

# 易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

## 2022 年中期报告

### 2022 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 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	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	18
7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	45
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	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权益投资明细	46
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	83
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	84
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	84
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	85
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	85

7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	85
7.11	投资组合报告附注 .....	85
8	基金份额持有人信息 .....	86
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	87
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	87
9	开放式基金份额变动 .....	88
10	重大事件揭示 .....	88
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	88
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 .....	88
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
10.4	基金投资策略的改变 .....	89
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	89
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	89
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	89
10.8	其他重大事件 .....	90
11	备查文件目录 .....	92
11.1	备查文件目录 .....	92
11.2	存放地点 .....	92
11.3	查阅方式 .....	92

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）	
场内简称	标普 500LOF	
基金主代码	161125	
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	292,546,629.86 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016 年 12 月 14 日	
下属分级基金的基金简称	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
下属分级基金的交易代码	161125	012860
报告期末下属分级基金的份额总额	288,432,300.82 份	4,114,329.04 份

注：本基金 A 类人民币份额及 A 类美元份额由原易方达标普 500 指数（QDII-LOF）变更而来，并于 2021 年 7 月 19 日起增设 C 类人民币份额及 C 类美元份额，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日。易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A 含 A 类人民币份额（份额代码：161125）及 A 类美元现汇份额（份额代码：003718），交易代码仅列示 A 类人民币份额代码；易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C 含 C 类人民币份额（份额代码：012860）及 C 类美元现汇份额（份额代码：012861），交易代码仅列示 C 类人民币份额代码。

### 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	本基金主要采用完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、固定收益品种和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	标普 500 指数收益率(使用估值汇率折算)×95%+活期存款利率(税后) ×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	State Street Bank and Trust Company
	中文	无	道富银行
注册地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		无	无

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 43 楼

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼

注：本基金 A 类人民币份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，A 类美元份额、

C 类人民币份额、C 类美元份额的注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
本期已实现收益	11,620,851.87	128,936.59
本期利润	-90,492,590.29	-817,825.19
加权平均基金份额本期利润	-0.2962	-0.2511
本期加权平均净值利润率	-17.15%	-14.68%
本期基金份额净值增长率	-15.30%	-15.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
期末可供分配利润	80,766,065.55	1,125,483.87
期末可供分配基金份额利润	0.2800	0.2736
期末基金资产净值	460,737,070.32	6,551,510.05
期末基金份额净值	1.5974	1.5924
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
基金份额累计净值增长率	59.74%	-6.96%

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

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④

		②		准差④		
过去一个月	-7.22%	1.76%	-7.31%	1.77%	0.09%	-0.01%
过去三个月	-10.75%	1.63%	-11.07%	1.64%	0.32%	-0.01%
过去六个月	-15.30%	1.49%	-15.58%	1.49%	0.28%	0.00%
过去一年	-7.42%	1.18%	-7.99%	1.17%	0.57%	0.01%
过去三年	24.11%	1.50%	24.78%	1.46%	-0.67%	0.04%
自基金合同生效起至今	59.74%	1.23%	64.85%	1.21%	-5.11%	0.02%

## 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）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
过去一个月	-7.24%	1.76%	-7.31%	1.77%	0.07%	-0.01%
过去三个月	-10.84%	1.63%	-11.07%	1.64%	0.23%	-0.01%
过去六个月	-15.50%	1.49%	-15.58%	1.49%	0.08%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-6.96%	1.20%	-7.32%	1.19%	0.36%	0.01%

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

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

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

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

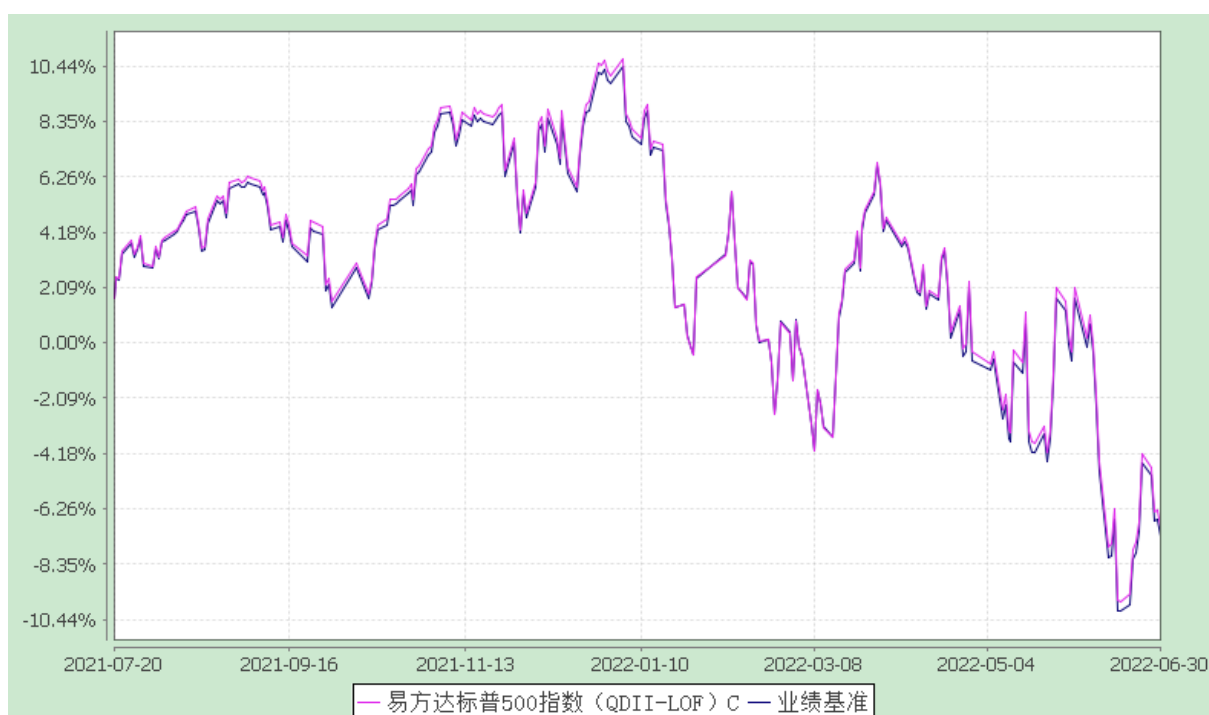
（2016 年 12 月 2 日至 2022 年 6 月 30 日）





### 易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C

(2021 年 7 月 20 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1.自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 59.74%，同期业绩比较基准收益率为 64.85%；C 类基金份额净值增长率为-6.96%，同期业绩比较基准收益率为-7.32%。

## 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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，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）及基金经理助理的简介

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		
FAN BING (范 冰)	本基金的基金经理， 易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、 易方达标普信息科技 指数（QDII-LOF）、 易方达原油 （QDII-LOF-FOF）、 易方达中证海外中国 互联网 50 （QDII-ETF）、易方 达纳斯达克 100 指数 （QDII-LOF）、易方 达 MSCI 中国 A 股国 际通 ETF、易方达中 证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）、 易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接 发起式、易方达日兴 资管日经 225ETF （QDII）、易方达中 证香港证券投资主题 ETF、易方达恒生科 技 ETF（QDII）、易 方达中证龙头企业指 数、易方达恒生港股	2017-03-25	-	17 年	新加坡籍，硕士研究生， 具有基金从业资格。曾任 皇家加拿大银行托管部 核算专员，美国道富集团 中台交易支持专员，巴克 莱资产管理公司悉尼金 融数据部高级金融数据 分析员、悉尼金融数据部 主管、新加坡金融数据部 主管，贝莱德集团金融数 据运营部部门经理、风险 控制与咨询部客户经理、 亚太股票指数基金部基 金经理，易方达基金管理 有限公司易方达标普消 费品指数增强（QDII）、 易方达标普医疗保健指 数（QDII-LOF）、易方达 标普生物科技指数 （QDII-LOF）的基金经 理。

	通新经济 ETF、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理，指数投资决策委员会委员，易方达资产管理（香港）有限公司国际指数部部门总监、投资决策委员会委员、基金经理				
--	---	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的

单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 22 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，8 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪标普 500 指数，该指数由标普道琼斯指数公司编制，是美国大盘蓝筹公司股票表现的代表性指数。标普 500 指数从在美国交易所上市的公司中，选取总市值最大的 500 家公司，根据流通市值赋予指数权重，并每季度定期调整。报告期内本基金主要采用完全复制法进行投资，即主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。

2022 年上半年，欧洲地缘政治风险延续导致关键商品出现供应链挑战，原油价格高位运行，美国劳动力成本上涨，通胀水平居高不下。美国经济的景气程度从去年的高点回落，财政政策的支持力度边际减弱。在此背景下美联储加快了货币紧缩节奏，在 3 月议息会议上启动加息进程，在 5 月议息会议上加息 50 个基点，在 6 月议息会议上再次加息 75 个基点，并开启缩表。通胀水平上行和金融条件收紧对需求形成冲击，美国经济增长和企业盈利增速放缓，引发投资者对于美国经济衰退风险的担忧，金融市场的避险情绪提升，对美股估值和市场风险偏好形成压制，美股整体振荡下跌。标普 500 指数在报告期内显著下行。

