

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	78
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	80
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	80
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	80
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	80
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	80

7.11 投资组合报告附注	80
§ 8 基金份额持有人信息	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2 期末上市基金前十名持有人	82
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
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	83
§ 9 开放式基金份额变动	83
§ 10 重大事件揭示	84
10.1 基金份额持有人大会决议	84
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	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
10.4 基金投资策略的改变	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
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	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
10.8 其他重大事件	87
§ 11 备查文件目录	89
11.1 备查文件目录	89
11.2 存放地点	89
11.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）	
场内简称	标普 500LOF	
基金主代码	161125	
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 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	375,507,620.07 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	2016 年 12 月 14 日	
下属分级基金的基金简称	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
下属分级基金的交易代码	161125	012860
报告期末下属分级基金的份额总额	353,928,416.02 份	21,579,204.05 份

注：1.自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日。

2.本基金 A 类份额含 A 类人民币份额（份额代码：161125）及 A 类美元现汇份额（份额代码：003718），交易代码仅列示 A 类人民币份额代码；本基金 C 类份额含 C 类人民币份额（份额代码：012860）及 C 类美元现汇份额（份额代码：012861），交易代码仅列示 C 类人民币份额代码。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、固定收益品种和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	标普 500 指数收益率(使用估值汇率折算)×95%+活期存款利率(税后) ×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	State Street Bank and Trust Company
	中文	无	道富银行
注册地址		无	One Congress Street, Suite 1, Boston, MA 02114-2016., United States
办公地址		无	One Congress Street, Suite 1, Boston, MA 02114-2016., United States
邮政编码		无	无

2.5 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

2.6 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 A 类人民币份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，A 类美元份额、

C 类人民币份额、C 类美元份额的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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
本期已实现收益	10,772,456.29	537,033.99
本期利润	45,098,236.09	3,899,224.33
加权平均基金份额本期利润	0.1244	0.2514
本期加权平均净值利润率	4.88%	10.01%
本期基金份额净值增长率	4.84%	4.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
期末可供分配利润	194,007,302.88	11,156,072.84
期末可供分配基金份额利润	0.5482	0.5170
期末基金资产净值	958,244,972.67	57,646,616.19
期末基金份额净值	2.7075	2.6714
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
基金份额累计净值增长率	170.75%	56.08%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

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

过去一个月	4.36%	0.62%	4.35%	0.62%	0.01%	0.00%
过去三个月	9.85%	1.84%	9.79%	1.84%	0.06%	0.00%
过去六个月	4.84%	1.48%	4.88%	1.48%	-0.04%	0.00%
过去一年	12.71%	1.20%	13.51%	1.21%	-0.80%	-0.01%
过去三年	69.49%	1.04%	70.47%	1.04%	-0.98%	0.00%
自基金合同生效起至今	170.75%	1.17%	181.02%	1.15%	-10.27%	0.02%

