

易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

§ 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 年 2 月 17 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	10
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	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
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	54
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.....	55
§ 8	基金份额持有人信息.....	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
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.....	57
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.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
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.....	60
§ 11	备查文件目录.....	61
11.1	备查文件目录.....	61
11.2	存放地点.....	62
11.3	查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500 增强策略 ETF
场内简称	增强 500、中证 500ETF 增强
基金主代码	563030
交易代码	563030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 2 月 17 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	428,669,000.00 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	2023 年 3 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>股票（含存托凭证）投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。</p> <p>此外，为更好地实现投资目标，本基金将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。同时，本基金可投资股指期货、股票期权和国债期货。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	韩鑫普
	联系电话	020-85102688	0755-82943666
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95565
传真		020-38798812	0755-82960794
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	深圳市福田区福田街道福华一 路111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	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
邮政编码		510620	518000
法定代表人		刘晓艳	霍达

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	www.efunds.com.cn
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 40-43 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（2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-7,232,571.20
本期利润	-10,841,540.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0168
本期加权平均净值利润率	-1.70%
本期基金份额净值增长率	-2.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-10,659,530.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0249
期末基金资产净值	418,009,469.68
期末基金份额净值	0.9751
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.49%

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。

4.本基金合同于 2023 年 2 月 17 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

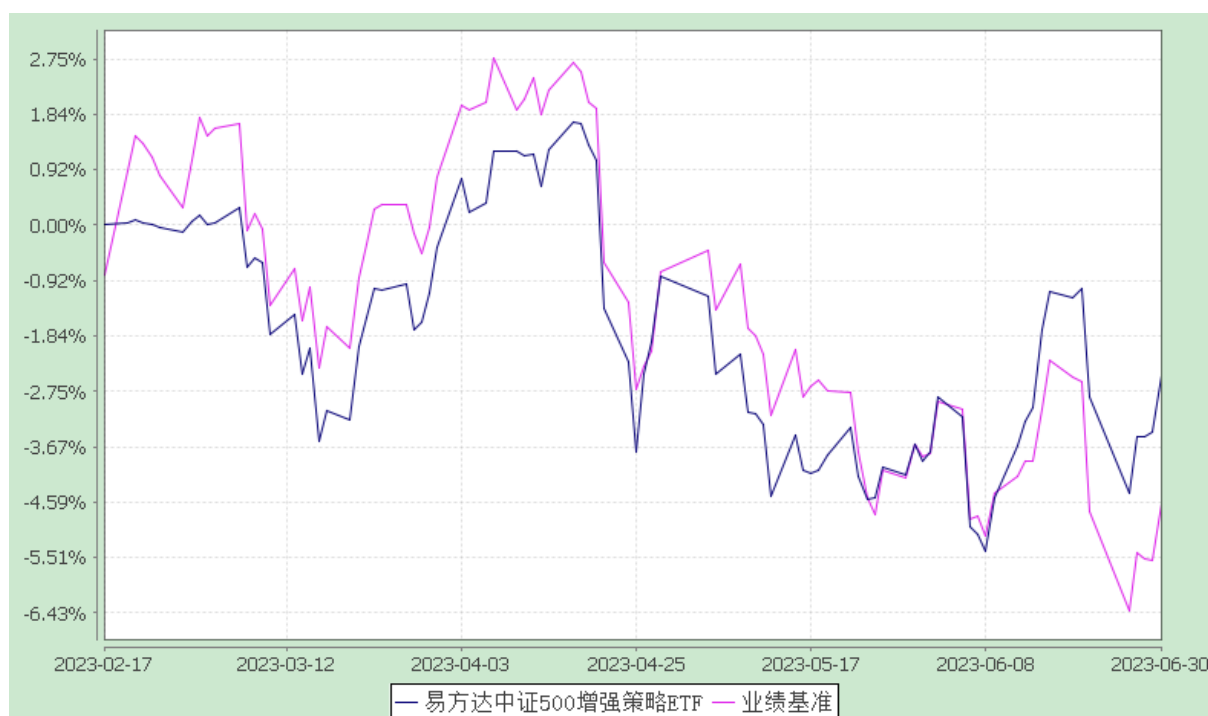
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.49%	0.93%	-0.81%	0.93%	2.30%	0.00%
过去三个月	-2.14%	0.83%	-5.38%	0.83%	3.24%	0.00%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-2.49%	0.75%	-4.62%	0.80%	2.13%	-0.05%

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

易方达中证 500 增强策略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

(2023 年 2 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2023 年 2 月 17 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，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（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。本报告期本基金处于建仓期内，在上市交易前已完成拟合标的指数。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-2.49%，同期业绩比较基准收益率为-4.62%。

