

# 易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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	5
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	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内容的真实、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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	59

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12	投资组合报告附注	59
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>60</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末上市基金前十名持有人	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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情况	62
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	62
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>62</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>63</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4	基金投资策略的改变	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8	其他重大事件	65
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>65</b>
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	65
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>66</b>
12.1	备查文件目录	66
12.2	存放地点	66
12.3	查阅方式	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式
场内简称	HS300ETF、沪深 300ETF 易方达
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	82,425,215,244.00 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	2013 年 3 月 25 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	王玉	王小飞

负责人	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码		510620； 519031	100033
法定代表人		刘晓艳	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼；广东省珠海市 横琴新区荣粤道 188 号 6 层

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	969,690,907.35
本期利润	4,794,170,109.30

加权平均基金份额本期利润	0.0696
本期加权平均净值利润率	4.05%
本期基金份额净值增长率	1.86%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>
期末可供分配利润	58,131,260,149.79
期末可供分配基金份额利润	0.7053
期末基金资产净值	140,556,475,393.79
期末基金份额净值	1.7053
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	70.53%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.59%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.71%	0.00%
过去三个月	-1.13%	0.75%	-2.14%	0.76%	1.01%	-0.01%
过去六个月	1.86%	0.89%	0.89%	0.90%	0.97%	-0.01%
过去一年	-7.86%	0.87%	-9.91%	0.87%	2.05%	0.00%
过去三年	-28.89%	1.04%	-33.74%	1.05%	4.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	70.53%	1.35%	31.98%	1.36%	38.55%	-0.01%

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

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

(2013年3月6日至2024年6月30日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 70.53%，同期业绩比较基准收益率为 31.98%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余海燕	本基金的基金经理, 易方达沪深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银联接、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达中证 500ETF、易方达中证海	2016-04-16	-	19 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资



	外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证军工 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证光伏产业指数发起式 (自 2023 年 04 月 11 日至 2024 年 05 月 06 日)、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 100ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接的基金经理，指数研究部总经理	2022-12-15	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监。

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 31 次，其中 26 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，5 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪沪深 300 指数，该指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具有代表性的 300 只证券组成，以综合反映沪深市场上市公司证券的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2024 年上半年，外部环境复杂性严峻性不确定性明显上升、国内结构调整持续深化等带来新挑战，但宏观政策效应持续释放、外需有所回暖、新质生产力加速发展等因素也形成新支撑，整体来看上半年国民经济延续恢复向好态势，生产稳定增长，需求持续恢复，整体经济运行平稳。上半年

我国国内生产总值 61.7 万亿元，按不变价格计算，同比增长 5.0%。

资本市场方面，报告期内 A 股市场展现出了宽幅震荡的特点，其波动率持续保持在较高的水平。2024 年伊始，A 股市场表现相对偏弱，一方面由于外部环境的不确定性上升，国际地缘局势波动加大；另一方面国内物价、房价下行压力显性化，叠加资金与投资者情绪负反馈现象的出现，导致 A 股市场加速调整；随着国内稳增长、稳预期、稳市场政策举措积极出台并落地，特别是房地产领域支持举措密集出台，基本面的改善预期成为影响中国资产表现的关键变量。受国内宏观经济数据边际改善，以及新“国九条”发布，要求提高上市公司质量，增强稳定回报能力等偏积极因素的影响，投资者风险偏好持续回升，进而推动了 A 股市场的企稳回升。自五月下旬以来由于公布的宏观数据显示经济增长修复仍需政策支持，整体经济复苏的力度并不强，受此影响 A 股市场在回升过程中出现了波折。

沪深 300 指数作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，聚集 A 股最核心的权益资产，涵盖了各行业龙头，指数表现跟中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关，与 A 股大盘走势基本保持一致。报告期内指数中的银行、公用事业、有色金属、电子、家用电器等行业的成份股涨幅居前，对沪深 300 指数收益贡献较大，而食品饮料、医药生物、计算机、非银金融等行业的成份股表现落后，拖累了指数的表现。报告期内沪深 300 指数上涨 0.89%。

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

#### 4.4.2 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 1.7053 元，本报告期份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%。年化跟踪误差 0.36%，在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，外部环境的不稳定性不确定性在上升，国内经济发展依然面临一些挑战，但在一系列稳增长、扩大内需的宏观政策支持下，我国经济发展面临的有利条件强于不利因素，经济长期回升向好的态势将不断得到巩固和增强。我国经济发展仍具有良好支撑和有利条件，市场空间广阔，产业体系完备，物质技术基础雄厚，人才红利不断增强，转型升级持续推进，改革开放不断深化，宏观政策空间较大，经济长期向好的基本趋势没有改变。影响后续 A 股市场整体表现的主要矛盾还是对中国经济基本面预期，市场对稳增长政策的关注度持续提升，政策也将是未来影响股市较为关键性的因素。党的三中全会已胜利召开，提出了“落实好宏观政策，积极扩大国内需求”的要求，

并部署了以进一步全面深化改革来推进中国式现代化。本届三中全会以经济体制改革为牵引，重点部署经济、科技、教育、民生等各领域改革任务，有望激发全社会内生动力和创新活力。中长期改革红利结合我国经济的高质量建设，是中国资本市场稳健发展的基石，本届三中全会有望通过改革预期提振市场风险偏好，从中长期维度树立基本面信心。当前 A 股市场估值仍处于历史底部区域，与全球市场比较处于明显偏低水平，纵向及横向对比均具备较好的投资吸引力。

指数的长期收益表现取决于其成份股盈利的长期增长情况，沪深 300 指数作为 A 股市场的核心宽基指数，涵盖了中国经济中主要行业的龙头企业，长期来看这些企业的盈利会随着整体经济的增长而相应增长。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的各行业龙头优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，沪深 300 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	791,548,384.58	201,615,865.28
结算备付金		144,662,702.76	37,113,286.36
存出保证金		103,049,440.13	22,765,218.79
交易性金融资产	6.4.7.2	139,610,060,796.83	48,564,486,820.75
其中：股票投资		139,610,060,796.83	48,564,486,820.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		245,683,232.99	714,138,908.56
应收股利		325,985.14	73,431.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	168,982.58	649,256.29
资产总计		140,895,499,525.01	49,540,842,787.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		278,537,601.96	652,333,634.11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,841,085.52	5,292,132.53
应付托管费		5,613,695.20	1,764,044.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		201,315.96	99,801.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	37,830,432.58	93,110,119.81
负债合计		339,024,131.22	752,599,732.05
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	82,425,215,244.00	29,141,215,244.00
未分配利润	6.4.7.8	58,131,260,149.79	19,647,027,810.98
净资产合计		140,556,475,393.79	48,788,243,054.98
负债和净资产总计		140,895,499,525.01	49,540,842,787.03

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7053 元，基金份额总额 82,425,215,244.00