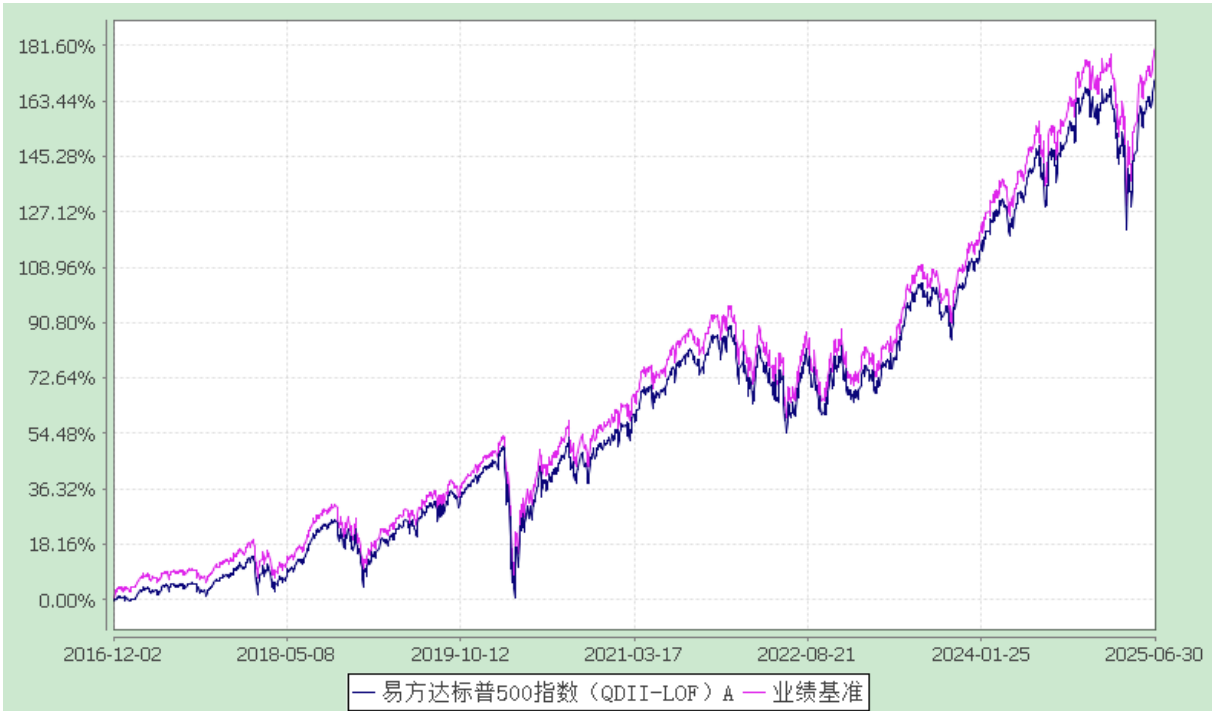
易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.32%	0.62%	4.35%	0.62%	-0.03%	0.00%
过去三个月	9.80%	1.83%	9.79%	1.84%	0.01%	-0.01%
过去六个月	4.72%	1.48%	4.88%	1.48%	-0.16%	0.00%
过去一年	12.39%	1.20%	13.51%	1.21%	-1.12%	-0.01%
过去三年	67.76%	1.04%	70.47%	1.04%	-2.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	56.08%	1.08%	57.98%	1.08%	-1.90%	0.00%

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

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）
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

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A
(2016 年 12 月 2 日至 2025 年 6 月 30 日)



易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

（2021 年 7 月 20 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：1.自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 170.75%，同期业绩比较基准收益率为 181.02%；C 类基金份额净值增长率为 56.08%，同期业绩比较基准收益率为 57.98%。

§ 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）及基金经理助理的简介

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		
PAN LINGDAN (潘令旦)	本基金的基金经理（报告期内已离职），易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）（自 2023 年 06 月 21 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）（自 2023 年 06 月 21 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达恒生国企 ETF 联接（QDII）（自 2023 年 06 月 21 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达恒生国企（QDII-ETF）（自 2023 年 06 月 21 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达恒生科技 ETF（QDII）（自 2023 年 06 月 21 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）（自 2023 年 06 月 21 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）（自 2023 年 09 月 23 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达恒生 ETF（QDII）（自 2024 年 04 月 10 日至 2025 年 04 月 10 日）、易方达中证港股通消费主题 ETF（自 2024 年 06 月	2023-09-23	2025-04-11	16 年	英国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任德意志银行（英国）量化业务分析师、估值分析师，德意志资产管理公司基金经理，瑞士银行联合集团伦敦分行资产管理部基金经理，贝莱德投资管理（英国）有限公司基金经理。

	08 日至 2025 年 04 月 10 日)、易方达黄金主题 (QDII-LOF-FOF) (自 2024 年 07 月 27 日至 2025 年 04 月 10 日)、易方达原油 (QDII-LOF-FOF) (自 2024 年 07 月 27 日至 2025 年 04 月 10 日)的基金经理, 易方达资产管理(香港)有限公司基金经理				
刘依姗	本基金的基金经理, 易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF) 的基金经理, 易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2025-04-11	-	7 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任领航投资香港有限公司项目经理高级助理, 易方达资产管理(香港)有限公司研究员、基金经理助理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，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相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪标普 500 指数，该指数由在美国交易所上市的总市值最大的 500 家美国公司组成，是美国大盘蓝筹公司股票表现的代表性指数。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

