

易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60

7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
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	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 易方达
基金主代码	159361
交易代码	159361
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,955,090,279.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	方圆
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com

客户服务电话	400 881 8088	95559
传真	020-38798812	021-62701216
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	510620；519031	200336
法定代表人	吴欣荣	任德奇

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

§ 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	44,354,765.15
本期利润	274,999,813.06
加权平均基金份额本期利润	0.0175
本期加权平均净值利润率	1.82%
本期基金份额净值增长率	1.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-201,758,724.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0145
期末基金资产净值	13,753,331,554.16
期末基金份额净值	0.9855
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.45%

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

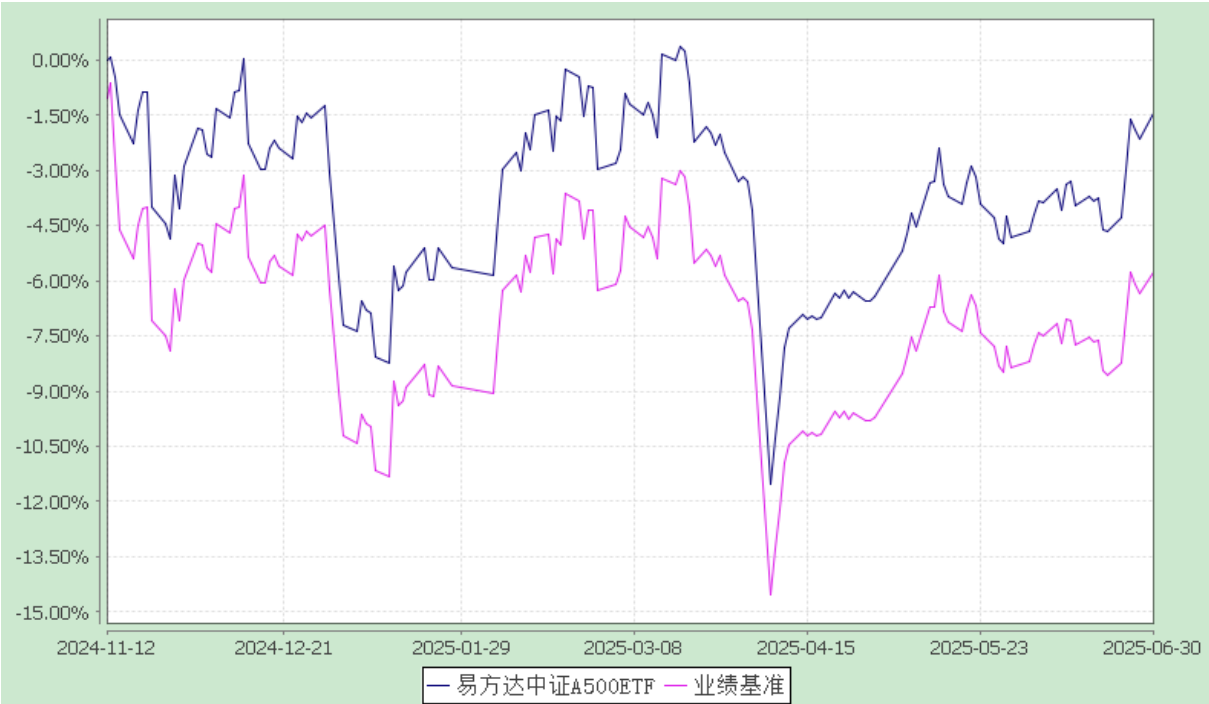
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.55%	0.60%	2.82%	0.60%	0.73%	0.00%
过去三个月	1.89%	1.20%	0.84%	1.20%	1.05%	0.00%
过去六个月	1.64%	1.10%	0.47%	1.10%	1.17%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.45%	1.08%	-5.77%	1.10%	4.32%	-0.02%

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024 年 11 月 12 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2024 年 11 月 12 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比

例符合基金合同的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-1.45%，同期业绩比较基准收益率为-5.77%。

§ 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		
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头 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、易方达中证 A500ETF 联接、易方达上证科创板综合 ETF 联接的基金经理，指数研究部总经理、指数投资决策委员会委员	2024-11-12	-	16 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，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业指数发起式、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。
张湛	本基金的基金经理助理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证新能源	2024-12-07	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指

ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50ETF 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接发起式、易方达中证医疗 ETF 联接发起式、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、易方达中证新能源 ETF 联接发起式、易方达中证全指证券公司 ETF 的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII)、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式、易方达创业板 ETF、易方达中证 A500ETF 联接、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 的基金经理助理				数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证 500 增强策略 ETF 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 38 次，其中 31 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，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 A500 指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性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。

2025 年上半年国民经济整体运行平稳，高质量发展取得实质性进展，以新质生产力为引领的新增长动能持续成长壮大。根据国家统计局初步核算，2025 年上半年国内生产总值达 66.1 万亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%。分结构来看，工业生产增长较快，尤其是高技术制造业等新兴产业增长趋势较好。2025 年上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.4%，其中，高技术制造业增加值增长 9.5%，3D 打印设备、新能源汽车、工业机器人等创新产品产量同比分别增长 43.1%、36.2%、35.6%。服务业增长较快，现代服务业发展趋势较好。2025 年上半年服务业增加值同比增长 5.5%，其中，信息传输、软件和信息技术服务业增加值增长 11.1%，体现了新一批信息技术应用的持续落地。此外，消费市场增速有所回升，2025 年上半年社会消费品零售总额 24.5 万亿元，同比增长 5.0%。固定资产投资继续扩大，扣除房地产开发投资，2025 年上半年全国固定资产投资增长 6.6%，其中制造业投资增长 7.5%。全国新建商品房销售面积 4.6 亿平方米，下降 3.5%；新建商品房销售额 4.4 万亿元，下降 5.5%，均较去年同期明显收窄。从 A 股市场表现来看，上半年风险偏好整体震荡上行，投资者信心得到显著增强，人工智能、创新药、机器人等新一批中国优势产业的快速发展推动了相关板块的预期持续上升。2025 年上半年，在风险偏好改善和盈利预期修复的共同推动下，中证 A500

指数上涨 0.47%。

本报告期涵盖本基金的建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作。在基金的正常运作期，本基金坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9855 元，本报告期份额净值增长率为 1.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.47%。年化跟踪误差 0.34%，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

展望未来，宏观经济方面，随着积极有为的宏观政策持续落地，社会信心有望持续回升，各项经济数据有望保持稳中向好的趋势。当前，尽管外部贸易和地缘环境仍然存在一定挑战，但国内积极有为的政策措施有效缓解了外部压力，尤其是新动能持续增长，新质生产力发展呈现多点开花的趋势。以人工智能、创新药、机器人等为代表的产业不仅在底层创新能力上取得进展，也在国际市场中持续验证了自身的竞争力。此外，信用周期的逐步回升、地产数据的持续改善及各项增量政策的落地也有望推动企业盈利系统性回升，带来市场风险偏好的持续改善。

中长期来看，我国正处在经济增长动能转型升级的关键节点，电子、电力设备、医药生物、计算机等行业正在形成一批新的中国优势企业，其基础创新能力和国际市场竞争力有望不断提升，从而为经济增长带来更明显的助力。中证 A500 指数从行业均衡视角反映 A 股代表性公司整体表现，提升对宏观经济结构调整及产业转型升级的表征性。中证 A500 指数细分行业覆盖度广，纳入更加多元的细分领域龙头公司，包含较多新质生产力代表行业，成长属性较强。一方面受益于信用周期修复、企业盈利筑底回升等积极因素带来的市场风险偏好持续改善，另一方面受益于创新产业带来的结构增长动能持续增强，其中长期配置价值值得关注。