份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,929,915,726.24	104,020,085.43
1.利息收入		15,364,098.25	12,429,643.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,661,453.69	604,281.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		13,702,644.56	11,825,362.00
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,080,536,468.82	54,507,284.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-502,064,573.11	-171,545,888.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	772,158.84
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	5,610,478.24	1,865,964.52
股利收益	6.4.7.14	1,576,990,563.69	223,415,049.56
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	3,824,479,201.95	34,221,151.81
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	9,535,957.22	2,862,005.87
<b>减：二、营业总支出</b>		135,745,616.94	20,214,696.15
1. 管理人报酬		88,410,457.06	13,082,387.91
2. 托管费		29,470,152.42	4,360,796.01
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		69,620.62	49,324.47
8. 其他费用	6.4.7.18	17,795,386.84	2,722,187.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>4,794,170,109.30</b>	<b>83,805,389.28</b>

列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,794,170,109.30</b>	<b>83,805,389.28</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>4,794,170,109.30</b>	<b>83,805,389.28</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	29,141,215,244.00	19,647,027,810.98	48,788,243,054.98
二、本期期初净资产	29,141,215,244.00	19,647,027,810.98	48,788,243,054.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	53,284,000,000.00	38,484,232,338.81	91,768,232,338.81
（一）、综合收益总额	-	4,794,170,109.30	4,794,170,109.30
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	53,284,000,000.00	33,690,062,229.51	86,974,062,229.51
其中：1.基金申购款	59,164,000,000.00	37,880,697,688.20	97,044,697,688.20
2.基金赎回款	-5,880,000,000.00	-4,190,635,458.69	-10,070,635,458.69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	82,425,215,244.00	58,131,260,149.79	140,556,475,393.79
项目	上年度可比期间 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	9,039,510,057.00	7,616,858,275.22	16,656,368,332.22
二、本期期初净资产	9,039,510,057.00	7,616,858,275.22	16,656,368,332.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,445,775,123.00	1,304,426,155.12	2,750,201,278.12
（一）、综合收益总额	-	83,805,389.28	83,805,389.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,445,775,123.00	1,220,620,765.84	2,666,395,888.84
其中：1.基金申购款	3,441,775,123.00	3,077,573,867.28	6,519,348,990.28
2.基金赎回款	-1,996,000,000.00	-1,856,953,101.44	-3,852,953,101.44
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	10,485,285,180.00	8,921,284,430.34	19,406,569,610.34

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1762 号《关于核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额，其中认购资金

利息折合 43,605.00 份基金份额。本基金为交易型开放式（ETF）、发起式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

#### 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》、本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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	791,548,384.58
等于：本金	791,487,128.56
加：应计利息	61,256.02
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	791,548,384.58

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	139,974,763,696.05	-	139,610,060,796.83	-364,702,899.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	139,974,763,696.05	-	139,610,060,796.83	-364,702,899.22

## 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 2024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	770,228,940.00	-	-	-
IF2407	64,834,620.00	-	-	-
IF2408	20,511,600.00	-	-	-
IF2409	684,882,720.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	770,228,940.00	-	-	-

#### 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
IF2407	IF2407	62	63,928,200.00	-906,420.00
IF2408	IF2408	20	20,564,400.00	52,800.00
IF2409	IF2409	644	661,439,520.00	-23,443,200.00
合计	-	-	-	-24,296,820.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-24,296,820.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	168,982.58
待摊费用	-
合计	168,982.58

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	1,356,070.20

其中：交易所市场	1,356,070.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	214,481.66
应付替代款	25,409,374.89
可退替代款	555,395.30
其他应付款	10,295,110.53
合计	37,830,432.58

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,141,215,244.00	29,141,215,244.00
本期申购	59,164,000,000.00	59,164,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,880,000,000.00	-5,880,000,000.00
本期末	82,425,215,244.00	82,425,215,244.00

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,827,960,174.44	-21,180,932,363.46	19,647,027,810.98
本期期初	40,827,960,174.44	-21,180,932,363.46	19,647,027,810.98
本期利润	969,690,907.35	3,824,479,201.95	4,794,170,109.30
本期基金份额交易产生的变动数	74,237,671,794.85	-40,547,609,565.34	33,690,062,229.51
其中：基金申购款	82,428,388,820.78	-44,547,691,132.58	37,880,697,688.20
基金赎回款	-8,190,717,025.93	4,000,081,567.24	-4,190,635,458.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,035,322,876.64	-57,904,062,726.85	58,131,260,149.79

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	943,031.78
其他	92,707.18
合计	1,661,453.69

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-648,983,701.82
股票投资收益——赎回差价收入	146,919,128.71
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	-502,064,573.11

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,164,820,037.00
减：卖出股票成本总额	12,798,668,515.11
减：交易费用	15,135,223.71
买卖股票差价收入	-648,983,701.82

注：交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 0 元。

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	10,070,635,458.69
减：现金支付赎回款总额	3,446,405,933.69
减：赎回股票成本总额	6,477,310,396.29
减：交易费用	-
赎回差价收入	146,919,128.71

## 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	5,610,478.24

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,576,990,563.69
其中：证券出借权益补偿收入	7,217,252.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,576,990,563.69

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	3,850,444,861.95
——股票投资	3,850,444,861.95
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-25,965,660.00
——权证投资	-
——期货投资	-25,965,660.00
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	3,824,479,201.95

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	9,535,957.22
合计	9,535,957.22

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
----	----



	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	18,813.77
指数使用费	17,682,091.41
合计	17,795,386.84

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
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
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	47,742,382,551.43	86.60%	658,782,700.07	10.72%

##### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	-	-	1,228,576.75	26.32%

#### 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 2024年1月1日至2024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	4,774,532.34	86.60%	1,264,547.41	93.25%
关联方名称	上年度可比期间 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	65,880.00	11.92%	53,259.13	17.99%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。本报告期及上年度可比期间该类佣金协议的服务范围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。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	88,410,457.06	13,082,387.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,958,239.11	73,789.70
应支付基金管理人的净管理费	84,452,217.95	13,008,598.21

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,470,152.42	4,360,796.01

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	1,117,810,745.00	771,831.61	0.00	0.00

## 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	1,278,457,945.60	1.65~6.00	3.13	1,305,862.71	62,446,466.60	23,095.53
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	1,476,336,107.00	0.80~8.02	3.12	1,426,822.75	144,323,485.00	65,753.15

## 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	114,932,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	114,932,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基	0.1394%	-

金总份额比例		
--------	--	--

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.5 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	7,822,306,700.00	9.4902%	7,722,668,638.00	26.5008%
广发证券股份有限公司	50,327,095.00	0.0611%	47,759,367.00	0.1639%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
中国建设银行-活期存款	791,548,384.58	625,714.73	178,381,474.63	244,527.94

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
万联证券股份有限公司	837023	芭薇股份	新股网上发行	200	1,154.00

上年度可比期间 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

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券和托管人建设银行发行的 A 股建设银行。于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 23,304,772 股（2023 年 12 月 31 日:8,310,772 股），占本基金净值比例为 0.20%(2023 年 12 月 31 日:0.24%)；持有建设银行发行的 A 股建设银行 52,722,359 股（2023 年 12 月 31 日:18,747,996 股），占本基金净值比例为 0.28%(2023 年 12 月 31 日:0.25%)。