§ 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		
官 泽 帆	本基金的基金经理,易方达中证 500 量化增强的基金经理, 量化投资部总经理助理	2023-02-17	-	13 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师, 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司数量化研究员、基金经理助理, 易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理, 易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达易百智能量化策略混合的基金经理。
张 湛	本基金的基金经理, 易方达中证科技 50ETF、易方达中证全指证券公司 ETF (自 2020 年 04 月 30 日至 2023 年 05 月 19 日)、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数 (LOF)、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证新能源 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证物联网主题 ETF (自 2021 年 10 月 13 日至 2023 年 05 月 19 日)、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接发起式、易方达中证医疗 ETF 联接发起式、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式的基金经理, 易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII) 的基金经理助理	2023-02-17	-	14 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理, 易方达中证军工 ETF、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF) 的基金经理。
徐 德 晖	本基金的基金经理助理, 量化研究员	2023-03-25	-	6 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指数与量化研究员。

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。

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 23 次，其中 20 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，3 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

回顾本报告期，当前经济复苏方向明确，国内生产总值同比增长 5.5%：生产端，1-6 月全国规模以上工业增加值同比增长 3.8%，6 月份同比增长 4.4%，高于去年同期，41 个大类行业中有 26 个行业增加值保持同比增长，其中制造业领涨；需求端，上半年社会消费品零售总额同比增长 8.2%，

较一季度增速有所加快，但 6 月单月增速有所回落，上半年增长主要来自于商品零售增长，但餐饮收入增速较高，同时居民消费能力改善，人均可支配收入增速有所提升，居民消费支出同比明显加快；投资端，上半年全国固定资产投资同比增长 3.8%，其中基建投资增速略高于去年同期，制造业投资方面 1-6 月累计同比增长环比持平，地产投资方面，1-6 月全国房地产开发投资同比下降 7.9%，从开发和销售数据来看，房地产复苏偏弱，整体出现回落。总体来看，目前国内经济仍处于复苏阶段。

市场表现方面，整体呈现震荡上涨趋势，2023 年上半年上证指数、沪深 300、中证 500、中证 1000 的收益率分别为 3.65%、-0.75%、2.29%、5.10%，此外创业板指出现回调，下跌 5.61%，而科创 50 则表现较好，上涨 4.71%。从申万一级行业表现的角度来看，TMT 板块表现强势，通信行业上涨最多达 50.66%，其次是传媒上涨 42.75%，计算机上涨 27.57%；另一方面，回撤较大的板块分别是商贸零售、房地产、美容护理，分别下跌 23.44%、14.29%、13.61%，行业间表现分化较大，同时行业轮动也较为频繁。从上述市场宽基与行业指数的表现不难看出，上半年小盘风格表现要好于大盘风格，此外，成长风格的表现要弱于价值风格，市场整体风险偏好前高后低，低波动与高分红等偏防御型风格整体表现也较优。从选股因子角度来看，由于上半年市场轮动频繁，量化类等交易型因子的选股效率较为突出。

本基金为指数增强型 ETF 基金，管理人在组合管理过程中，以基准指数的构成为基础，严格控制组合在行业与风格上的相对偏离，采用基金管理人自主开发的多因子量化选股模型对个股进行超低配，在兼顾 ETF 产品特性的基础上，减少系统性风格冲击，获取较为稳健的超额收益。

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 0.9751 元，本报告期份额净值增长率为-2.49%，同期业绩比较基准收益率为-4.62%，年化跟踪误差 5.54%，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

从上半年及二季度宏观经济数据来看，疫后服务业的持续回暖带动了经济整体回升向好，需求端的消费复苏比较稳健，以餐饮为代表的服务消费增速维持在高位，但消费进一步持续复苏的基础仍需稳固；投资端的基建投资维持高增，制造业韧性较强，地产投资处于磨底期；供给端的工业生产稳步恢复。对下阶段仍建议保持适当乐观：首先，短期宏观经济已呈现较明显的筑底特征；其次，虽然地产链偏弱，但汽车、消费电子等均在周期低位，同时出口也维持在了经验低位；第三，从历史规律看，PPI（生产价格指数）对宏观短周期有较好的指示意义，当前位置对应后续企业盈利有好转趋势；第四，政策周期相对明确，政策陆续出台，后续仍可期待。

综上，下阶段本基金运作管理仍将迎来诸多方面的挑战，管理人将继续严格遵照多因子量化增强的投资模式进行操作，同时结合采用长期有效的基本面量化模型进行选股，配置稳健的策略模型以顺应市场风格变换，为投资人创造持续稳健的超额收益。

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

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，招商证券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。

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：易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	16,474,932.06
结算备付金		1,965,294.93
存出保证金		2,504,056.59
交易性金融资产	6.4.7.2	398,965,031.43
其中：股票投资		398,723,175.15
基金投资		-
债券投资		241,856.28
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		1,117,570.53

应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	79,559.74
资产总计		421,106,445.28
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		156,909.89
应付托管费		31,381.98
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		1.01
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	2,908,682.72
负债合计		3,096,975.60
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	428,669,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-10,659,530.32
净资产合计		418,009,469.68
负债和净资产总计		421,106,445.28

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日，2023 年半年度实际报告期间为 2023 年 2 月 17 日至 2023 年 6 月 30 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。

2.报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9751 元，基金份额总额 428,669,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30