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

##### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.5974 元，本报告期份额净值增长率为-15.30%，同期业绩比较基准收益率为-15.58%；C 类基金份额净值为 1.5924 元，本报告期份额净值增长率为-15.50%，同期业绩比较基准收益率为-15.58%，年化跟踪误差 0.56%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，美国经济增长预期下行，通胀压力恐怕难以快速回落，美联储仍然处于加

速收紧货币政策的阶段，宏观金融条件的收紧可能继续压制美股的估值水平，并加剧股价的波动。短期来看，需要关注美联储货币政策企稳和转向的迹象。中长期来看，需要关注在面临经济衰退风险和通胀水平高企的环境下，美股上市公司的盈利及利润率水平是否能够达到市场预期。

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，为看好美股市场投资机遇的投资者提供质地优良的指数投资工具。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C:本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	39,710,292.18	39,030,584.33
结算备付金		3,165,747.25	8,840,740.08
存出保证金		1,116,240.05	483,915.63
交易性金融资产	6.4.7.2	425,004,639.04	567,499,887.18
其中：股票投资		425,004,639.04	567,499,887.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		300,093.34	304,704.49

应收申购款		1,248,905.09	1,637,161.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	3,650.28
资产总计		470,545,916.95	617,800,643.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
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		-	-
应付赎回款		2,282,806.41	3,878,824.50
应付管理人报酬		314,711.48	406,674.17
应付托管费		98,347.35	127,085.68
应付销售服务费		1,848.58	809.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	57,018.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	559,622.76	760,511.31
负债合计		3,257,336.58	5,230,923.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	292,546,629.86	324,803,502.06
未分配利润	6.4.7.8	174,741,950.51	287,766,218.11
净资产合计		467,288,580.37	612,569,720.17
负债和净资产总计		470,545,916.95	617,800,643.37

注：1.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.5974 元，C 类基金份额净值 1.5924 元；基金份额总额 292,546,629.86 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 288,432,300.82 份，C 类基金份额总额 4,114,329.04 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-88,197,064.52	51,377,515.81
1.利息收入		43,974.24	44,085.54
其中：存款利息收入	6.4.7.9	43,974.24	44,085.54
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,358,958.43	4,919,345.09
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,664,971.47	1,011,721.90
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-4,727,487.69	1,462,969.76
股利收益	6.4.7.15	3,421,474.65	2,444,653.43
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	-103,060,203.94	46,707,472.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,254,201.03	-442,890.04
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	206,005.72	149,502.93
<b>减：二、营业总支出</b>		3,113,350.96	2,471,743.41
1. 管理人报酬		2,124,678.14	1,619,025.50
2. 托管费		663,961.90	505,945.46
3. 销售服务费		9,561.60	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	5,105.10
8. 其他费用	6.4.7.19	315,149.32	341,667.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-91,310,415.48</b>	<b>48,905,772.40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-91,310,415.48</b>	<b>48,905,772.40</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-91,310,415.48</b>	<b>48,905,772.40</b>

注：上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号&lt;年度报告和



中期报告》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	324,803,502.06	-	287,766,218.11	612,569,720.17
二、本期期初净资产（基金净值）	324,803,502.06	-	287,766,218.11	612,569,720.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,256,872.20	-	-113,024,267.60	-145,281,139.80
（一）、综合收益总额	-	-	-91,310,415.48	-91,310,415.48
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,256,872.20	-	-21,713,852.12	-53,970,724.32
其中：1.基金申购款	74,292,457.11	-	54,116,553.58	128,409,010.69
2.基金赎回款	-106,549,329.31	-	-75,830,405.70	-182,379,735.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	292,546,629.86	-	174,741,950.51	467,288,580.37
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	211,864,079.23	-	112,304,586.29	324,168,665.5

产（基金净值）				2
二、本期期初净资产（基金净值）	211,864,079.23	-	112,304,586.29	324,168,665.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	90,158,132.36	-	106,820,457.70	196,978,590.06
（一）、综合收益总额	-	-	48,905,772.40	48,905,772.40
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	90,158,132.36	-	57,914,685.30	148,072,817.66
其中：1.基金申购款	168,200,829.04	-	105,225,036.17	273,425,865.21
2.基金赎回款	-78,042,696.68	-	-47,310,350.87	-125,353,047.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	302,022,211.59	-	219,125,043.99	521,147,255.58

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：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)(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[2016]2193 号《关于准予易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，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《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 693,199,312.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,037.35 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金，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

建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）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基金净值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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### （2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### （3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发

生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值

变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 39,030,584.33 元、8,840,740.08 元、483,915.63 元、3,650.28 元、304,704.49 元和 1,637,161.38 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 39,034,234.61 元、8,840,740.08 元、483,915.63 元、0.00 元、304,704.49 元和 1,637,161.38 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 567,499,887.18 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 567,499,887.18 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,878,824.50 元、406,674.17 元、127,085.68 元、809.19 元和 454,511.31 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,878,824.50 元、406,674.17 元、127,085.68 元、809.19 元和 454,511.31 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b)修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]12 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》及其他相

关境内外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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，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。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	39,710,292.18
等于：本金	39,706,702.29
加：应计利息	3,589.89
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	39,710,292.18

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	388,716,418.32	-	425,004,639.04	36,288,220.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	388,716,418.32	-	425,004,639.04	36,288,220.72

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,546,153.08	-	-	-
ESU2	15,546,153.08	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,546,153.08	-	-	-

#### 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
ESU2	S&P500 EMINI FUT Sep22	12	15,259,710.18	-286,442.90
合计	-	-	-	-286,442.90
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-286,442.90
净额	-	-	-	0.00

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,803.76
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	332,235.79
其他应付款	222,583.21
合计	559,622.76

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	323,161,715.07	323,161,715.07
本期申购	69,981,931.69	69,981,931.69
本期赎回（以“-”号填列）	-104,711,345.94	-104,711,345.94
本期末	288,432,300.82	288,432,300.82

##### 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,641,786.99	1,641,786.99
本期申购	4,310,525.42	4,310,525.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,837,983.37	-1,837,983.37
本期末	4,114,329.04	4,114,329.04

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	77,666,653.90	208,647,354.27	286,314,008.17
本期利润	11,620,851.87	-102,113,442.16	-90,492,590.29
本期基金份额交易产生的变动数	-8,521,440.22	-14,995,208.16	-23,516,648.38

其中：基金申购款	17,650,805.45	33,351,130.87	51,001,936.32
基金赎回款	-26,172,245.67	-48,346,339.03	-74,518,584.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,766,065.55	91,538,703.95	172,304,769.50

单位：人民币元

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	389,908.36	1,062,301.58	1,452,209.94
本期利润	128,936.59	-946,761.78	-817,825.19
本期基金份额交易产生的变动数	606,638.92	1,196,157.34	1,802,796.26
其中：基金申购款	1,079,056.63	2,035,560.63	3,114,617.26
基金赎回款	-472,417.71	-839,403.29	-1,311,821.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,125,483.87	1,311,697.14	2,437,181.01

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	43,511.91
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	-
其他	462.33
合计	43,974.24

#### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,664,971.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,664,971.47

##### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	83,845,944.52
减：卖出股票成本总额	70,171,172.89
减：交易费用	9,800.16
买卖股票差价收入	13,664,971.47

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
期货投资收益	-4,727,487.69
合计	-4,727,487.69

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,421,474.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,421,474.65

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-102,437,958.22
——股票投资	-102,437,958.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-622,245.72
——权证投资	-
——期货投资	-622,245.72
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	-103,060,203.94

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	206,005.72
合计	206,005.72

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	330.32
上市费	-
指数使用费	159,350.86
指数数据费	63,232.35
合计	315,149.32

### 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 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
道富银行	境外资产托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,124,678.14	1,619,025.50

其中：支付销售机构的客户维护费	532,866.66	367,262.05
-----------------	------------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	663,961.90	505,945.46

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) A	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	3,443.57	3,443.57
合计	-	3,443.57	3,443.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		



	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达标普500指数 (QDII-LOF) A	易方达标普500指数 (QDII-LOF) C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 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 0.35%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.35% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，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，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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

###### 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

无。

###### 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

无。

#### 6.4.10.5 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	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 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
道富银行-活期存款	35,411,381.70	4,555.82	581,600.74	-
中国建设银行-活期存款	4,298,910.48	38,956.09	49,536,769.06	41,721.22

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司和道富银行保管，按银行

同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于托管行道富银行发行的股票 STT US。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有道富银行的股票 STT US 728 股(2021 年 12 月 31 日: 806 股), 占本基金资产净值的比例为 0.06% (2021 年 12 月 31 日: 0.08%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

本报告期内未发生利润分配。

##### 易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 2022 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2021 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

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 2022年6月30日	上年度末 2021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 2022年6月30日	上年度末 2021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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