#### 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（2024 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
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
30139	汇成	2024-0	6 个月	新股	12.20	41.66	219	2,671.	9,123.	-

2	真空	5-28		流通受限				80	54	
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月以内	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-

603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月以内	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-



				受限						
68804	海光	2024-0	6 个月	询价	63.03	65.55	1,493,	94,162	97,927	
1	信息	5-20		转让			932	,533.9	,242.6	-
				流通				6	0	
				受限						

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 2024 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 2024 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	000002	万科 A	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	6.93	2,979,300.0 0	20,646,549. 00
2	000301	东方盛虹	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	7.97	94,000.00	749,180.00
3	000338	潍柴动力	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	16.24	243,500.00	3,954,440.0 0
4	000408	藏格矿业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	24.07	75,200.00	1,810,064.0 0
5	000538	云南白药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	51.15	79,400.00	4,061,310.0 0
6	000596	古井贡酒	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	211.0 7	3,300.00	696,531.00
7	000617	中油资本	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.52	1,360,600.0 0	7,510,512.0 0
8	000625	长安汽车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	13.43	263,800.00	3,542,834.0 0
9	000733	振华科技	2024 年 7 月 9 日	41.53	103,900.00	4,314,967.0

			-2024 年 7 月 12 日			0
10	000786	北新建材	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	29.66	2,800.00	83,048.00
11	000792	盐湖股份	2024 年 7 月 11 日 -2024 年 7 月 12 日	17.45	25,200.00	439,740.00
12	000800	一汽解放	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	7.83	87,600.00	685,908.00
13	000876	新希望	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	9.14	51,900.00	474,366.00
14	000895	双汇发展	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	23.77	320,000.00	7,606,400.00
15	000938	紫光股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	22.35	24,300.00	543,105.00
16	000963	华东医药	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	27.81	30,000.00	834,300.00
17	000977	浪潮信息	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	36.37	287,700.00	10,463,649.00
18	000999	华润三九	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	42.58	99,840.00	4,251,187.20
19	001289	龙源电力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	17.25	108,900.00	1,878,525.00
20	001979	招商蛇口	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	8.79	1,501,300.00	13,196,427.00
21	002050	三花智控	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	19.08	9,000.00	171,720.00
22	002074	国轩高科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	19.15	3,000.00	57,450.00
23	002129	TCL 中环	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.65	115,100.00	995,615.00
24	002180	纳思达	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	26.42	3,600.00	95,112.00
25	002230	科大讯飞	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	42.95	882,500.00	37,903,375.00
26	002236	大华股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	15.46	331,100.00	5,118,806.00
27	002241	歌尔股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	19.51	46,600.00	909,166.00
28	002271	东方雨虹	2024 年 7 月 11 日 -2024 年 7 月 12 日	12.34	20,000.00	246,800.00
29	002415	海康威视	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	30.91	38,900.00	1,202,399.00
30	002459	晶澳科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	11.20	35,400.00	396,480.00
31	002460	赣锋锂业	2024 年 7 月 2 日	28.65	354,100.00	10,144,965.00

			-2024 年 7 月 12 日			00
32	002466	天齐锂业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 11 日	29.91	6,000.00	179,460.00
33	002475	立讯精密	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	39.31	4,700.00	184,757.00
34	002493	荣盛石化	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.66	2,900.00	28,014.00
35	002555	三七互娱	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	13.05	1,700.00	22,185.00
36	002603	以岭药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.33	369,400.00	5,662,902.00
37	002709	天赐材料	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.56	280,000.00	4,916,800.00
38	002812	恩捷股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	31.65	12,100.00	382,965.00
39	002916	深南电路	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	105.77	29,000.00	3,067,330.00
40	002938	鹏鼎控股	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	39.76	6,000.00	238,560.00
41	003816	中国广核	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.63	416,000.00	1,926,080.00
42	300015	爱尔眼科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.32	87,000.00	897,840.00
43	300223	北京君正	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	55.44	62,900.00	3,487,176.00
44	300308	中际旭创	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	137.88	7,980.00	1,100,282.40
45	300347	泰格医药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	48.60	243,900.00	11,853,540.00
46	300418	昆仑万维	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	32.24	14,700.00	473,928.00
47	300496	中科创达	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	45.59	8,600.00	392,074.00
48	300661	圣邦股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 11 日	82.78	74,000.00	6,125,720.00
49	300751	迈为股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	119.48	1,000.00	119,480.00
50	300759	康龙化成	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	18.58	10,600.00	196,948.00
51	300896	爱美客	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	172.10	137,400.00	23,646,540.00
52	300919	中伟股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	30.99	4,900.00	151,851.00
53	300957	贝泰妮	2024 年 7 月 2 日	48.32	196,500.00	9,494,880.00

			-2024 年 7 月 12 日			0
54	300979	华利集团	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	60.85	46,200.00	2,811,270.0 0
55	301269	华大九天	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	77.05	32,500.00	2,504,125.0 0
56	600009	上海机场	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	32.25	11,200.00	361,200.00
57	600010	包钢股份	2024 年 7 月 11 日 -2024 年 7 月 12 日	1.40	2,322,200.0 0	3,251,080.0 0
58	600011	华能国际	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	9.62	15,500.00	149,110.00
59	600023	浙能电力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	7.11	71,900.00	511,209.00
60	600031	三一重工	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	16.50	2,400.00	39,600.00
61	600048	保利发展	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.76	345,400.00	3,025,704.0 0
62	600050	中国联通	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.70	112,000.00	526,400.00
63	600061	国投资本	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.65	1,000.00	5,650.00
64	600085	同仁堂	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	38.21	14,900.00	569,329.00
65	600089	特变电工	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.87	1,000.00	13,870.00
66	600104	上汽集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.86	90,700.00	1,257,102.0 0
67	600111	北方稀土	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 11 日	17.20	76,800.00	1,320,960.0 0
68	600115	中国东航	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	4.01	210,000.00	842,100.00
69	600132	重庆啤酒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	60.70	15,300.00	928,710.00
70	600183	生益科技	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	21.06	6,000.00	126,360.00
71	600188	兖矿能源	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 12 日	22.73	82,000.00	1,863,860.0 0
72	600196	复星医药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	22.14	64,200.00	1,421,388.0 0
73	600346	恒力石化	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	13.95	12,900.00	179,955.00
74	600372	中航机载	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	11.97	1,000.00	11,970.00
75	600436	片仔癀	2024 年 7 月 2 日	207.1	29,000.00	6,007,930.0

