

# 易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券 投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	55

7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12	投资组合报告附注.....	56
8	基金份额持有人信息.....	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
9	开放式基金份额变动.....	58
10	重大事件揭示.....	58
10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4	基金投资策略的改变.....	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8	其他重大事件.....	61
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
12	备查文件目录.....	64
12.1	备查文件目录.....	64
12.2	存放地点.....	64
12.3	查阅方式.....	64

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500E、沪港深 500ETF 指数
基金主代码	517010
交易代码	517010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 3 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,144,188.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 8 月 12 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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

### 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-791,671.72
本期利润	766,052.67
加权平均基金份额本期利润	0.0212

本期加权平均净值利润率	2.44%
本期基金份额净值增长率	-6.18%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	-4,118,500.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0855
期末基金资产净值	44,025,687.61
期末基金份额净值	0.9145
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-8.55%

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

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

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

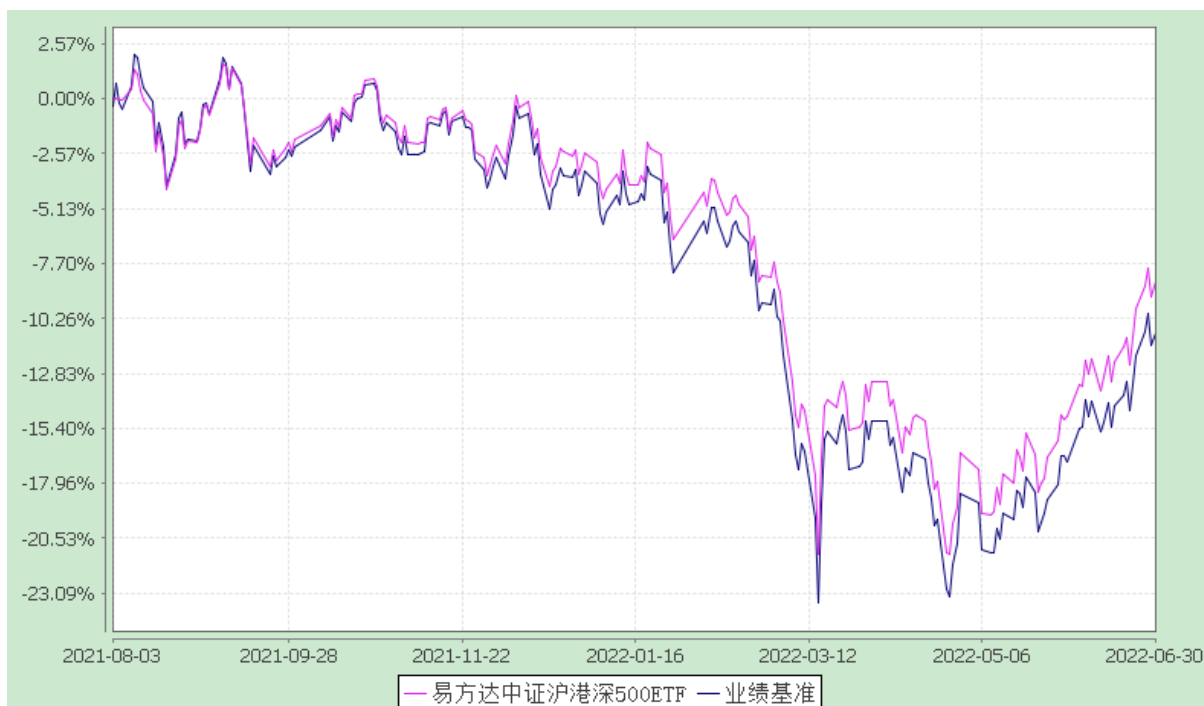
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.32%	1.09%	6.87%	1.13%	0.45%	-0.04%
过去三个月	6.47%	1.37%	5.93%	1.36%	0.54%	0.01%
过去六个月	-6.18%	1.47%	-7.78%	1.55%	1.60%	-0.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-8.55%	1.20%	-10.92%	1.28%	2.37%	-0.08%

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

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2021 年 8 月 3 日至 2022 年 6 月 30 日）



注：1.本基金合同于 2021 年 8 月 3 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-8.55%，同期业绩比较基准收益率为-10.92%。

## 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		



成曦	本基金的基金经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达恒生国企联接（QDII）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证创新药产业 ETF、易方达上证科创板 50 联接、易方达中证智能电动汽车 ETF、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证科创创业 50ETF、易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证沪港深 300ETF、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF、易方达中证港股通中国 100ETF、易方达中证消费 50ETF、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）的基金经理	2021-08-03	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理，易方达中小板指数（LOF）、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级、易方达深证成指 ETF、易方达深证成指 ETF 联接、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、易方达原油（QDII-LOF-FOF）、易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式、易方达中证香港证券投资主题 ETF 的基金经理。
伍臣东	本基金的基金经理助理，易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证科创创业 50ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF 的基金经理，易方达上证科创板 50 联接、易方达中证创新药产业 ETF、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证智能电动汽车 ETF、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证消费 50ETF 的基金经理助理	2021-09-04	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究支持专员、指数研究员。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 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 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。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证沪港深 500 指数，该指数选取沪港深交易所上市的互联互通范围内流动性较好、市值较大的 500 只股票作为指数样本股，以反映沪港深三地上市大市值企业股票的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

回顾 2022 年上半年，面对“奥密克戎”新变种的冲击，我国局部地区疫情防控形势仍然严峻复杂，疫情对经济运行产生了短期冲击；另一方面，地缘政治风险加剧导致关键商品出现供应链挑战，大幅度推升全球主要经济体通胀水平，在此背景下美联储等主要央行启动货币紧缩进程并逐步加大力度，全球金融市场流动性承受了一定的压力。在国际形势更趋复杂严峻、国内发展面临新挑战、经济下行压力进一步加大的背景下，一季度 A 股市场投资者风险偏好有所回落。二季度随着疫情精准防控取得阶段性成效，国内聚集性疫情逐步得到控制。与此同时各项稳经济大盘政策举措持续落地，

我国经济克服超预期因素不利影响，呈现企稳回升态势。4 月底以来，市场情绪明显好转。按不变价格计算，上半年我国国内生产总值同比增长 2.5%，其中二季度国内生产总值实现同比正增长。