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	上年度末
--------	-----	------

	2022年6月30日	2021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 2022年6月30日	上年度末 2021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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	39,710,292.18	-	-	-	39,710,292.18
结算备付金	3,165,747.25	-	-	-	3,165,747.25
存出保证金	1,116,240.05	-	-	-	1,116,240.05
交易性金融资产	-	-	-	425,004,639.04	425,004,639.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	300,093.34	300,093.34
应收申购款	165,111.54	-	-	1,083,793.55	1,248,905.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	44,157,391.02	-	-	426,388,525.93	470,545,916.95
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	-	-	-	2,282,806.41	2,282,806.41
应付管理人报酬	-	-	-	314,711.48	314,711.48
应付托管费	-	-	-	98,347.35	98,347.35
应付销售服务费	-	-	-	1,848.58	1,848.58
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	559,622.76	559,622.76
负债总计	-	-	-	3,257,336.58	3,257,336.58
利率敏感度缺口	44,157,391.02	-	-	423,131,189.35	467,288,580.37
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	39,030,584.33	-	-	-	39,030,584.33
结算备付金	8,840,740.08	-	-	-	8,840,740.08
存出保证金	483,915.63	-	-	-	483,915.63
交易性金融资产	-	-	-	567,499,887.18	567,499,887.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,650.28	3,650.28
应收股利	-	-	-	304,704.49	304,704.49
应收申购款	209,141.02	-	-	1,428,020.36	1,637,161.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,564,381.06	-	-	569,236,262.31	617,800,643.37
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,878,824.50	3,878,824.50
应付管理人报酬	-	-	-	406,674.17	406,674.17
应付托管费	-	-	-	127,085.68	127,085.68
应付销售服务费	-	-	-	809.19	809.19
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	57,018.35	57,018.35
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	760,511.31	760,511.31
负债总计	-	-	-	5,230,923.20	5,230,923.20
利率敏感度缺口	48,564,381.06	-	-	564,005,339.11	612,569,720.17

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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



## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	35,990,984.11	-	-	35,990,984.11
结算备付金	3,165,747.25	-	-	3,165,747.25
存出保证金	1,116,240.05	-	-	1,116,240.05
交易性金融资产	425,004,639.04	-	-	425,004,639.04
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	300,093.34	-	-	300,093.34
应收申购款	104,253.48	-	-	104,253.48
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>465,681,957.27</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>465,681,957.27</b>
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	379,171.55	-	-	379,171.55
其他负债	677.11	-	-	677.11
<b>负债合计</b>	<b>379,848.66</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>379,848.66</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>465,302,108.61</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>465,302,108.61</b>
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

银行存款	2,292,800.04	-	-	2,292,800.04
结算备付金	8,840,740.08	-	-	8,840,740.08
存出保证金	483,915.63	-	-	483,915.63
交易性金融资产	567,499,887.18	-	-	567,499,887.18
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	3.12	-	-	3.12
应收股利	304,704.49	-	-	304,704.49
应收申购款	279,371.76	-	-	279,371.76
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>579,701,422.30</b>	-	-	<b>579,701,422.30</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	328,995.87	-	-	328,995.87
其他负债	1,097.26	-	-	1,097.26
<b>负债合计</b>	<b>330,093.13</b>	-	-	<b>330,093.13</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>579,371,329.17</b>	-	-	<b>579,371,329.17</b>

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-23,265,105.43	-28,968,566.46
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	23,265,105.43	28,968,566.46

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	425,004,639.04	90.95	567,499,887.18	92.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	425,004,639.04	90.95	567,499,887.18	92.64

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	21,250,231.37	28,374,993.61
2.业绩比较基准下降 5%	-21,250,231.37	-28,374,993.61	

### 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 2022年6月30日
第一层次	425,004,639.04
第二层次	-
第三层次	-
合计	425,004,639.04

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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，确定相关股票、和债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 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	425,004,639.04	90.32
	其中：普通股	412,933,014.46	87.76
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-

	房地产信托凭证	12,071,624.58	2.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	42,876,039.43	9.11
8	其他各项资产	2,665,238.48	0.57
9	合计	470,545,916.95	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	425,004,639.04	90.95
合计	425,004,639.04	90.95

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	18,518,546.75	3.96
材料	11,031,208.44	2.36
工业	33,144,696.70	7.09
非必需消费品	44,824,501.83	9.59
必需消费品	29,675,376.03	6.35
保健	64,350,447.08	13.77
金融	46,103,469.78	9.87
信息技术	114,055,969.99	24.41
电信服务	37,725,576.71	8.07

公用事业	13,180,622.07	2.82
房地产	12,394,223.66	2.65
合计	425,004,639.04	90.95

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	30,530	28,013,797.02	5.99
2	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	14,850	25,596,779.60	5.48
3	Alphabet Inc	-	GOOGL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	598	8,746,279.57	1.87
			GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	548	8,045,106.86	1.72
4	Amazon.c om Inc	-	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	17,374	12,384,496.35	2.65
5	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,667	7,534,158.18	1.61
6	Berkshire Hathaway Inc	-	BRK/B US	纽约证 券交易 所	美国	3,593	6,583,620.72	1.41
7	UnitedHe alth Group Inc	-	UNH US	纽约证 券交易 所	美国	1,863	6,422,089.60	1.37
8	Johnson & Johnson	-	JNJ US	纽约证 券交易 所	美国	5,225	6,224,754.71	1.33
9	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,972	5,058,418.96	1.08
10	Meta Platforms	-	META US	纳斯达 克证券	美国	4,554	4,928,399.14	1.05

	Inc			交易所				
11	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	8,365	4,807,903.34	1.03
12	Procter & Gamble Co/The	-	PG US	纽约证券交易所	美国	4,764	4,597,413.43	0.98
13	JPMorgan Chase & Co	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	5,832	4,407,655.04	0.94
14	Visa Inc	-	V US	纽约证券交易所	美国	3,268	4,318,359.86	0.92
15	Pfizer Inc	-	PFE US	纽约证券交易所	美国	11,141	3,920,280.62	0.84
16	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	3,902	3,791,481.67	0.81
17	Home Depot Inc/The	-	HD US	纽约证券交易所	美国	2,052	3,777,189.61	0.81
18	Mastercard Inc	-	MA US	纽约证券交易所	美国	1,706	3,612,135.08	0.77
19	AbbVie Inc	-	ABBV US	纽约证券交易所	美国	3,509	3,606,964.35	0.77
20	Eli Lilly & Co	-	LLY US	纽约证券交易所	美国	1,566	3,407,674.29	0.73
21	Coca-Cola Co/The	-	KO US	纽约证券交易所	美国	7,747	3,270,893.21	0.70
22	Merck & Co Inc	-	MRK US	纽约证券交易所	美国	5,022	3,072,853.01	0.66
23	PepsiCo Inc	-	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,746	3,071,461.20	0.66
24	Bank of America Corp	-	BAC US	纽约证券交易所	美国	14,078	2,941,258.57	0.63
25	Verizon	-	VZ US	纽约证	美国	8,339	2,840,293.00	0.61

	Communi cations Inc			券交易 所				
26	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证 券交易 所	美国	778	2,836,719.79	0.61
27	Costco Wholesale Corp	-	COST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	881	2,833,859.66	0.61
28	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	811	2,644,237.30	0.57
29	Abbott Laboratori es	-	ABT US	纽约证 券交易 所	美国	3,477	2,535,406.18	0.54
30	McDonal d's Corp	-	MCD US	纽约证 券交易 所	美国	1,469	2,434,001.42	0.52
31	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,249	2,360,650.12	0.51
32	Accenture PLC	-	ACN US	纽约证 券交易 所	美国	1,258	2,344,182.62	0.50
33	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,894	2,342,282.36	0.50
34	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	938	2,304,455.03	0.49
35	Walt Disney Co/The	-	DIS US	纽约证 券交易 所	美国	3,617	2,291,572.63	0.49
36	Walmart Inc	-	WMT US	纽约证 券交易 所	美国	2,788	2,274,929.97	0.49
37	Salesforce Inc	-	CRM US	纽约证 券交易 所	美国	1,974	2,186,500.03	0.47
38	Danaher Corp	-	DHR US	纽约证 券交易 所	美国	1,285	2,186,394.25	0.47
39	Bristol-M	-	BMJ US	纽约证	美国	4,228	2,184,936.54	0.47



	yers Squibb Co			券交易 所				
40	Philip Morris Internatio nal Inc	-	PM US	纽约证 券交易 所	美国	3,078	2,039,740.23	0.44
41	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	8,119	2,038,465.54	0.44
42	NextEra Energy Inc	-	NEE US	纽约证 券交易 所	美国	3,901	2,027,993.54	0.43
43	AT&T Inc	-	T US	纽约证 券交易 所	美国	14,215	1,999,637.47	0.43
44	Wells Fargo & Co	-	WFC US	纽约证 券交易 所	美国	7,526	1,978,476.56	0.42
45	Linde Public Limited	-	LIN US	纽约证 券交易 所	美国	1,000	1,929,728.84	0.41
46	QUALCO MM Inc	-	QCOM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,224	1,906,666.86	0.41
47	Raytheon Technolog ies Corp	-	RTX US	纽约证 券交易 所	美国	2,953	1,904,781.43	0.41
48	Texas Instrumen ts Inc	-	TXN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,831	1,888,139.30	0.40
49	United Parcel Service Inc	-	UPS US	纽约证 券交易 所	美国	1,459	1,787,419.38	0.38
50	Union Pacific Corp	-	UNP US	纽约证 券交易 所	美国	1,247	1,784,965.02	0.38
51	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,061	1,732,489.52	0.37
52	NIKE Inc	-	NKE US	纽约证 券交易 所	美国	2,520	1,728,480.80	0.37
53	Internatio	-	IBM US	纽约证	美国	1,786	1,692,382.46	0.36