			-2024 年 7 月 2 日	7		0
76	600438	通威股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	19.11	2,121,300.0 0	40,538,043. 00
77	600460	士兰微	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.51	35,000.00	612,850.00
78	600489	中金黄金	2024 年 7 月 11 日 -2024 年 7 月 11 日	14.80	203,500.00	3,011,800.0 0
79	600515	海南机场	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.14	123,900.00	389,046.00
80	600570	恒生电子	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.66	7,900.00	139,514.00
81	600600	青岛啤酒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	72.77	31,900.00	2,321,363.0 0
82	600660	福耀玻璃	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	47.90	109,700.00	5,254,630.0 0
83	600732	爱旭股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	9.05	249,700.00	2,259,785.0 0
84	600760	中航沈飞	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	40.10	7,700.00	308,770.00
85	600803	新奥股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.80	3,400.00	70,720.00
86	600809	山西汾酒	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	210.8 8	4,000.00	843,520.00
87	600845	宝信软件	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	31.93	7,440.00	237,559.20
88	600941	中国移动	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 2 日	107.5 0	10,300.00	1,107,250.0 0
89	601006	大秦铁路	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	7.16	571,400.00	4,091,224.0 0
90	601012	隆基绿能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	14.02	4,949,900.0 0	69,397,598. 00
91	601021	春秋航空	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	56.33	20,600.00	1,160,398.0 0
92	601059	信达证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	14.21	210,900.00	2,996,889.0 0
93	601100	恒立液压	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	46.58	62,000.00	2,887,960.0 0
94	601138	工业富联	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	27.40	42,400.00	1,161,760.0 0
95	601186	中国铁建	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.57	78,000.00	668,460.00
96	601236	红塔证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	6.42	297,200.00	1,908,024.0 0
97	601238	广汽集团	2024 年 7 月 2 日	7.74	234,300.00	1,813,482.0

			-2024 年 7 月 9 日			0
98	601328	交通银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.47	283,100.00	2,114,757.0 0
99	601360	三六零	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	7.68	5,153,400.0 0	39,578,112. 00
100	601390	中国中铁	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.52	407,400.00	2,656,248.0 0
101	601600	中国铝业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.63	6,100.00	46,543.00
102	601633	长城汽车	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	25.30	114,400.00	2,894,320.0 0
103	601658	邮储银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	5.07	176,000.00	892,320.00
104	601689	拓普集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	53.61	17,400.00	932,814.00
105	601698	中国卫通	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	14.09	528,100.00	7,440,929.0 0
106	601699	潞安环能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	18.13	28,600.00	518,518.00
107	601728	中国电信	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.15	179,000.00	1,100,850.0 0
108	601766	中国中车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.51	99,700.00	748,747.00
109	601788	光大证券	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.62	55,400.00	809,948.00
110	601799	星宇股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	112.0 4	40,200.00	4,504,008.0 0
111	601800	中国交建	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.94	217,600.00	1,945,344.0 0
112	601808	中海油服	2024 年 7 月 11 日 -2024 年 7 月 12 日	17.20	22,500.00	387,000.00
113	601857	中国石油	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.32	264,800.00	2,732,736.0 0
114	601865	福莱特	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	20.10	247,100.00	4,966,710.0 0
115	601868	中国能建	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	2.12	1,019,800.0 0	2,161,976.0 0
116	601872	招商轮船	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	8.45	121,500.00	1,026,675.0 0
117	601877	正泰电器	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	19.06	27,400.00	522,244.00
118	601878	浙商证券	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	10.72	8,700.00	93,264.00
119	601888	中国中免	2024 年 7 月 2 日	62.49	53,500.00	3,343,215.0

			-2024 年 7 月 9 日			0
120	601898	中煤能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.48	274,400.00	3,424,512.0 0
121	601901	方正证券	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	7.73	13,200.00	102,036.00
122	601919	中远海控	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.49	140,400.00	2,174,796.0 0
123	601989	中国重工	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 12 日	4.93	40,600.00	200,158.00
124	601995	中金公司	2024 年 7 月 11 日 -2024 年 7 月 12 日	29.61	4,300.00	127,323.00
125	601998	中信银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.70	242,000.00	1,621,400.0 0
126	603019	中科曙光	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	41.50	148,400.00	6,158,600.0 0
127	603195	公牛集团	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	77.12	36,565.00	2,819,892.8 0
128	603260	合盛硅业	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	46.71	83,600.00	3,904,956.0 0
129	603369	今世缘	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	46.20	24,600.00	1,136,520.0 0
130	603392	万泰生物	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	65.88	126,400.00	8,327,232.0 0
131	603806	福斯特	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	14.70	206,360.00	3,033,492.0 0
132	603833	欧派家居	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	53.56	100,000.00	5,356,000.0 0
133	603899	晨光股份	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 12 日	31.28	89,000.00	2,783,920.0 0
134	603993	洛阳钼业	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	8.50	22,000.00	187,000.00
135	605117	德业股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	74.34	110,880.00	8,242,819.2 0
136	605499	东鹏饮料	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	215.7 5	4,200.00	906,150.00
137	688126	沪硅产业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.81	173,900.00	2,401,559.0 0
138	688187	时代电气	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	49.38	3,500.00	172,830.00
139	688223	晶科能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	7.10	460,000.00	3,266,000.0 0
140	688256	寒武纪	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	198.6 7	19,900.00	3,953,533.0 0
141	688303	大全能源	2024 年 7 月 9 日	20.39	150,600.00	3,070,734.0

			-2024 年 7 月 12 日			0
142	688363	华熙生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	56.57	302,000.00	17,084,140.00
143	688396	华润微	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	37.44	10,800.00	404,352.00
144	688599	天合光能	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	16.92	106,300.00	1,798,596.00
合计	-	-	-	-	36,471,265.00	554,519,598.80

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对于约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

## 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及

对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	791,548,384.58	-	-	-	791,548,384.58
结算备付金	144,662,702.76	-	-	-	144,662,702.76
存出保证金	103,049,440.13	-	-	-	103,049,440.13
交易性金融资产	-	-	-	139,610,060,796.83	139,610,060,796.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	245,683,232.99	245,683,232.99

应收股利	-	-	-	325,985.14	325,985.14
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	168,982.58	168,982.58
资产总计	1,039,260,527.47	-	-	139,856,238,997.54	140,895,499,525.01
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	-	-	-	278,537,601.96	278,537,601.96
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	16,841,085.52	16,841,085.52
应付托管费	-	-	-	5,613,695.20	5,613,695.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	201,315.96	201,315.96
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	37,830,432.58	37,830,432.58
负债总计	-	-	-	339,024,131.22	339,024,131.22
利率敏感度缺口	1,039,260,527.47	-	-	139,517,214,866.32	140,556,475,393.79
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	201,615,865.28	-	-	-	201,615,865.28
结算备付金	37,113,286.36	-	-	-	37,113,286.36
存出保证金	22,765,218.79	-	-	-	22,765,218.79
交易性金融资产	-	-	-	48,564,486,820.75	48,564,486,820.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	714,138,908.56	714,138,908.56
应收股利	-	-	-	73,431.00	73,431.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	649,256.29	649,256.29
资产总计	261,494,370.43	-	-	49,279,348,416.60	49,540,842,787.03
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	-	-	-	652,333,634.11	652,333,634.11
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,292,132.53	5,292,132.53
应付托管费	-	-	-	1,764,044.20	1,764,044.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	99,801.40	99,801.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	93,110,119.81	93,110,119.81
负债总计	-	-	-	752,599,732.05	752,599,732.05
利率敏感度缺口	261,494,370.43	-	-	48,526,748,684.55	48,788,243,054.98