回顾 2025 年上半年，美国经济保持温和增长，但也呈现出阶段性放缓趋势。消费总体保持强劲，劳动力市场受关税政策引发的结构性调整影响，失业率呈温和上升态势，而通胀压力持续存在。货币政策方面，美联储在上半年的四议息会议上均选择暂停调整利率，将联邦基金利率目标区间维持在 4.25% 至 4.50% 之间。美联储主席鲍威尔承认关税为政策带来新的复杂性，对降息时点保持谨慎。利率点阵图显示多数官员仍预期年内降息两次，但内部分歧有所扩大。市场表现方面，宏观经济挑战与关税不确定性带来了显著波动，但部分关税暂缓及中美贸易关系出现缓和信号显著改善了市场

情绪与外贸预期。此外，上半年多数科技企业盈利端表现超预期，为市场提供了核心支撑。在以上因素综合影响下，标普 500 指数在报告期内经历急跌后震荡反弹并创下新高，其中通讯服务、公用事业、信息技术等板块的表现较为突出。

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。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 2.7075 元，本报告期份额净值增长率为 4.84%，同期业绩比较基准收益率为 4.88%；C 类基金份额净值为 2.6714 元，本报告期份额净值增长率为 4.72%，同期业绩比较基准收益率为 4.88%。年化跟踪误差 0.15%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，人工智能驱动的盈利增长有望继续为市场提供基本面支撑，但经济增速放缓和政策不确定因素可能形成制约。关税政策的调整或显著影响市场情绪与通胀路径，而美联储的利率路径决策预计将成为流动性环境变化的主导因素。短期来看，市场仍将集中关注美国通胀水平和美联储货币政策的发展。中长期来看，美国股市是全球资本市场的关键组成部分，也是美国家庭财富管理和海外投资者进行全球资产配置的重要组成部分。标普 500 指数的成份股公司大多是所在行业的全球领先企业。观察中长期趋势，标普 500 指数的表现持续且显著地超越美国 GDP 增速，未来仍将是分享美国股票投资机遇的重要途径。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C:本报告期内未实施利润分配。

4.9 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：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

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	61,968,970.52	75,049,336.70

结算备付金		6,899,650.67	7,068,583.68
存出保证金		1,118,994.98	1,990,278.62
交易性金融资产	6.4.7.2	952,271,922.28	881,050,982.16
其中：股票投资		952,271,922.28	881,050,982.16
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		-	-
应收股利		434,261.67	436,804.21
应收申购款		3,093,674.08	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,025,787,474.20	965,595,985.37
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		-	-
应付赎回款		8,787,849.65	1,309,914.33
应付管理人报酬		655,300.59	584,739.81
应付托管费		163,825.16	182,731.19
应付销售服务费		15,803.96	6,796.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	27,584.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	273,105.98	781,798.03
负债合计		9,895,885.34	2,893,564.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	375,507,620.07	372,912,487.81
未分配利润	6.4.7.8	640,383,968.79	589,789,933.45
净资产合计		1,015,891,588.86	962,702,421.26
负债和净资产总计		1,025,787,474.20	965,595,985.37

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.7075 元，C 类基金份额净值 2.6714 元；

基金份额总额 375,507,620.07 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 353,928,416.02 份，C 类基金份额总额 21,579,204.05 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		54,157,098.52	66,775,979.72
1.利息收入		222,515.28	158,446.04
其中：存款利息收入	6.4.7.9	222,515.28	158,446.04
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）		17,237,980.07	10,951,187.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	11,386,898.18	4,153,526.26
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	217,452.25	4,008,252.95
股利收益	6.4.7.15	5,633,629.64	2,789,408.15
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	37,687,970.14	55,983,090.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,134,451.83	-325,721.91
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	143,084.86	8,978.10
减：二、营业总支出		5,159,638.10	3,007,890.66
1. 管理人报酬		3,821,368.74	2,027,286.37
2. 托管费		989,871.10	633,527.05
3. 销售服务费		67,150.65	12,144.51
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,003.57	14,443.27
8. 其他费用	6.4.7.19	280,244.04	320,489.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		48,997,460.42	63,768,089.06

