	002444	巨星科技	1,900	59,090.00	0.00
395	300748	金力永磁	1,900	58,615.00	0.00
396	600323	瀚蓝环境	2,100	57,666.00	0.00
397	300759	康龙化成	1,950	56,413.50	0.00
398	688114	华大智造	1,075	54,911.00	0.00
399	000963	华东医药	1,950	54,834.00	0.00
400	300699	光威复材	1,900	54,435.00	0.00
401	601799	星宇股份	600	54,372.00	0.00
402	603568	伟明环保	3,520	54,137.60	0.00

403	002064	华峰化学	5,700	54,093.00	0.00
404	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
405	600398	海澜之家	10,300	53,869.00	0.00
406	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
407	600529	山东药玻	2,900	53,505.00	0.00
408	300115	长盈精密	1,900	53,086.00	0.00
408	600316	洪都航空	1,900	53,086.00	0.00
410	688009	中国通号	11,122	52,940.72	0.00
411	000034	神州数码	1,900	52,725.00	0.00
412	601000	唐山港	12,700	52,705.00	0.00
413	300012	华测检测	3,800	52,668.00	0.00
414	601018	宁波港	16,700	52,605.00	0.00
415	002074	国轩高科	1,900	52,269.00	0.00
416	001965	招商公路	5,700	52,212.00	0.00
417	600208	衢州发展	18,300	51,789.00	0.00
418	300083	创世纪	3,800	51,756.00	0.00
419	600008	首创环保	18,900	51,408.00	0.00
420	600170	上海建工	22,900	50,838.00	0.00
421	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.00
422	600486	扬农化工	1,000	50,700.00	0.00
423	600998	九州通	10,800	50,652.00	0.00
424	000002	万科 A	17,100	50,616.00	0.00
425	002414	高德红外	3,800	50,388.00	0.00
426	600161	天坛生物	4,300	49,794.00	0.00
427	002252	上海莱士	11,423	49,575.82	0.00
428	600820	隧道股份	9,500	49,495.00	0.00
429	300142	沃森生物	3,800	49,362.00	0.00
430	002223	鱼跃医疗	1,900	48,754.00	0.00
431	603885	吉祥航空	4,700	48,363.00	0.00
432	601238	广汽集团	9,500	48,260.00	0.00
433	688303	大全能源	2,767	48,228.81	0.00
434	002078	太阳纸业	3,800	47,462.00	0.00
435	000032	深桑达 A	1,900	47,405.00	0.00
436	603816	顾家家居	2,100	46,956.00	0.00
437	603939	益丰药房	2,600	46,748.00	0.00
438	002459	晶澳科技	5,700	46,170.00	0.00
439	688166	博瑞医药	1,312	45,933.12	0.00
440	000830	鲁西化工	3,800	45,600.00	0.00
441	300676	华大基因	1,300	45,578.00	0.00
442	600038	中直股份	1,800	45,522.00	0.00
443	002318	久立特材	1,900	45,410.00	0.00
444	002155	湖南黄金	1,900	45,353.00	0.00
445	300003	乐普医疗	3,800	45,030.00	0.00
446	300573	兴齐眼药	1,100	44,836.00	0.00