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程序和技术，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合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	86,349,558.04	76,560,025.68
结算备付金		23,215,708.64	76,386,150.18
存出保证金		8,349,575.94	13,991,947.91
交易性金融资产	6.4.7.2	13,698,554,228.03	15,015,415,986.87
其中：股票投资		13,698,281,810.12	15,015,415,986.87
基金投资		-	-
债券投资		272,417.91	-
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		206,584,615.93	25,197,365.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	-
资产总计		14,023,129,302.82	15,207,551,475.78
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		197,450,937.75	9,167,648.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,708,140.14	1,664,522.33
应付托管费		569,380.06	554,840.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	70,069,290.13	53,275,918.99
负债合计		269,797,748.66	64,662,930.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	13,955,090,279.00	15,617,090,279.00
未分配利润	6.4.7.8	-201,758,724.84	-474,201,733.99

净资产合计		13,753,331,554.16	15,142,888,545.01
负债和净资产总计		14,023,129,302.82	15,207,551,475.78

注：1.本基金合同生效日为 2024 年 11 月 12 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 11 月 12 日至 2024 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9855 元，基金份额总额 13,955,090,279.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		290,157,444.03
1.利息收入		291,130.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	291,130.42
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		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		53,734,166.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-120,570,179.50
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	443,993.22
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	-413,081.79
股利收益	6.4.7.14	174,273,434.51
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	230,645,047.91
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	5,487,099.26
减：二、营业总支出		15,157,630.97
1. 管理人报酬		11,239,397.94
2. 托管费		3,746,465.96
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		685.87

8. 其他费用	6.4.7.18	171,081.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		274,999,813.06
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		274,999,813.06
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		274,999,813.06

注：本基金合同生效日为 2024 年 11 月 12 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	15,617,090,279.00	-474,201,733.99	15,142,888,545.01
二、本期期初净资产	15,617,090,279.00	-474,201,733.99	15,142,888,545.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,662,000,000.00	272,443,009.15	-1,389,556,990.85
（一）、综合收益总额	-	274,999,813.06	274,999,813.06
（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）	-1,662,000,000.00	-2,556,803.91	-1,664,556,803.91
其中：1.基金申购款	7,176,000,000.00	-318,864,542.25	6,857,135,457.75
2.基金赎回款	-8,838,000,000.00	316,307,738.34	-8,521,692,261.66
（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	13,955,090,279.00	-201,758,724.84	13,753,331,554.16

产			
---	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2024 年 11 月 12 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，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 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1520 号《关于准予易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,090,279.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 89,811.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意

义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

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

（7）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线

法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、本基金收益分配方式采用现金分红；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、在符合以下有关基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准：

（1）本基金可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于 0 元时，基金管理人可进行收益分配，累计报酬率计算方式详见招募说明书；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- 4、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行 1 次收益分配；
- 5、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，在履行适当程序后基金管理人可调整基金收益的分配原则；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

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

非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	86,349,558.04
等于：本金	86,343,795.69
加：应计利息	5,762.35
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	86,349,558.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		13,642,211,352.38	-	13,698,281,810.12	56,070,457.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	272,400.00	17.91	272,417.91	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	272,400.00	17.91	272,417.91	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		13,642,483,752.38	17.91	13,698,554,228.03	56,070,457.74

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 2025 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	50,888,405.55	-	-	-
IC2509	13,352,414.12	-	-	-
IF2509	37,535,991.43	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	50,888,405.55	-	-	-

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
IC2509	IC2509	12	13,861,920.00	509,505.88
IF2509	IF2509	33	38,481,300.00	945,308.57
合计	-	-	-	1,454,814.45
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,454,814.45
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	380,888.75
其中：交易所市场	380,888.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,697.44
应付替代款	69,488,343.02

可退替代款	103,360.92
合计	70,069,290.13

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,617,090,279.00	15,617,090,279.00
本期申购	7,176,000,000.00	7,176,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,838,000,000.00	-8,838,000,000.00
本期末	13,955,090,279.00	13,955,090,279.00

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	-49,543,460.59	-424,658,273.40	-474,201,733.99
本期期初	-49,543,460.59	-424,658,273.40	-474,201,733.99
本期利润	44,354,765.15	230,645,047.91	274,999,813.06
本期基金份额交易产生的变动数	6,920,930.22	-9,477,734.13	-2,556,803.91
其中：基金申购款	-31,533,363.28	-287,331,178.97	-318,864,542.25
基金赎回款	38,454,293.50	277,853,444.84	316,307,738.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,732,234.78	-203,490,959.62	-201,758,724.84

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	116,249.76
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	169,888.23
其他	4,992.43
合计	291,130.42

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-51,809,869.89

股票投资收益——赎回差价收入	-68,760,309.61
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	-120,570,179.50

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,977,026,292.48
减：卖出股票成本总额	6,024,001,973.75
减：交易费用	4,834,188.62
买卖股票差价收入	-51,809,869.89

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	8,521,692,261.66
减：现金支付赎回款总额	4,970,694,294.66
减：赎回股票成本总额	3,619,758,276.61
减：交易费用	-
赎回差价收入	-68,760,309.61

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	225.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	443,767.53
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	443,993.22

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交	2,942,999.80

总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,498,900.00
减：应计利息总额	214.55
减：交易费用	117.72
买卖债券差价收入	443,767.53

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-413,081.79

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	174,273,434.51
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	174,273,434.51

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	228,413,013.46
——股票投资	228,413,013.46
——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	2,232,034.45
——权证投资	-
——期货投资	2,232,034.45
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	230,645,047.91

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	5,487,099.26
合计	5,487,099.26

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	84,300.75
合计	171,081.20

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
交通银行股份有限公司	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
易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接	该基金是本基金的联接基金

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	191,111.00	0.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年1月1日至2025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	19.10	0.00%	5.64	0.00%

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。

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

3.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 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,239,397.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	516,244.64
应支付基金管理人的净管理费	10,723,153.30

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

$$H=E\times0.15\%\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,746,465.96

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

$$H=E\times0.05\%\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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
易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,902,974,497.00	35.1340%	6,064,274,928.00	38.8310%
广发证券股份有限公司	62,922,100.00	0.4509%	327,528,531.00	2.0972%

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	86,349,558.04	116,249.76

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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：份）	总金额

				股/张)	
广发证券股份 有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

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，在报告期内投资于托管人交通银行发行的 A 股交通银行。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有交通银行发行的 A 股交通银行 15,942,834 股（2024 年 12 月 31 日:15,640,649 股），占本基金净值比例为 0.93%(2024 年 12 月 31 日:0.80%)。

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（2025 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
00133 5	信凯 科技	2025-0 4-02	6 个月	新股 流通 受限	12.80	28.05	80	1,024. 00	2,244. 00	-
00135 6	富岭 股份	2025-0 1-16	6 个月	新股 流通 受限	5.30	14.44	709	3,757. 70	10,237 .96	-
00138 8	信通 电子	2025-0 6-24	1 个月 以内	新股 流通 受限	16.42	16.42	843	13,842 .06	13,842 .06	-
00138 8	信通 电子	2025-0 6-24	6 个月	新股 流通 受限	16.42	16.42	94	1,543. 48	1,543. 48	-
00139 5	亚联 机械	2025-0 1-20	6 个月	新股 流通 受限	19.08	47.25	80	1,526. 40	3,780. 00	-
30117 3	毓恬 冠佳	2025-0 2-24	6 个月	新股 流通 受限	28.33	44.98	173	4,901. 09	7,781. 54	-

