

# 易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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 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	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	53
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	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	57
§ 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 .....	58
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 .....	62
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
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 .....	62
§ 12	备查文件目录 .....	63
12.1	备查文件目录 .....	63
12.2	存放地点 .....	63
12.3	查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 500 量化增强	
基金主代码	012080	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 15 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	556,078,772.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	012080	012081
报告期末下属分级基金的份额总额	411,661,686.45 份	144,417,086.51 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7%；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，谋求基金资产的长期增值。股票投资方面，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。债券投资方面，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，并通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择等方面进行积极主动的债券投资管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。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，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。本基金可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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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、以及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。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。
--	--

### 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	中国证券报
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	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼

## § 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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
本期已实现收益	-8,062,181.77	-2,326,749.09
本期利润	9,840,212.47	296,041.66
加权平均基金份额本期利润	0.0230	0.0016
本期加权平均净值利润率	2.54%	0.17%
本期基金份额净值增长率	2.45%	2.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
期末可供分配利润	-46,752,254.15	-17,180,719.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1136	-0.1190
期末基金资产净值	364,909,432.30	127,236,366.83
期末基金份额净值	0.8864	0.8810
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金份额累计净值增长率	-11.36%	-11.90%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 量化增强 A

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

过去一个月	0.89%	0.86%	-0.77%	0.89%	1.66%	-0.03%
过去三个月	-3.63%	0.76%	-5.10%	0.78%	1.47%	-0.02%
过去六个月	2.45%	0.73%	2.20%	0.75%	0.25%	-0.02%
过去一年	-6.90%	0.91%	-6.65%	0.91%	-0.25%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-11.36%	1.01%	-10.13%	1.09%	-1.23%	-0.08%

## 易方达中证 500 量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.86%	0.86%	-0.77%	0.89%	1.63%	-0.03%
过去三个月	-3.69%	0.76%	-5.10%	0.78%	1.41%	-0.02%
过去六个月	2.30%	0.73%	2.20%	0.75%	0.10%	-0.02%
过去一年	-7.18%	0.91%	-6.65%	0.91%	-0.53%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-11.90%	1.01%	-10.13%	1.09%	-1.77%	-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 500 指数量化增强型证券投资基金  
 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 6 月 15 日至 2023 年 6 月 30 日)

易方达中证 500 量化增强 A





## 易方达中证 500 量化增强 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-11.36%，同期业绩比较基准收益率为-10.13%；C 类基金份额净值增长率为-11.90%，同期业绩比较基准收益率为-10.13%。

## § 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 增强策略 ETF 的基金经理, 量化投资部总经理助理	2021-06-15	-	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。
H U A N G J I A N S H E N G ( 黄 健 生 )	本基金的基金经理，易方达中证 1000 量化增强的基金经理，量化投资决策委员会委员	2021-09-04	-	12 年	加拿大籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任美国 Sun Microsystems 资深软件工程师，美国 GMN Capital/伦敦 GSA Capital 量化投资研究员，美国巴克莱全球投资者（Barclays Global Investors）量化研究员，加拿大阿尔伯塔投资管理公司副基金经理，华泰柏瑞基金管理有限公司量化投资部门总监、投资经理，易方达基金管理有限公司量化投资部总经理，易方达量化策略精选混合、易方达沪深 300 量化增强的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

在此期间，作为指数增强型基金，本基金严格遵照量化指数增强投资模式进行操作，以标的指数的构成为基础，主要利用自主开发的以基本面选股因子为主的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.8864 元，本报告期份额净值增长率为 2.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%；C 类基金份额净值为 0.8810 元，本报告期份额净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%，年化跟踪误差 3.79%，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

易方达中证 500 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C:本报告期内未实施利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人

利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	29,714,855.26	29,926,078.40
结算备付金		1,907,439.93	1,099,258.86
存出保证金		88,145.32	49,130.62
交易性金融资产	6.4.7.2	460,707,044.60	478,733,630.96
其中：股票投资		460,547,197.06	478,733,630.96
基金投资		-	-
债券投资		159,847.54	-
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		545,379.24	-
应收股利		-	-
应收申购款		184,179.17	821,240.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		493,147,043.52	510,629,339.78
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>

<b>负债：</b>			
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		214,526.93	98,325.31
应付管理人报酬		323,455.72	353,039.75
应付托管费		60,647.95	66,194.95
应付销售服务费		31,281.77	33,452.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	371,331.35	354,384.05
负债合计		1,001,244.39	905,396.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	556,078,772.96	589,849,103.75
未分配利润	6.4.7.8	-63,932,973.83	-80,125,160.51
净资产合计		492,145,799.13	509,723,943.24
负债和净资产总计		493,147,043.52	510,629,339.78