447	601567	三星电气	3,000	44,820.00	0.00
448	000833	粤桂股份	1,900	44,498.00	0.00
449	300122	智飞生物	3,800	44,422.00	0.00
450	600763	通策医疗	1,300	44,044.00	0.00
451	601880	辽港股份	31,700	43,746.00	0.00
452	603392	万泰生物	1,600	43,152.00	0.00
453	000999	华润三九	1,910	42,955.90	0.00
454	300049	福瑞医科	1,100	42,768.00	0.00
455	600535	天士力	3,200	42,336.00	0.00
456	002085	万丰奥威	3,800	42,142.00	0.00
456	300251	光线传媒	3,800	42,142.00	0.00
458	300100	双林股份	1,500	41,670.00	0.00
459	600511	国药股份	1,600	41,664.00	0.00
460	600816	建元信托	16,900	41,236.00	0.00
461	000400	许继电气	1,900	41,230.00	0.00
462	002065	东华软件	5,700	40,698.00	0.00
463	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
464	300457	赢合科技	1,900	40,052.00	0.00
465	000519	中兵红箭	1,900	40,033.00	0.00
466	000967	盈峰环境	3,800	40,014.00	0.00
466	601155	新城控股	3,900	40,014.00	0.00
468	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
469	688063	派能科技	739	39,366.53	0.00
470	000415	渤海租赁	9,500	38,665.00	0.00
471	002266	浙富控股	7,600	38,456.00	0.00
472	002044	美年健康	7,600	38,228.00	0.00
473	300432	富临精工	1,900	38,171.00	0.00
474	002176	江特电机	3,800	38,038.00	0.00
475	300409	道氏技术	1,900	37,867.00	0.00
476	000617	中油资本	5,700	37,563.00	0.00
477	601866	中远海发	16,800	37,128.00	0.00
478	600064	南京高科	5,200	37,076.00	0.00
479	002405	四维图新	5,700	36,879.00	0.00
480	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
481	600754	锦江酒店	2,000	35,980.00	0.00
482	600635	大众公用	8,300	35,524.00	0.00
483	000738	航发控制	1,900	34,751.00	0.00
484	002544	普天科技	1,900	34,618.00	0.00
485	600655	豫园股份	8,400	34,524.00	0.00
486	000786	北新建材	1,900	34,371.00	0.00
487	000887	中鼎股份	1,900	33,991.00	0.00
488	002389	航天彩虹	1,900	33,763.00	0.00
489	000623	吉林敖东	1,900	33,687.00	0.00
490	603899	晨光股份	1,600	33,008.00	0.00

491	000932	华菱钢铁	9,500	32,965.00	0.00
492	000683	博源化工	5,700	32,832.00	0.00
493	600663	陆家嘴	5,100	32,028.00	0.00
494	600004	白云机场	4,400	31,944.00	0.00
495	600258	首旅酒店	2,900	31,668.00	0.00
496	600859	王府井	3,400	31,212.00	0.00
497	002410	广联达	3,800	31,008.00	0.00
498	000039	中集集团	3,800	30,818.00	0.00
499	002244	滨江集团	3,800	28,880.00	0.00
500	000998	隆平高科	3,816	28,772.64	0.00
501	002603	以岭药业	1,900	28,500.00	0.00
502	002432	九安医疗	400	28,272.00	0.00
503	600864	哈投股份	5,400	28,026.00	0.00
504	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
505	002607	中公教育	15,200	27,360.00	0.00
506	002120	韵达股份	3,800	24,168.00	0.00
507	603833	欧派家居	800	24,088.00	0.00
508	300118	东方日升	1,900	23,655.00	0.00
509	002007	华兰生物	1,900	23,161.00	0.00
510	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
511	300144	宋城演艺	3,800	22,078.00	0.00
512	600325	华发股份	9,500	21,945.00	0.00
513	300601	康泰生物	1,900	21,546.00	0.00
514	002891	中宠股份	800	21,376.00	0.00
515	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
516	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
517	000035	中国天楹	3,800	18,354.00	0.00
518	300070	碧水源	5,700	18,183.00	0.00
519	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
520	000069	华侨城 A	9,500	15,580.00	0.00
521	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
522	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
523	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
524	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
525	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
526	002572	索菲亚	1,900	13,870.00	0.00
527	002091	江苏国泰	1,900	13,737.00	0.00
528	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
529	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
530	301078	孩子王	1,900	12,844.00	0.00
531	002292	奥飞娱乐	1,900	12,464.00	0.00
532	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
533	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
534	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00

535	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
536	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
537	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
538	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
539	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
540	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
541	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
542	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
543	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300750	宁德时代	80,851,982.49	1.57
2	300308	中际旭创	42,664,689.05	0.83
3	300502	新易盛	31,107,797.70	0.60
4	000333	美的集团	28,933,848.52	0.56
5	002371	北方华创	28,552,180.00	0.55
6	002475	立讯精密	22,166,372.00	0.43
7	002594	比亚迪	19,857,072.01	0.38
8	300059	东方财富	18,806,150.23	0.36
9	300274	阳光电源	16,382,926.00	0.32
10	300476	胜宏科技	16,221,145.00	0.31
11	300394	天孚通信	16,022,572.40	0.31
12	002384	东山精密	15,269,901.00	0.30
13	000858	五粮液	15,002,493.60	0.29
14	000725	京东方 A	12,300,840.00	0.24
15	000651	格力电器	12,208,236.32	0.24
16	300124	汇川技术	11,633,344.04	0.23
17	002463	沪电股份	10,076,035.00	0.20
18	002028	思源电气	10,046,973.00	0.19
19	000338	潍柴动力	9,719,860.76	0.19
20	002714	牧原股份	9,044,678.00	0.18