301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-

				受限						
60307 2	天和 磁材	2024-1 2-24	6 个月	新股 流通 受限	12.30	54.45	226	2,779. 80	12,305 .70	-
60312 0	肯特 催化	2025-0 4-09	6 个月	新股 流通 受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172. 95	-
60312 4	江南 新材	2025-0 3-12	6 个月	新股 流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075. 28	-
60320 2	天有 为	2025-0 4-16	6 个月	新股 流通 受限	93.50	90.66	166	15,521 .00	15,049 .56	-
60321 0	泰鸿 万立	2025-0 4-01	6 个月	新股 流通 受限	8.60	15.61	286	2,459. 60	4,464. 46	-
60325 7	中国 瑞林	2025-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600. 56	2,922. 66	-
60327 1	永杰 新材	2025-0 3-04	6 个月	新股 流通 受限	20.60	35.08	126	2,595. 60	4,420. 08	-
60338 2	海阳 科技	2025-0 6-05	6 个月	新股 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207. 50	2,350. 95	-
60340 0	华之 杰	2025-0 6-12	6 个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133. 16	2,497. 17	-
60340 9	汇通 控股	2025-0 2-25	6 个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	100	2,418. 00	3,332. 00	-
68841 1	海博 思创	2025-0 1-20	6 个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	560	10,852 .80	46,754 .40	-
68854 5	兴福 电子	2025-0 1-15	6 个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	994	11,609 .92	26,788 .30	-
68858 3	思看 科技	2025-0 1-08	6 个月	新股 流通 受限	33.46	79.68	227	5,855. 50	18,087 .36	-
68875 5	汉邦 科技	2025-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	22.77	39.33	203	4,622. 31	7,983. 99	-
68875	赛分	2025-0	6 个月	新股	4.32	16.97	777	3,356.	13,185	-

8	科技	1-02		流通受限				64	.69	
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
300751	迈为股份	2025-05-16	6 个月	询价转让流通受限	68.31	65.11	175	11,954.25	11,394.25	-
688271	联影医疗	2025-03-24	6 个月	询价转让流通受限	108.66	124.63	46,454	5,047,691.64	5,789,562.02	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025-06-16	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	2,724	272,400.00	272,417.91	-

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 2025 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 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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 2025 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%(2024 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 2025年6月30日	上年度末 2024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企业发行的债券。
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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	272,417.91	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	272,417.91	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、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025 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 2025 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	86,349,558.04	-	-	-	86,349,558.04
结算备付金	23,215,708.64	-	-	-	23,215,708.64
存出保证金	8,349,575.94	-	-	-	8,349,575.94
交易性金融资产	-	-	272,417.91	13,698,281,810.12	13,698,554,228.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	206,584,615.93	206,584,615.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	117,914,842.62	-	272,417.91	13,904,942,042.29	14,023,129,302.82
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	-	-	-	197,450,937.75	197,450,937.75
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	1,708,140.14	1,708,140.14
应付托管费	-	-	-	569,380.06	569,380.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.58	0.58
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,069,290.13	70,069,290.13
负债总计	-	-	-	269,797,748.66	269,797,748.66
利率敏感度缺口	117,914,842.62	-	272,417.91	13,635,144,293.63	13,753,331,554.16
上年度末 2024 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	76,560,025.68	-	-	-	76,560,025.68
结算备付金	76,386,150.18	-	-	-	76,386,150.18
存出保证金	13,991,947.91	-	-	-	13,991,947.91
交易性金融资产	-	-	-	15,015,415,986.87	15,015,415,986.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	25,197,365.14	25,197,365.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	166,938,123.77	-	-	15,040,613,352.01	15,207,551,475.78
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	-	-	-	9,167,648.67	9,167,648.67

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,664,522.33	1,664,522.33
应付托管费	-	-	-	554,840.78	554,840.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	53,275,918.99	53,275,918.99
负债总计	-	-	-	64,662,930.77	64,662,930.77
利率敏感度缺口	166,938,123.77	-	-	14,975,950,421.24	15,142,888,545.01

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		上年度末	
	2025 年 6 月 30 日		2024 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	13,698,281,810.12	99.60	15,015,415,986.87	99.16
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	13,698,281,810.12	99.60	15,015,415,986.87	99.16

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	684,669,628.14	750,858,714.89
	2.业绩比较基准下降 5%	-684,669,628.14	-750,858,714.89

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	13,692,015,932.13
第二层次	287,803.45
第三层次	6,250,492.45
合计	13,698,554,228.03

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,698,281,810.12	97.68
	其中：股票	13,698,281,810.12	97.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	272,417.91	0.00
	其中：债券	272,417.91	0.00
	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	109,565,266.68	0.78
8	其他各项资产	215,009,808.11	1.53
9	合计	14,023,129,302.82	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

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	74,797,813.80	0.54
B	采矿业	692,219,770.13	5.03
C	制造业	7,954,476,133.56	57.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	422,269,394.00	3.07
E	建筑业	260,717,984.00	1.90
F	批发和零售业	96,908,205.08	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	477,930,856.80	3.48
H	住宿和餐饮业	11,852,835.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	906,115,256.94	6.59
J	金融业	2,219,174,608.80	16.14
K	房地产业	143,392,763.75	1.04
L	租赁和商务服务业	152,151,577.40	1.11
M	科学研究和技术服务业	152,216,776.66	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	30,002,712.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,004,356.00	0.07
Q	卫生和社会工作	51,787,393.20	0.38
R	文化、体育和娱乐业	43,263,373.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	13,698,281,810.12	99.60

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	377,100	531,529,992.00	3.86
2	300750	宁德时代	1,583,816	399,470,071.52	2.90
3	601318	中国平安	6,426,500	356,542,220.00	2.59
4	600036	招商银行	7,400,600	340,057,570.00	2.47
5	601166	兴业银行	9,927,900	231,717,186.00	1.68
6	600900	长江电力	7,306,100	220,205,854.00	1.60
7	000333	美的集团	2,943,526	212,522,577.20	1.55
8	601899	紫金矿业	9,841,400	191,907,300.00	1.40
9	002594	比亚迪	538,811	178,836,759.01	1.30