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.8864 元，C 类基金份额净值 0.8810 元；基金份额总额 556,078,772.96 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 411,661,686.45 份，C 类基金份额总额 144,417,086.51 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		13,092,848.91	-46,431,298.45
1.利息收入		69,532.50	177,770.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	69,532.50	177,770.44
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）		-7,602,261.31	-68,875,779.79
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,275,219.93	-67,999,658.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	63.31	-
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	-	-6,730,472.81
股利收益	6.4.7.14	5,672,895.31	5,854,351.69
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	20,525,184.99	22,178,364.76
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	100,392.73	88,346.14
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,956,594.78</b>	<b>3,103,067.03</b>
1. 管理人报酬		2,201,952.04	2,363,101.80
2. 托管费		412,866.02	443,081.56
3. 销售服务费		249,671.62	205,702.81
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		0.21	-
8. 其他费用	6.4.7.18	92,104.89	91,180.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>10,136,254.13</b>	<b>-49,534,365.48</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>10,136,254.13</b>	<b>-49,534,365.48</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>10,136,254.13</b>	<b>-49,534,365.48</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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）	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24
二、本期期初净	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24



资产(基金净值)			
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-33,770,330.79	16,192,186.68	-17,578,144.11
(一)、综合收益总额	-	10,136,254.13	10,136,254.13
(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)	-33,770,330.79	6,055,932.55	-27,714,398.24
其中：1.基金申购款	204,530,649.95	-16,582,655.99	187,947,993.96
2.基金赎回款	-238,300,980.74	22,638,588.54	-215,662,392.20
(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)	556,078,772.96	-63,932,973.83	492,145,799.13
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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)	666,578,009.30	15,684,755.18	682,262,764.48
二、本期期初净资产(基金净值)	666,578,009.30	15,684,755.18	682,262,764.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-34,922,545.07	-46,351,998.26	-81,274,543.33
(一)、综合收益总额	-	-49,534,365.48	-49,534,365.48
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-34,922,545.07	3,182,367.22	-31,740,177.85
其中：1.基金申购款	77,472,017.12	-7,259,243.63	70,212,773.49
2.基金赎回款	-112,394,562.19	10,441,610.85	-101,952,951.34

(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)	631,655,464.23	-30,667,243.08	600,988,221.15

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 指数量化增强型证券投资基金(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]1043 号《关于准予易方达中证 500 指数量化增强型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 指数量化增强型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 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,088,975,598.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 547,709.87 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。

本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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 500 指数量化增强型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净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。

(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。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	29,714,855.26
等于：本金	29,712,359.91
加：应计利息	2,495.35
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	29,714,855.26

##### 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	465,948,585.66	-	460,547,197.06	-5,401,388.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	66.54		
	市场	114,998.49	159,847.54	44,782.51
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	114,998.49	66.54	159,847.54	44,782.51

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	466,063,584.15	66.54	460,707,044.60	-5,356,606.09

### 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

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	220,575.26
其中：交易所市场	220,575.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	150,756.09
合计	371,331.35

### 6.4.7.7 实收基金

#### 易方达中证 500 量化增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	439,130,298.21	439,130,298.21
本期申购	30,102,395.96	30,102,395.96
本期赎回（以“-”号填列）	-57,571,007.72	-57,571,007.72
本期末	411,661,686.45	411,661,686.45

## 易方达中证 500 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,718,805.54	150,718,805.54
本期申购	174,428,253.99	174,428,253.99
本期赎回（以“-”号填列）	-180,729,973.02	-180,729,973.02
本期末	144,417,086.51	144,417,086.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 易方达中证 500 量化增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-36,985,111.31	-22,217,543.45	-59,202,654.76
本期利润	-8,062,181.77	17,902,394.24	9,840,212.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,406,489.70	203,698.44	2,610,188.14
其中：基金申购款	-2,575,848.63	-55,687.31	-2,631,535.94
基金赎回款	4,982,338.33	259,385.75	5,241,724.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,640,803.38	-4,111,450.77	-46,752,254.15

## 易方达中证 500 量化增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,321,782.99	-7,600,722.76	-20,922,505.75
本期利润	-2,326,749.09	2,622,790.75	296,041.66
本期基金份额交易产生的变动数	-87,205.59	3,532,950.00	3,445,744.41
其中：基金申购款	-15,114,013.41	1,162,893.36	-13,951,120.05
基金赎回款	15,026,807.82	2,370,056.64	17,396,864.46
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-15,735,737.67	-1,444,982.01	-17,180,719.68
-----	----------------	---------------	----------------

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	56,530.73
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	12,395.89
其他	605.88
合计	69,532.50

**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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-13,275,219.93
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-13,275,219.93

**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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,148,933,564.09
减：卖出股票成本总额	1,160,425,619.04
减：交易费用	1,783,164.98
买卖股票差价收入	-13,275,219.93

**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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	63.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	63.31

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.12 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,672,895.31
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	5,672,895.31

#### 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1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	20,525,184.99
——股票投资	20,480,402.48
——债券投资	44,782.51
——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	20,525,184.99

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	100,392.73



合计	100,392.73
----	------------

**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1月1日至2023年6月30日
审计费用	30,248.72
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,348.80
合计	92,104.89

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成	成交金额	占当期股票成

		交总额的比例		交总额的比例
广发证券	2,259,937,959.43	100.00%	2,138,454,109.39	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	452,001.33	100.00%	220,575.26	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	427,699.27	100.00%	248,402.83	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 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	2,201,952.04
其中：支付销售机构的客户维护费	765,945.28	880,663.33