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	688820	盛合晶微	2,136,703.16	0.04
2	600519	贵州茅台	1,524,791.00	0.03

3	920186	中科仪	1,312,214.18	0.03
4	601318	中国平安	1,153,330.00	0.02
5	300750	宁德时代	1,148,943.00	0.02
6	688808	联讯仪器	1,076,640.12	0.02
7	688818	电科蓝天	1,065,235.27	0.02
8	601899	紫金矿业	1,021,674.00	0.02
9	600036	招商银行	960,251.00	0.02
10	688797	臻宝科技	893,707.76	0.02
11	688256	寒武纪	831,738.15	0.02
12	688002	睿创微纳	808,285.29	0.02
13	688635	长进光子	679,918.00	0.01
14	600900	长江电力	669,733.00	0.01
15	603986	兆易创新	669,105.00	0.01
16	688223	晶科能源	659,606.56	0.01
17	688012	中微公司	618,955.80	0.01
18	601166	兴业银行	613,068.00	0.01
19	688041	海光信息	552,895.51	0.01
20	688008	澜起科技	545,810.76	0.01

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	1,049,395,703.07
卖出股票收入（成交）总额	60,087,171.01

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,634,547.95	0.73
	其中：政策性金融债	50,634,547.95	0.73
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）	22,000.53	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,656,548.48	0.73

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	250431	25 农发 31	500,000	50,634,547.95	0.73
2	111025	圣泉转债	130	13,000.14	0.00
3	113704	春风转债	90	9,000.39	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 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前

一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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目标 ETF 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对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。

7.13.2 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	9,603,126.13
2	应收清算款	7,923,314.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,490,761.88
6	其他应收款	6,415,471.70
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,432,674.24

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.11	新股流通受限

2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.04	新股流通受限
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.04	新股流通受限

§ 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 A500ETF 联接 A	163,400	18,579.44	242,837,637.94	8.00%	2,793,042,481.95	92.00%
易方达中证 A500ETF 联接 C	91,802	18,432.01	85,182,965.22	5.03%	1,606,912,815.87	94.97%
易方达中证 A500ETF 联接 Y	42,961	7,626.42	0.00	0.00%	327,638,698.46	100.00%
合计	298,163	16,955.88	328,020,603.16	6.49%	4,727,593,996.28	93.51%

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 A500ETF 联接 A	3,923,548.93	0.1292%
	易方达中证 A500ETF 联接 C	157,574.67	0.0093%
	易方达中证 A500ETF 联接 Y	876,900.86	0.2676%
	合计	4,958,024.46	0.0981%

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 A500ETF 联接 A	0
	易方达中证 A500ETF 联接 C	0
	易方达中证 A500ETF 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 A500ETF 联接 A	0
	易方达中证 A500ETF 联接 C	0
	易方达中证 A500ETF 联接 Y	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 A500ETF 联接 A	易方达中证 A500ETF 联接 C	易方达中证 A500ETF 联接 Y
基金合同生效日（2024 年 11 月 11 日）基金份额总额	2,575,692,783.65	5,414,273,774.45	-
本报告期期初基金份额总额	2,313,790,728.77	1,700,545,661.71	182,167,062.35
本报告期基金总申购份额	2,875,523,843.21	1,712,523,304.34	217,204,008.25
减：本报告期基金总赎回份额	2,153,434,452.09	1,720,973,184.96	71,732,372.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,035,880,119.89	1,692,095,781.09	327,638,698.46

§ 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的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	1,987,200.68	0.18%	198.74	0.18%	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	987,263,651.42	89.47%	98,731.08	89.47%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	114,236,828.11	10.35%	11,423.72	10.35%	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	1,167,885 ,706.84	100.00 %
山西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	1,722,454. 41	100.00 %	-	-	-	-	-	-
湘财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-

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关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	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	2026-01-15
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第	中国证券报	2026-01-22

	4 季度报告提示性公告		
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
6	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	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	2026-03-21
7	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	2026-03-23
8	关于取消易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类基金份额参加交通银行费率优惠活动的公告	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	2026-03-25
9	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
10	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
11	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
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	2026-04-23
13	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2026-05-16
15	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
16	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
17	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 A500 指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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