10	300059	东方财富	7,555,494	174,758,576.22	1.27
11	600030	中信证券	5,831,400	161,063,268.00	1.17
12	601398	工商银行	20,944,100	158,965,719.00	1.16
13	600276	恒瑞医药	2,668,400	138,489,960.00	1.01
14	000858	五粮液	1,164,074	138,408,398.60	1.01
15	601328	交通银行	15,942,834	127,542,672.00	0.93
16	000651	格力电器	2,677,600	120,277,792.00	0.87
17	601288	农业银行	19,078,700	112,182,756.00	0.82
18	600887	伊利股份	3,785,500	105,539,740.00	0.77
19	002475	立讯精密	3,033,700	105,239,053.00	0.77
20	688981	中芯国际	1,191,825	105,083,210.25	0.76
21	600919	江苏银行	8,776,200	104,787,828.00	0.76
22	603259	药明康德	1,489,500	103,594,725.00	0.75
23	601816	京沪高铁	17,537,500	100,840,625.00	0.73
24	600000	浦发银行	7,018,600	97,418,168.00	0.71
25	000725	京东方 A	21,941,519	87,546,660.81	0.64
26	002371	北方华创	186,831	82,618,536.51	0.60
27	300760	迈瑞医疗	364,320	81,880,920.00	0.60
28	601088	中国神华	1,966,200	79,709,748.00	0.58
29	688041	海光信息	563,854	79,666,931.66	0.58
30	300308	中际旭创	529,500	77,232,870.00	0.56
31	601601	中国太保	2,049,700	76,884,247.00	0.56
32	300502	新易盛	589,320	74,855,426.40	0.54
33	688256	寒武纪	121,648	73,171,272.00	0.53
34	300124	汇川技术	1,132,600	73,131,982.00	0.53
35	601728	中国电信	9,279,600	71,916,900.00	0.52
36	601668	中国建筑	12,348,900	71,253,153.00	0.52
37	002352	顺丰控股	1,437,020	70,069,095.20	0.51
38	000001	平安银行	5,797,900	69,980,653.00	0.51
39	002714	牧原股份	1,635,880	68,723,318.80	0.50
40	002230	科大讯飞	1,380,300	66,088,764.00	0.48
41	601127	赛力斯	486,600	65,360,112.00	0.48
42	603501	豪威集团	507,500	64,782,375.00	0.47
43	600031	三一重工	3,545,500	63,641,725.00	0.46
44	000063	中兴通讯	1,920,000	62,380,800.00	0.45
45	603019	中科曙光	874,804	61,586,201.60	0.45
46	600309	万华化学	1,130,900	61,362,634.00	0.45
47	002415	海康威视	2,207,500	61,213,975.00	0.45
48	600941	中国移动	537,600	60,506,880.00	0.44
49	300274	阳光电源	867,800	58,810,806.00	0.43
50	601857	中国石油	6,770,800	57,890,340.00	0.42
51	601919	中远海控	3,758,100	56,521,824.00	0.41
52	688008	澜起科技	689,189	56,513,498.00	0.41

53	600690	海尔智家	2,242,100	55,559,238.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	955,000	54,444,550.00	0.40
55	601012	隆基绿能	3,616,800	54,324,336.00	0.39
56	600406	国电南瑞	2,393,600	53,640,576.00	0.39
57	601766	中国中车	7,265,200	51,147,008.00	0.37
58	603986	兆易创新	398,000	50,358,940.00	0.37
59	000568	泸州老窖	439,900	49,884,660.00	0.36
60	600050	中国联通	9,337,700	49,863,318.00	0.36
61	000338	潍柴动力	3,231,900	49,706,622.00	0.36
62	600028	中国石化	8,720,100	49,181,364.00	0.36
63	300476	胜宏科技	362,900	48,766,502.00	0.35
64	000100	TCL 科技	11,222,200	48,592,126.00	0.35
65	601988	中国银行	8,552,135	48,062,998.70	0.35
66	601006	大秦铁路	7,221,156	47,659,629.60	0.35
67	688012	中微公司	254,976	46,482,124.80	0.34
68	601985	中国核电	4,915,900	45,816,188.00	0.33
69	601225	陕西煤业	2,315,100	44,542,524.00	0.32
70	600104	上汽集团	2,764,435	44,369,181.75	0.32
71	002027	分众传媒	6,037,100	44,070,830.00	0.32
72	600150	中国船舶	1,336,300	43,483,202.00	0.32
73	600418	江淮汽车	1,041,300	41,745,717.00	0.30
74	601628	中国人寿	992,100	40,864,599.00	0.30
75	603288	海天味业	993,500	38,657,085.00	0.28
76	600760	中航沈飞	653,380	38,301,135.60	0.28
77	000425	徐工机械	4,916,100	38,198,097.00	0.28
78	605499	东鹏饮料	121,200	38,062,860.00	0.28
79	000625	长安汽车	2,969,700	37,893,372.00	0.28
80	000792	盐湖股份	2,213,800	37,811,704.00	0.27
81	688111	金山办公	134,972	37,798,908.60	0.27
82	600111	北方稀土	1,507,400	37,534,260.00	0.27
83	600938	中国海油	1,425,700	37,225,027.00	0.27
84	688271	联影医疗	289,426	36,826,805.30	0.27
85	600905	三峡能源	8,551,000	36,427,260.00	0.26
86	601658	邮储银行	6,591,200	36,053,864.00	0.26
87	600089	特变电工	3,021,750	36,049,477.50	0.26
88	002625	光启技术	899,200	35,950,016.00	0.26
89	601888	中国中免	580,000	35,362,600.00	0.26
90	002050	三花智控	1,338,200	35,301,716.00	0.26
91	603993	洛阳钼业	4,188,300	35,265,486.00	0.26
92	600436	片仔癀	175,800	35,161,758.00	0.26
93	600048	保利发展	4,295,900	34,796,790.00	0.25
94	300015	爱尔眼科	2,779,500	34,688,160.00	0.25
95	600019	宝钢股份	5,239,400	34,527,646.00	0.25

96	601390	中国中铁	6,137,500	34,431,375.00	0.25
97	600547	山东黄金	1,077,500	34,404,575.00	0.25
98	002463	沪电股份	806,660	34,347,582.80	0.25
99	300033	同花顺	125,300	34,208,153.00	0.25
100	600415	小商品城	1,641,900	33,954,492.00	0.25
101	002241	歌尔股份	1,455,100	33,932,932.00	0.25
102	300014	亿纬锂能	737,400	33,780,294.00	0.25
103	601600	中国铝业	4,733,900	33,326,656.00	0.24
104	601989	中国重工	6,809,600	31,596,544.00	0.23
105	000977	浪潮信息	611,600	31,118,208.00	0.23
106	002384	东山精密	817,400	30,873,198.00	0.22
107	600893	航发动力	798,800	30,785,752.00	0.22
108	002179	中航光电	762,700	30,782,572.00	0.22
109	600585	海螺水泥	1,428,400	30,667,748.00	0.22
110	600570	恒生电子	902,300	30,263,142.00	0.22
111	603799	华友钴业	815,300	30,182,406.00	0.22
112	000538	云南白药	531,860	29,672,469.40	0.22
113	600584	长电科技	856,300	28,848,747.00	0.21
114	000938	紫光股份	1,199,800	28,783,202.00	0.21
115	000988	华工科技	598,600	28,140,186.00	0.20
116	601727	上海电气	3,779,100	27,927,549.00	0.20
117	002028	思源电气	373,800	27,253,758.00	0.20
118	600438	通威股份	1,618,300	27,106,525.00	0.20
119	300408	三环集团	803,900	26,850,260.00	0.20
120	002049	紫光国微	407,180	26,816,874.80	0.19
121	300433	蓝思科技	1,194,600	26,639,580.00	0.19
122	000002	万科 A	4,058,200	26,053,644.00	0.19
123	600795	国电电力	5,317,200	25,735,248.00	0.19
124	600489	中金黄金	1,734,300	25,372,809.00	0.18
125	601669	中国电建	5,151,700	25,088,779.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	990,900	24,653,592.00	0.18
127	601689	拓普集团	518,400	24,494,400.00	0.18
128	600010	包钢股份	13,527,200	24,213,688.00	0.18
129	002422	科伦药业	673,900	24,206,488.00	0.18
130	300339	润和软件	474,700	24,129,001.00	0.18
131	600009	上海机场	747,100	23,735,367.00	0.17
132	002456	欧菲光	1,983,900	23,509,215.00	0.17
133	601100	恒立液压	323,600	23,299,200.00	0.17
134	600160	巨化股份	808,700	23,193,516.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	680,300	22,973,731.00	0.17
136	000768	中航西飞	832,400	22,757,816.00	0.17
137	300394	天孚通信	282,860	22,583,542.40	0.16
138	601186	中国铁建	2,747,700	22,009,077.00	0.16