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 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	412,866.02	443,081.56

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证 500 量化 增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	合计
易方达基金管理有限 公司	-	69,468.14	69,468.14
中国工商银行	-	39,681.20	39,681.20
广发证券	-	4,550.43	4,550.43
合计	-	113,699.77	113,699.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证500量化增强A	易方达中证500量化增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	14,796.19	14,796.19
中国工商银行	-	42,265.02	42,265.02
广发证券	-	4,506.12	4,506.12
合计	-	61,567.33	61,567.33

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

易方达中证 500 量化增强 A

无。

**易方达中证 500 量化增强 C**

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	29,714,855.26	56,530.73	35,852,704.25	110,254.13

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 2023年1月1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
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
上年度可比期间 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
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02

**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****易方达中证 500 量化增强 A**

本报告期内未发生利润分配。

**易方达中证 500 量化增强 C**

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	725	8,613.00	15,239.50	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
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	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

				受限						
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	6 个月	新股 流通 受限	25.82	25.82	306	7,900. 92	7,900. 92	-
30123 2	飞沃 科技	2023-0 6-08	6 个月	新股 流通 受限	72.50	58.42	165	11,962 .50	9,639. 30	-
30128 1	科源 制药	2023-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	44.18	25.10	337	10,647 .38	8,458. 70	-
30129 1	明阳 电气	2023-0 6-21	6 个月	新股 流通 受限	38.13	31.03	703	26,805 .39	21,814 .09	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月	新股 流通 受限	29.60	71.42	333	9,856. 80	23,782 .86	-
30130 1	川宁 生物	2022-1 2-20	6 个月	新股 流通 受限	5.00	8.96	3,574	17,870 .00	32,023 .04	-
30130 5	朗坤 环境	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	25.25	19.69	753	19,013 .25	14,826 .57	-
30130 7	美利 信	2023-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	32.34	31.86	687	22,217 .58	21,887 .82	-
30131 5	威士 顿	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	32.29	51.12	226	7,297. 54	11,553 .12	-
30132 3	新莱 福	2023-0 5-29	6 个月	新股 流通 受限	39.06	39.36	228	8,905. 68	8,974. 08	-
30133 2	德尔 玛	2023-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	14.81	13.73	1,122	16,616 .82	15,405 .06	-
30133 7	亚华 电子	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	32.60	30.37	232	7,563. 20	7,045. 84	-
30134 5	涛涛 车业	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	73.45	46.64	232	17,040 .40	10,820 .48	-
30135 5	南王 科技	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	17.55	16.75	563	9,880. 65	9,430. 25	-
30135	湖南	2023-0	6 个月	新股	23.77	42.89	676	16,068	28,993	-

8	裕能	2-01		流通受限				.52	.64	
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	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	734	14,672.66	12,404.60	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	3,155	181,917.30	181,917.30	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	351	20,238.66	20,238.66	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月以内	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-



301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,675	11,021.50	12,696.50	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	700	7,252.00	8,288.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	531	6,191.46	6,510.06	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	537	19,412.55	20,475.81	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,258	64,703.88	58,839.48	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,570	18,997.00	18,949.90	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	485	11,446.00	31,364.95	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

				受限						
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,127	42,690.76	33,235.23	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	6,093	34,669.17	32,963.13	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,038	22,621.80	34,727.52	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	136	22,591.52	16,606.96	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	231	35,199.78	31,409.07	-
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	758	16,046.86	17,813.00	-
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	619	18,730.94	15,679.27	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	128	16,102.40	15,107.84	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	553	14,787.22	22,496.04	-
68859	新相	2023-0	6 个月	新股	11.18	14.59	959	10,721	13,991	-

3	微	5-25		流通受限				.62	.81	
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	双元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	143	18,000.84	12,410.97	-
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	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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。

本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。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，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金可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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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、以及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。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。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 0.03%(2022 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 2023年6月30日	上年度末 2022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	上年度末
--------	-----	------

	2023年6月30日	2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	159,847.54	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	159,847.54	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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 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	29,714,855.26	-	-	-	29,714,855.26
结算备付金	1,907,439.93	-	-	-	1,907,439.93
存出保证金	88,145.32	-	-	-	88,145.32
交易性金融资产	-	-	159,847.54	460,547,197.06	460,707,044.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	545,379.24	545,379.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	184,179.17	184,179.17
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,710,440.51	-	159,847.54	461,276,755.47	493,147,043.52
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	-	-	-	214,526.93	214,526.93
应付管理人报酬	-	-	-	323,455.72	323,455.72
应付托管费	-	-	-	60,647.95	60,647.95
应付销售服务费	-	-	-	31,281.77	31,281.77
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	371,331.35	371,331.35
负债总计	-	-	-	1,001,244.39	1,001,244.39
利率敏感度缺口	31,710,440.51	-	159,847.54	460,275,511.08	492,145,799.13
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	29,926,078.40	-	-	-	29,926,078.40
结算备付金	1,099,258.86	-	-	-	1,099,258.86
存出保证金	49,130.62	-	-	-	49,130.62
交易性金融资产	-	-	-	478,733,630.96	478,733,630.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	821,240.94	821,240.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,074,467.88	-	-	479,554,871.90	510,629,339.78
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	-	-	-	98,325.31	98,325.31
应付管理人报酬	-	-	-	353,039.75	353,039.75
应付托管费	-	-	-	66,194.95	66,194.95
应付销售服务费	-	-	-	33,452.48	33,452.48
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	-	-	-	354,384.05
负债总计	-	-	-	905,396.54
利率敏感度缺口	31,074,467.88	-	-	478,649,475.36
				509,723,943.24