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，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	139,610,060,796.8 3	99.33	48,564,486,820.75	99.54
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	139,610,060,796.8 3	99.33	48,564,486,820.75	99.54

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	6,981,062,045.62	2,426,723,043.57
	2.业绩比较基准下降 5%	-6,981,062,045.62	-2,426,723,043.57

#### 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	139,511,591,866.29
第二层次	45,611.11
第三层次	98,423,319.43
合计	139,610,060,796.83

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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和债券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，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的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	139,610,060,796.83	99.09
	其中：股票	139,610,060,796.83	99.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	936,211,087.34	0.66
8	其他各项资产	349,227,640.84	0.25
9	合计	140,895,499,525.01	100.00

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 554,519,598.80 元，占净值比例 0.39%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,762,681,502.80	1.25
B	采矿业	8,507,787,129.89	6.05
C	制造业	72,719,477,707.36	51.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,550,942,634.81	4.66
E	建筑业	3,122,225,798.59	2.22
F	批发和零售业	359,871,277.92	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	5,231,660,522.15	3.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,308,958,693.59	4.49



J	金融业	31,156,173,988.71	22.17
K	房地产业	1,283,713,525.51	0.91
L	租赁和商务服务业	1,122,026,366.51	0.80
M	科学研究和技术服务业	1,106,536,050.27	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	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	377,954,509.68	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	139,610,029,785.47	99.33

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,925,126	7,227,080,641.14	5.14
2	300750	宁德时代	20,713,834	3,729,111,535.02	2.65
3	601318	中国平安	84,568,907	3,497,769,993.52	2.49
4	600036	招商银行	97,223,876	3,324,084,320.44	2.36
5	600900	长江电力	96,071,124	2,778,376,906.08	1.98
6	000333	美的集团	38,469,096	2,481,256,692.00	1.77
7	601899	紫金矿业	129,393,658	2,273,446,571.06	1.62
8	601166	兴业银行	114,184,290	2,011,927,189.80	1.43
9	000858	五粮液	15,296,300	1,958,538,252.00	1.39
10	002594	比亚迪	7,159,839	1,791,749,709.75	1.27
11	601328	交通银行	215,967,428	1,613,276,687.16	1.15
12	601398	工商银行	275,529,025	1,570,515,442.50	1.12
13	002475	立讯精密	39,524,497	1,553,707,977.07	1.11
14	600030	中信证券	76,684,085	1,397,950,869.55	0.99
15	000651	格力电器	35,445,389	1,390,168,156.58	0.99
16	300760	迈瑞医疗	4,754,300	1,383,073,413.00	0.98
17	600276	恒瑞医药	35,147,374	1,351,768,004.04	0.96
18	600887	伊利股份	49,958,789	1,290,935,107.76	0.92
19	600309	万华化学	14,871,862	1,202,538,761.32	0.86
20	000725	京东方 A	290,384,323	1,187,671,881.07	0.84
21	601088	中国神华	25,878,370	1,148,223,276.90	0.82
22	601288	农业银行	250,806,893	1,093,518,053.48	0.78

23	300059	东方财富	99,311,206	1,048,726,335.36	0.75
24	601816	京沪高铁	192,946,662	1,036,123,574.94	0.74
25	300308	中际旭创	7,091,480	977,773,262.40	0.70
26	002714	牧原股份	21,441,724	934,859,166.40	0.67
27	601857	中国石油	89,037,543	918,867,443.76	0.65
28	002415	海康威视	29,288,528	905,308,400.48	0.64
29	601668	中国建筑	163,599,590	868,713,822.90	0.62
30	600919	江苏银行	115,450,237	857,795,260.91	0.61
31	601138	工业富联	31,268,500	856,756,900.00	0.61
32	600690	海尔智家	29,701,392	842,925,504.96	0.60
33	300498	温氏股份	41,767,020	827,822,336.40	0.59
34	000568	泸州老窖	5,767,370	827,559,921.30	0.59
35	600809	山西汾酒	3,844,506	810,729,425.28	0.58
36	002371	北方华创	2,522,044	806,776,655.16	0.57
37	601985	中国核电	74,120,695	790,126,608.70	0.56
38	600406	国电南瑞	31,593,652	788,577,553.92	0.56
39	601225	陕西煤业	30,564,162	787,638,454.74	0.56
40	603259	药明康德	19,836,593	777,396,079.67	0.55
41	601919	中远海控	50,092,075	775,926,241.75	0.55
42	000001	平安银行	76,260,746	774,046,571.90	0.55
43	600031	三一重工	46,761,186	771,559,569.00	0.55
44	600941	中国移动	7,137,355	767,265,662.50	0.55
45	601988	中国银行	165,574,234	764,952,961.08	0.54
46	300124	汇川技术	14,804,603	759,476,133.90	0.54
47	600000	浦发银行	92,274,715	759,420,904.45	0.54
48	601601	中国太保	26,961,313	751,142,180.18	0.53
49	601728	中国电信	121,932,711	749,886,172.65	0.53
50	000792	盐湖股份	42,776,300	746,446,435.00	0.53
51	600028	中国石化	114,880,251	726,043,186.32	0.52
52	601766	中国中车	95,633,720	718,209,237.20	0.51
53	688981	中芯国际	15,539,464	716,369,290.40	0.51
54	600150	中国船舶	17,544,317	714,229,145.07	0.51
55	300274	阳光电源	11,439,840	709,613,275.20	0.50
56	600050	中国联通	149,874,946	704,412,246.20	0.50
57	000063	中兴通讯	25,012,540	699,600,743.80	0.50
58	000338	潍柴动力	42,731,219	693,954,996.56	0.49
59	002352	顺丰控股	19,281,003	688,138,997.07	0.49
60	601169	北京银行	116,318,803	679,301,809.52	0.48
61	603501	韦尔股份	6,730,929	668,852,414.73	0.48
62	601012	隆基绿能	47,671,690	668,357,093.80	0.48
63	600837	海通证券	75,895,063	649,661,739.28	0.46
64	000100	TCL 科技	147,641,415	637,810,912.80	0.45
65	600016	民生银行	167,298,710	634,062,110.90	0.45
66	002230	科大讯飞	14,616,306	627,770,342.70	0.45