139	600183	生益科技	729,900	22,006,485.00	0.16
140	002252	上海莱士	3,165,900	21,749,733.00	0.16
141	000157	中联重科	2,970,600	21,477,438.00	0.16
142	600839	四川长虹	2,202,000	21,403,440.00	0.16
143	601360	三六零	2,094,700	21,365,940.00	0.16
144	688036	传音控股	265,841	21,187,527.70	0.15
145	600989	宝丰能源	1,311,800	21,172,452.00	0.15
146	000963	华东医药	523,400	21,124,424.00	0.15
147	600886	国投电力	1,429,300	21,067,882.00	0.15
148	002074	国轩高科	641,800	20,832,828.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	1,577,100	20,691,552.00	0.15
150	600115	中国东航	5,115,600	20,615,868.00	0.15
151	300442	润泽科技	412,300	20,421,219.00	0.15
152	000408	藏格矿业	467,900	19,965,293.00	0.15
153	000807	云铝股份	1,245,700	19,906,286.00	0.14
154	600066	宇通客车	796,200	19,793,532.00	0.14
155	002466	天齐锂业	613,600	19,659,744.00	0.14
156	002001	新和成	915,520	19,473,110.40	0.14
157	002340	格林美	3,064,600	19,460,210.00	0.14
158	002517	恺英网络	1,000,200	19,313,862.00	0.14
159	600426	华鲁恒升	886,200	19,203,954.00	0.14
160	300661	圣邦股份	263,095	19,145,423.15	0.14
161	600196	复星医药	762,800	19,138,652.00	0.14
162	002195	岩山科技	3,386,752	19,067,413.76	0.14
163	001979	招商蛇口	2,167,300	19,007,221.00	0.14
164	600029	南方航空	3,212,300	18,952,570.00	0.14
165	688169	石头科技	120,646	18,887,131.30	0.14
166	601800	中国交建	2,124,300	18,885,027.00	0.14
167	000661	长春高新	190,200	18,864,036.00	0.14
168	002558	巨人网络	800,500	18,851,775.00	0.14
169	002236	大华股份	1,186,700	18,844,796.00	0.14
170	000975	山金国际	993,700	18,820,678.00	0.14
171	301236	软通动力	344,200	18,807,088.00	0.14
172	600674	川投能源	1,169,400	18,757,176.00	0.14
173	600011	华能国际	2,623,100	18,728,934.00	0.14
174	002156	通富微电	729,600	18,692,352.00	0.14
175	688126	沪硅产业	981,687	18,377,180.64	0.13
176	600487	亨通光电	1,183,100	18,101,430.00	0.13
177	600346	恒力石化	1,259,500	17,960,470.00	0.13
178	300251	光线传媒	876,900	17,774,763.00	0.13
179	300418	昆仑万维	524,400	17,635,572.00	0.13
180	300207	欣旺达	879,100	17,634,746.00	0.13
181	601111	中国国航	2,232,400	17,613,636.00	0.13

182	600745	闻泰科技	519,900	17,432,247.00	0.13
183	600372	中航机载	1,442,700	17,398,962.00	0.13
184	600460	士兰微	700,900	17,396,338.00	0.13
185	002648	卫星化学	1,003,700	17,394,121.00	0.13
186	601868	中国能建	7,715,100	17,204,673.00	0.13
187	000066	中国长城	1,161,000	17,182,800.00	0.12
188	003816	中国广核	4,704,300	17,123,652.00	0.12
189	688608	恒玄科技	48,974	17,041,972.52	0.12
190	600096	云天化	765,700	16,822,429.00	0.12
191	002916	深南电路	155,480	16,762,298.80	0.12
192	688213	思特威	163,937	16,757,640.14	0.12
193	601117	中国化学	2,182,400	16,739,008.00	0.12
194	300347	泰格医药	312,000	16,635,840.00	0.12
195	601319	中国人保	1,904,800	16,590,808.00	0.12
196	002465	海格通信	1,190,100	16,589,994.00	0.12
197	600741	华域汽车	939,700	16,585,705.00	0.12
198	002273	水晶光电	829,900	16,573,103.00	0.12
199	600879	航天电子	1,582,300	16,566,681.00	0.12
200	688777	中控技术	368,608	16,554,185.28	0.12
201	601168	西部矿业	993,901	16,528,573.63	0.12
202	002920	德赛西威	161,700	16,514,421.00	0.12
203	601021	春秋航空	296,100	16,477,965.00	0.12
204	600588	用友网络	1,227,900	16,417,023.00	0.12
205	300782	卓胜微	229,200	16,358,004.00	0.12
206	600176	中国巨石	1,432,100	16,325,940.00	0.12
207	600256	广汇能源	2,709,000	16,308,180.00	0.12
208	688120	华海清科	96,575	16,292,202.50	0.12
209	300450	先导智能	649,800	16,147,530.00	0.12
210	002601	龙佰集团	995,100	16,130,571.00	0.12
211	601633	长城汽车	749,400	16,097,112.00	0.12
212	000831	中国稀土	442,400	15,979,488.00	0.12
213	002555	三七互娱	923,200	15,962,128.00	0.12
214	000786	北新建材	601,800	15,935,664.00	0.12
215	600219	南山铝业	4,152,600	15,904,458.00	0.12
216	002294	信立泰	335,900	15,898,147.00	0.12
217	600352	浙江龙盛	1,560,800	15,857,728.00	0.12
218	600885	宏发股份	702,620	15,675,452.20	0.11
219	688235	百济神州	67,055	15,666,730.20	0.11
220	600482	中国动力	678,500	15,652,995.00	0.11
221	300017	网宿科技	1,458,300	15,632,976.00	0.11
222	000933	神火股份	937,800	15,604,992.00	0.11
223	600039	四川路桥	1,566,900	15,512,310.00	0.11
224	002185	华天科技	1,528,400	15,436,840.00	0.11

225	300896	爱美客	88,204	15,418,941.24	0.11
226	000630	铜陵有色	4,573,100	15,274,154.00	0.11
227	302132	中航成飞	171,600	15,090,504.00	0.11
228	002493	荣盛石化	1,809,300	14,981,004.00	0.11
229	688002	睿创微纳	212,594	14,822,053.68	0.11
230	600085	同仁堂	410,600	14,806,236.00	0.11
231	002129	TCL 中环	1,925,450	14,787,456.00	0.11
232	001965	招商公路	1,225,500	14,706,000.00	0.11
233	688617	惠泰医疗	49,310	14,645,070.00	0.11
234	688396	华润微	309,476	14,594,888.16	0.11
235	002709	天赐材料	799,900	14,494,188.00	0.11
236	601877	正泰电器	639,300	14,492,931.00	0.11
237	600362	江西铜业	617,500	14,468,025.00	0.11
238	002281	光迅科技	293,100	14,455,692.00	0.11
239	002595	豪迈科技	244,100	14,455,602.00	0.11
240	002130	沃尔核材	601,400	14,325,348.00	0.10
241	000423	东阿阿胶	273,745	14,316,863.50	0.10
242	603392	万泰生物	232,200	14,164,200.00	0.10
243	002131	利欧股份	4,032,400	14,113,400.00	0.10
244	300122	智飞生物	719,550	14,095,984.50	0.10
245	300866	安克创新	123,960	14,081,856.00	0.10
246	002085	万丰奥威	885,000	14,062,650.00	0.10
247	688099	晶晨股份	196,336	13,941,819.36	0.10
248	300454	深信服	147,500	13,891,550.00	0.10
249	300058	蓝色光标	2,116,640	13,885,158.40	0.10
250	002532	天山铝业	1,666,700	13,850,277.00	0.10
251	688506	百利天恒	46,741	13,840,944.92	0.10
252	300002	神州泰岳	1,171,000	13,817,800.00	0.10
253	002738	中矿资源	429,548	13,814,263.68	0.10
254	688122	西部超导	265,039	13,750,223.32	0.10
255	600161	天坛生物	713,466	13,691,412.54	0.10
256	002180	纳思达	594,300	13,633,242.00	0.10
257	300223	北京君正	196,900	13,625,480.00	0.10
258	603596	伯特利	258,400	13,615,096.00	0.10
259	300832	新产业	239,935	13,609,113.20	0.10
260	002472	双环传动	406,200	13,603,638.00	0.10
261	002138	顺络电子	480,900	13,522,908.00	0.10
262	002078	太阳纸业	1,001,000	13,473,460.00	0.10
263	603129	春风动力	62,200	13,466,300.00	0.10
264	002128	电投能源	675,200	13,355,456.00	0.10
265	300474	景嘉微	182,800	13,344,400.00	0.10
266	002938	鹏鼎控股	416,300	13,334,089.00	0.10
267	002436	兴森科技	1,006,900	13,331,356.00	0.10