在多重内外部因素持续变化的影响下，报告期内 A 股市场整体走势先跌后涨，波动率维持在较高水平。港股市场受到地缘政治风险加剧、美联储货币紧缩节奏加快、国内经济下行压力加大、以及行业监管政策环境变化等多重因素的影响，整体波动较为剧烈，主要宽基指数均出现下跌。报告期内中证沪港深 500 指数下跌 7.8%。

本报告期涵盖本基金的建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作。在基金的正常运作期，本基金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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9145 元，本报告期份额净值增长率为-6.18%，同期业绩比较基准收益率为-7.78%，年化跟踪误差 2.99%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，全球经济增速或受制于主要发达国家央行为抗击高通胀持续加码的货币紧缩政策，疫情反复和地缘政治风险导致的供应链冲击也是经济修复进程中不容忽视的拖累因素。我国仍将坚持以“动态清零”为目标的疫情精准防控，在有效控制疫情处于总体平稳的基础上，稳住经济大盘相关的一揽子政策措施将加快落地。货币政策助力实体经济融资成本稳中有降、维持流动性合理充裕的同时，财政政策在保市场主体、为中小企业纾困解难方面将发挥更加重要的作用，作为逆周期调节工具的基建投资也将发力提速。多方合力有望推动我国经济克服超预期因素的不利冲击，实现企稳复苏。长期来看，在我国居民可投资资产快速增加，财富结构面临转型的背景下，权益市场配置比例逐步增加的趋势不变。国内资本市场开放性、包容性有望不断增强，新兴领域优质企业登陆资本市场的步伐加快，为国际投资者配置中国资产、分享高成长机遇提供了更多选择，A 股市场的全球吸引力将持续提升。

香港市场方面，长期来看，随着中国经济的蓬勃发展和香港国际金融中心地位的持续提升，内地与香港市场双向高水平互联互通不断推进，香港资本市场充分发挥作为中国与海外市场沟通纽带的作用，未来将迎来更大的发展机遇。港股市场作为中国权益资产的重要组成部分，其中估值合理、竞争力强的优质上市公司对海内外资金具有吸引力。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的

跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享沪港深证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

自本报告期初至 2022 年 1 月 11 日，2022 年 2 月 16 日至 2022 年 3 月 28 日，2022 年 4 月 28 日至 2022 年 6 月 10 日，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	1,866,701.68	1,664,263.60
结算备付金		3,776.23	102,745.94
存出保证金		9,065.89	37,366.21
交易性金融资产	6.4.7.2	42,042,440.65	18,935,608.67
其中：股票投资		42,036,440.22	18,935,608.67
基金投资		-	-
债券投资		6,000.43	-
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		117,202.53	295.79
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	224.94
资产总计		44,114,803.22	20,740,505.15
<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		3.52	1.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,387.93	2,550.93
应付托管费		1,795.98	850.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	81,928.18	128,309.33
负债合计		89,115.61	131,712.02
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	48,144,188.00	21,144,188.00
未分配利润	6.4.7.8	-4,118,500.39	-535,394.87
净资产合计		44,025,687.61	20,608,793.13
负债和净资产总计		44,114,803.22	20,740,505.15

注：1.本基金合同生效日为 2021 年 8 月 3 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 8 月 3 日至 2021 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9145 元，基金份额总额 48,144,188.00 份。

3.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：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		897,551.08
1.利息收入		6,708.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,708.03
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）		-1,001,720.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,468,777.82
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	3,771.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	463,286.02
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,557,724.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	334,839.35
<b>减：二、营业总支出</b>		131,498.41
1. 管理人报酬		23,221.29
2. 托管费		7,740.41
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	100,536.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>766,052.67</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>766,052.67</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		766,052.67

注：本基金合同生效日为 2021 年 8 月 3 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	21,144,188.00	-	-535,394.87	20,608,793.13
二、本期期初净资产（基金净值）	21,144,188.00	-	-535,394.87	20,608,793.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,000,000.00	-	-3,583,105.52	23,416,894.48
（一）、综合收益总额	-	-	766,052.67	766,052.67
（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）	27,000,000.00	-	-4,349,158.19	22,650,841.81
其中：1.基金申购款	87,000,000.00	-	-8,827,950.33	78,172,049.67
2.基金赎回款	-60,000,000.00	-	4,478,792.14	-55,521,207.86
（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）	48,144,188.00	-	-4,118,500.39	44,025,687.61

注：本基金合同生效日为 2021 年 8 月 3 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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业务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，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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。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

金融资产和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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

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。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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 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》，公募证券投资基金自 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、应收利息和应收股利，金额分别为 1,664,263.60 元、102,745.94 元、37,366.21 元、224.94 元和 295.79 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-应收利息和应收股利，金额分别为 1,664,425.44 元、102,792.24 元、37,383.01 元、0.00 元和 295.79 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 18,935,608.67 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 18,935,608.67 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 1.43 元、2,550.93 元、850.33 元和 28,028.51 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 1.43 元、2,550.93 元、850.33 元和 28,028.51 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]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]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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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	1,866,701.68
等于：本金	1,866,539.87
加：应计利息	161.81
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,866,701.68

##### 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	40,762,069.17	-	42,036,440.22	1,274,371.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券				
交易所		0.45		
市场	5,999.98		6,000.43	-

	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	5,999.98	0.45	6,000.43	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		40,768,069.15	0.45	42,042,440.65	1,274,371.05

### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,524.12
其中：交易所市场	14,524.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	62,574.20



可退替代款	4,829.86
合计	81,928.18

## 6.4.7.7 实收基金

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	21,144,188.00	21,144,188.00
本期申购	87,000,000.00	87,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-60,000,000.00	-60,000,000.00
本期末	48,144,188.00	48,144,188.00

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-455,373.68	-80,021.19	-535,394.87
本期利润	-791,671.72	1,557,724.39	766,052.67
本期基金份额交易产生的变动数	-702,067.67	-3,647,090.52	-4,349,158.19
其中：基金申购款	-2,776,594.06	-6,051,356.27	-8,827,950.33
基金赎回款	2,074,526.39	2,404,265.75	4,478,792.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,949,113.07	-2,169,387.32	-4,118,500.39

## 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	4,244.79
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	2,122.96
其他	340.28
合计	6,708.03

## 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	-1,063,213.06
股票投资收益——赎回差价收入	-405,564.76
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,468,777.82

## 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	39,936,766.84
减：卖出股票成本总额	40,849,905.20
减：交易费用	150,074.70
买卖股票差价收入	-1,063,213.06

## 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	55,521,207.86
减：现金支付赎回款总额	36,066,011.86
减：赎回股票成本总额	19,860,760.76
减：交易费用	-
赎回差价收入	-405,564.76