	nal Business Machines Corp			券交易 所				
54	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,218	1,651,544.40	0.35
55	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证 券交易 所	美国	2,604	1,619,371.16	0.35
56	Medtronic PLC	-	MDT US	纽约证 券交易 所	美国	2,664	1,604,655.47	0.34
57	American Tower Corp	-	AMT US	纽约证 券交易 所	美国	923	1,583,283.49	0.34
58	Honeywel l Internatio nal Inc	-	HON US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,352	1,577,119.40	0.34
59	S&P Global Inc	-	SPGI US	纽约证 券交易 所	美国	691	1,563,141.84	0.33
60	ConocoPh illips	-	COP US	纽约证 券交易 所	美国	2,573	1,550,877.90	0.33
61	Elevance Health Inc	-	ELV US	纽约证 券交易 所	美国	478	1,548,140.38	0.33
62	Lowe's Cos Inc	-	LOW US	纽约证 券交易 所	美国	1,313	1,539,203.95	0.33
63	Oracle Corp	-	ORCL US	纽约证 券交易 所	美国	3,126	1,465,861.17	0.31
64	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达 克证券 交易所	美国	561	1,451,218.37	0.31
65	Morgan Stanley	-	MS US	纽约证 券交易 所	美国	2,779	1,418,593.58	0.30
66	Goldman Sachs	-	GS US	纽约证 券交易	美国	682	1,359,512.46	0.29

	Group Inc/The			所				
67	Lockheed Martin Corp	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	471	1,359,133.40	0.29
68	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	398	1,270,179.16	0.27
69	Charles Schwab Corp/The	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	2,995	1,269,958.62	0.27
70	Caterpillar Inc	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	1,056	1,266,914.74	0.27
71	Citigroup Inc	-	C US	纽约证券交易所	美国	3,871	1,194,812.35	0.26
72	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	829	1,168,610.18	0.25
73	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,278	1,167,893.80	0.25
74	Prologis Inc	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	1,470	1,160,706.43	0.25
75	BlackRock Inc	-	BLK US	纽约证券交易所	美国	282	1,152,678.12	0.25
76	Mondelez International Inc	-	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	2,748	1,145,121.35	0.25
77	American Express Co	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	1,212	1,127,565.13	0.24
78	Cigna Corp	-	CI US	纽约证券交易所	美国	630	1,114,210.52	0.24
79	Deere & Co	-	DE US	纽约证券交易所	美国	554	1,113,464.08	0.24
80	Chubb Ltd	-	CB US	纽约证券交易所	美国	841	1,109,554.02	0.24

				所				
81	Duke Energy Corp	-	DUK US	纽约证券交易所	美国	1,529	1,100,160.14	0.24
82	Zoetis Inc	-	ZTS US	纽约证券交易所	美国	934	1,077,483.46	0.23
83	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,762	1,075,882.79	0.23
84	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,292	1,074,315.81	0.23
85	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,170	1,056,453.55	0.23
86	Marsh & McLennan Cos Inc	-	MMC US	纽约证券交易所	美国	997	1,038,819.02	0.22
87	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	882	1,035,135.06	0.22
88	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,491	1,033,345.60	0.22
89	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,040	1,019,687.16	0.22
90	Boeing Co/The	-	BA US	纽约证券交易所	美国	1,104	1,013,011.20	0.22
91	Southern Co/The	-	SO US	纽约证券交易所	美国	2,110	1,009,824.76	0.22
92	Altria Group Inc	-	MO US	纽约证券交易所	美国	3,584	1,004,721.28	0.22
93	CME Group Inc	-	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	714	980,910.04	0.21
94	3M Co	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	1,129	980,561.65	0.21
95	Crown	-	CCI US	纽约证	美国	860	971,856.36	0.21

	Castle International Corp			券交易所				
96	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	508	960,732.35	0.21
97	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	713	960,443.15	0.21
98	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	81	950,791.89	0.20
99	Becton Dickinson and Co	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	566	936,481.78	0.20
100	Northrop Grumman Corp	-	NOC US	纽约证券交易所	美国	291	934,655.54	0.20
101	General Electric Co	-	GE US	纽约证券交易所	美国	2,186	934,110.24	0.20
102	Progressive Corp/The	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	1,161	905,968.33	0.19
103	Colgate-Palmolive Co	-	CL US	纽约证券交易所	美国	1,664	894,985.06	0.19
104	Stryker Corp	-	SYK US	纽约证券交易所	美国	668	891,846.00	0.19
105	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	2,346	879,355.14	0.19
106	PNC Financial Services Group Inc	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	825	873,557.50	0.19
107	Target Corp	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	919	871,075.09	0.19
108	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证券交易所	美国	1,611	862,910.94	0.18
109	EOG	-	EOG US	纽约证	美国	1,163	862,023.76	0.18

	Resources Inc			券交易所				
110	Regeneron Pharmaceuticals Inc	-	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	214	849,004.31	0.18
111	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,327	843,909.02	0.18
112	Truist Financial Corp	-	TFC US	纽约证券交易所	美国	2,644	841,642.58	0.18
113	US Bancorp	-	USB US	纽约证券交易所	美国	2,685	829,285.42	0.18
114	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	2,218	822,891.73	0.18
115	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,553	811,519.54	0.17
116	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达克证券交易所	美国	180	793,714.33	0.17
117	Humana Inc	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	251	788,492.65	0.17
118	Edwards Lifesciences Corp	-	EW US	纽约证券交易所	美国	1,235	788,160.98	0.17
119	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	275	786,517.36	0.17
120	Estee Lauder Cos Inc	-	EL US	纽约证券交易所	美国	460	786,228.43	0.17
121	Waste Management Inc	-	WM US	纽约证券交易所	美国	758	778,246.16	0.17
122	Aon PLC	-	AON US	纽约证券交易所	美国	422	763,790.61	0.16
123	Dollar General	-	DG US	纽约证券交易所	美国	456	751,144.18	0.16

	Corp			所				
124	Fidelity National Information Services Inc	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	1,213	746,278.89	0.16
125	FedEx Corp	-	FDX US	纽约证券交易所	美国	477	725,775.29	0.16
126	Norfolk Southern Corp	-	NSC US	纽约证券交易所	美国	475	724,581.20	0.16
127	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	230	723,233.22	0.15
128	Sherwin-Williams Co/The	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	475	713,806.05	0.15
129	Air Products & Chemicals Inc	-	APD US	纽约证券交易所	美国	440	710,141.29	0.15
130	Boston Scientific Corp	-	BSX US	纽约证券交易所	美国	2,839	710,130.08	0.15
131	Intercontinental Exchange Inc	-	ICE US	纽约证券交易所	美国	1,108	699,303.18	0.15
132	Occidental Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	1,768	698,655.67	0.15
133	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	1,159	692,054.27	0.15
134	Illinois Tool Works Inc	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	562	687,411.79	0.15
135	General Dynamics	-	GD US	纽约证券交易所	美国	457	678,598.04	0.15

	Corp			所				
136	Schlumberger Ltd	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	2,807	673,679.06	0.14
137	Eaton Corp PLC	-	ETN US	纽约证券交易所	美国	792	669,690.87	0.14
138	Pioneer Natural Resources Co	-	PXD US	纽约证券交易所	美国	446	667,741.88	0.14
139	Moderna Inc	-	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	689	660,560.48	0.14
140	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	1,161	659,275.65	0.14
141	American Electric Power Co Inc	-	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,020	656,769.55	0.14
142	Public Storage	-	PSA US	纽约证券交易所	美国	303	635,831.39	0.14
143	KLA Corp	-	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	296	633,876.16	0.14
144	McKesson Corp	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	289	632,715.15	0.14
145	Newmont Corp	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	1,576	631,139.52	0.14
146	Emerson Electric Co	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	1,179	629,379.39	0.13
147	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	623	628,309.25	0.13
148	L3Harris Technologies Inc	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	383	621,281.68	0.13
149	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	304	619,628.66	0.13