268	600233	圆通速递	1,028,000	13,250,920.00	0.10
269	000301	东方盛虹	1,585,200	13,204,716.00	0.10
270	002410	广联达	983,900	13,194,099.00	0.10
271	300346	南大光电	413,824	13,093,391.36	0.10
272	600143	金发科技	1,262,300	13,014,313.00	0.09
273	603606	东方电缆	251,500	13,005,065.00	0.09
274	300395	菲利华	254,500	13,004,950.00	0.09
275	600188	兖矿能源	1,068,200	12,999,994.00	0.09
276	600862	中航高科	498,000	12,987,840.00	0.09
277	300759	康龙化成	528,900	12,979,206.00	0.09
278	300136	信维通信	577,400	12,933,760.00	0.09
279	300024	机器人	752,000	12,919,360.00	0.09
280	002353	杰瑞股份	369,000	12,915,000.00	0.09
281	000034	神州数码	342,600	12,895,464.00	0.09
282	002223	鱼跃医疗	361,500	12,869,400.00	0.09
283	002065	东华软件	1,336,200	12,827,520.00	0.09
284	300054	鼎龙股份	447,000	12,819,960.00	0.09
285	002202	金风科技	1,239,900	12,708,975.00	0.09
286	601618	中国中冶	4,250,200	12,665,596.00	0.09
287	688072	拓荆科技	81,514	12,529,516.94	0.09
288	601615	明阳智能	1,085,800	12,475,842.00	0.09
289	688047	龙芯中科	93,482	12,469,563.98	0.09
290	000999	华润三九	398,460	12,463,828.80	0.09
291	688223	晶科能源	2,386,187	12,384,310.53	0.09
292	002624	完美世界	813,400	12,339,278.00	0.09
293	002271	东方雨虹	1,146,700	12,304,091.00	0.09
294	300496	中科创达	214,500	12,273,690.00	0.09
295	300383	光环新网	855,800	12,237,940.00	0.09
296	002008	大族激光	501,593	12,223,821.41	0.09
297	688578	艾力斯	131,131	12,200,428.24	0.09
298	600845	宝信软件	515,400	12,173,748.00	0.09
299	600515	海南机场	3,417,400	12,097,596.00	0.09
300	002405	四维图新	1,415,400	12,087,516.00	0.09
301	300604	长川科技	268,200	12,044,862.00	0.09
302	601872	招商轮船	1,922,200	12,032,972.00	0.09
303	603659	璞泰来	633,800	11,902,764.00	0.09
304	600549	厦门钨业	568,300	11,888,836.00	0.09
305	000733	振华科技	237,100	11,866,855.00	0.09
306	600895	张江高科	461,300	11,855,410.00	0.09
307	002459	晶澳科技	1,184,720	11,823,505.60	0.09
308	000426	兴业银锡	746,400	11,793,120.00	0.09
309	300012	华测检测	1,002,800	11,722,732.00	0.09
310	300459	汤姆猫	2,091,500	11,712,400.00	0.09

311	002155	湖南黄金	651,070	11,621,599.50	0.08
312	688266	泽璟制药	107,991	11,610,112.41	0.08
313	300627	华测导航	329,920	11,547,200.00	0.08
314	603087	甘李药业	210,200	11,514,756.00	0.08
315	603605	珀莱雅	138,600	11,474,694.00	0.08
316	688599	天合光能	780,759	11,344,428.27	0.08
317	605589	圣泉集团	405,600	11,255,400.00	0.08
318	300253	卫宁健康	1,056,600	11,199,960.00	0.08
319	601216	君正集团	2,022,100	11,161,992.00	0.08
320	300037	新宙邦	316,100	11,126,720.00	0.08
321	605117	德业股份	210,840	11,102,834.40	0.08
322	300699	光威复材	350,200	11,090,834.00	0.08
323	600332	白云山	418,100	11,021,116.00	0.08
324	000617	中油资本	1,506,700	10,998,910.00	0.08
325	600392	盛和资源	835,000	10,996,950.00	0.08
326	000932	华菱钢铁	2,481,800	10,919,920.00	0.08
327	300003	乐普医疗	789,200	10,875,176.00	0.08
328	002444	巨星科技	426,300	10,874,913.00	0.08
329	300073	当升科技	247,200	10,844,664.00	0.08
330	000519	中兵红箭	491,800	10,765,502.00	0.08
331	600153	建发股份	1,038,100	10,765,097.00	0.08
332	000878	云南铜业	839,400	10,677,168.00	0.08
333	300316	晶盛机电	392,600	10,659,090.00	0.08
334	603979	金诚信	229,100	10,639,404.00	0.08
335	601233	桐昆股份	1,003,300	10,634,980.00	0.08
336	688180	君实生物	312,661	10,624,220.78	0.08
337	300628	亿联网络	305,600	10,622,656.00	0.08
338	002389	航天彩虹	413,500	10,585,600.00	0.08
339	300001	特锐德	440,000	10,546,800.00	0.08
340	600803	新奥股份	555,600	10,500,840.00	0.08
341	300142	沃森生物	951,500	10,466,500.00	0.08
342	002414	高德红外	1,018,500	10,439,625.00	0.08
343	601799	星宇股份	83,200	10,400,000.00	0.08
344	002821	凯莱英	116,476	10,279,007.00	0.07
345	600699	均胜电子	588,600	10,265,184.00	0.07
346	002812	恩捷股份	350,000	10,251,500.00	0.07
347	300568	星源材质	804,600	10,202,328.00	0.07
348	002007	华兰生物	650,000	10,185,500.00	0.07
349	600118	中国卫星	353,100	10,088,067.00	0.07
350	600521	华海药业	540,500	10,069,515.00	0.07
351	600177	雅戈尔	1,377,500	10,055,750.00	0.07
352	002152	广电运通	741,100	9,960,384.00	0.07
353	600398	海澜之家	1,428,700	9,943,752.00	0.07