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,770.11
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	3,771.11

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,770.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	29,000.00

成本总额	
减：应计利息总额	0.57
减：交易费用	0.03
买卖债券差价收入	3,770.11

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 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	463,286.02
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	463,286.02

#### 6.4.7.15 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	1,557,724.39
——股票投资	1,557,724.39
——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	-
——权证投资	-
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	1,557,724.39

#### 6.4.7.16 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	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	334,839.35

其他	-
合计	334,839.35

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

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	918.00
港股通证券组合费	441.57
其他	84,300.75
合计	100,536.71

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

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
当期发生的基金应支付的管理费	23,221.29
其中：支付销售机构的客户维护费	653.69

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

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,740.41

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	33,000,000.00
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	33,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	68.5441%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2022年1月1日至2022年6月30日

	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,866,701.68	4,244.79

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	600958	东方证券	配股	1,428	12,080.88

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券、托管行发行的股票工商银行。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有广发证券的 A 股 3,600 股(2021 年 12 月 31 日：1,400 股)，占本基金资产净值的比例为 0.15%（2021 年 12 月 31 日：0.17%）；持有工商银行的港股 103,000 股(2021 年 12 月 31 日：49,000 股)，占本基金资产净值的比例为 0.93%（2021 年 12 月 31 日：0.86%）；持有工商银行的 A 股 41,800 股(2021 年 12 月 31 日：18,900 股)，占本基金资产净值的比例为 0.45%（2021 年 12 月 31 日：0.42%）。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
113060	浙 22 转债	2022-06-15	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	60	6,000.00	6,000.43	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
06666	恒大物业	2022-03-21	重大事项停牌	1.97	-	-	3,000	7,418.72	5,900.81	-
03380	龙光集团	2022-05-12	重大事项停牌	1.86	2022-08-24	0.82	2,000	4,878.60	3,728.63	-

## 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。

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金属股票基金，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。

## 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 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 0.01%(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	6,000.43	0.00
AAA 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	6,000.43	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 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

#### 6.4.13.2.6 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(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。本基金可通过港股通投资香港市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,866,701.68	-	-	-	1,866,701.68
结算备付金	3,776.23	-	-	-	3,776.23
存出保证金	9,065.89	-	-	-	9,065.89

交易性金融资产	-	-	6,000.43	42,036,440.22	42,042,440.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	117,202.53	117,202.53
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	1,879,543.80	-	6,000.43	42,229,258.99	44,114,803.22
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3.52	3.52
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,387.93	5,387.93
应付托管费	-	-	-	1,795.98	1,795.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	81,928.18	81,928.18
负债总计	-	-	-	89,115.61	89,115.61
利率敏感度缺口	1,879,543.80	-	6,000.43	42,140,143.38	44,025,687.61
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	1,664,263.60	-	-	-	1,664,263.60
结算备付金	102,745.94	-	-	-	102,745.94
存出保证金	37,366.21	-	-	-	37,366.21
交易性金融资产	-	-	-	18,935,608.67	18,935,608.67
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	-	-	-	224.94	224.94
应收股利	-	-	-	295.79	295.79
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,804,375.75	-	-	18,936,129.40	20,740,505.15
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	-	-	-	1.43	1.43
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,550.93	2,550.93
应付托管费	-	-	-	850.33	850.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	28,028.51	28,028.51
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	100,280.82	100,280.82
负债总计	-	-	-	131,712.02	131,712.02
利率敏感度缺口	1,804,375.75	-	-	18,804,417.38	20,608,793.13

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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				
交易性金融资产	-	15,979,149.74	-	15,979,149.74
资产合计	-	<b>15,979,149.74</b>	-	<b>15,979,149.74</b>
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	<b>15,979,149.74</b>	-	<b>15,979,149.74</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				
交易性金融资产	-	6,589,097.67	-	6,589,097.67
资产合计	-	<b>6,589,097.67</b>	-	<b>6,589,097.67</b>
外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	<b>6,589,097.67</b>	-	<b>6,589,097.67</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%	-798,957.49	-329,454.88
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	798,957.49	329,454.88

## 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	42,036,440.22	95.48	18,935,608.67	91.88
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	42,036,440.22	95.48	18,935,608.67	91.88

#### 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%	2,101,821.05	946,780.42
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,101,821.05	-946,780.42

#### 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	42,026,810.78
第二层次	15,629.87
第三层次	-
合计	42,042,440.65

**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	42,036,440.22	95.29
	其中：股票	42,036,440.22	95.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,000.43	0.01



	其中：债券	6,000.43	0.01
	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	1,870,477.91	4.24
8	其他各项资产	201,884.66	0.46
9	合计	44,114,803.22	100.00

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 15,979,149.74 元，占净值比例 36.30%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	304,604.00	0.69
B	采矿业	683,303.70	1.55
C	制造业	15,469,372.87	35.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	629,700.00	1.43
E	建筑业	470,512.80	1.07
F	批发和零售业	117,053.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	675,640.48	1.53
H	住宿和餐饮业	37,740.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	757,752.98	1.72
J	金融业	5,306,407.40	12.05
K	房地产业	474,064.00	1.08
L	租赁和商务服务业	360,949.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	465,152.00	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,738.00	0.03
Q	卫生和社会工作	233,093.00	0.53
R	文化、体育和娱乐业	59,189.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	26,057,272.23	59.19

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	439,208.47	1.00
材料	194,059.71	0.44
工业	659,557.58	1.50
非必需消费品	2,529,288.60	5.75
必需消费品	594,344.23	1.35
保健	719,299.45	1.63
金融	5,397,480.36	12.26
信息技术	733,429.76	1.67
电信服务	3,092,982.79	7.03
公用事业	511,067.52	1.16
房地产	1,108,431.27	2.52
合计	15,979,149.74	36.30

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	8,000	2,424,634.69	5.51
2	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	3.25
3	00005	汇丰控股	24,400	1,077,761.75	2.45
4	01299	友邦保险	14,200	1,032,821.51	2.35
5	601318	中国平安	13,000	606,970.00	1.38
5	02318	中国平安	9,000	410,619.48	0.93
6	03690	美团-W	5,900	979,859.60	2.23
7	300750	宁德时代	1,700	907,800.00	2.06
8	600036	招商银行	14,700	620,340.00	1.41
8	03968	招商银行	5,500	246,936.11	0.56