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		上年度末 2022 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	460,547,197.06	93.58	478,733,630.96	93.92
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	460,547,197.06	93.58	478,733,630.96	93.92
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	23,717,286.66	25,467,820.52
	2.业绩比较基准下降 5%	-23,717,286.66	-25,467,820.52

#### 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	459,307,638.56
第二层次	385,309.20
第三层次	1,014,096.84
合计	460,707,044.60

###### 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、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	460,547,197.06	93.39
	其中：股票	460,547,197.06	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,847.54	0.03
	其中：债券	159,847.54	0.03
	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	31,622,295.19	6.41
8	其他各项资产	817,703.73	0.17
9	合计	493,147,043.52	100.00

### 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	3,820,070.00	0.78
B	采矿业	14,600,098.00	2.97

C	制造业	240,348,174.27	48.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,197,521.10	2.07
E	建筑业	4,233,009.00	0.86
F	批发和零售业	17,721,913.46	3.60
G	交通运输、仓储和邮政业	6,919,736.25	1.41
H	住宿和餐饮业	1,462,940.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,895,850.62	5.06
J	金融业	32,254,360.06	6.55
K	房地产业	5,941,494.00	1.21
L	租赁和商务服务业	1,921,429.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	5,630,020.00	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	1,129,968.00	0.23
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	7,523,733.00	1.53
S	综合	-	-
	合计	378,600,316.76	76.93

#### 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	2,017,891.00	0.41
B	采矿业	2,876,823.00	0.58
C	制造业	59,656,224.55	12.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	685,499.47	0.14
E	建筑业	1,881,173.57	0.38
F	批发和零售业	52,289.25	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,573,197.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,551,978.15	1.53
J	金融业	1,843,164.00	0.37
K	房地产业	776,912.40	0.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	362,078.48	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	645,866.57	0.13
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	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,946,880.30	16.65

### 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	48,000	7,077,600.00	1.44
2	002422	科伦药业	153,100	4,544,008.00	0.92
3	300724	捷佳伟创	40,400	4,538,940.00	0.92
4	300003	乐普医疗	181,800	4,110,498.00	0.84
5	300012	华测检测	197,900	3,859,050.00	0.78
6	603688	石英股份	33,800	3,847,792.00	0.78
7	600109	国金证券	437,600	3,793,992.00	0.77
8	300285	国瓷材料	137,921	3,779,035.40	0.77
9	601108	财通证券	521,138	3,773,039.12	0.77
10	600161	天坛生物	138,700	3,765,705.00	0.77
11	600418	江淮汽车	297,300	3,743,007.00	0.76
12	002025	航天电器	58,600	3,738,680.00	0.76
13	601233	桐昆股份	280,800	3,720,600.00	0.76
14	600060	海信视像	149,300	3,695,175.00	0.75
15	002600	领益智造	526,600	3,638,806.00	0.74
16	601168	西部矿业	344,100	3,616,491.00	0.73
17	688777	中控技术	57,481	3,608,657.18	0.73
18	603596	伯特利	45,000	3,566,700.00	0.72
19	600298	安琪酵母	98,300	3,559,443.00	0.72