67	600660	福耀玻璃	12,574,498	602,318,454.20	0.43
68	002142	宁波银行	25,906,435	571,495,956.10	0.41
69	601229	上海银行	78,054,768	566,677,615.68	0.40
70	600089	特变电工	39,732,109	551,084,351.83	0.39
71	600938	中国海油	16,427,600	542,110,800.00	0.39
72	601390	中国中铁	80,701,612	526,174,510.24	0.37
73	000625	长安汽车	39,084,136	524,899,946.48	0.37
74	688041	海光信息	7,345,246	509,391,643.08	0.36
75	600104	上汽集团	36,373,355	504,134,700.30	0.36
76	603986	兆易创新	5,228,012	499,902,507.44	0.36
77	601688	华泰证券	40,211,422	498,219,518.58	0.35
78	600436	片仔癀	2,392,226	495,597,460.42	0.35
79	600048	保利发展	56,429,569	494,323,024.44	0.35
80	601006	大秦铁路	68,985,257	493,934,440.12	0.35
81	600905	三峡能源	112,463,245	490,339,748.20	0.35
82	002027	分众传媒	79,497,644	481,755,722.64	0.34
83	601888	中国中免	7,691,205	480,623,400.45	0.34
84	601211	国泰君安	35,458,604	480,464,084.20	0.34
85	688012	中微公司	3,388,353	478,638,744.78	0.34
86	603019	中科曙光	11,520,112	478,084,648.00	0.34
87	601600	中国铝业	62,408,228	476,174,779.64	0.34
88	603993	洛阳钼业	55,567,022	472,319,687.00	0.34
89	601818	光大银行	145,806,283	462,205,917.11	0.33
90	600019	宝钢股份	69,467,421	461,958,349.65	0.33
91	603288	海天味业	13,088,155	451,148,702.85	0.32
92	600585	海螺水泥	18,924,578	446,430,795.02	0.32
93	601658	邮储银行	87,310,500	442,664,235.00	0.31
94	601989	中国重工	89,529,761	441,381,721.73	0.31
95	600886	国投电力	23,467,390	428,045,193.60	0.30
96	601009	南京银行	40,616,823	422,008,790.97	0.30
97	600795	国电电力	69,987,777	419,226,784.23	0.30
98	688008	澜起科技	7,219,040	412,640,326.40	0.29
99	688111	金山办公	1,803,491	410,294,202.50	0.29
100	601628	中国人寿	13,070,147	405,828,064.35	0.29
101	600999	招商证券	29,122,685	405,096,548.35	0.29
102	600438	通威股份	21,195,931	405,054,241.41	0.29
103	000938	紫光股份	17,949,032	401,160,865.20	0.29
104	000425	徐工机械	55,745,226	398,578,365.90	0.28
105	600547	山东黄金	14,287,974	391,204,728.12	0.28
106	601939	建设银行	52,722,359	390,145,456.60	0.28
107	600893	航发动力	10,538,184	385,170,625.20	0.27
108	300014	亿纬锂能	9,625,645	384,255,748.40	0.27
109	002304	洋河股份	4,725,856	381,565,613.44	0.27
110	002179	中航光电	9,971,930	379,431,936.50	0.27

111	601669	中国电建	67,718,147	378,544,441.73	0.27
112	300015	爱尔眼科	36,623,499	377,954,509.68	0.27
113	000002	万科 A	53,429,300	370,265,049.00	0.26
114	002241	歌尔股份	18,867,403	368,103,032.53	0.26
115	600926	杭州银行	27,970,268	365,011,997.40	0.26
116	000538	云南白药	7,053,835	360,803,660.25	0.26
117	600584	长电科技	11,292,332	358,079,847.72	0.25
118	600760	中航沈飞	8,648,177	346,791,897.70	0.25
119	600111	北方稀土	19,896,919	342,227,006.80	0.24
120	600489	中金黄金	22,922,318	339,250,306.40	0.24
121	002050	三花智控	17,570,480	335,244,758.40	0.24
122	600011	华能国际	34,654,900	333,380,138.00	0.24
123	601916	浙商银行	118,462,100	326,955,396.00	0.23
124	002252	上海莱士	41,720,557	326,254,755.74	0.23
125	688256	寒武纪	1,626,040	323,045,366.80	0.23
126	600015	华夏银行	49,957,828	319,730,099.20	0.23
127	600009	上海机场	9,756,836	314,657,961.00	0.22
128	600958	东方证券	41,042,468	311,922,756.80	0.22
129	600426	华鲁恒升	11,700,100	311,690,664.00	0.22
130	601186	中国铁建	36,158,077	309,874,719.89	0.22
131	300408	三环集团	10,606,941	309,616,607.79	0.22
132	002311	海大集团	6,580,344	309,605,185.20	0.22
133	000166	申万宏源	70,921,557	305,671,910.67	0.22
134	601901	方正证券	38,851,759	300,324,097.07	0.21
135	000157	中联重科	39,097,602	300,269,583.36	0.21
136	600989	宝丰能源	17,261,700	299,145,261.00	0.21
137	000977	浪潮信息	8,095,156	294,420,823.72	0.21
138	600674	川投能源	15,365,100	288,095,625.00	0.20
139	300433	蓝思科技	15,686,240	286,273,880.00	0.20
140	003816	中国广核	61,744,300	285,876,109.00	0.20
141	000776	广发证券	23,304,772	283,619,075.24	0.20
142	688271	联影医疗	2,573,464	282,309,000.80	0.20
143	002001	新和成	14,639,831	281,084,755.20	0.20
144	002049	紫光国微	5,327,849	280,244,857.40	0.20
145	601377	兴业证券	54,392,033	275,223,686.98	0.20
146	688036	传音控股	3,592,656	274,981,890.24	0.20
147	600115	中国东航	67,302,979	269,884,945.79	0.19
148	601111	中国国航	36,560,203	269,814,298.14	0.19
149	000596	古井贡酒	1,275,908	269,305,901.56	0.19
150	000768	中航西飞	10,990,717	264,106,929.51	0.19
151	300122	智飞生物	9,387,257	263,124,813.71	0.19
152	002460	赣锋锂业	8,861,219	253,873,924.35	0.18
153	001979	招商蛇口	28,463,889	250,197,584.31	0.18
154	600029	南方航空	42,460,922	250,094,830.58	0.18