9	00939	建设银行	143,000	644,479.74	1.46
9	601939	建设银行	8,095	49,055.70	0.11
10	01398	工商银行	103,000	410,474.10	0.93
10	601398	工商银行	41,800	199,386.00	0.45
11	00388	香港交易所	1,500	495,155.01	1.12
12	601012	隆基绿能	7,268	484,266.84	1.10
13	000858	五粮液	2,300	464,439.00	1.05
14	002594	比亚迪	1,100	366,839.00	0.83
15	000333	美的集团	5,900	356,301.00	0.81
16	00941	中国移动	7,500	314,282.33	0.71
16	600941	中国移动	600	36,300.00	0.08
17	03988	中国银行	100,000	267,674.47	0.61
17	601988	中国银行	25,200	82,152.00	0.19
18	601166	兴业银行	17,400	346,260.00	0.79
19	300059	东方财富	12,640	321,056.00	0.73
20	600900	长江电力	13,600	314,432.00	0.71
21	02269	药明生物	5,000	307,013.21	0.70
22	603259	药明康德	2,500	259,975.00	0.59
22	02359	药明康德	500	44,683.68	0.10
23	600030	中信证券	11,635	252,014.10	0.57
23	06030	中信证券	3,500	52,500.11	0.12
24	601888	中国中免	1,200	279,516.00	0.63
25	601328	交通银行	32,800	163,344.00	0.37
25	03328	交通银行	21,000	97,337.73	0.22
26	01810	小米集团-W	20,800	242,627.67	0.55
27	600887	伊利股份	6,100	237,595.00	0.54
28	601899	紫金矿业	17,200	160,476.00	0.36
28	02899	紫金矿业	8,000	65,747.01	0.15
29	01024	快手-W	3,000	224,230.82	0.51
30	000568	泸州老窖	900	221,886.00	0.50
31	02331	李宁	3,500	217,603.10	0.49
32	00981	中芯国际	7,000	108,831.48	0.25
32	688981	中芯国际	2,258	101,993.86	0.23
33	601288	农业银行	38,000	114,760.00	0.26
33	01288	农业银行	37,000	93,660.41	0.21
34	600690	海尔智家	4,502	123,624.92	0.28
34	06690	海尔智家	3,400	84,467.12	0.19
35	000002	万科 A	8,200	168,100.00	0.38
35	02202	万科企业	2,300	38,788.00	0.09
36	601088	中国神华	3,900	129,870.00	0.29
36	01088	中国神华	4,000	76,967.10	0.17
37	002415	海康威视	5,600	202,720.00	0.46
38	600276	恒瑞医药	5,460	202,511.40	0.46
39	002475	立讯精密	5,900	199,361.00	0.45

40	600438	通威股份	3,300	197,538.00	0.45
41	02015	理想汽车-W	1,500	196,137.83	0.45
42	00883	中国海洋石油	22,000	194,914.90	0.44
43	600809	山西汾酒	600	194,880.00	0.44
44	000651	格力电器	5,700	192,204.00	0.44
45	300760	迈瑞医疗	600	187,920.00	0.43
46	600309	万华化学	1,900	184,281.00	0.42
47	002714	牧原股份	3,200	176,864.00	0.40
48	000725	京东方 A	44,700	176,118.00	0.40
49	002812	恩捷股份	700	175,315.00	0.40
50	00669	创科实业	2,500	174,993.25	0.40
51	000001	平安银行	11,600	173,768.00	0.39
52	002142	宁波银行	4,760	170,455.60	0.39
53	09633	农夫山泉	4,200	161,810.50	0.37
54	002129	TCL 中环	2,700	159,003.00	0.36
55	00001	长和	3,500	158,787.40	0.36
56	00016	新鸿基地产	2,000	158,552.23	0.36
57	02628	中国人寿	8,000	93,455.16	0.21
57	601628	中国人寿	2,043	63,496.44	0.14
58	00386	中国石油化工股份	30,000	90,564.62	0.21
58	600028	中国石化	16,000	65,280.00	0.15
59	000792	盐湖股份	5,200	155,792.00	0.35
60	601601	中国太保	4,100	96,473.00	0.22
60	02601	中国太保	3,400	55,768.65	0.13
61	603799	华友钴业	1,590	152,035.80	0.35
62	300124	汇川技术	2,300	151,501.00	0.34
63	09868	小鹏汽车-W	1,400	151,334.42	0.34
64	603288	海天味业	1,670	150,901.20	0.34
65	600048	保利发展	8,600	150,156.00	0.34
66	002466	天齐锂业	1,200	149,760.00	0.34
67	002460	赣锋锂业	1,000	148,700.00	0.34
68	300015	爱尔眼科	3,300	147,741.00	0.34
69	600585	海螺水泥	2,900	102,312.00	0.23
69	00914	海螺水泥	1,500	43,614.69	0.10
70	01658	邮储银行	14,000	74,589.67	0.17
70	601658	邮储银行	13,000	70,070.00	0.16
71	600436	片仔癀	400	142,692.00	0.32
72	01113	长实集团	3,000	142,389.14	0.32
73	00002	中电控股	2,500	139,182.17	0.32
74	00857	中国石油股份	24,000	76,761.85	0.17
74	601857	中国石油	11,609	61,527.70	0.14
75	300014	亿纬锂能	1,400	136,500.00	0.31
76	600031	三一重工	7,100	135,326.00	0.31