20	300866	安克创新	40,100	3,508,750.00	0.71
21	688256	寒武纪	18,592	3,495,296.00	0.71
22	002568	百润股份	95,300	3,464,155.00	0.70
23	002056	横店东磁	185,000	3,368,850.00	0.68
24	603338	浙江鼎力	60,100	3,366,201.00	0.68
25	300487	蓝晓科技	53,250	3,323,865.00	0.68
26	000728	国元证券	509,260	3,320,375.20	0.67
27	300144	宋城演艺	267,300	3,314,520.00	0.67
28	688002	睿创微纳	72,698	3,256,870.40	0.66
29	002531	天顺风能	208,600	3,176,978.00	0.65
30	000878	云南铜业	287,500	3,176,875.00	0.65
31	600820	隧道股份	527,900	3,172,679.00	0.64
32	603885	吉祥航空	202,100	3,118,403.00	0.63
33	600909	华安证券	667,500	3,117,225.00	0.63
34	603233	大参林	110,168	3,085,805.68	0.63
35	600655	豫园股份	446,200	3,060,932.00	0.62
36	600985	淮北矿业	264,300	3,044,736.00	0.62
37	002299	圣农发展	157,800	3,021,870.00	0.61
38	601958	金钼股份	268,400	2,992,660.00	0.61
39	688188	柏楚电子	15,870	2,992,447.20	0.61
40	002249	大洋电机	522,600	2,978,820.00	0.61
41	000739	普洛药业	165,900	2,943,066.00	0.60
42	600066	宇通客车	197,700	2,914,098.00	0.59
43	601555	东吴证券	419,640	2,912,301.60	0.59
44	601717	郑煤机	233,500	2,907,075.00	0.59
45	002244	滨江集团	328,600	2,898,252.00	0.59
46	002867	周大生	160,000	2,844,800.00	0.58
47	002080	中材科技	138,500	2,842,020.00	0.58
48	002353	杰瑞股份	112,700	2,832,151.00	0.58
49	002745	木林森	307,600	2,829,920.00	0.58
50	603225	新凤鸣	253,000	2,795,650.00	0.57
51	002223	鱼跃医疗	77,300	2,782,027.00	0.57
52	600352	浙江龙盛	296,500	2,772,275.00	0.56
53	688029	南微医学	33,792	2,756,075.52	0.56
54	688208	道通科技	90,378	2,739,357.18	0.56
55	600801	华新水泥	221,500	2,735,525.00	0.56
56	000783	长江证券	459,300	2,663,940.00	0.54
57	002409	雅克科技	36,500	2,660,120.00	0.54
58	600481	双良节能	188,800	2,639,424.00	0.54
59	603883	老百姓	87,600	2,614,860.00	0.53
60	603218	日月股份	137,500	2,611,125.00	0.53
61	002739	万达电影	207,950	2,607,693.00	0.53
62	002563	森马服饰	417,600	2,597,472.00	0.53
63	002444	巨星科技	118,300	2,588,404.00	0.53

64	002203	海亮股份	214,500	2,576,145.00	0.52
65	000683	远兴能源	357,500	2,570,425.00	0.52
66	300136	信维通信	126,800	2,546,144.00	0.52
67	603939	益丰药房	68,580	2,537,460.00	0.52
68	002110	三钢闽光	597,902	2,523,146.44	0.51
69	603444	吉比特	5,120	2,514,483.20	0.51
70	002273	水晶光电	209,839	2,505,477.66	0.51
71	688516	奥特维	13,240	2,494,416.00	0.51
72	000591	太阳能	366,000	2,481,480.00	0.50
73	601128	常熟银行	360,900	2,461,338.00	0.50
74	601077	渝农商行	679,400	2,439,046.00	0.50
75	600699	均胜电子	137,300	2,421,972.00	0.49
76	600143	金发科技	276,900	2,417,337.00	0.49
77	000932	华菱钢铁	504,500	2,406,465.00	0.49
78	600563	法拉电子	17,500	2,402,750.00	0.49
79	600521	华海药业	129,900	2,391,459.00	0.49
80	600998	九州通	226,331	2,349,315.78	0.48
81	000997	新大陆	123,100	2,326,590.00	0.47
82	603927	中科软	60,000	2,313,600.00	0.47
83	688390	固德威	13,841	2,309,509.26	0.47
84	600486	扬农化工	26,400	2,307,888.00	0.47
85	600038	中直股份	57,500	2,289,650.00	0.47
86	002507	涪陵榨菜	124,930	2,287,468.30	0.46
87	600859	王府井	113,000	2,236,270.00	0.45
88	600021	上海电力	203,800	2,194,926.00	0.45
89	300115	长盈精密	183,330	2,183,460.30	0.44
90	688200	华峰测控	14,265	2,182,545.00	0.44
91	300861	美畅股份	50,000	2,168,500.00	0.44
92	002465	海格通信	209,305	2,164,213.70	0.44
93	300017	网宿科技	304,364	2,164,028.04	0.44
94	603737	三棵树	32,900	2,152,318.00	0.44
95	600131	国网信通	106,300	2,146,197.00	0.44
96	002572	索菲亚	119,900	2,088,658.00	0.42
97	000709	河钢股份	921,400	2,082,364.00	0.42
98	300888	稳健医疗	49,240	2,051,830.80	0.42
99	300618	寒锐钴业	60,500	1,960,805.00	0.40
100	600863	内蒙华电	468,800	1,945,520.00	0.40
101	600959	江苏有线	573,100	1,937,078.00	0.39
102	000537	广宇发展	165,600	1,932,552.00	0.39
103	300058	蓝色光标	198,700	1,921,429.00	0.39
104	600167	联美控股	275,600	1,920,932.00	0.39
105	000012	南玻 A	321,700	1,917,332.00	0.39
106	603026	胜华新材	32,300	1,913,775.00	0.39
107	000898	鞍钢股份	684,800	1,903,744.00	0.39