				交易所				
150	General Motors Co	-	GM US	纽约证券交易所	美国	2,895	617,081.02	0.13
151	Kimberly-Clark Corp	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	669	606,813.58	0.13
152	General Mills Inc	-	GIS US	纽约证券交易所	美国	1,195	605,118.28	0.13
153	Marathon Petroleum Corp	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	1,075	593,125.01	0.13
154	Exelon Corp	-	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,947	592,200.78	0.13
155	Ford Motor Co	-	F US	纽约证券交易所	美国	7,841	585,706.09	0.13
156	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	1,117	581,738.78	0.12
157	MetLife Inc	-	MET US	纽约证券交易所	美国	1,373	578,594.29	0.12
158	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	810	577,762.95	0.12
159	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	40	576,944.16	0.12
160	Moody's Corp	-	MCO US	纽约证券交易所	美国	316	576,794.63	0.12
161	Sysco Corp	-	SYU US	纽约证券交易所	美国	1,011	574,776.44	0.12
162	Freeport-McMoRan Inc	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	2,865	562,615.99	0.12
163	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	132	559,679.22	0.12
164	Roper	-	ROP US	纽约证	美国	210	556,217.34	0.12

	Technologies Inc			券交易所				
165	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	547	550,780.50	0.12
166	Realty Income Corp	-	O US	纽约证券交易所	美国	1,195	547,453.60	0.12
167	Capital One Financial Corp	-	COF US	纽约证券交易所	美国	781	546,122.66	0.12
168	Travelers Cos Inc/The	-	TRV US	纽约证券交易所	美国	480	544,847.56	0.12
169	IQVIA Holdings Inc	-	IQV US	纽约证券交易所	美国	373	543,202.39	0.12
170	American International Group Inc	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	1,573	539,781.06	0.12
171	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	955	525,505.64	0.11
172	Corteva Inc	-	CTVA US	纽约证券交易所	美国	1,436	521,778.06	0.11
173	NXP Semiconductors NV	-	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	519	515,620.55	0.11
174	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,082	513,840.35	0.11
175	Amphenol Corp	-	APH US	纽约证券交易所	美国	1,186	512,446.80	0.11
176	HCA Healthcare Inc	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	452	509,818.88	0.11
177	Ecolab Inc	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	493	508,748.82	0.11

178	Williams Cos Inc/The	-	WMB US	纽约证券交易所	美国	2,419	506,690.50	0.11
179	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,325	503,143.59	0.11
180	Constellation Brands Inc	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	321	502,095.00	0.11
181	Dow Inc	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	1,443	499,819.64	0.11
182	Marriott International Inc/MD	-	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	546	498,398.36	0.11
183	Welltower Inc	-	WELL US	纽约证券交易所	美国	901	497,968.09	0.11
184	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	429	495,105.62	0.11
185	Digital Realty Trust Inc	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	565	492,307.70	0.11
186	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	638	487,576.90	0.10
187	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	637	483,734.56	0.10
188	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	55	482,544.96	0.10
189	Prudential Financial Inc	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	738	473,904.30	0.10
190	Agilent Technologies Inc	-	A US	纽约证券交易所	美国	591	471,093.77	0.10
191	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	447	467,549.35	0.10

192	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	747	464,743.64	0.10
193	Allstate Corp/The	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	546	464,392.50	0.10
194	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,025	464,276.20	0.10
195	Motorola Solutions Inc	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	330	464,214.12	0.10
196	HP Inc	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	2,092	460,239.36	0.10
197	SBA Communications Corp	-	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	213	457,520.50	0.10
198	Arthur J Gallagher & Co	-	AJG US	纽约证券交易所	美国	417	456,292.52	0.10
199	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	558	455,574.53	0.10
200	Devon Energy Corp	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	1,229	454,564.40	0.10
201	Consolidated Edison Inc	-	ED US	纽约证券交易所	美国	703	448,692.66	0.10
202	MSCI Inc	-	MSCI US	纽约证券交易所	美国	161	445,342.67	0.10
203	Johnson Controls International plc	-	JCI US	纽约证券交易所	美国	1,383	444,415.75	0.10
204	Aflac Inc	-	AFL US	纽约证券交易所	美国	1,188	441,154.01	0.09
205	Yum!	-	YUM US	纽约证	美国	572	435,755.90	0.09

	Brands Inc			券交易所				
206	Kinder Morgan Inc	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	3,872	435,534.42	0.09
207	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	172	431,188.39	0.09
208	Baxter International Inc	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	1,000	431,073.22	0.09
209	Microchip Technology Inc	-	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,104	430,337.12	0.09
210	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	626	422,822.50	0.09
211	Global Payments Inc	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	566	420,282.90	0.09
212	Kroger Co/The	-	KR US	纽约证券交易所	美国	1,320	419,298.74	0.09
213	Public Service Enterprise Group Inc	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	987	419,176.33	0.09
214	Hershey Co/The	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	290	418,767.20	0.09
215	Parker-Hannifin Corp	-	PH US	纽约证券交易所	美国	252	416,137.67	0.09
216	Bank of New York Mellon Corp	-	BK US	纽约证券交易所	美国	1,482	414,859.96	0.09
217	Simon Property Group Inc	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	651	414,717.00	0.09
218	Hilton Worldwide Holdings	-	HLT US	纽约证券交易所	美国	552	412,850.97	0.09

	Inc							
219	ResMed Inc	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	290	408,004.13	0.09
220	Carrier Global Corp	-	CARR US	纽约证券交易所	美国	1,691	404,704.53	0.09
221	Trane Technologies PLC	-	TT US	纽约证券交易所	美国	464	404,426.82	0.09
222	International Flavors & Fragrances Inc	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	505	403,728.29	0.09
223	Otis Worldwide Corp	-	OTIS US	纽约证券交易所	美国	839	397,933.20	0.09
224	Warner Bros Discovery Inc	-	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,385	394,943.74	0.08
225	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	287	392,823.48	0.08
226	Hess Corp	-	HES US	纽约证券交易所	美国	550	391,053.14	0.08
227	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	166	390,745.63	0.08
228	DexCom Inc	-	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	779	389,656.30	0.08
229	Eversource Energy	-	ES US	纽约证券交易所	美国	685	388,334.69	0.08
230	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	312	386,041.88	0.08
231	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,142	382,607.79	0.08
232	VICI	-	VICI US	纽约证	美国	1,913	382,471.08	0.08

	Properties Inc			券交易所				
233	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	690	381,305.51	0.08
234	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	356	380,823.90	0.08
235	Twitter Inc	-	TWTR US	纽约证券交易所	美国	1,515	380,172.96	0.08
236	DuPont De Nemours Inc.	-	DD US	纽约证券交易所	美国	1,011	377,122.83	0.08
237	Halliburton Co	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	1,791	376,950.88	0.08
238	TransDigm Group Inc	-	TDG US	纽约证券交易所	美国	103	370,986.12	0.08
239	Nucor Corp	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	529	370,690.02	0.08
240	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	315	365,928.01	0.08
241	Cummins Inc	-	CMI US	纽约证券交易所	美国	279	362,381.17	0.08
242	Walgreens Boots Alliance Inc	-	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,423	361,957.21	0.08
243	AvalonBay Communities Inc	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	277	361,121.98	0.08
244	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,409	360,665.67	0.08
245	Baker Hughes Company	-	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,858	360,002.58	0.08

246	American Water Works Co Inc	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	360	359,443.79	0.08
247	Republic Services Inc	-	RSG US	纽约证券交易所	美国	409	359,233.26	0.08
248	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	464	356,065.00	0.08
249	Discover Financial Services	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	558	354,198.43	0.08
250	Enphase Energy Inc	-	ENPH US	纳斯达克证券交易所	美国	268	351,169.44	0.08
251	Ameriprise Financial Inc	-	AMP US	纽约证券交易所	美国	219	349,341.26	0.07
252	Keurig Dr Pepper Inc	-	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,465	347,961.59	0.07
253	Mettler-Toledo International Inc	-	MTD US	纽约证券交易所	美国	45	346,943.47	0.07
254	First Republic Bank/CA	-	FRC US	纽约证券交易所	美国	356	344,531.06	0.07
255	T Rowe Price Group Inc	-	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	451	343,879.45	0.07
256	AMETEK Inc	-	AME US	纽约证券交易所	美国	458	337,782.21	0.07
257	Keysight Technologies Inc	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	360	333,059.94	0.07
258	Tyson Foods Inc	-	TSN US	纽约证券交易所	美国	576	332,687.86	0.07
259	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	886	330,019.67	0.07



				所				
260	Equity Residential	-	EQR US	纽约证券交易所	美国	679	329,109.47	0.07
261	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	694	327,111.09	0.07
262	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	384	326,657.26	0.07
263	Albemarle Corp	-	ALB US	纽约证券交易所	美国	232	325,391.22	0.07
264	Weyerhaeuser Co	-	WY US	纽约证券交易所	美国	1,462	324,975.65	0.07
265	CBRE Group Inc	-	CBRE US	纽约证券交易所	美国	653	322,599.08	0.07
266	Aptiv PLC	-	APTV US	纽约证券交易所	美国	537	321,010.22	0.07
267	Edison International	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	756	320,868.28	0.07
268	Corning Inc	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	1,499	317,002.84	0.07
269	Old Dominion Freight Line Inc	-	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	182	313,039.56	0.07
270	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,112	310,986.41	0.07
271	Ameren Corp	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	512	310,498.36	0.07
272	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	424	309,206.55	0.07
273	Fifth Third Bancorp	-	FITB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,362	307,135.14	0.07