77	02319	蒙牛乳业	4,000	133,922.75	0.30
78	601668	中国建筑	25,040	133,212.80	0.30
79	02388	中银香港	5,000	132,554.45	0.30
80	02020	安踏体育	1,600	131,904.51	0.30
81	002352	顺丰控股	2,300	128,363.00	0.29
82	002304	洋河股份	700	128,205.00	0.29
83	300498	温氏股份	6,000	127,740.00	0.29
84	300274	阳光电源	1,300	127,725.00	0.29
85	06160	百济神州	1,500	126,354.32	0.29
86	600089	特变电工	4,600	125,994.00	0.29
87	01109	华润置地	4,000	125,199.82	0.28
88	002271	东方雨虹	2,400	123,528.00	0.28
89	00175	吉利汽车	8,000	122,052.72	0.28
90	603501	韦尔股份	700	121,121.00	0.28
91	00027	银河娱乐	3,000	120,068.68	0.27
92	601816	京沪高铁	23,500	117,970.00	0.27
93	002049	紫光国微	600	113,832.00	0.26
94	600837	海通证券	11,600	113,796.00	0.26
95	603986	兆易创新	800	113,768.00	0.26
96	600000	浦发银行	13,993	112,083.93	0.25
97	300122	智飞生物	1,000	111,010.00	0.25
98	601633	长城汽车	1,500	55,560.00	0.13
98	02333	长城汽车	4,000	55,211.07	0.13
99	600016	民生银行	29,676	110,394.72	0.25
100	600406	国电南瑞	4,080	110,160.00	0.25
101	00011	恒生银行	900	106,599.43	0.24
102	00688	中国海外发展	5,000	106,043.56	0.24
103	601919	中远海控	7,600	105,640.00	0.24
104	000625	长安汽车	5,980	103,573.60	0.24
105	600919	江苏银行	14,100	100,392.00	0.23
106	600104	上汽集团	5,600	99,736.00	0.23
107	000063	中兴通讯	3,900	99,567.00	0.23
108	601225	陕西煤业	4,700	99,546.00	0.23
109	601688	华泰证券	7,000	99,400.00	0.23
110	002709	天赐材料	1,600	99,296.00	0.23
111	02688	新奥能源	900	99,210.59	0.23
112	02382	舜宇光学科技	900	98,440.92	0.22
113	002241	歌尔股份	2,900	97,440.00	0.22
114	00960	龙湖集团	3,000	95,054.37	0.22
115	002230	科大讯飞	2,300	94,806.00	0.22
116	00003	香港中华煤气	13,000	93,942.62	0.21
117	000661	长春高新	400	93,368.00	0.21
118	300142	沃森生物	1,900	91,941.00	0.21
119	600111	北方稀土	2,600	91,416.00	0.21

120	06098	碧桂园服务	3,000	89,666.67	0.20
121	688599	天合光能	1,374	89,653.50	0.20
122	002459	晶澳科技	1,120	88,368.00	0.20
123	00066	港铁公司	2,500	87,656.98	0.20
124	00006	电能实业	2,000	84,407.25	0.19
125	601211	国泰君安	5,500	83,600.00	0.19
126	002371	北方华创	300	83,136.00	0.19
127	300450	先导智能	1,300	82,134.00	0.19
128	002027	分众传媒	12,100	81,433.00	0.18
129	02313	申洲国际	1,000	81,285.81	0.18
130	000338	潍柴动力	6,500	81,055.00	0.18
131	601169	北京银行	17,700	80,358.00	0.18
132	300347	泰格医药	700	80,115.00	0.18
133	000100	TCL 科技	16,700	79,993.00	0.18
134	01093	石药集团	12,000	79,943.16	0.18
135	600660	福耀玻璃	1,900	79,439.00	0.18
136	06618	京东健康	1,500	78,955.42	0.18
137	601229	上海银行	11,900	77,945.00	0.18
138	601985	中国核电	11,300	77,518.00	0.18
139	600050	中国联通	22,200	76,812.00	0.17
140	600745	闻泰科技	900	76,599.00	0.17
141	600522	中天科技	3,300	76,230.00	0.17
142	601766	中国中车	14,600	75,920.00	0.17
143	601390	中国中铁	12,300	75,522.00	0.17
144	03800	协鑫科技	23,000	74,546.91	0.17
145	600893	航发动力	1,600	72,816.00	0.17
146	601669	中国电建	9,200	72,404.00	0.16
147	00881	中升控股	1,500	71,002.15	0.16
148	01821	ESR	3,800	68,894.11	0.16
149	600009	上海机场	1,200	68,040.00	0.15
150	00267	中信股份	10,000	67,987.61	0.15
151	000733	振华科技	500	67,985.00	0.15
152	601615	明阳智能	2,000	67,600.00	0.15
153	603659	璞泰来	800	67,520.00	0.15
154	000776	广发证券	3,600	67,320.00	0.15
155	600196	复星医药	1,500	66,135.00	0.15
156	002410	广联达	1,200	65,328.00	0.15
157	600999	招商证券	4,500	64,845.00	0.15
158	300782	卓胜微	480	64,800.00	0.15
159	600958	东方证券	6,328	64,608.88	0.15
160	00868	信义玻璃	4,000	64,378.70	0.15
161	600905	三峡能源	10,200	64,158.00	0.15
162	601009	南京银行	6,142	63,999.64	0.15
163	01997	九龙仓置业	2,000	63,968.21	0.15

164	600010	包钢股份	27,200	63,920.00	0.15
165	600570	恒生电子	1,467	63,873.18	0.15
166	600019	宝钢股份	10,600	63,812.00	0.14
167	00268	金蝶国际	4,000	62,941.98	0.14
168	00992	联想集团	10,000	62,685.43	0.14
169	00968	信义光能	6,000	62,189.42	0.14
170	002179	中航光电	980	62,053.60	0.14
171	000895	双汇发展	2,100	61,530.00	0.14
172	002050	三花智控	2,200	60,456.00	0.14
173	002311	海大集团	1,000	60,010.00	0.14
174	01801	信达生物	2,000	59,692.26	0.14
175	601818	光大银行	19,700	59,297.00	0.13
176	002920	德赛西威	400	59,200.00	0.13
177	01928	金沙中国有限公司	3,600	57,632.96	0.13
178	300759	康龙化成	600	57,132.00	0.13
179	00288	万洲国际	11,000	57,006.97	0.13
180	002493	荣盛石化	3,700	56,943.00	0.13
181	02328	中国财险	8,000	55,826.80	0.13
182	000799	酒鬼酒	300	55,743.00	0.13
183	600346	恒力石化	2,500	55,600.00	0.13
184	01177	中国生物制药	13,000	55,253.83	0.13
185	002074	国轩高科	1,200	54,720.00	0.12
186	600760	中航沈飞	900	54,405.00	0.12
187	300316	晶盛机电	800	54,072.00	0.12
188	600926	杭州银行	3,600	53,928.00	0.12
189	600426	华鲁恒升	1,800	52,560.00	0.12
190	002001	新和成	2,300	52,463.00	0.12
191	001979	招商蛇口	3,900	52,377.00	0.12
192	600763	通策医疗	300	52,332.00	0.12
193	300496	中科创达	400	52,192.00	0.12
194	600460	士兰微	1,000	52,000.00	0.12
195	600600	青岛啤酒	500	51,960.00	0.12
196	002340	格林美	5,700	51,870.00	0.12
197	000768	中航西飞	1,700	51,493.00	0.12
198	000538	云南白药	840	50,727.60	0.12
199	600176	中国巨石	2,900	50,489.00	0.11
200	601989	中国重工	13,600	50,456.00	0.11
201	002202	金风科技	3,400	50,320.00	0.11
202	000963	华东医药	1,100	49,676.00	0.11
203	603993	洛阳钼业	8,500	48,705.00	0.11
204	00788	中国铁塔	56,000	48,369.55	0.11
205	300207	欣旺达	1,500	47,400.00	0.11
206	601138	工业富联	4,800	47,232.00	0.11