		日
一、营业总收入		-9,385,313.12
1.利息收入		990,106.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	990,106.96
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)		-7,652,238.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,274,037.28
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	10,362.79
资产支持证券投资	6.4.7.12	-
收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-332.33
股利收益	6.4.7.14	4,611,768.54
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	-3,608,968.98
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	885,787.18
减：二、营业总支出		1,456,227.06
1. 管理人报酬		1,138,813.65
2. 托管费		227,762.77
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		0.36
8. 其他费用	6.4.7.18	89,650.28
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-10,841,540.18
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-10,841,540.18

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-10,841,540.18

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日，2023 年半年度实际报告期间为 2023 年 2 月 17 日至 2023 年 6 月 30 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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,142,669,000.00	-	1,142,669,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-714,000,000.00	-10,659,530.32	-724,659,530.32
（一）、综合收益总额	-	-10,841,540.18	-10,841,540.18
（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）	-714,000,000.00	182,009.86	-713,817,990.14
其中：1.基金申购款	88,500,000.00	-2,757,007.51	85,742,992.49
2.基金赎回款	-802,500,000.00	2,939,017.37	-799,560,982.63
（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	428,669,000.00	-10,659,530.32	418,009,469.68

资产(基金净值)			
----------	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日，2023 年半年度实际报告期间为 2023 年 2 月 17 日至 2023 年 6 月 30 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 500 增强策略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[2022]2597 号《关于准予易方达中证 500 增强策略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 500 增强策略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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,142,669,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金募集期间为 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 2 月 14 日，募集金额总额为人民币 1,142,669,000.00 元，其中：有效净认购金额为人民币 1,142,669,000.00 元，经安永华明（2023）验字第 60468000_G02 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现

该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

（5）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（6）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（7）公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损

失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配；

(4) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价

(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	16,474,932.06
等于: 本金	16,469,185.74
加: 应计利息	5,746.32
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	16,474,932.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		402,156,582.02	-	398,723,175.15	-3,433,406.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	173,997.71	100.68	241,856.28	67,757.89
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	173,997.71	100.68	241,856.28	67,757.89
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		402,330,579.73	100.68	398,965,031.43	-3,365,648.98

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 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,276,560.00	-	-	-
IC2312	13,276,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,276,560.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2312	IC2312	11	13,033,240.00	-243,320.00
合计	-	-	-	-243,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-243,320.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	79,559.74
合计	79,559.74

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	146,858.78
其中：交易所市场	146,858.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	31,310.02
应付替代款	2,707,882.72
可退替代款	22,631.20
合计	2,908,682.72

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	1,142,669,000.00	1,142,669,000.00
本期申购	88,500,000.00	88,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-802,500,000.00	-802,500,000.00
本期末	428,669,000.00	428,669,000.00

注：本基金合同于 2023 年 2 月 17 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,142,669,000.00 份基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-7,232,571.20	-3,608,968.98	-10,841,540.18
本期基金份额交易产生的变动数	1,114,552.37	-932,542.51	182,009.86
其中：基金申购款	-1,064,197.40	-1,692,810.11	-2,757,007.51
基金赎回款	2,178,749.77	760,267.60	2,939,017.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,118,018.83	-4,541,511.49	-10,659,530.32

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	951,569.53
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	35,020.93
其他	3,516.50
合计	990,106.96

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 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,803,718.10
股票投资收益——赎回差价收入	-3,470,319.18
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	-12,274,037.28

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
	2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	582,407,193.61
减：卖出股票成本总额	590,083,929.64
减：交易费用	1,126,982.07
买卖股票差价收入	-8,803,718.10

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
	2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	799,560,982.63
减：现金支付赎回款总额	372,261,190.63
减：赎回股票成本总额	430,770,111.18
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,470,319.18

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
	2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	103.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,259.72
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	10,362.79

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
	2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,269.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,999.78
减：应计利息总额	7.82
减：交易费用	2.44

买卖债券差价收入	10,259.72
----------	-----------

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

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股指期货投资收益	-332.33

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,611,768.54
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	4,611,768.54

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-3,365,648.98
——股票投资	-3,433,406.87
——债券投资	67,757.89
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-243,320.00
——权证投资	-
——期货投资	-243,320.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,608,968.98

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-

其他	159,881.31
替代损益收入	725,905.87
合计	885,787.18

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 2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	25,283.12
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	64,367.16
合计	89,650.28

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
招商证券股份有限公司	基金托管人、申购赎回代办证券公司
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 2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,138,813.65
其中：支付销售机构的客户维护费	174,445.70

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年2月17日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托	227,762.77

管费

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

无。

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 2023 年 2 月 17 日（基金合同生效日）至 2023 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
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	新股网下 发行	6,018	151,954.50
广发证券股	301376	致欧科技	新股网下	4,192	103,374.72

份有限公司			发行		
招商证券股 份有限公司	301428	世纪恒通	新股网下 发行	2,289	60,315.15

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,184	14,065.92	24,887.68	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
30117	锡南	2023-0	6 个月	新股	34.00	34.93	250	8,500.	8,732.	-