108	688819	天能股份	50,795	1,871,287.80	0.38
109	002250	联化科技	178,400	1,866,064.00	0.38
110	603317	天味食品	127,630	1,864,674.30	0.38
111	603127	昭衍新药	43,300	1,770,970.00	0.36
112	601869	长飞光纤	47,800	1,769,078.00	0.36
113	601187	厦门银行	349,927	1,756,633.54	0.36
114	601000	唐山港	479,500	1,692,635.00	0.34
115	688006	杭可科技	55,030	1,676,764.10	0.34
116	600258	首旅酒店	77,200	1,462,940.00	0.30
117	000513	丽珠集团	34,000	1,322,940.00	0.27
118	002518	科士达	32,100	1,284,321.00	0.26
119	002028	思源电气	26,000	1,214,720.00	0.25
120	600489	中金黄金	116,600	1,204,478.00	0.24
121	002266	浙富控股	273,600	1,129,968.00	0.23
122	001914	招商积余	73,800	1,110,690.00	0.23
123	300146	汤臣倍健	46,200	1,107,876.00	0.23
124	300395	菲利华	22,100	1,087,320.00	0.22
125	600862	中航高科	42,800	1,083,268.00	0.22
126	600566	济川药业	37,100	1,077,384.00	0.22
127	603456	九洲药业	38,900	1,065,082.00	0.22
128	002138	顺络电子	43,200	1,032,912.00	0.21
129	600879	航天电子	120,000	1,018,800.00	0.21
130	002797	第一创业	177,800	1,017,016.00	0.21
131	601231	环旭电子	67,400	1,008,304.00	0.20
132	600153	建发股份	92,300	1,006,993.00	0.20
133	002294	信立泰	31,400	979,366.00	0.20
134	002430	杭氧股份	28,400	975,824.00	0.20
135	600497	驰宏锌锗	194,100	974,382.00	0.20
136	688301	奕瑞科技	3,441	971,841.63	0.20
137	603160	汇顶科技	20,900	966,625.00	0.20
138	601966	玲珑轮胎	42,900	953,238.00	0.19
139	600637	东方明珠	120,500	942,310.00	0.19
140	600271	航天信息	67,842	928,756.98	0.19
141	600380	健康元	72,500	921,475.00	0.19
142	002595	豪迈科技	26,200	920,406.00	0.19
143	002683	广东宏大	31,100	915,584.00	0.19
144	600398	海澜之家	132,200	909,536.00	0.18
145	002152	广电运通	77,600	909,472.00	0.18
146	600528	中铁工业	91,000	899,080.00	0.18
147	601577	长沙银行	115,100	893,176.00	0.18
148	600329	达仁堂	19,600	879,844.00	0.18
149	601456	国联证券	93,000	846,300.00	0.17
150	600582	天地科技	144,500	842,435.00	0.17
151	600282	南钢股份	249,000	839,130.00	0.17



152	002429	兆驰股份	152,100	836,550.00	0.17
153	600906	财达证券	115,600	832,320.00	0.17
154	600827	百联股份	62,100	830,277.00	0.17
155	600737	中粮糖业	103,000	829,150.00	0.17
156	000987	越秀资本	130,300	827,405.00	0.17
157	601778	晶科科技	166,300	821,522.00	0.17
158	601928	凤凰传媒	71,800	818,520.00	0.17
159	000825	太钢不锈	208,700	807,669.00	0.16
160	000998	隆平高科	52,000	798,200.00	0.16
161	601611	中国核建	94,400	797,680.00	0.16
162	300850	新强联	21,300	796,194.00	0.16
163	002511	中顺洁柔	71,200	793,880.00	0.16
164	601098	中南传媒	67,500	783,000.00	0.16
165	002468	申通快递	71,800	776,876.00	0.16
166	000089	深圳机场	111,500	774,925.00	0.16
167	600968	海油发展	252,300	774,561.00	0.16
168	603650	彤程新材	23,300	764,240.00	0.16
169	603826	坤彩科技	15,100	755,000.00	0.15
170	002128	电投能源	57,100	754,862.00	0.15
171	688185	康希诺	9,233	752,489.50	0.15
172	600901	江苏金租	178,920	738,939.60	0.15
173	603868	飞科电器	10,700	675,063.00	0.14
174	300776	帝尔激光	8,600	558,140.00	0.11
175	600350	山东高速	87,425	556,897.25	0.11
176	000155	川能动力	35,300	508,320.00	0.10
177	600369	西南证券	133,900	488,735.00	0.10
178	300418	昆仑万维	11,300	455,164.00	0.09
179	600155	华创云信	59,900	372,578.00	0.08
180	601991	大唐发电	98,100	324,711.00	0.07
181	600339	中油工程	79,200	322,344.00	0.07
182	600970	中材国际	20,600	262,650.00	0.05
183	600378	昊华科技	5,900	222,076.00	0.05
184	000988	华工科技	4,500	171,045.00	0.03
185	002340	格林美	15,200	105,032.00	0.02
186	000778	新兴铸管	12,300	50,184.00	0.01
187	002384	东山精密	1,000	25,900.00	0.01
188	601016	节能风电	30	110.10	0.00