155	601800	中国交建	27,968,611	250,039,382.34	0.18
156	600010	包钢股份	178,296,880	249,615,632.00	0.18
157	600188	兖矿能源	10,880,746	247,319,356.58	0.18
158	601633	长城汽车	9,759,861	246,924,483.30	0.18
159	002601	龙佰集团	13,105,500	243,369,135.00	0.17
160	002466	天齐锂业	8,120,978	242,898,451.98	0.17
161	002236	大华股份	15,563,143	240,606,190.78	0.17
162	002648	卫星化学	13,214,183	237,591,010.34	0.17
163	603799	华友钴业	10,734,478	237,553,998.14	0.17
164	601117	中国化学	28,770,008	237,064,865.92	0.17
165	000786	北新建材	7,970,300	236,399,098.00	0.17
166	000661	长春高新	2,564,196	235,316,266.92	0.17
167	600346	恒力石化	16,572,504	231,186,430.80	0.16
168	000983	山西焦煤	22,381,971	230,758,121.01	0.16
169	002493	荣盛石化	23,885,000	230,729,100.00	0.16
170	300782	卓胜微	2,961,200	230,203,688.00	0.16
171	601838	成都银行	15,043,405	228,509,321.95	0.16
172	600372	中航机载	19,051,963	228,051,997.11	0.16
173	603369	今世缘	4,918,463	227,232,990.60	0.16
174	600161	天坛生物	9,305,511	227,054,468.40	0.16
175	601788	光大证券	15,388,460	224,979,285.20	0.16
176	600023	浙能电力	31,639,800	224,958,978.00	0.16
177	688223	晶科能源	31,457,630	223,349,173.00	0.16
178	600196	复星医药	9,975,656	220,861,023.84	0.16
179	000807	云铝股份	16,330,900	220,630,459.00	0.16
180	300418	昆仑万维	6,817,435	219,794,104.40	0.16
181	002129	TCL 中环	25,376,775	219,509,103.75	0.16
182	600845	宝信软件	6,834,501	218,225,616.93	0.16
183	601021	春秋航空	3,854,129	217,103,086.57	0.15
184	002938	鹏鼎控股	5,451,827	216,764,641.52	0.15
185	300661	圣邦股份	2,611,025	216,140,649.50	0.15
186	601872	招商轮船	25,560,743	215,988,278.35	0.15
187	601868	中国能建	101,852,900	215,928,148.00	0.15
188	601360	三六零	28,077,522	215,635,368.96	0.15
189	600233	圆通速递	13,513,200	211,481,580.00	0.15
190	600219	南山铝业	55,262,100	210,548,601.00	0.15
191	600570	恒生电子	11,915,448	210,426,811.68	0.15
192	600176	中国巨石	18,939,961	209,286,569.05	0.15
193	002180	纳思达	7,805,000	206,208,100.00	0.15
194	600085	同仁堂	5,375,070	205,381,424.70	0.15
195	601995	中金公司	6,934,800	205,339,428.00	0.15
196	600600	青岛啤酒	2,807,976	204,336,413.52	0.15
197	300896	爱美客	1,180,475	203,159,747.50	0.14
198	600741	华域汽车	12,371,371	202,643,056.98	0.14

199	605499	东鹏饮料	936,800	202,114,600.00	0.14
200	603392	万泰生物	3,011,474	198,395,907.12	0.14
201	300347	泰格医药	4,077,601	198,171,408.60	0.14
202	601336	新华保险	6,598,404	198,150,072.12	0.14
203	601066	中信建投	10,273,745	197,666,853.80	0.14
204	002736	国信证券	22,740,023	197,610,799.87	0.14
205	601689	拓普集团	3,674,384	196,983,726.24	0.14
206	601100	恒立液压	4,208,709	196,041,665.22	0.14
207	002271	东方雨虹	15,846,453	195,545,230.02	0.14
208	600183	生益科技	9,273,100	195,291,486.00	0.14
209	600745	闻泰科技	6,879,600	194,348,700.00	0.14
210	000895	双汇发展	8,161,400	193,996,478.00	0.14
211	600362	江西铜业	8,147,568	192,934,410.24	0.14
212	000963	华东医药	6,936,132	192,893,830.92	0.14
213	002920	德赛西威	2,202,400	191,807,016.00	0.14
214	001965	招商公路	16,065,430	190,535,999.80	0.14
215	600027	华电国际	26,799,200	185,986,448.00	0.13
216	601881	中国银河	17,050,985	185,173,697.10	0.13
217	601898	中煤能源	14,470,000	180,585,600.00	0.13
218	688126	沪硅产业	12,932,941	178,603,915.21	0.13
219	002459	晶澳科技	15,616,649	174,906,468.80	0.12
220	300033	同花顺	1,678,728	174,084,093.60	0.12
221	601618	中国中冶	56,124,339	173,985,450.90	0.12
222	000999	华润三九	4,037,200	171,903,976.00	0.12
223	600026	中远海能	10,971,900	171,271,359.00	0.12
224	601699	潞安环能	9,384,600	170,142,798.00	0.12
225	002916	深南电路	1,601,500	169,390,655.00	0.12
226	600515	海南机场	53,798,684	168,927,867.76	0.12
227	300832	新产业	2,491,450	168,023,388.00	0.12
228	601607	上海医药	8,737,700	166,977,447.00	0.12
229	000301	东方盛虹	20,753,300	165,403,801.00	0.12
230	601878	浙商证券	15,282,800	163,831,616.00	0.12
231	000876	新希望	17,830,590	162,971,592.60	0.12
232	601998	中信银行	24,167,139	161,919,831.30	0.12
233	600039	四川路桥	20,519,703	161,900,456.67	0.12
234	600332	白云山	5,509,412	161,591,053.96	0.11
235	600588	用友网络	16,116,020	161,160,200.00	0.11
236	600875	东方电气	8,716,725	160,823,576.25	0.11
237	601877	正泰电器	8,431,690	160,708,011.40	0.11
238	002074	国轩高科	8,375,800	160,396,570.00	0.11
239	600415	小商品城	21,515,801	159,647,243.42	0.11
240	002555	三七互娱	12,192,957	159,118,088.85	0.11
241	002709	天赐材料	9,031,200	158,587,872.00	0.11
242	688396	华润微	4,203,623	157,383,645.12	0.11

243	600025	华能水电	14,231,200	153,412,336.00	0.11
244	600803	新奥股份	7,343,700	152,748,960.00	0.11
245	000408	藏格矿业	6,253,000	150,509,710.00	0.11
246	300223	北京君正	2,670,700	148,063,608.00	0.11
247	300316	晶盛机电	5,133,300	147,479,709.00	0.10
248	300628	亿联网络	3,975,270	146,170,677.90	0.10
249	002812	恩捷股份	4,601,537	145,638,646.05	0.10
250	688599	天合光能	8,550,232	144,669,925.44	0.10
251	300142	沃森生物	12,597,600	143,360,688.00	0.10
252	300450	先导智能	8,602,071	143,052,440.73	0.10
253	605117	德业股份	1,880,122	139,768,269.48	0.10
254	600460	士兰微	7,849,200	137,439,492.00	0.10
255	002007	华兰生物	8,609,482	135,943,720.78	0.10
256	601238	广汽集团	17,390,271	134,600,697.54	0.10
257	300496	中科创达	2,913,600	132,831,024.00	0.09
258	603260	合盛硅业	2,808,700	131,194,377.00	0.09
259	300759	康龙化成	7,048,900	130,968,562.00	0.09
260	301269	华大九天	1,695,400	130,630,570.00	0.09
261	300751	迈为股份	1,089,856	130,215,994.88	0.09
262	601319	中国人保	25,071,100	129,116,165.00	0.09
263	300999	金龙鱼	4,677,500	127,929,625.00	0.09
264	000733	振华科技	3,070,000	127,497,100.00	0.09
265	600018	上港集团	21,921,268	126,704,929.04	0.09
266	601799	星宇股份	1,115,102	124,936,028.08	0.09
267	600918	中泰证券	21,869,300	123,998,931.00	0.09
268	002821	凯莱英	1,868,414	122,941,641.20	0.09
269	300413	芒果超媒	5,863,300	122,542,970.00	0.09
270	688009	中国通号	20,299,081	121,794,486.00	0.09
271	603806	福斯特	8,189,730	120,389,031.00	0.09
272	601865	福莱特	5,958,900	119,773,890.00	0.09
273	603659	璞泰来	8,388,727	118,532,712.51	0.08
274	603195	公牛集团	1,513,763	116,741,402.56	0.08
275	600132	重庆啤酒	1,889,100	114,668,370.00	0.08
276	300919	中伟股份	3,696,908	114,567,178.92	0.08
277	600061	国投资本	20,191,348	114,081,116.20	0.08
278	000617	中油资本	19,882,100	109,749,192.00	0.08
279	601059	信达证券	7,659,060	108,835,242.60	0.08
280	000708	中信特钢	7,938,500	107,725,445.00	0.08
281	688303	大全能源	5,099,966	103,988,306.74	0.07
282	002603	以岭药业	6,607,621	101,294,829.93	0.07
283	002410	广联达	10,531,180	100,888,704.40	0.07
284	688187	时代电气	2,034,897	100,483,213.86	0.07
285	300454	深信服	1,966,556	99,370,074.68	0.07
286	002841	视源股份	3,327,993	98,275,633.29	0.07