0	科技	6-16		流通受限				00	50	
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	542	20,666.46	16,818.26	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	602	15,200.50	11,853.38	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	889	13,166.09	12,205.97	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-

30137 6	致欧科技	2023-0 6-14	6 个月	新股 流通 受限	24.66	22.51	420	10,357 .20	9,454. 20	-
30138 2	蜂助手	2023-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	23.80	32.84	408	9,710. 40	13,398 .72	-
30139 7	溯联股份	2023-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	292	15,554 .84	11,738 .40	-
30139 9	英特科技	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	43.99	51.57	293	12,889 .07	15,110 .01	-
30142 8	世纪恒通	2023-0 5-10	6 个月	新股 流通 受限	26.35	30.60	229	6,034. 15	7,007. 40	-
30148 6	致尚科技	2023-0 6-30	1 个月 以内	新股 流通 受限	57.66	57.66	2,445	140,97 8.70	140,97 8.70	-
30148 6	致尚科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 流通 受限	57.66	57.66	272	15,683 .52	15,683 .52	-
30148 8	豪恩汽电	2023-0 6-26	1 个月 以内	新股 流通 受限	39.78	39.78	2,356	93,721 .68	93,721 .68	-
30148 8	豪恩汽电	2023-0 6-26	6 个月	新股 流通 受限	39.78	39.78	262	10,422 .36	10,422 .36	-
60106 1	中信金属	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	2,754	18,121 .32	20,875 .32	-
60106 5	江盐集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	10.36	11.84	875	9,065. 00	10,360 .00	-
60113 3	柏诚股份	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742. 24	8,140. 64	-
60312 5	常青科技	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	160	4,156. 80	3,924. 80	-
60313 5	中重科技	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178 .40	11,234 .92	-
60313 7	恒尚节能	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通	15.90	17.09	139	2,210. 10	2,375. 51	-

				受限						
60317 2	万丰 股份	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	14.58	16.13	122	1,778. 76	1,967. 86	-
68814 6	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	716	25,883 .40	27,301 .08	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	3,122	62,002 .92	56,383 .32	-
68833 4	西高 院	2023-0 6-09	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	841	11,908 .56	13,632 .61	-
68835 2	颀中 科技	2023-0 4-11	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	2,361	28,568 .10	28,497 .27	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	379	8,944. 40	24,509 .93	-
68842 9	时创 能源	2023-0 6-20	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643. 20	8,833. 38	-
68843 3	华曙 高科	2023-0 4-07	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143 .88	13,167 .00	-
68844 3	智翔 金泰	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	876	33,182 .88	25,833 .24	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	4,844	27,562 .36	26,206 .04	-
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	1,565	17,371 .50	26,667 .60	-
68847 8	晶升 股份	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	32.52	42.37	402	13,073 .04	17,032 .74	-
68847 9	友车 科技	2023-0 5-04	6 个月	新股 流通 受限	33.99	29.49	321	10,910 .79	9,466. 29	-
68850 7	索辰 科技	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	245.56	122.11	222	36,834 .00	27,108 .42	-
68852	航天	2023-0	6 个月	新股	21.86	23.85	472	10,317	11,257	-

3	环宇	5-26		流通受限				.92	.20	
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	591	12,511.47	13,888.50	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	473	14,312.98	11,981.09	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	100	12,580.00	11,803.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	426	11,391.24	17,329.68	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	111	13,972.68	9,633.69	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为股票型基金，理论上其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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。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 2023 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 0.06%。

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 2023年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2023年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2023年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2023年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	241,856.28
未评级	0.00
合计	241,856.28

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 2023年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2023年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2023 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

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。

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 2023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	16,474,932.06	-	-	-	16,474,932.06
结算备付金	1,965,294.93	-	-	-	1,965,294.93
存出保证金	2,504,056.59	-	-	-	2,504,056.59
交易性金融资产	-	-	241,856.28	398,723,175.15	398,965,031.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,117,570.53	1,117,570.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	79,559.74	79,559.74
资产总计	20,944,283.58	-	241,856.28	399,920,305.42	421,106,445.28

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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	156,909.89	156,909.89
应付托管费	-	-	-	31,381.98	31,381.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.01	1.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,908,682.72	2,908,682.72
负债总计	-	-	-	3,096,975.60	3,096,975.60
利率敏感度缺口	20,944,283.58	-	241,856.28	396,823,329.82	418,009,469.68

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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
----	-----

	2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	398,723,175.15	95.39
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	398,723,175.15	95.39

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 2023 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	20,284,575.77
	2.业绩比较基准下降 5%	-20,284,575.77

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	397,778,177.02
第二层次	339,815.46
第三层次	847,038.95
合计	398,965,031.43