354	601238	广汽集团	1,319,100	9,880,059.00	0.07
355	600316	洪都航空	261,800	9,869,860.00	0.07
356	300315	掌趣科技	1,617,300	9,817,011.00	0.07
357	603260	合盛硅业	206,700	9,797,580.00	0.07
358	600704	物产中大	1,856,800	9,785,336.00	0.07
359	000738	航发控制	469,250	9,736,937.50	0.07
360	300413	芒果超媒	445,600	9,722,992.00	0.07
361	600038	中直股份	249,900	9,698,619.00	0.07
362	600497	驰宏锌锗	1,814,300	9,597,647.00	0.07
363	002044	美年健康	1,861,500	9,568,110.00	0.07
364	000009	中国宝安	1,076,976	9,563,546.88	0.07
365	000623	吉林敖东	563,700	9,554,715.00	0.07
366	600765	中航重机	565,500	9,545,640.00	0.07
367	002318	久立特材	406,700	9,512,713.00	0.07
368	600018	上港集团	1,662,200	9,491,162.00	0.07
369	600141	兴发集团	460,200	9,447,906.00	0.07
370	601567	三星医疗	419,800	9,411,916.00	0.07
371	300919	中伟股份	284,080	9,340,550.40	0.07
372	601677	明泰铝业	746,800	9,275,256.00	0.07
373	000400	许继电气	424,100	9,232,657.00	0.07
374	002409	雅克科技	166,400	9,100,416.00	0.07
375	000960	锡业股份	591,432	9,048,909.60	0.07
376	002607	中公教育	2,942,600	9,004,356.00	0.07
377	600637	东方明珠	1,199,300	8,958,771.00	0.07
378	601607	上海医药	499,200	8,925,696.00	0.06
379	600498	烽火通信	423,000	8,895,690.00	0.06
380	300088	长信科技	1,487,800	8,867,288.00	0.06
381	603939	益丰药房	361,900	8,855,693.00	0.06
382	688188	柏楚电子	67,230	8,851,501.80	0.06
383	002245	蔚蓝锂芯	688,500	8,833,455.00	0.06
384	600529	山东药玻	397,800	8,807,292.00	0.06
385	002841	视源股份	254,400	8,802,240.00	0.06
386	300724	捷佳伟创	162,100	8,802,030.00	0.06
387	300182	捷成股份	1,596,500	8,796,715.00	0.06
388	300757	罗博特科	58,640	8,794,240.80	0.06
389	002739	万达电影	760,500	8,692,515.00	0.06
390	002407	多氟多	710,705	8,663,493.95	0.06
391	000039	中集集团	1,101,000	8,653,860.00	0.06
392	301358	湖南裕能	275,800	8,602,202.00	0.06
393	600563	法拉电子	78,700	8,585,383.00	0.06
394	600026	中远海能	827,600	8,549,108.00	0.06
395	300068	南都电源	536,300	8,537,896.00	0.06
396	300558	贝达药业	147,100	8,524,445.00	0.06

397	601018	宁波港	2,314,900	8,472,534.00	0.06
398	000887	中鼎股份	469,700	8,262,023.00	0.06
399	600486	扬农化工	142,200	8,247,600.00	0.06
400	300285	国瓷材料	474,500	8,232,575.00	0.06
401	002025	航天电器	159,700	8,210,177.00	0.06
402	603806	福斯特	623,300	8,077,968.00	0.06
403	300763	锦浪科技	139,600	8,011,644.00	0.06
404	300144	宋城演艺	935,600	7,999,380.00	0.06
405	688303	大全能源	375,071	7,996,513.72	0.06
406	600820	隧道股份	1,310,500	7,994,050.00	0.06
407	688009	中国通号	1,542,724	7,929,601.36	0.06
408	600008	首创环保	2,618,000	7,906,360.00	0.06
409	300296	利亚德	1,291,300	7,876,930.00	0.06
410	002064	华峰化学	1,189,900	7,865,239.00	0.06
411	002497	雅化集团	688,200	7,845,480.00	0.06
412	603486	科沃斯	134,100	7,808,643.00	0.06
413	600516	方大炭素	1,680,700	7,798,448.00	0.06
414	002312	川发龙蟒	677,000	7,771,960.00	0.06
415	603568	伟明环保	405,500	7,736,940.00	0.06
416	600998	九州通	1,502,600	7,723,364.00	0.06
417	600166	福田汽车	2,825,200	7,656,292.00	0.06
418	603816	顾家家居	298,400	7,615,168.00	0.06
419	600170	上海建工	3,176,500	7,591,835.00	0.06
420	605358	立昂微	324,000	7,549,200.00	0.05
421	600208	衢州发展	2,546,300	7,537,048.00	0.05
422	600763	通策医疗	182,440	7,531,123.20	0.05
423	601179	中国西电	1,219,400	7,487,116.00	0.05
424	600312	平高电气	486,100	7,481,079.00	0.05
425	000683	博源化工	1,553,044	7,439,080.76	0.05
426	601155	新城控股	540,200	7,389,936.00	0.05
427	002176	江特电机	1,017,300	7,385,598.00	0.05
428	002244	滨江集团	747,300	7,286,175.00	0.05
429	300676	华大基因	146,300	7,281,351.00	0.05
430	600323	瀚蓝环境	296,100	7,210,035.00	0.05
431	000818	航锦科技	318,700	7,170,750.00	0.05
432	601000	唐山港	1,764,500	7,163,870.00	0.05
433	000708	中信特钢	604,900	7,113,624.00	0.05
434	603613	国联股份	298,900	7,080,941.00	0.05
435	603885	吉祥航空	525,000	7,071,750.00	0.05
436	000629	钒钛股份	2,761,650	7,069,824.00	0.05
437	000830	鲁西化工	684,400	7,049,320.00	0.05
438	002432	九安医疗	193,500	7,049,205.00	0.05
439	002603	以岭药业	497,600	7,016,160.00	0.05

440	600535	天士力	443,300	6,937,645.00	0.05
441	002439	启明星辰	432,600	6,917,274.00	0.05
442	300567	精测电子	114,100	6,915,601.00	0.05
443	600499	科达制造	687,100	6,733,580.00	0.05
444	600511	国药股份	230,913	6,733,423.08	0.05
445	601880	辽港股份	4,450,400	6,675,600.00	0.05
446	300390	天华新能	349,960	6,673,737.20	0.05
447	603000	人民网	330,200	6,673,342.00	0.05
448	002145	中核钛白	1,583,698	6,572,346.70	0.05
449	603899	晨光股份	225,700	6,543,043.00	0.05
450	000563	陕国投 A	1,827,900	6,525,603.00	0.05
451	688005	容百科技	291,582	6,508,110.24	0.05
452	600859	王府井	467,800	6,497,742.00	0.05
453	600004	白云机场	711,700	6,476,470.00	0.05
454	603077	和邦生物	3,673,100	6,427,925.00	0.05
455	600655	豫园股份	1,157,800	6,425,790.00	0.05
456	601966	玲珑轮胎	435,700	6,391,719.00	0.05
457	600131	国网信通	361,100	6,391,470.00	0.05
458	000547	航天发展	760,700	6,389,880.00	0.05
459	600325	华发股份	1,311,000	6,384,570.00	0.05
460	300529	健帆生物	290,300	6,261,771.00	0.05
461	600754	锦江酒店	277,400	6,224,856.00	0.05
462	000998	隆平高科	616,700	6,074,495.00	0.04
463	300601	康泰生物	398,300	6,050,177.00	0.04
464	603833	欧派家居	106,500	6,011,925.00	0.04
465	002756	永兴材料	188,500	5,984,875.00	0.04
466	002544	普天科技	249,000	5,839,050.00	0.04
467	300070	碧水源	1,288,800	5,799,600.00	0.04
468	600867	通化东宝	706,900	5,796,580.00	0.04
469	002120	韵达股份	862,800	5,780,760.00	0.04
470	601866	中远海发	2,337,300	5,773,131.00	0.04
471	600667	太极实业	874,400	5,753,552.00	0.04
472	300438	鹏辉能源	205,300	5,668,333.00	0.04
473	300751	迈为股份	81,475	5,666,622.25	0.04
474	600258	首旅酒店	398,300	5,627,979.00	0.04
475	000032	深桑达 A	276,300	5,589,549.00	0.04
476	300457	赢合科技	238,000	5,474,000.00	0.04
477	000069	华侨城 A	2,388,599	5,374,347.75	0.04
478	002508	老板电器	282,700	5,374,127.00	0.04
479	002831	裕同科技	227,900	5,337,418.00	0.04
480	000967	盈峰环境	752,400	5,229,180.00	0.04
481	300118	东方日升	544,900	5,220,142.00	0.04
482	300573	兴齐眼药	100,120	5,185,214.80	0.04