## 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	30,835	2,590,756.70	0.53

2	601137	博威合金	161,300	2,509,828.00	0.51
3	300855	图南股份	67,800	2,394,696.00	0.49
4	601021	春秋航空	39,700	2,281,559.00	0.46
5	603027	千禾味业	107,800	2,276,736.00	0.46
6	688186	广大特材	69,384	2,257,061.52	0.46
7	002959	小熊电器	26,600	2,221,100.00	0.45
8	688357	建龙微纳	30,752	1,989,346.88	0.40
9	688556	高测股份	36,875	1,959,537.50	0.40
10	300777	中简科技	41,000	1,937,660.00	0.39
11	600502	安徽建工	354,600	1,872,288.00	0.38
12	688665	四方光电	19,904	1,853,460.48	0.38
13	002179	中航光电	39,710	1,800,848.50	0.37
14	002283	天润工业	270,200	1,734,684.00	0.35
15	688063	派能科技	8,568	1,698,606.00	0.35
16	603129	春风动力	10,300	1,667,570.00	0.34
17	688366	昊海生科	19,615	1,651,975.30	0.34
18	002371	北方华创	5,200	1,651,780.00	0.34
19	300856	科思股份	20,800	1,638,416.00	0.33
20	300775	三角防务	47,400	1,601,172.00	0.33
21	002540	亚太科技	276,400	1,597,592.00	0.32
22	688508	芯朋微	27,427	1,590,491.73	0.32
23	000923	河钢资源	117,000	1,579,500.00	0.32
24	603345	安井食品	10,600	1,556,080.00	0.32
25	002987	京北方	70,868	1,553,426.56	0.32
26	688100	威胜信息	51,900	1,547,139.00	0.31
27	002212	天融信	155,600	1,509,320.00	0.31
28	300811	铂科新材	25,380	1,508,587.20	0.31
29	601336	新华保险	40,700	1,496,539.00	0.30
30	688018	乐鑫科技	11,500	1,492,930.00	0.30
31	002466	天齐锂业	19,800	1,384,218.00	0.28
32	002458	益生股份	110,900	1,369,615.00	0.28
33	603639	海利尔	67,900	1,216,768.00	0.25
34	688088	虹软科技	28,440	1,215,810.00	0.25
35	002851	麦格米特	25,900	944,573.00	0.19
36	002314	南山控股	235,428	776,912.40	0.16
37	000921	海信家电	25,300	681,835.00	0.14
38	688019	安集科技	4,114	678,110.62	0.14
39	300896	爱美客	1,500	667,425.00	0.14
40	688578	艾力斯	24,694	665,503.30	0.14
41	688012	中微公司	4,242	663,660.90	0.13
42	000528	柳工	83,700	661,230.00	0.13
43	300723	一品红	22,500	659,250.00	0.13
44	601816	京沪高铁	124,500	654,870.00	0.13
45	000800	一汽解放	77,900	652,023.00	0.13

46	688599	天合光能	15,299	651,890.39	0.13
47	000338	潍柴动力	52,300	651,658.00	0.13
48	600011	华能国际	70,200	650,052.00	0.13
49	603619	中曼石油	38,400	649,728.00	0.13
50	688389	普门科技	27,624	648,887.76	0.13
51	002234	民和股份	35,600	648,276.00	0.13
52	600583	海油工程	110,700	647,595.00	0.13
53	000999	华润三九	10,600	642,996.00	0.13
54	688126	沪硅产业	30,743	642,528.70	0.13
55	688396	华润微	12,236	641,288.76	0.13
56	600029	南方航空	105,600	636,768.00	0.13
57	600054	黄山旅游	49,300	631,040.00	0.13
58	688050	爱博医疗	3,044	625,024.52	0.13
59	688076	诺泰生物	17,493	622,400.94	0.13
60	603369	今世缘	11,700	617,760.00	0.13
61	688311	盟升电子	8,076	564,835.44	0.11
62	688037	芯源微	3,144	537,466.80	0.11
63	002402	和而泰	30,900	524,682.00	0.11
64	002434	万里扬	48,800	436,760.00	0.09
65	603859	能科科技	6,800	347,684.00	0.07
66	600926	杭州银行	29,500	346,625.00	0.07
67	301486	致尚科技	3,506	202,155.96	0.04
68	300973	立高食品	2,200	150,524.00	0.03
69	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.02
70	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
71	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
72	688249	晶合集成	3,258	58,839.48	0.01
73	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
74	688472	阿特斯	2,038	34,727.52	0.01
75	688443	智翔金泰	1,127	33,235.23	0.01
76	688469	中芯集成	6,093	32,963.13	0.01
77	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
78	688531	日联科技	231	31,409.07	0.01
79	688361	中科飞测	485	31,364.95	0.01
80	301358	湖南裕能	676	28,993.64	0.01
81	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
82	688582	芯动联科	553	22,496.04	0.00
83	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
84	301291	明阳电气	703	21,814.09	0.00
85	688146	中船特气	537	20,475.81	0.00
86	688352	颀中科技	1,570	18,949.90	0.00
87	688552	航天南湖	758	17,813.00	0.00
88	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
89	688507	索辰科技	136	16,606.96	0.00