274	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	404	305,412.73	0.07
275	SVB Financial Group	-	SIVB US	纳斯达克证券交易所	美国	115	304,857.63	0.07
276	Extra Space Storage Inc	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	266	303,703.74	0.06
277	Rockwell Automation Inc	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	227	303,646.35	0.06
278	State Street Corp	-	STT US	纽约证券交易所	美国	728	301,215.69	0.06
279	LyondellBasell Industries NV	-	LYB US	纽约证券交易所	美国	513	301,120.25	0.06
280	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证券交易所	美国	242	296,863.75	0.06
281	Church & Dwight Co Inc	-	CHD US	纽约证券交易所	美国	477	296,635.96	0.06
282	West Pharmaceutical Services Inc	-	WST US	纽约证券交易所	美国	145	294,252.27	0.06
283	Laboratory Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证券交易所	美国	187	294,129.25	0.06
284	Willis Towers Watson PLC	-	WTW US	纳斯达克证券交易所	美国	222	294,097.44	0.06
285	Zimmer Biomet Holdings Inc	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	416	293,321.47	0.06
286	FirstEnergy	-	FE US	纽约证	美国	1,134	292,175.83	0.06

	y Corp			券交易所				
287	Ball Corp	-	BALL US	纽约证 券交易 所	美国	632	291,695.16	0.06
288	Hartford Financial Services Group Inc	-	HIG US	纽约证 券交易 所	美国	664	291,580.26	0.06
289	ON Semicond uctor Corp	-	ON US	纳斯达 克证券 交易所	美国	863	291,392.41	0.06
290	Tractor Supply Co	-	TSCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	222	288,823.09	0.06
291	Alexandri a Real Estate Equities Inc	-	ARE US	纽约证 券交易 所	美国	295	287,139.53	0.06
292	Southwest Airlines Co	-	LUV US	纽约证 券交易 所	美国	1,177	285,323.36	0.06
293	Amerisou rceBergen Corp	-	ABC US	纽约证 券交易 所	美国	299	283,909.13	0.06
294	DR Horton Inc	-	DHI US	纽约证 券交易 所	美国	636	282,528.73	0.06
295	Duke Realty Corp	-	DRE US	纽约证 券交易 所	美国	763	281,387.86	0.06
296	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证 券交易 所	美国	446	280,590.48	0.06
297	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	265	280,223.77	0.06
298	McCormi ck & Co Inc/MD	-	MKC US	纽约证 券交易 所	美国	496	277,127.13	0.06
299	Coterra Energy	-	CTRA US	纽约证 券交易	美国	1,587	274,689.08	0.06

	Inc			所				
300	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	171	274,621.02	0.06
301	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证 券交易 所	美国	793	273,717.67	0.06
302	STERIS PLC	-	STE US	纽约证 券交易 所	美国	196	271,176.80	0.06
303	Diamondback Energy Inc	-	FANG US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	333	270,757.67	0.06
304	Ulta Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	104	269,059.49	0.06
305	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	229	268,452.17	0.06
306	Northern Trust Corp	-	NTRS US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	413	267,424.06	0.06
307	PPL Corp	-	PPL US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,465	266,747.61	0.06
308	Waters Corp	-	WAT US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	120	266,560.70	0.06
309	Match Group Inc	-	MTCH US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	567	265,195.80	0.06
310	Gartner Inc	-	IT US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	161	261,305.88	0.06
311	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	576	260,939.23	0.06
312	WW Grainger Inc	-	GWW US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	85	259,238.23	0.06

313	Take-Two Interactiv e Software Inc	-	TTWO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	314	258,217.22	0.06
314	Catalent Inc	-	CTLT US	纽约证 券交易 所	美国	356	256,343.53	0.05
315	Fortive Corp	-	FTV US	纽约证 券交易 所	美国	700	255,476.15	0.05
316	Amcor PLC	-	AMCR US	纽约证 券交易 所	美国	2,991	249,517.30	0.05
317	Constellat ion Energy Corpotati on	-	CEG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	648	249,023.01	0.05
318	Genuine Parts Co	-	GPC US	纽约证 券交易 所	美国	278	248,147.30	0.05
319	CenterPoi nt Energy Inc	-	CNP US	纽约证 券交易 所	美国	1,249	247,955.49	0.05
320	Delta Air Lines Inc	-	DAL US	纽约证 券交易 所	美国	1,272	247,314.02	0.05
321	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证 券交易 所	美国	259	247,005.69	0.05
322	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证 券交易 所	美国	122	245,014.96	0.05
323	Lennar Corp	-	LEN US	纽约证 券交易 所	美国	514	243,442.48	0.05
324	CF Industries Holdings Inc	-	CF US	纽约证 券交易 所	美国	419	241,079.33	0.05
325	Quanta Services	-	PWR US	纽约证 券交易	美国	285	239,743.96	0.05

	Inc			所				
326	Kellogg Co	-	K US	纽约证券交易所	美国	500	239,395.64	0.05
327	PerkinElmer Inc	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	247	235,760.34	0.05
328	Nasdaq Inc	-	NDAQ US	纳斯达克证券交易所	美国	229	234,440.34	0.05
329	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证券交易所	美国	1,860	234,060.08	0.05
330	Cincinnati Financial Corp	-	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	293	233,967.05	0.05
331	Citizens Financial Group Inc	-	CFG US	纽约证券交易所	美国	974	233,302.09	0.05
332	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	386	231,625.58	0.05
333	Teledyne Technologies Inc	-	TDY US	纽约证券交易所	美国	92	231,611.22	0.05
334	United Rentals Inc	-	URI US	纽约证券交易所	美国	142	231,497.80	0.05
335	Hologic Inc	-	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	495	230,224.51	0.05
336	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	723	229,176.12	0.05
337	Dover Corp	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	281	228,797.80	0.05
338	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	144	228,727.73	0.05
339	Huntington Bancshare	-	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,822	227,843.04	0.05

	s Inc/OH							
340	Hewlett Packard Enterprise Co	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	2,552	227,110.55	0.05
341	Clorox Co/The	-	CLX US	纽约证券交易所	美国	240	227,081.56	0.05
342	Ingersoll-Rand Inc.	-	IR US	纽约证券交易所	美国	795	224,520.49	0.05
343	Monolithic Power Systems Inc	-	MPWR US	纳斯达克证券交易所	美国	87	224,237.81	0.05
344	Essex Property Trust Inc	-	ESS US	纽约证券交易所	美国	127	222,897.47	0.05
345	EPAM Systems Inc	-	EPAM US	纽约证券交易所	美国	111	219,600.90	0.05
346	Broadridge Financial Solutions Inc	-	BR US	纽约证券交易所	美国	228	218,129.90	0.05
347	Jacobs Engineering Group Inc	-	J US	纽约证券交易所	美国	255	217,571.17	0.05
348	FleetCor Technologies Inc	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	154	217,160.37	0.05
349	Expeditors International of Washington Inc	-	EXPD US	纳斯达克证券交易所	美国	331	216,504.80	0.05
350	Principal Financial Group Inc	-	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	481	215,610.37	0.05
351	Conagra Brands	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	936	215,091.24	0.05

	Inc			所				
352	Quest Diagnostics Inc	-	DGX US	纽约证 券交易 所	美国	240	214,195.67	0.05
353	Molina Healthcare Inc	-	MOH US	纽约证 券交易 所	美国	114	213,929.50	0.05
354	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	189	212,250.51	0.05
355	Internatio nal Paper Co	-	IP US	纽约证 券交易 所	美国	756	212,237.82	0.05
356	Marathon Oil Corp	-	MRO US	纽约证 券交易 所	美国	1,406	212,126.41	0.05
357	Stanley Black & Decker Inc	-	SWK US	纽约证 券交易 所	美国	300	211,127.22	0.05
358	KeyCorp	-	KEY US	纽约证 券交易 所	美国	1,817	210,113.20	0.04
359	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证 券交易 所	美国	276	207,648.03	0.04
360	Zebra Technolog ies Corp	-	ZBRA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	105	207,145.68	0.04
361	Cooper Cos Inc/The	-	COO US	纽约证 券交易 所	美国	97	203,842.94	0.04
362	SolarEdge Technolog ies Inc	-	SEDG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	110	202,045.35	0.04
363	Westingho use Air Brake Technolog ies Corp	-	WAB US	纽约证 券交易 所	美国	365	201,068.17	0.04
364	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	323	200,823.34	0.04
365	Evergy	-	EVRG US	纽约证	美国	448	196,187.64	0.04



	Inc			券交易所				
366	Paramount Global	-	PARA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,184	196,114.62	0.04
367	Garmin Ltd	-	GRMN US	纽约证券交易所	美国	297	195,840.33	0.04
368	Akamai Technologies Inc	-	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	317	194,305.84	0.04
369	Cardinal Health Inc	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	550	192,942.68	0.04
370	Darden Restaurants Inc	-	DRI US	纽约证券交易所	美国	254	192,835.17	0.04
371	CarMax Inc	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	317	192,497.45	0.04
372	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	489	192,350.67	0.04
373	Fox Corp	-	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	625	134,899.14	0.03
			FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	287	57,207.30	0.01
374	Seagate Technology Holdings PLC	-	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	400	191,784.97	0.04
375	Expedia Group Inc	-	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	301	191,569.06	0.04
376	Trimble Inc	-	TRMB US	纳斯达克证券交易所	美国	490	191,494.36	0.04
377	NetApp Inc	-	NTAP US	纳斯达克证券交易所	美国	437	191,341.21	0.04
378	Teradyne	-	TER US	纳斯达克	美国	318	191,119.87	0.04