483	002292	奥飞娱乐	529,600	5,147,712.00	0.04
484	600129	太极集团	238,200	5,076,042.00	0.04
485	002572	索菲亚	347,800	4,872,678.00	0.04
486	601636	旗滨集团	958,100	4,800,081.00	0.03
487	002266	浙富控股	1,550,400	4,775,232.00	0.03
488	688063	派能科技	100,098	4,512,417.84	0.03
489	603650	彤程新材	139,600	4,488,140.00	0.03
490	000035	中国天楹	1,044,500	4,480,905.00	0.03
491	600864	哈投股份	737,900	4,405,263.00	0.03
492	688390	固德威	100,648	4,373,155.60	0.03
493	300769	德方纳米	130,600	4,312,412.00	0.03
494	002091	江苏国泰	584,700	4,250,769.00	0.03
495	600315	上海家化	199,400	4,201,358.00	0.03
496	002372	伟星新材	378,200	3,918,152.00	0.03
497	001914	招商积余	258,200	3,193,934.00	0.02
498	600007	中国国贸	117,400	2,416,092.00	0.02
499	600335	国机汽车	351,600	2,267,820.00	0.02
500	301381	赛维时代	71,200	1,420,440.00	0.01
501	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
502	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
503	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
504	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
505	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
506	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
507	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
508	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
509	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
510	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
511	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
512	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
513	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
514	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
515	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
516	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
517	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
518	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
519	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
520	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
521	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
522	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
523	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
524	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
525	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00

526	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
527	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
528	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
529	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
530	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
531	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
532	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
533	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
534	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
535	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
536	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	600519	贵州茅台	411,056,465.01	2.71
2	601318	中国平安	192,057,332.06	1.27
3	600036	招商银行	181,300,500.22	1.20
4	601166	兴业银行	136,045,494.98	0.90
5	600900	长江电力	120,383,353.03	0.79
6	601899	紫金矿业	92,547,406.99	0.61
7	688041	海光信息	90,064,962.40	0.59
8	600030	中信证券	88,751,463.35	0.59
9	601398	工商银行	81,354,317.00	0.54
10	688981	中芯国际	76,282,994.95	0.50
11	601328	交通银行	75,825,744.30	0.50
12	600276	恒瑞医药	70,186,154.32	0.46
13	600887	伊利股份	65,637,014.82	0.43
14	601816	京沪高铁	57,744,926.00	0.38
15	601288	农业银行	56,672,662.00	0.37
16	600309	万华化学	54,735,132.11	0.36
17	600919	江苏银行	49,775,331.90	0.33
18	603259	药明康德	43,804,378.73	0.29
19	600000	浦发银行	43,290,636.17	0.29
20	601601	中国太保	42,608,710.89	0.28

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	600519	贵州茅台	475,134,598.94	3.14
2	601318	中国平安	231,614,057.36	1.53
3	600036	招商银行	220,421,043.73	1.46
4	600900	长江电力	144,469,079.00	0.95
5	601166	兴业银行	130,356,293.00	0.86
6	601899	紫金矿业	113,093,066.81	0.75
7	600030	中信证券	105,942,222.99	0.70
8	688041	海光信息	98,601,714.02	0.65
9	601398	工商银行	98,342,663.20	0.65
10	688981	中芯国际	87,971,444.37	0.58
11	600276	恒瑞医药	86,876,033.07	0.57
12	600887	伊利股份	78,182,737.72	0.52
13	601328	交通银行	72,528,610.89	0.48
14	601988	中国银行	71,738,091.70	0.47
15	601816	京沪高铁	68,938,135.00	0.46
16	601288	农业银行	68,518,065.00	0.45
17	600309	万华化学	60,901,771.00	0.40
18	600919	江苏银行	60,101,426.50	0.40
19	603259	药明康德	56,639,240.37	0.37
20	600000	浦发银行	52,830,150.86	0.35

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	5,276,506,003.85
卖出股票收入（成交）总额	5,977,026,292.48

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）	272,417.91	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	272,417.91	0.00

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	123257	安克转债	2,724	272,417.91	0.00

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。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，兴业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福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省上杭县住房和城乡建设局的处罚。

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	8,349,575.94
2	应收清算款	206,584,615.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	215,009,808.11

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		交通银行股份有限公司 一易方达中证 A500 交 易型开放式指数证券投 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
20,704	674,028.7 0	12,850,904, 650.00	92.09%	1,104,185,6 29.00	7.91%	4,902,974,4 97.00	35.13%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“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	中国人寿保险股份有限公司	1,895,729,891.00	13.58%
2	中国国际金融股份有限公司	414,913,192.00	2.97%
3	中国平安人寿保险股份有限公司－寿险传统低一自主	312,824,125.00	2.24%
4	大家人寿保险股份有限公司－万能产品	306,120,100.00	2.19%
5	幸福人寿保险股份有限公司－自有	269,604,900.00	1.93%
6	新华人寿保险股份有限公司	224,027,320.00	1.61%
7	华泰证券股份有限公司	201,785,071.00	1.45%
8	中国联合网络通信集团有限公司企业年金计划－招商银行股份有限公司	161,114,400.00	1.15%
9	中国人寿再保险有限责任公司	155,151,571.00	1.11%
10	中国华能集团有限公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	146,160,600.00	1.05%
11	交通银行股份有限公司－易方达中证	4,902,974,497.00	35.13%

	A500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金		
--	-----------------------------	--	--

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	11,100.00	0.0001%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 12 日）基金份额总额	2,000,090,279.00
本报告期期初基金份额总额	15,617,090,279.00
本报告期基金总申购份额	7,176,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,838,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,955,090,279.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担

任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

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	-	-	-	-	-
广发证券	1	191,111.00	0.00%	19.10	0.00%	-
国泰海通	2	915,867,320.40	8.14%	91,590.26	8.14%	-
国投证券	2	8,944,727,354.54	79.53%	894,559.40	79.53%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	581,989,107.02	5.17%	58,205.28	5.17%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	778,844,163.11	6.93%	77,890.62	6.93%	-
中信证券	1	24,933,126.93	0.22%	2,493.74	0.22%	-

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长江证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、民生证券股份有限

公司、申万宏源证券有限公司、太平洋证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	2,942,999.80	100.00%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中航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	2025-01-20

		子披露网站	
2	关于指定易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金主流动性服务商的公告	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	2025-01-27
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银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	2025-02-27
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中山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	2025-03-20
5	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
9	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
10	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	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	2025-03-25
11	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
12	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	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	2025-04-11
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2025-04-22
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17

§ 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
交通银行股份有限公司－易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2025 年 01 月 01 日~2025 年 06 月 30 日	6,064,274,928.00	801,199,569.00	1,962,500,000.00	4,902,974,497.00	35.13 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临持续运作、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。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇二五年八月三十日