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列

入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	398,723,175.15	94.68
	其中：股票	398,723,175.15	94.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	241,856.28	0.06
	其中：债券	241,856.28	0.06
	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	18,440,226.99	4.38
8	其他各项资产	3,701,186.86	0.88
9	合计	421,106,445.28	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	1,062,825.00	0.25
B	采矿业	8,357,554.00	2.00
C	制造业	211,001,556.58	50.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,767,865.00	2.58
E	建筑业	2,767,605.00	0.66
F	批发和零售业	16,312,439.92	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	5,223,786.00	1.25
H	住宿和餐饮业	1,550,110.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,689,876.54	6.38
J	金融业	26,804,684.80	6.41
K	房地产业	7,317,761.00	1.75
L	租赁和商务服务业	2,996,733.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	3,507,339.60	0.84
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,435,884.40	1.30
S	综合	-	-
	合计	329,796,020.84	78.90

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	741,000.00	0.18

B	采矿业	-	-
C	制造业	50,329,842.93	12.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,113,027.47	0.27
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	55,217.20	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,936,739.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,018,981.71	2.16
J	金融业	3,744,806.00	0.90
K	房地产业	1,925,880.00	0.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,632.61	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	11,853.38	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	68,925,279.31	16.49

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

7.3.1 期末指数投资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	300308	中际旭创	52,800	7,785,360.00	1.86
2	688777	中控技术	60,195	3,779,042.10	0.90
3	601555	东吴证券	515,700	3,578,958.00	0.86
4	002223	鱼跃医疗	97,200	3,498,228.00	0.84
5	603596	伯特利	43,200	3,424,032.00	0.82
6	300285	国瓷材料	124,200	3,403,080.00	0.81
7	600418	江淮汽车	267,000	3,361,530.00	0.80

8	601108	财通证券	461,870	3,343,938.80	0.80
9	601233	桐昆股份	251,100	3,327,075.00	0.80
10	600109	国金证券	383,100	3,321,477.00	0.79
11	002409	雅克科技	45,400	3,308,752.00	0.79
12	603688	石英股份	29,000	3,301,360.00	0.79
13	002025	航天电器	51,200	3,266,560.00	0.78
14	600161	天坛生物	120,100	3,260,715.00	0.78
15	002600	领益智造	468,300	3,235,953.00	0.77
16	600481	双良节能	231,200	3,232,176.00	0.77
17	600563	法拉电子	23,500	3,226,550.00	0.77
18	000683	远兴能源	448,000	3,221,120.00	0.77
19	000783	长江证券	554,200	3,214,360.00	0.77
20	601168	西部矿业	300,300	3,156,153.00	0.76
21	300003	乐普医疗	138,700	3,136,007.00	0.75
22	603939	益丰药房	83,920	3,105,040.00	0.74
23	600699	均胜电子	174,800	3,083,472.00	0.74
24	603338	浙江鼎力	54,600	3,058,146.00	0.73
25	000932	华菱钢铁	640,000	3,052,800.00	0.73
26	601128	常熟银行	445,500	3,038,310.00	0.73
27	002353	杰瑞股份	119,600	3,005,548.00	0.72
28	688256	寒武纪	15,984	3,004,992.00	0.72
29	300058	蓝色光标	309,900	2,996,733.00	0.72
30	002056	横店东磁	163,100	2,970,051.00	0.71
31	002739	万达电影	236,200	2,961,948.00	0.71
32	300136	信维通信	147,500	2,961,800.00	0.71
33	002568	百润股份	81,200	2,951,620.00	0.71
34	600298	安琪酵母	81,000	2,933,010.00	0.70
35	000807	云铝股份	229,900	2,926,627.00	0.70
36	300866	安克创新	33,328	2,916,200.00	0.70
37	600143	金发科技	333,100	2,907,963.00	0.70
38	000513	丽珠集团	74,710	2,906,966.10	0.70
39	000997	新大陆	153,300	2,897,370.00	0.69
40	300487	蓝晓科技	46,400	2,896,288.00	0.69
41	600998	九州通	275,883	2,863,665.54	0.69
42	002531	天顺风能	187,600	2,857,148.00	0.68
43	002080	中材科技	139,200	2,856,384.00	0.68
44	600486	扬农化工	32,600	2,849,892.00	0.68
45	688029	南微医学	34,479	2,812,107.24	0.67
46	600038	中直股份	70,500	2,807,310.00	0.67
47	000878	云南铜业	252,600	2,791,230.00	0.67
48	002273	水晶光电	232,934	2,781,231.96	0.67
49	603885	吉祥航空	180,100	2,778,943.00	0.66
50	600820	隧道股份	460,500	2,767,605.00	0.66
51	002518	科士达	68,900	2,756,689.00	0.66