	Inc			克证券 交易所				
379	FactSet Research Systems Inc	-	FDS US	纽约证 券交易 所	美国	74	190,994.23	0.04
380	Camden Property Trust	-	CPT US	纽约证 券交易 所	美国	211	190,437.85	0.04
381	VF Corp	-	VFC US	纽约证 券交易 所	美国	636	188,537.45	0.04
382	WR Berkley Corp	-	WRB US	纽约证 券交易 所	美国	409	187,371.15	0.04
383	Incyte Corp	-	INCY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	367	187,120.48	0.04
384	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	621	186,841.55	0.04
385	Pool Corp	-	POOL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	79	186,222.36	0.04
386	Domino's Pizza Inc	-	DPZ US	纽约证 券交易 所	美国	71	185,700.48	0.04
387	Leidos Holdings Inc	-	LDOS US	纽约证 券交易 所	美国	274	185,198.00	0.04
388	Xylem Inc/NY	-	XYL US	纽约证 券交易 所	美国	352	184,693.43	0.04
389	Iron Mountain Inc	-	IRM US	纽约证 券交易 所	美国	565	184,629.61	0.04
390	Synchron y Financial	-	SYF US	纽约证 券交易 所	美国	996	184,627.39	0.04
391	UDR Inc	-	UDR US	纽约证 券交易 所	美国	594	183,541.76	0.04
392	AES Corp	-	AES US	纽约证 券交易	美国	1,301	183,449.47	0.04

				所				
393	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	82	182,975.31	0.04
394	Healthpeak Properties Inc	-	PEAK US	纽约证券交易所	美国	1,052	182,934.78	0.04
395	JM Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	212	182,134.78	0.04
396	IDEX Corp	-	IEX US	纽约证券交易所	美国	149	181,629.75	0.04
397	Brown & Brown Inc	-	BRO US	纽约证券交易所	美国	458	179,326.73	0.04
398	Bio-Technologie Corp	-	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	77	179,135.86	0.04
399	FMC Corp	-	FMC US	纽约证券交易所	美国	248	178,110.35	0.04
400	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	415	177,168.54	0.04
401	Paycom Software Inc	-	PAYC US	纽约证券交易所	美国	94	176,719.75	0.04
402	Best Buy Co Inc	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	403	176,319.01	0.04
403	Textron Inc	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	430	176,242.04	0.04
404	Avery Dennison Corp	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	162	175,992.64	0.04
405	Generac Holdings Inc	-	GNRC US	纽约证券交易所	美国	124	175,247.54	0.04
406	Jack Henry & Associate	-	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	145	175,187.00	0.04

	s Inc							
407	Hormel Foods Corp	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	551	175,136.40	0.04
408	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	164	173,322.44	0.04
409	CH Robinson Worldwide Inc	-	CHRW US	纳斯达克证券交易所	美国	254	172,804.99	0.04
410	LKQ Corp	-	LKQ US	纳斯达克证券交易所	美国	524	172,638.42	0.04
411	Packaging Corp of America	-	PKG US	纽约证券交易所	美国	186	171,644.06	0.04
412	Celanese Corp	-	CE US	纽约证券交易所	美国	213	168,126.81	0.04
413	Brown-Forman Corp	-	BF/B US	纽约证券交易所	美国	357	168,101.24	0.04
414	NortonLifeLock Inc	-	NLOK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,135	167,278.96	0.04
415	Boston Properties Inc	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	278	166,016.14	0.04
416	Viatis Inc	-	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,359	165,763.06	0.04
417	Masco Corp	-	MAS US	纽约证券交易所	美国	477	161,987.69	0.03
418	NVR Inc	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	6	161,240.31	0.03
419	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	1,203	159,619.31	0.03
420	NiSource Inc	-	NI US	纽约证券交易所	美国	805	159,324.94	0.03

				所				
421	Citrix Systems Inc	-	CTXS US	纳斯达克证券交易所	美国	244	159,123.80	0.03
422	Cboe Global Markets Inc	-	CBOE US	巴兹全球市场	美国	209	158,769.64	0.03
423	Eastman Chemical Co	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	263	158,452.87	0.03
424	Howmet Aerospace Inc	-	HWM US	纽约证券交易所	美国	750	158,305.15	0.03
425	Apa Corp	-	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	672	157,401.12	0.03
426	Loews Corp	-	L US	纽约证券交易所	美国	391	155,507.57	0.03
427	Teleflex Inc	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	92	151,799.79	0.03
428	Las Vegas Sands Corp	-	LVS US	纽约证券交易所	美国	671	151,267.51	0.03
429	United Airlines Holdings Inc	-	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	632	150,237.64	0.03
430	Signature Bank/New York NY	-	SBNY US	纳斯达克证券交易所	美国	124	149,141.00	0.03
431	ABIOME D Inc	-	ABMD US	纳斯达克证券交易所	美国	89	147,841.34	0.03
432	PTC Inc	-	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	207	147,733.89	0.03
433	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,393	146,592.01	0.03

434	Live Nation Entertainment Inc	-	LYV US	纽约证券交易所	美国	264	146,316.04	0.03
435	Everest Re Group Ltd	-	RE US	纽约证券交易所	美国	77	144,842.48	0.03
436	Nordson Corp	-	NDSN US	纳斯达克证券交易所	美国	106	144,017.52	0.03
437	Advance Auto Parts Inc	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	123	142,886.18	0.03
438	Bio-Rad Laboratories Inc	-	BIO US	纽约证券交易所	美国	43	142,852.15	0.03
439	Charles River Laboratories International Inc	-	CRL US	纽约证券交易所	美国	99	142,167.79	0.03
440	Interpublic Group of Cos Inc	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	769	142,084.16	0.03
441	Henry Schein Inc	-	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	271	139,573.90	0.03
442	WestRock Co	-	WRK US	纽约证券交易所	美国	521	139,306.11	0.03
443	Hasbro Inc	-	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	253	139,030.95	0.03
444	Snap-on Inc	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	105	138,846.45	0.03
445	Lamb Weston Holdings Inc	-	LW US	纽约证券交易所	美国	285	136,685.04	0.03
446	MGM Resorts International	-	MGM US	纽约证券交易所	美国	703	136,589.41	0.03

	nal							
447	Qorvo Inc	-	QRVO US	纳斯达克 证券交易 所	美国	215	136,099.14	0.03
448	Molson Coors Beverage Co	-	TAP US	纽约证 券交易 所	美国	368	134,628.54	0.03
449	Lumen Technolog ies Inc	-	LUMN US	纽约证 券交易 所	美国	1,798	131,652.03	0.03
450	PulteGrou p Inc	-	PHM US	纽约证 券交易 所	美国	494	131,390.55	0.03
451	Assurant Inc	-	AIZ US	纽约证 券交易 所	美国	112	129,927.33	0.03
452	MarketAx ess Holdings Inc	-	MKTX US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	75	128,863.91	0.03
453	Campbell Soup Co	-	CPB US	纽约证 券交易 所	美国	395	127,380.69	0.03
454	Comerica Inc	-	CMA US	纽约证 券交易 所	美国	256	126,075.53	0.03
455	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证 券交易 所	美国	478	122,451.24	0.03
456	Etsy Inc	-	ETSY US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	248	121,852.72	0.03
457	Juniper Networks Inc	-	JNPR US	纽约证 券交易 所	美国	635	121,459.56	0.03
458	F5 Inc	-	FFIV US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	118	121,199.29	0.03
459	Regency Centers Corp	-	REG US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	301	119,813.99	0.03
460	Globe Life Inc	-	GL US	纽约证 券交易	美国	182	119,057.15	0.03

				所				
461	Whirlpool Corp	-	WHR US	纽约证券交易所	美国	112	116,412.19	0.02
462	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	79	115,488.29	0.02
463	Allegion PLC	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	175	114,983.06	0.02
464	Organon & Co	-	OGN US	纽约证券交易所	美国	495	112,122.33	0.02
465	Sealed Air Corp	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	289	111,953.40	0.02
466	Robert Half International Inc	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	218	109,570.45	0.02
467	Nielsen Holdings PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	700	109,087.10	0.02
468	Pinnacle West Capital Corp	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	221	108,453.00	0.02
469	American Airlines Group Inc	-	AAL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,263	107,482.00	0.02
470	News Corp	-	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	767	80,200.29	0.02
			NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	255	27,194.26	0.01
471	Caesars Entertainment Inc	-	CZR US	纳斯达克证券交易所	美国	417	107,188.44	0.02
472	Fortune Brands Home & Security	-	FBHS US	纽约证券交易所	美国	265	106,497.84	0.02