207	601066	中信建投	1,633	47,210.03	0.11
208	00151	中国旺旺	8,000	46,659.17	0.11
209	601006	大秦铁路	7,072	46,604.48	0.11
210	601877	正泰电器	1,300	46,514.00	0.11
211	300012	华测检测	2,000	46,420.00	0.11
212	000166	申万宏源	10,800	46,332.00	0.11
213	06186	中国飞鹤	6,000	46,282.88	0.11
214	00322	康师傅控股	4,000	45,975.01	0.10
215	600584	长电科技	1,700	45,900.00	0.10
216	603806	福斯特	700	45,864.00	0.10
217	02007	碧桂园	11,000	45,718.46	0.10
218	600588	用友网络	2,100	45,591.00	0.10
219	01929	周大福	3,600	45,441.38	0.10
220	601377	兴业证券	6,400	45,120.00	0.10
221	601600	中国铝业	9,400	44,650.00	0.10
222	600029	南方航空	6,100	44,591.00	0.10
223	600132	重庆啤酒	300	43,980.00	0.10
224	600741	华域汽车	1,900	43,700.00	0.10
225	601186	中国铁建	5,500	43,450.00	0.10
226	600188	兖矿能源	1,100	43,428.00	0.10
227	601100	恒立液压	700	43,204.00	0.10
228	601838	成都银行	2,600	43,108.00	0.10
229	600383	金地集团	3,200	43,008.00	0.10
230	03323	中国建材	6,000	42,998.95	0.10
231	600085	同仁堂	800	42,304.00	0.10
232	01876	百威亚太	2,100	42,203.63	0.10
233	300408	三环集团	1,400	42,140.00	0.10
234	601111	中国国航	3,600	41,796.00	0.09
235	600150	中国船舶	2,200	41,756.00	0.09
236	000786	北新建材	1,200	41,544.00	0.09
237	06969	思摩尔国际	2,000	41,391.20	0.09
238	000876	新希望	2,700	41,310.00	0.09
239	601689	拓普集团	600	41,058.00	0.09
240	600885	宏发股份	980	41,013.00	0.09
241	600547	山东黄金	2,200	40,832.00	0.09
242	603019	中科曙光	1,400	40,628.00	0.09
243	002180	纳思达	800	40,496.00	0.09
244	601117	中国化学	4,300	40,463.00	0.09
245	601238	广汽集团	2,600	39,624.00	0.09
246	00083	信和置业	4,000	39,612.40	0.09
247	003816	中国广核	14,100	39,480.00	0.09
248	002384	东山精密	1,700	38,981.00	0.09
249	601800	中国交建	4,200	38,976.00	0.09
250	600884	杉杉股份	1,300	38,636.00	0.09



251	600015	华夏银行	7,400	38,554.00	0.09
252	00101	恒隆地产	3,000	38,175.68	0.09
253	600989	宝丰能源	2,600	38,090.00	0.09
254	300628	亿联网络	500	38,075.00	0.09
255	300999	金龙鱼	700	37,814.00	0.09
256	600886	国投电力	3,600	37,800.00	0.09
257	600754	锦江酒店	600	37,740.00	0.09
258	600011	华能国际	5,300	37,312.00	0.08
259	000301	东方盛虹	2,200	37,202.00	0.08
260	002648	卫星化学	1,439	37,198.15	0.08
261	603816	顾家家居	650	36,809.50	0.08
262	601868	中国能建	15,500	36,735.00	0.08
263	03888	金山软件	1,400	36,636.34	0.08
264	000723	美锦能源	3,000	36,600.00	0.08
265	603486	科沃斯	300	36,567.00	0.08
266	00586	海螺创业	2,500	36,559.37	0.08
267	000157	中联重科	5,900	36,344.00	0.08
268	601788	光大证券	2,300	36,248.00	0.08
269	600115	中国东航	6,600	36,234.00	0.08
270	300601	康泰生物	800	36,144.00	0.08
271	002236	大华股份	2,200	36,124.00	0.08
272	00998	中信银行	12,000	36,020.60	0.08
273	603369	今世缘	700	35,700.00	0.08
274	000425	徐工机械	6,600	35,574.00	0.08
275	603260	合盛硅业	300	35,388.00	0.08
276	000938	紫光股份	1,800	34,920.00	0.08
277	600233	圆通速递	1,700	34,663.00	0.08
278	01193	华润燃气	1,100	34,382.91	0.08
279	300595	欧普康视	600	34,314.00	0.08
280	002601	龙佰集团	1,700	34,085.00	0.08
281	002555	三七互娱	1,600	33,968.00	0.08
282	601555	东吴证券	4,879	33,811.47	0.08
283	605358	立昂微	500	33,690.00	0.08
284	02618	京东物流	2,300	33,673.96	0.08
285	601901	方正证券	5,000	33,550.00	0.08
286	002736	国信证券	3,500	33,495.00	0.08
287	601233	桐昆股份	2,100	33,348.00	0.08
288	002008	大族激光	1,000	33,130.00	0.08
289	603882	金域医学	400	33,020.00	0.08
290	00135	昆仑能源	6,000	32,993.23	0.07
291	600845	宝信软件	600	32,760.00	0.07
292	000069	华侨城 A	5,000	32,450.00	0.07
293	09992	泡泡玛特	1,000	32,411.70	0.07
294	601336	新华保险	1,000	32,190.00	0.07