287	300442	润泽科技	4,051,400	97,031,030.00	0.07
288	603899	晨光股份	2,925,531	91,510,609.68	0.07
289	688363	华熙生物	1,504,058	85,084,561.06	0.06
290	601808	中海油服	4,644,000	79,876,800.00	0.06
291	600732	爱旭股份	8,609,619	77,917,051.95	0.06
292	603833	欧派家居	1,426,593	76,408,321.08	0.05
293	300979	华利集团	1,184,381	72,069,583.85	0.05
294	601236	红塔证券	11,169,892	71,710,706.64	0.05
295	601698	中国卫通	4,968,460	70,005,601.40	0.05
296	300957	贝泰妮	1,322,775	63,916,488.00	0.05
297	688082	盛美上海	680,257	57,488,519.07	0.04
298	000800	一汽解放	7,327,600	57,375,108.00	0.04
299	603296	华勤技术	713,513	39,407,322.99	0.03
300	001289	龙源电力	1,180,800	20,368,800.00	0.01
301	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
302	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
303	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
304	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
305	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
306	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
307	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
308	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
309	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
310	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
311	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
312	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
313	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
314	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
315	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
316	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
317	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
318	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
319	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
320	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
321	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
322	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
323	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
324	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
325	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
326	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
327	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
328	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
329	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
330	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00



331	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	300750	宁德时代	2,409,576,969.86	4.94
2	000333	美的集团	1,772,179,862.84	3.63
3	000858	五粮液	1,574,522,731.90	3.23
4	002594	比亚迪	1,138,101,927.90	2.33
5	300760	迈瑞医疗	970,904,231.74	1.99
6	000651	格力电器	964,064,349.04	1.98
7	300059	东方财富	956,695,178.81	1.96
8	600519	贵州茅台	935,551,972.74	1.92
9	002475	立讯精密	862,461,362.18	1.77
10	000725	京东方 A	845,789,011.00	1.73
11	300124	汇川技术	704,491,931.02	1.44
12	002415	海康威视	683,339,665.50	1.40
13	000568	泸州老窖	649,822,721.05	1.33
14	300498	温氏股份	625,530,987.83	1.28
15	002714	牧原股份	589,392,216.91	1.21
16	002352	顺丰控股	551,266,749.44	1.13
17	000001	平安银行	544,519,373.42	1.12
18	002371	北方华创	525,792,254.33	1.08
19	300274	阳光电源	525,707,299.96	1.08
20	002230	科大讯飞	509,971,624.87	1.05

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	688271	联影医疗	493,456,036.39	1.01
2	688012	中微公司	399,949,765.36	0.82
3	000333	美的集团	308,804,222.82	0.63
4	300750	宁德时代	285,608,881.30	0.59
5	000858	五粮液	277,541,619.18	0.57
6	002594	比亚迪	259,992,746.62	0.53
7	600436	片仔癀	249,367,148.25	0.51
8	600919	江苏银行	240,743,019.28	0.49

9	600028	中国石化	229,104,381.78	0.47
10	601998	中信银行	224,933,271.00	0.46
11	002142	宁波银行	189,503,228.99	0.39
12	002202	金风科技	180,697,239.35	0.37
13	300124	汇川技术	180,468,210.35	0.37
14	000661	长春高新	161,983,654.95	0.33
15	601615	明阳智能	155,014,405.04	0.32
16	601318	中国平安	153,110,012.47	0.31
17	688041	海光信息	149,909,076.71	0.31
18	000651	格力电器	146,958,724.28	0.30
19	000725	京东方 A	144,305,210.64	0.30
20	300059	东方财富	131,812,574.45	0.27

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	43,062,121,412.25
卖出股票收入（成交）总额	12,164,820,037.00

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 7.11 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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	103,049,440.13
2	应收清算款	245,683,232.99
3	应收股利	325,985.14
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	168,982.58
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,227,640.84

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有限 公司一易方达沪深 300 交易型开放式指数发起 式证券投资基金联接基 金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
98,801	834,254.8 7	78,371,109, 656.00	95.08%	4,054,105,5 88.00	4.92%	7,822,306,7 00.00	9.49%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行

股份有限公司—易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 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	中央汇金投资有限责任公司	54,735,310,974.00	67.03%
2	中国人寿保险股份有限公司	3,618,848,131.00	4.43%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	788,125,600.00	0.97%
4	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	742,473,700.00	0.91%
5	中央汇金资产管理有限责任公司	596,404,800.00	0.73%
6	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	498,588,806.00	0.61%
7	易方达基金—中央汇金资产管理有限责任公司—易方达基金—汇金资管单一资产管理计划	470,000,017.00	0.58%
8	友邦人寿保险有限公司—传统	439,160,694.00	0.54%
9	北京诚通金控投资有限公司	391,896,600.00	0.48%
10	友邦人寿保险有限公司—分红	367,308,887.00	0.45%
11	中国建设银行股份有限公司—易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	7,822,306,700.00	9.58%

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

#### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	10,002,600.00	0.0121%	不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,002,600.00	0.0121%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,104,307,415.00
本报告期期初基金份额总额	29,141,215,244.00
本报告期基金总申购份额	59,164,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,880,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	82,425,215,244.00

注：期初基金总份额包含场外份额 772,907,829 份；期末基金总份额包含场外份额 772,907,829 份。

## § 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 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	
长江证券	1	128,362.00	0.00%	77.02	0.00%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	47,742,382,551.43	86.60%	4,774,532.34	86.60%	-
华创证券	2	7,236,871,540.20	13.13%	723,690.31	13.13%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	151,334,850.01	0.27%	15,133.47	0.27%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金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；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	成交金额	占当期权证成交总额的比例



				比例		
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2024-01-19
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-11
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2024-04-20
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2024 年 01 月 01 日 ~2024 年 06 月 30 日	6,146,25 7,685.00	48,589,0 53,289.0 0	0.00	54,735,3 10,974.0 0	66.41 %
中国建设银行股份有 限公司—易方达沪深 300 交易型开放式指 数发起式证券投资基 金联接基金	1	2024 年 01 月 01 日 ~2024 年 01 月 17 日	7,722,66 8,638.00	2,641,88 1,000.00	2,542,24 2,938.00	7,822,30 6,700.00	9.49%
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；如场外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>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照；

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日