	Inc							
473	BorgWarner Inc	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	468	104,813.01	0.02
474	Zions Bancorp NA	-	ZION US	纳斯达克证券交易所	美国	306	104,532.74	0.02
475	Lincoln National Corp	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	332	104,212.20	0.02
476	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证券交易所	美国	442	103,588.04	0.02
477	Royal Caribbean Cruises Ltd	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	438	102,621.20	0.02
478	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证券交易所	美国	500	102,415.96	0.02
479	DENTSP LY SIRONA Inc	-	XRAY US	纳斯达克证券交易所	美国	427	102,393.88	0.02
480	DXC Technology Co	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	492	100,083.89	0.02
481	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	323	99,219.39	0.02
482	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	143	96,654.43	0.02
483	AO Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	260	95,414.63	0.02
484	Newell Brands Inc	-	NWL US	纳斯达克证券交易所	美国	739	94,433.16	0.02
485	Carnival Corp	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	1,570	91,144.17	0.02
486	Mohawk	-	MHK US	纽约证	美国	108	89,944.30	0.02

	Industries Inc			券交易所				
487	Federal Realty Investment Trust	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	137	88,029.27	0.02
488	Franklin Resources Inc	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	549	85,887.06	0.02
489	Bath & Body Works Inc.	-	BBWI US	纽约证券交易所	美国	474	85,638.00	0.02
490	Ceridian HCM Holding Inc	-	CDAY US	纽约证券交易所	美国	266	84,048.74	0.02
491	Wynn Resorts Ltd	-	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	206	78,777.61	0.02
492	Invesco Ltd	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	666	72,097.75	0.02
493	DaVita Inc	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	128	68,690.37	0.01
494	Penn Entertainment Inc	-	PENN US	纳斯达克证券交易所	美国	325	66,352.26	0.01
495	Alaska Air Group Inc	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	245	65,853.93	0.01
496	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	832	62,092.80	0.01
497	Vornado Realty Trust	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	311	59,674.35	0.01
498	DISH Network Corp	-	DISH US	纳斯达克证券交易所	美国	488	58,723.68	0.01
499	Ralph	-	RL US	纽约证	美国	96	57,760.99	0.01

	Lauren Corp			券交易所				
500	PVH Corp	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	139	53,081.13	0.01

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Apple Inc	AAPL US	2,106,049.65	0.34
2	Microsoft Corp	MSFT US	1,893,738.15	0.31
3	Alphabet Inc	GOOGL US	675,413.21	0.11
		GOOG US	562,971.77	0.09
4	Amazon.com Inc	AMZN US	1,137,085.85	0.19
5	Tesla Inc	TSLA US	881,707.17	0.14
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	520,475.72	0.08
7	NVIDIA Corp	NVDA US	492,073.93	0.08
8	Johnson & Johnson	JNJ US	417,056.37	0.07
9	UnitedHealth Group Inc	UNH US	411,004.73	0.07
10	VICI Properties Inc	VICI US	394,074.38	0.06
11	Meta Platforms Inc	META US	385,187.59	0.06
12	JPMorgan Chase & Co	JPM US	370,768.18	0.06
13	Keurig Dr Pepper Inc	KDP US	336,774.94	0.05
14	Exxon Mobil Corp	XOM US	326,816.28	0.05
15	ON Semiconductor Corp	ON US	302,980.36	0.05
16	Chevron Corp	CVX US	293,692.90	0.05
17	Procter & Gamble Co/The	PG US	287,348.33	0.05
18	Visa Inc	V US	274,509.89	0.04
19	Pfizer Inc	PFE US	262,699.55	0.04
20	Molina Healthcare Inc	MOH US	254,077.42	0.04

注：1. 买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	----------	------	----------	-------------

				(%)
1	Apple Inc	AAPL US	5,928,473.50	0.97
2	Microsoft Corp	MSFT US	5,139,641.62	0.84
3	Alphabet Inc	GOOGL US	1,791,510.21	0.29
		GOOG US	1,736,891.45	0.28
4	Amazon.com Inc	AMZN US	3,012,705.75	0.49
5	Tesla Inc	TSLA US	1,531,666.76	0.25
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	1,492,378.42	0.24
7	NVIDIA Corp	NVDA US	1,365,245.14	0.22
8	Meta Platforms Inc	META US	1,221,122.88	0.20
9	UnitedHealth Group Inc	UNH US	1,108,327.33	0.18
10	Johnson & Johnson	JNJ US	1,076,174.09	0.18
11	JPMorgan Chase & Co	JPM US	959,255.70	0.16
12	Visa Inc	V US	848,185.75	0.14
13	Procter & Gamble Co/The	PG US	836,769.08	0.14
14	Exxon Mobil Corp	XOM US	790,091.98	0.13
15	Home Depot Inc/The	HD US	779,222.24	0.13
16	Mastercard Inc	MA US	701,299.45	0.11
17	Pfizer Inc	PFE US	687,574.61	0.11
18	Bank of America Corp	BAC US	673,870.57	0.11
19	Chevron Corp	CVX US	671,780.35	0.11
20	AbbVie Inc	ABBV US	640,360.48	0.10

注：1.卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	29,646,274.13
卖出收入（成交）总额	83,845,944.52

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Sep22	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为-286,442.90 元，已包含在结算备付金中。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，谷歌在报告编制日前一年内曾受到西班牙数据保护局、俄罗斯联邦法警局、法国国家信息自由委员会、法国巴黎商业法院、俄罗斯莫斯科法院、韩国公平贸易委员会和法国竞争管理局的处罚。谷歌在本报告期内受到英国竞争主管机关竞争与市场委员会调查。苹果在报告编制日前一年内曾受到意大利监管机构和荷兰消费者和市场监管局的处罚。苹果在本报告期内受到英国竞争和市场管理局和欧盟委员会调查。强生公司在报告编制日前一年内曾受到美国西弗吉尼亚州相关药物监管委员会的处罚。特斯拉在报告编制日前一年内曾受到美国环保署的处罚。特斯拉在本报告期内受到德国联邦汽车运输管理局的调查。亚马逊在报告编制日前一年内曾受到卢森堡数据保护委员会、美国华盛顿州总检察长办公室和意大利反垄断机构的处罚。亚马逊在本报告期内受到美国证监会和美国联邦贸易委员会调查。

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

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

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,116,240.05
2	应收清算款	-
3	应收股利	300,093.34
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,248,905.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,665,238.48

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
易方达标普 500 指数(QDII-LOF) A	75,181	3,836.51	31,595,454.96	10.95%	256,836,845.86	89.05%
易方达标普 500 指数(QDII-LOF) C	2,356	1,746.32	0.00	0.00%	4,114,329.04	100.00%

合计	77,537	3,772.99	31,595,454.96	10.80%	260,951,174.90	89.20%
----	--------	----------	---------------	--------	----------------	--------

注：易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A 包含 A 类人民币份额及 A 类美元份额；易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C 包含 C 类人民币份额及 C 类美元份额。下同。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	马国芳	2,223,400.00	7.75%
2	许可	1,000,000.00	3.49%
3	安洁	986,555.00	3.44%
4	张远文	720,113.00	2.51%
5	袁达能	710,200.00	2.48%
6	杨巧伟	626,005.00	2.18%
7	夏天平	388,424.00	1.35%
8	上海翼丰投资管理有限公司一翼丰 103 号私募基金	326,864.00	1.14%
9	任钢	285,583.00	1.00%
10	吴淞	273,302.00	0.95%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	575,670.70	0.1996%
	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C	1,820.39	0.0442%
	合计	577,491.09	0.1974%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	10~50
	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C	0
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	0
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	693,199,312.42	-
本报告期期初基金份额总额	323,161,715.07	1,641,786.99
本报告期基金总申购份额	69,981,931.69	4,310,525.42
减：本报告期基金总赎回份额	104,711,345.94	1,837,983.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	288,432,300.82	4,114,329.04

注：易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A 份额变动含 A 类人民币份额及 A 类美元份额；易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C 份额变动含 C 类人民币份额及 C 类美元份额。

## 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 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Citigroup Global Markets Limited	1	110,596,830.36	98.47%	8,431.99	90.77%	-
Goldman Sachs	1	1,715,050.41	1.53%	857.59	9.23%	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无新增交易账户，如下证券经营机构 Everbright Securities (International) Limited, GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd. 的期货账户不再列示。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

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

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

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

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、

税收等资讯的提供与培训；

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

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

c) 基金交易账户的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。
- 2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

### 10.7.2 基金租用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
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

1	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2022 年 1 月 17 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-12
4	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）恢复大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2022-01-21
6	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2022 年 2 月 21 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-16
7	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）暂停大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-09
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	证券时报	2022-03-30
9	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
10	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2022 年 4 月 15 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-12
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2022-04-22
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
14	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
15	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2022 年 5 月 30 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-25
16	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2022 年 6 月 20 日暂停申购、赎回及定期定额	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2022-06-15

	投资业务的公告	子披露网站	
17	关于易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2022 年下半年境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-27
18	关于旗下部分基金 2022 年 7 月 4 日因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-28

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）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。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 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

二〇二二年八月三十日