52	600859	王府井	138,700	2,744,873.00	0.66
53	300017	网宿科技	383,600	2,727,396.00	0.65
54	300115	长盈精密	228,400	2,720,244.00	0.65
55	600060	海信视像	109,900	2,720,025.00	0.65
56	603233	大参林	96,638	2,706,830.38	0.65
57	600909	华安证券	577,500	2,696,925.00	0.65
58	002572	索菲亚	154,800	2,696,616.00	0.65
59	688002	睿创微纳	60,158	2,695,078.40	0.64
60	603927	中科软	69,800	2,691,488.00	0.64
61	600021	上海电力	249,700	2,689,269.00	0.64
62	600580	卧龙电驱	181,826	2,656,477.86	0.64
63	603737	三棵树	40,340	2,639,042.80	0.63
64	600655	豫园股份	384,600	2,638,356.00	0.63
65	601958	金钼股份	236,300	2,634,745.00	0.63
66	600131	国网信通	129,600	2,616,624.00	0.63
67	000591	太阳能	384,600	2,607,588.00	0.62
68	000739	普洛药业	146,300	2,595,362.00	0.62
69	603218	日月股份	135,900	2,580,741.00	0.62
70	002244	滨江集团	291,800	2,573,676.00	0.62
71	600985	淮北矿业	222,800	2,566,656.00	0.61
72	300861	美畅股份	59,100	2,563,167.00	0.61
73	300390	天华新能	70,740	2,532,492.00	0.61
74	000709	河钢股份	1,117,100	2,524,646.00	0.60
75	688390	固德威	15,091	2,518,084.26	0.60
76	603225	新凤鸣	226,000	2,497,300.00	0.60
77	603228	景旺电子	96,600	2,477,790.00	0.59
78	300144	宋城演艺	199,511	2,473,936.40	0.59
79	300618	寒锐钴业	76,072	2,465,493.52	0.59
80	603444	吉比特	5,000	2,455,550.00	0.59
81	688208	道通科技	80,934	2,453,109.54	0.59
82	601778	晶科科技	496,300	2,451,722.00	0.59
83	002444	巨星科技	111,500	2,439,620.00	0.58
84	688516	奥特维	12,941	2,438,084.40	0.58
85	600521	华海药业	131,900	2,428,279.00	0.58
86	688006	杭可科技	79,578	2,424,741.66	0.58
87	001914	招商积余	158,200	2,380,910.00	0.57
88	600637	东方明珠	304,100	2,378,062.00	0.57
89	600167	联美控股	339,800	2,368,406.00	0.57
90	000537	广宇发展	202,500	2,363,175.00	0.57
91	300888	稳健医疗	55,994	2,333,269.98	0.56
92	000012	南玻 A	389,600	2,322,016.00	0.56
93	600066	宇通客车	154,200	2,272,908.00	0.54
94	688301	奕瑞科技	8,013	2,263,111.59	0.54
95	603883	老百姓	75,500	2,253,675.00	0.54

96	603786	科博达	33,700	2,214,090.00	0.53
97	601231	环旭电子	147,900	2,212,584.00	0.53
98	600409	三友化工	405,500	2,209,975.00	0.53
99	002110	三钢闽光	515,900	2,177,098.00	0.52
100	600801	华新水泥	173,100	2,137,785.00	0.51
101	601869	长飞光纤	57,500	2,128,075.00	0.51
102	603317	天味食品	145,520	2,126,047.20	0.51
103	300012	华测检测	107,200	2,090,400.00	0.50
104	002250	联化科技	198,600	2,077,356.00	0.50
105	688188	柏楚电子	10,565	1,992,136.40	0.48
106	603026	胜华新材	33,200	1,967,100.00	0.47
107	600535	天士力	131,471	1,907,644.21	0.46
108	600155	华创云信	306,100	1,903,942.00	0.46
109	688009	中国通号	327,535	1,899,703.00	0.45
110	300832	新产业	30,800	1,817,200.00	0.43
111	600369	西南证券	490,300	1,789,595.00	0.43
112	600959	江苏有线	522,058	1,764,556.04	0.42
113	600566	济川药业	59,028	1,714,173.12	0.41
114	601000	唐山港	468,700	1,654,511.00	0.40
115	002249	大洋电机	290,000	1,653,000.00	0.40
116	600258	首旅酒店	81,800	1,550,110.00	0.37
117	688200	华峰测控	9,780	1,496,340.00	0.36
118	603127	昭衍新药	34,644	1,416,939.60	0.34
119	002019	亿帆医药	95,100	1,388,460.00	0.33
120	601997	贵阳银行	235,200	1,213,632.00	0.29
121	688819	天能股份	32,676	1,203,783.84	0.29
122	002966	苏州银行	181,900	1,191,445.00	0.29
123	002595	豪迈科技	33,700	1,183,881.00	0.28
124	002299	圣农发展	55,500	1,062,825.00	0.25
125	300363	博腾股份	34,000	1,006,060.00	0.24
126	600377	宁沪高速	80,400	790,332.00	0.19
127	601187	厦门银行	134,600	675,692.00	0.16
128	601077	渝农商行	185,400	665,586.00	0.16
129	000155	川能动力	45,200	650,880.00	0.16
130	603160	汇顶科技	9,700	448,625.00	0.11
131	300418	昆仑万维	9,500	382,660.00	0.09
132	603517	绝味食品	7,600	282,340.00	0.07
133	000728	国元证券	26,200	170,824.00	0.04
134	002507	涪陵榨菜	6,890	126,155.90	0.03
135	000988	华工科技	3,100	117,831.00	0.03
136	002340	格林美	10,200	70,482.00	0.02
137	002422	科伦药业	2,100	62,328.00	0.01
138	000898	鞍钢股份	16,100	44,758.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	688630	芯碁微装	32,656	2,743,757.12	0.66
2	688408	中信博	32,273	2,721,582.09	0.65
3	688556	高测股份	45,895	2,438,860.30	0.58
4	688357	建龙微纳	37,028	2,395,341.32	0.57
5	601137	博威合金	149,300	2,323,108.00	0.56
6	688508	芯朋微	36,660	2,125,913.40	0.51
7	002179	中航光电	46,570	2,111,949.50	0.51
8	603027	千禾味业	98,406	2,078,334.72	0.50
9	002540	亚太科技	358,700	2,073,286.00	0.50
10	300777	中简科技	43,800	2,069,988.00	0.50
11	300855	图南股份	57,100	2,016,772.00	0.48
12	300856	科思股份	25,600	2,016,512.00	0.48
13	600197	伊力特	73,000	1,983,410.00	0.47
14	601021	春秋航空	33,700	1,936,739.00	0.46
15	002314	南山控股	583,600	1,925,880.00	0.46
16	002959	小熊电器	22,800	1,903,800.00	0.46
17	688186	广大特材	58,485	1,902,517.05	0.46
18	600926	杭州银行	161,300	1,895,275.00	0.45
19	002987	京北方	86,200	1,889,504.00	0.45
20	300775	三角防务	55,800	1,884,924.00	0.45
21	601336	新华保险	50,300	1,849,531.00	0.44
22	002410	广联达	56,660	1,840,883.40	0.44
23	300041	回天新材	155,330	1,832,894.00	0.44
24	002389	航天彩虹	82,000	1,821,220.00	0.44
25	688095	福昕软件	13,054	1,649,764.52	0.39
26	688063	派能科技	8,243	1,634,174.75	0.39
27	002371	北方华创	5,100	1,620,015.00	0.39
28	603129	春风动力	9,900	1,602,810.00	0.38
29	688366	昊海生科	18,443	1,553,269.46	0.37
30	603345	安井食品	10,200	1,497,360.00	0.36
31	688018	乐鑫科技	10,947	1,421,139.54	0.34
32	688311	盟升电子	18,953	1,325,572.82	0.32
33	600674	川投能源	71,600	1,077,580.00	0.26
34	002851	麦格米特	27,600	1,006,572.00	0.24
35	688665	四方光电	9,408	876,072.96	0.21
36	002458	益生股份	60,000	741,000.00	0.18
37	688012	中微公司	4,727	739,539.15	0.18
38	003006	百亚股份	36,060	623,116.80	0.15