295	000977	浪潮信息	1,200	31,776.00	0.07
296	688126	沪硅产业	1,380	31,712.40	0.07
297	600219	南山铝业	8,500	31,365.00	0.07
298	002385	大北农	4,000	31,240.00	0.07
299	603185	上机数控	200	31,198.00	0.07
300	300363	博腾股份	400	31,196.00	0.07
301	601995	中金公司	700	31,143.00	0.07
302	300454	深信服	300	31,134.00	0.07
303	601108	财通证券	3,900	30,693.00	0.07
304	300529	健帆生物	600	30,534.00	0.07
305	01378	中国宏桥	4,000	30,342.14	0.07
306	603833	欧派家居	200	30,136.00	0.07
307	002841	视源股份	400	30,128.00	0.07
308	300413	芒果超媒	900	30,024.00	0.07
309	601360	三六零	3,500	29,820.00	0.07
310	601618	中国中冶	8,500	29,750.00	0.07
311	300003	乐普医疗	1,600	29,712.00	0.07
312	002007	华兰生物	1,300	29,640.00	0.07
313	603589	口子窖	500	29,305.00	0.07
314	600298	安琪酵母	600	29,250.00	0.07
315	300144	宋城演艺	1,900	29,165.00	0.07
316	002252	上海莱士	4,900	29,057.00	0.07
317	002120	韵达股份	1,700	29,002.00	0.07
318	603517	绝味食品	500	28,910.00	0.07
319	300033	同花顺	300	28,845.00	0.07
320	002013	中航机电	2,300	28,405.00	0.06
321	002916	深南电路	300	28,113.00	0.06
322	603899	晨光股份	500	28,040.00	0.06
323	601155	新城控股	1,100	27,973.00	0.06
324	000783	长江证券	4,700	27,871.00	0.06
325	00241	阿里健康	6,000	27,708.16	0.06
326	601077	渝农商行	7,400	27,380.00	0.06
327	000703	恒逸石化	2,600	27,326.00	0.06
328	00384	中国燃气	2,600	26,948.75	0.06
329	601865	福莱特	700	26,670.00	0.06
330	01209	华润万象生活	800	26,613.51	0.06
331	601696	中银证券	2,000	26,600.00	0.06
332	300433	蓝思科技	2,400	26,568.00	0.06
333	603939	益丰药房	500	26,415.00	0.06
334	601878	浙商证券	2,300	26,174.00	0.06
335	002602	世纪华通	5,400	26,028.00	0.06
336	600918	中泰证券	3,400	26,010.00	0.06
337	300146	汤臣倍健	1,200	25,980.00	0.06
338	00762	中国联通	8,000	25,382.04	0.06

339	002185	华天科技	2,700	25,326.00	0.06
340	601607	上海医药	1,400	25,312.00	0.06
341	600332	白云山	800	25,272.00	0.06
342	601089	福元医药	1,194	25,133.70	0.06
343	600674	川投能源	2,100	25,032.00	0.06
344	01066	威高股份	3,200	24,957.86	0.06
345	000066	中国长城	2,300	24,886.00	0.06
346	300919	中伟股份	200	24,780.00	0.06
347	601727	上海电气	6,000	24,660.00	0.06
348	600109	国金证券	2,700	24,300.00	0.06
349	601728	中国电信	6,500	24,245.00	0.06
350	601636	旗滨集团	1,900	24,225.00	0.06
351	000708	中信特钢	1,200	24,180.00	0.05
352	002938	鹏鼎控股	800	24,168.00	0.05
353	601898	中煤能源	2,300	23,874.00	0.05
354	600183	生益科技	1,400	23,786.00	0.05
355	01972	太古地产	1,400	23,322.74	0.05
356	600362	江西铜业	1,300	23,179.00	0.05
357	002624	完美世界	1,600	22,992.00	0.05
358	600018	上港集团	3,900	22,737.00	0.05
359	601990	南京证券	2,700	22,518.00	0.05
360	600705	中航产融	6,400	22,144.00	0.05
361	002080	中材科技	800	22,000.00	0.05
362	002508	老板电器	600	21,618.00	0.05
363	002673	西部证券	3,300	21,582.00	0.05
364	300676	华大基因	300	21,510.00	0.05
365	00853	微创医疗	1,100	21,401.13	0.05
366	300223	北京君正	200	21,250.00	0.05
367	00285	比亚迪电子	1,000	21,165.95	0.05
368	002568	百润股份	700	21,028.00	0.05
369	00884	旭辉控股集团	6,240	21,025.36	0.05
370	600143	金发科技	2,200	20,944.00	0.05
371	002414	高德红外	1,580	20,334.60	0.05
372	000728	国元证券	3,200	19,904.00	0.05
373	000408	藏格矿业	600	19,764.00	0.04
374	601319	中国人保	3,900	19,734.00	0.04
375	601216	君正集团	4,000	19,520.00	0.04
376	00772	阅文集团	600	19,447.02	0.04
377	600161	天坛生物	800	19,424.00	0.04
378	600079	人福医药	1,200	19,200.00	0.04
379	00656	复星国际	3,000	18,600.38	0.04
380	600803	新奥股份	1,000	18,590.00	0.04
381	600779	水井坊	200	18,508.00	0.04
382	06110	滔搏	3,000	18,292.51	0.04