90	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
91	688570	天玛智控	619	15,679.27	0.00
92	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
93	001287	中电港	725	15,239.50	0.00
94	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
95	688581	安杰思	128	15,107.84	0.00
96	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
97	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
98	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
99	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
100	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
101	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
102	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
103	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
104	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
105	601061	中信金属	1,675	12,696.50	0.00
106	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
107	688623	二元科技	143	12,410.97	0.00
108	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
109	301439	泓淋电力	734	12,404.60	0.00
110	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
111	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
112	603605	珀莱雅	100	11,240.00	0.00
113	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
114	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
115	301345	涛涛车业	232	10,820.48	0.00
116	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
117	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
118	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
119	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
120	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
121	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
122	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
123	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
124	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
125	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
126	601065	江盐集团	700	8,288.00	0.00
127	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
128	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
129	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
130	002821	凯莱英	60	7,071.60	0.00
131	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
132	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
133	601133	柏诚股份	531	6,510.06	0.00

134	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
135	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
136	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
137	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
138	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
139	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
140	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
141	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
142	600459	贵研铂业	120	1,836.00	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	002422	科伦药业	10,107,205.00	1.98
2	002353	杰瑞股份	8,397,586.90	1.65
3	002299	圣农发展	7,790,489.00	1.53
4	601233	桐昆股份	7,545,161.38	1.48
5	603596	伯特利	7,527,150.00	1.48
6	002056	横店东磁	7,383,134.00	1.45
7	688777	中控技术	7,125,718.04	1.40
8	600060	海信视像	7,120,076.00	1.40
9	002966	苏州银行	6,965,755.00	1.37
10	603688	石英股份	6,783,251.00	1.33
11	603939	益丰药房	6,597,607.00	1.29
12	603456	九洲药业	6,560,606.31	1.29
13	600380	健康元	6,487,523.00	1.27
14	300012	华测检测	6,218,051.00	1.22
15	688516	奥特维	6,216,249.28	1.22
16	600499	科达制造	6,166,276.00	1.21
17	300866	安克创新	6,100,904.27	1.20
18	002244	滨江集团	6,014,424.00	1.18
19	600066	宇通客车	5,958,983.00	1.17
20	002430	杭氧股份	5,901,227.00	1.16

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	002422	科伦药业	10,500,108.00	2.06
2	603444	吉比特	9,442,208.10	1.85
3	603456	九洲药业	9,341,775.00	1.83
4	600079	人福医药	9,339,954.00	1.83
5	002384	东山精密	9,141,752.00	1.79
6	600060	海信视像	8,799,936.68	1.73
7	688122	西部超导	8,708,879.44	1.71
8	300866	安克创新	8,281,372.00	1.62
9	600499	科达制造	7,606,389.00	1.49
10	600160	巨化股份	7,326,255.00	1.44
11	600718	东软集团	7,306,290.63	1.43
12	002340	格林美	7,177,334.00	1.41
13	601699	潞安环能	7,123,398.00	1.40
14	601778	晶科科技	6,700,248.31	1.31
15	600563	法拉电子	6,650,843.66	1.30
16	000598	兴蓉环境	6,649,741.00	1.30
17	000937	冀中能源	6,633,196.00	1.30
18	002468	申通快递	6,623,310.00	1.30
19	002966	苏州银行	6,621,615.00	1.30
20	600963	岳阳林纸	6,601,880.40	1.30

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	1,121,758,782.66
卖出股票收入（成交）总额	1,148,933,564.09

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）	159,847.54	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	159,847.54	0.03

#### 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	1,150	159,847.54	0.03

#### 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，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。

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	88,145.32
2	应收清算款	545,379.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	184,179.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	817,703.73

#### 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达中证 500 量化增强 A	10,099	40,762.62	7,366,081.77	1.79%	404,295,604.68	98.21%
易方达中证 500 量化增强 C	8,134	17,754.74	1,864,644.55	1.29%	142,552,441.96	98.71%
合计	18,233	30,498.48	9,230,726.32	1.66%	546,848,046.64	98.34%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达中证 500 量化增强 A	795,827.86	0.1933%
	易方达中证 500 量化增强 C	7,238.99	0.0050%
	合计	803,066.85	0.1444%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	0
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	50~100
	易方达中证 500 量化增强 C	0

	合计	50~100
--	----	--------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 15 日）基金份额总额	777,613,734.55	311,361,864.27
本报告期期初基金份额总额	439,130,298.21	150,718,805.54
本报告期基金总申购份额	30,102,395.96	174,428,253.99
减：本报告期基金总赎回份额	57,571,007.72	180,729,973.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	411,661,686.45	144,417,086.51

## § 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、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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	2,259,937,959.43	100.00%	452,001.33	100.00%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为华福证券有限责任公司。

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## 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	关于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2023 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-10
2	关于旗下部分基金 2023 年 1 月 19 日至 2023 年 1 月 20 日因港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-16
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
4	关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
6	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	关于旗下部分基金 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 4 月 10 日因港股通非交易日及境外主要投资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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-03
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
10	关于旗下部分基金 2023 年 5 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情
----	----------------	-----------

者类别						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	2023年02月07日~2023年03月21日	0.00	159,344,947.39	159,344,947.39	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

广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  
二〇二三年八月三十日