39	300811	铂科新材	9,900	588,456.00	0.14
40	301486	致尚科技	2,717	156,662.22	0.04
41	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
42	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
43	688249	晶合集成	3,122	56,383.32	0.01
44	688531	日联科技	346	47,045.62	0.01
45	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
46	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.01
47	688146	中船特气	716	27,301.08	0.01
48	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.01
49	688472	阿特斯	1,565	26,667.60	0.01
50	688469	中芯集成	4,844	26,206.04	0.01
51	688443	智翔金泰	876	25,833.24	0.01
52	001287	中电港	1,184	24,887.68	0.01
53	688361	中科飞测	379	24,509.93	0.01
54	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
55	301307	美利信	687	21,887.82	0.01
56	601061	中信金属	2,754	20,875.32	0.00
57	688582	芯动联科	426	17,329.68	0.00
58	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
59	301291	明阳电气	542	16,818.26	0.00
60	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
61	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
62	688552	航天南湖	591	13,888.50	0.00
63	688334	西高院	841	13,632.61	0.00
64	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
65	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
66	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
67	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
68	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
69	301332	德尔玛	889	12,205.97	0.00
70	688570	天玛智控	473	11,981.09	0.00
71	301305	朗坤环境	602	11,853.38	0.00
72	688581	安杰思	100	11,803.00	0.00
73	301397	溯联股份	292	11,738.40	0.00
74	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
75	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
76	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
77	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
78	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
79	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
80	688623	双元科技	111	9,633.69	0.00
81	688479	友车科技	321	9,466.29	0.00
82	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00

83	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
84	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
85	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
86	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
87	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
88	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
89	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
90	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
91	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
92	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
93	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
94	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
95	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
96	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
97	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
98	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
99	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002340	格林美	12,432,662.00	2.97
2	603345	安井食品	11,720,743.13	2.80
3	002384	东山精密	11,477,402.00	2.75
4	300724	捷佳伟创	11,183,949.72	2.68
5	002738	中矿资源	10,809,254.70	2.59
6	300003	乐普医疗	10,752,914.00	2.57
7	000932	华菱钢铁	10,632,894.00	2.54
8	603605	珀莱雅	10,546,581.20	2.52
9	603688	石英股份	10,216,706.00	2.44
10	601555	东吴证券	10,198,627.00	2.44
11	601699	潞安环能	10,178,323.00	2.43
12	300144	宋城演艺	10,132,933.52	2.42
13	000807	云铝股份	10,020,253.00	2.40
14	300308	中际旭创	9,873,432.00	2.36
15	300136	信维通信	9,815,991.00	2.35
16	601108	财通证券	9,702,768.50	2.32
17	600160	巨化股份	9,557,970.00	2.29
18	002025	航天电器	9,526,505.41	2.28