383	300558	贝达药业	300	18,240.00	0.04
384	600038	中直股份	400	18,080.00	0.04
385	300832	新产业	400	18,044.00	0.04
386	601198	东兴证券	2,000	17,800.00	0.04
387	601966	玲珑轮胎	700	17,759.00	0.04
388	01691	J S 环球生活	2,000	17,480.08	0.04
389	600372	中航电子	900	17,451.00	0.04
390	01999	敏华控股	2,400	17,404.83	0.04
391	002600	领益智造	3,400	17,068.00	0.04
392	02588	中银航空租赁	300	16,919.93	0.04
393	003022	联泓新科	500	16,615.00	0.04
394	600369	西南证券	4,000	15,880.00	0.04
395	00754	合生创展集团	1,540	15,777.57	0.04
396	300677	英科医疗	620	15,723.20	0.04
397	603233	大参林	500	15,650.00	0.04
398	601881	中国银河	1,600	15,472.00	0.04
399	600025	华能水电	2,200	15,378.00	0.03
400	002064	华峰化学	1,800	15,192.00	0.03
401	000050	深天马 A	1,500	14,955.00	0.03
402	603087	甘李药业	300	14,391.00	0.03
403	603707	健友股份	500	14,100.00	0.03
404	01833	平安好医生	700	13,918.22	0.03
405	00966	中国太平	1,600	13,245.18	0.03
406	000987	越秀金控	1,863	13,096.89	0.03
407	002607	中公教育	2,200	12,738.00	0.03
408	002153	石基信息	740	11,743.80	0.03
409	601231	环旭电子	800	11,488.00	0.03
410	06993	蓝月亮集团	2,000	11,459.55	0.03
411	02689	玖龙纸业	2,000	11,356.92	0.03
412	002939	长城证券	1,100	11,176.00	0.03
413	000800	一汽解放	1,100	10,274.00	0.02
414	601808	中海油服	700	9,765.00	0.02
415	01128	永利澳门	2,000	9,116.33	0.02
416	000877	天山股份	700	8,610.00	0.02
417	06808	高鑫零售	3,500	7,632.57	0.02
418	601825	沪农商行	1,100	6,897.00	0.02
419	06666	恒大物业	3,000	5,900.81	0.01
420	03380	龙光集团	2,000	3,728.63	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	5,011,229.93	24.32
2	03690	美团-W	2,202,332.59	10.69
3	00005	汇丰控股	2,023,204.87	9.82
4	01299	友邦保险	1,938,664.41	9.41
5	600519	贵州茅台	1,893,935.00	9.19
6	300750	宁德时代	1,535,230.00	7.45
7	00939	建设银行	1,249,918.62	6.06
7	601939	建设银行	37,678.00	0.18
8	03968	招商银行	716,621.22	3.48
8	600036	招商银行	531,820.00	2.58
9	02318	中国平安	721,982.90	3.50
9	601318	中国平安	478,901.00	2.32
10	00388	香港交易所	958,333.68	4.65
11	01398	工商银行	783,393.55	3.80
11	601398	工商银行	157,163.00	0.76
12	02269	药明生物	915,671.52	4.44
13	002594	比亚迪	728,985.00	3.54
14	000333	美的集团	722,959.00	3.51
15	000858	五粮液	694,909.00	3.37
16	00941	中国移动	630,205.21	3.06
16	600941	中国移动	39,312.00	0.19
17	000568	泸州老窖	611,213.00	2.97
18	300059	东方财富	529,625.61	2.57
19	01810	小米集团-W	524,788.85	2.55
20	03988	中国银行	447,632.35	2.17
20	601988	中国银行	62,450.00	0.30
21	002415	海康威视	496,374.00	2.41
22	02020	安踏体育	490,457.05	2.38
23	002475	立讯精密	437,632.00	2.12
24	002304	洋河股份	427,164.00	2.07

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	3,661,244.03	17.77
2	03690	美团-W	2,001,404.12	9.71
3	600519	贵州茅台	1,583,123.00	7.68
4	01299	友邦保险	1,488,623.32	7.22
5	00005	汇丰控股	1,470,241.24	7.13

6	300750	宁德时代	1,054,326.00	5.12
7	00939	建设银行	885,623.93	4.30
7	601939	建设银行	599.00	0.00
8	02269	药明生物	828,934.41	4.02
9	00388	香港交易所	715,326.45	3.47
10	002594	比亚迪	649,828.00	3.15
11	03968	招商银行	620,975.76	3.01
11	600036	招商银行	12,017.00	0.06
12	01398	工商银行	583,310.68	2.83
12	601398	工商银行	10,941.00	0.05
13	000568	泸州老窖	580,905.00	2.82
14	000333	美的集团	559,877.00	2.72
15	02318	中国平安	477,020.63	2.31
15	601318	中国平安	8,963.00	0.04
16	02020	安踏体育	475,850.03	2.31
17	000858	五粮液	454,902.00	2.21
18	00941	中国移动	448,236.09	2.17
19	002304	洋河股份	438,141.00	2.13
20	01810	小米集团-W	395,743.84	1.92

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	65,045,552.58
卖出股票收入（成交）总额	39,936,766.84

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,000.43	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,000.43	0.01

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

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	113060	浙 22 转债	60	6,000.43	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中,美团在报告编制日前一年内曾受到成都市锦江区综合执法局、国家市场监督管理总局的处罚。腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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

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

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,065.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	117,202.53
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	201,884.66

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明



本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
873	55,147.98	38,193,588.00	79.33%	9,950,600.00	20.67%

### 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	易方达基金管理有限公司	33,000,000.00	68.54%
2	中信证券股份有限公司	1,903,836.00	3.95%
3	华泰证券股份有限公司	1,767,700.00	3.67%
4	中国国际金融股份有限公司	1,522,052.00	3.16%
5	冀国军	1,101,000.00	2.29%
6	贺晗	938,000.00	1.95%
7	王晓晨	300,000.00	0.62%
8	张燕君	250,000.00	0.52%
9	蒋斌	200,000.00	0.42%
10	杨蔼莉	200,000.00	0.42%
11	何燕莉	200,000.00	0.42%

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	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	1,000.00	0.0021%

## 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 3 日）基金份额总额	234,144,188.00
本报告期期初基金份额总额	21,144,188.00
本报告期基金总申购份额	87,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	60,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	48,144,188.00

## 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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统

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	57,033,917.61	54.35%	28,517.13	54.35%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	11,118,937.00	10.60%	5,559.54	10.60%	-
中信建投	3	6,477,576.94	6.17%	3,238.85	6.17%	-
中信证券	2	30,309,704.66	28.88%	15,156.46	28.88%	-

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。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 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 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	32,770.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-08
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第四季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-21
5	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 1 月 27 日至 2022 年 1 月 28 日暂停申购及赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-24
6	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-04
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加甬兴证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-15
8	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指	上海证券报、基金管理人	2022-03-18

	数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
9	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-24
10	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金增加广发证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-24
11	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-25
12	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-26
13	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 3 月 31 日至 2022 年 4 月 1 日暂停申购及赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-28
14	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-29
15	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	上海证券报	2022-03-30
16	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华安证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-01
17	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
18	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 4 月 15 日至 2022 年 4 月 18 日暂停申购及赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-12
19	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
20	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	上海证券报	2022-04-22
21	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 4 月 28 日至 2022 年 4 月 29 日暂停申购及赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-25
22	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 5 月 9 日暂停申购及赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-29
23	易方达基金管理有限公司关于旗下基金参与东方证券股份有限公司 A 股配股的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2022-04-30

		电子披露网站	
24	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
25	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
26	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-19
27	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-02
28	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-09
29	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-10
30	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-11
31	易方达基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-18
32	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年下半年港股通非交易日暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-27
33	关于旗下部分基金 2022 年 7 月 1 日因港股通非交易日及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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-28

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022年03月29日~2022年06月30日	0.00	33,000,000.00	0.00	33,000,000.00	68.54%

	2	2022 年 01 月 12 日	3,025,336.00	34,441,600.00	35,563,100.00	1,903,836.00	3.95%
	3	2022 年 01 月 12 日	1,995,352.00	32,966,600.00	33,439,900.00	1,522,052.00	3.16%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金将面临基金财产清算并终止的风险；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 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

二〇二二年八月三十日