19	601128	常熟银行	9,508,062.00	2.27
20	601168	西部矿业	9,328,887.00	2.23
21	300390	天华新能	9,277,625.00	2.22
22	002299	圣农发展	9,236,597.00	2.21
23	002056	横店东磁	9,212,778.00	2.20
24	002273	水晶光电	9,064,736.40	2.17
25	603596	伯特利	9,006,947.00	2.15
26	600026	中远海能	8,928,978.12	2.14
27	002409	雅克科技	8,918,487.00	2.13
28	000591	太阳能	8,860,025.00	2.12
29	000878	云南铜业	8,786,814.00	2.10
30	000729	燕京啤酒	8,584,693.55	2.05
31	300017	网宿科技	8,554,457.00	2.05
32	000728	国元证券	8,541,030.00	2.04
33	000997	新大陆	8,536,802.00	2.04
34	000513	丽珠集团	8,489,970.30	2.03
35	600521	华海药业	8,470,582.00	2.03
36	300866	安克创新	8,442,367.00	2.02
37	600985	淮北矿业	8,406,716.00	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	12,594,666.00	3.01
2	002340	格林美	11,654,452.35	2.79
3	002384	东山精密	11,001,106.28	2.63
4	002738	中矿资源	10,712,681.00	2.56
5	300383	光环新网	9,799,326.73	2.34
6	300724	捷佳伟创	9,587,112.00	2.29
7	000729	燕京啤酒	8,446,026.47	2.02
8	300604	长川科技	8,229,610.34	1.97
9	000728	国元证券	8,172,879.00	1.96
10	002429	兆驰股份	8,084,697.00	1.93
11	000738	航发控制	7,714,593.18	1.85
12	300003	乐普医疗	7,688,650.00	1.84
13	002299	圣农发展	7,348,871.00	1.76
14	002409	雅克科技	7,298,445.00	1.75
15	300144	宋城演艺	7,170,916.00	1.72
16	300136	信维通信	7,153,806.80	1.71
17	002683	广东宏大	6,965,716.24	1.67
18	002557	洽洽食品	6,944,300.18	1.66

19	000807	云铝股份	6,944,026.00	1.66
20	300017	网宿科技	6,916,552.51	1.65

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	1,379,609,554.33
卖出股票收入（成交）总额	582,407,193.61

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）	241,856.28	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	241,856.28	0.06

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	113669	景 23 转债	1,740	241,856.28	0.06
---	--------	---------	-------	------------	------

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 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，财通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局浙江省分局的处罚。东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到江苏省无锡市江阴市人民政府澄江街道办事处处罚。江苏鱼跃医疗设备股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到江苏省镇江市市场监督管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 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	2,504,056.59
2	应收清算款	1,117,570.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	79,559.74
8	其他	-
9	合计	3,701,186.86

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	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
5,917	72,447.02	87,655,200.00	20.45%	341,013,800.00	79.55%

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	招证资本投资有限公司	44,965,800.00	10.49%
2	海南盛丰私募基金管理有限公司—盛丰 优谷私募证券投资基金	6,829,800.00	1.59%
3	上海量游资产管理有限公司—量游 1 号 基金	6,160,900.00	1.44%
4	广丰集团有限公司	5,000,000.00	1.17%
5	花艳	5,000,000.00	1.17%
6	李防震	5,000,000.00	1.17%
7	王琦	4,000,000.00	0.93%
8	方正证券股份有限公司	3,221,400.00	0.75%
9	中信证券股份有限公司	2,538,200.00	0.59%
10	高宏达	2,354,400.00	0.55%

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	0.00	0.0000%

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（2023 年 2 月 17 日）基金份额总额	1,142,669,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	88,500,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	802,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	428,669,000.00

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 17 日。

§ 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 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

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、公募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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

10.6.2 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	
天风证券	2	1,208,713,206.73	61.87%	241,754.47	61.87%	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	744,971,233.71	38.13%	148,999.99	38.13%	-

注：a) 本报告期内新增交易单元的证券公司为天风证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，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
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	61,269.76	100.00%	-	-	-	-

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	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	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	2023-02-18
2	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、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	2023-03-08
3	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-08
4	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	上海证券报	2023-03-08
5	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数	上海证券报、基金管理人	2023-03-13

	证券投资基金上市交易提示性公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	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	2023-03-25
7	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	2023-03-31
8	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	2023-04-22
9	易方达中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金增加东北证券为一级交易商的公告	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	2023-04-27
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-05-11
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-05-16
12	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	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	2023-05-26
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	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	2023-06-06
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-06-15

§ 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中证 500 增强策略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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 增强策略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。

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

二〇二三年八月三十日