列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,997,460.42	63,768,089.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		48,997,460.42	63,768,089.06

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

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	372,912,487.81	589,789,933.45	962,702,421.26
二、本期期初净资产	372,912,487.81	589,789,933.45	962,702,421.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,595,132.26	50,594,035.34	53,189,167.60
（一）、综合收益总额	-	48,997,460.42	48,997,460.42
（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）	2,595,132.26	1,596,574.92	4,191,707.18
其中：1.基金申购款	75,896,356.14	113,727,175.78	189,623,531.92
2.基金赎回款	-73,301,223.88	-112,130,600.86	-185,431,824.74
（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	375,507,620.07	640,383,968.79	1,015,891,588.86
项目	上年度可比期间 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	208,465,872.97	230,417,308.26	438,883,181.23

产			
二、本期期初净资产	208,465,872.97	230,417,308.26	438,883,181.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,073,795.72	108,172,862.93	141,246,658.65
（一）、综合收益总额	-	63,768,089.06	63,768,089.06
（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）	33,073,795.72	44,404,773.87	77,478,569.59
其中：1.基金申购款	51,246,613.07	66,794,173.15	118,040,786.22
2.基金赎回款	-18,172,817.35	-22,389,399.28	-40,562,216.63
（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	241,539,668.69	338,590,171.19	580,129,839.88

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

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)(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[2016]2193 号《关于准予易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，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《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 693,199,312.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,037.35 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。自 2021 年 7 月 19 日起,本基金增设 C 类份额

类别,份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再

缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	61,968,970.52
等于：本金	61,933,758.94
加：应计利息	35,211.58
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	61,968,970.52

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		707,466,414.30	-	952,271,922.28	244,805,507.98
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		707,466,414.30	-	952,271,922.28	244,805,507.98

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

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	13,106,487.53	-	-	-
ESU5	13,106,487.53	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,106,487.53	-	-	-

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
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	6	13,430,428.43	323,940.90
合计	-	-	-	323,940.90
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	323,940.90
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

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,269.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他应付款	166,534.36
合计	273,105.98

6.4.7.7 实收基金

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

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	362,034,146.65	362,034,146.65
本期申购	53,305,747.42	53,305,747.42
本期赎回（以“-”号填列）	-61,411,478.05	-61,411,478.05
本期末	353,928,416.02	353,928,416.02

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

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	10,878,341.16	10,878,341.16
本期申购	22,590,608.72	22,590,608.72
本期赎回（以“-”号填列）	-11,889,745.83	-11,889,745.83
本期末	21,579,204.05	21,579,204.05

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,667,159.68	385,249,237.51	572,916,397.19
本期期初	187,667,159.68	385,249,237.51	572,916,397.19
本期利润	10,772,456.29	34,325,779.80	45,098,236.09
本期基金份额交易产生的变动数	-4,432,313.09	-9,265,763.54	-13,698,076.63
其中：基金申购款	27,907,358.77	52,529,433.29	80,436,792.06
基金赎回款	-32,339,671.86	-61,795,196.83	-94,134,868.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	194,007,302.88	410,309,253.77	604,316,556.65

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,351,701.96	11,521,834.30	16,873,536.26

本期期初	5,351,701.96	11,521,834.30	16,873,536.26
本期利润	537,033.99	3,362,190.34	3,899,224.33
本期基金份额交易产生的变动数	5,267,336.89	10,027,314.66	15,294,651.55
其中：基金申购款	11,178,040.08	22,112,343.64	33,290,383.72
基金赎回款	-5,910,703.19	-12,085,028.98	-17,995,732.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,156,072.84	24,911,339.30	36,067,412.14

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	149,912.55
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	71,321.08
其他	1,281.65
合计	222,515.28

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	11,386,898.18
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	11,386,898.18

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	49,083,688.93
减：卖出股票成本总额	37,690,338.26
减：交易费用	6,452.49
买卖股票差价收入	11,386,898.18

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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
期货投资收益	217,452.25

6.4.7.15 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	5,633,629.64
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,633,629.64

6.4.7.16 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	36,861,729.65
——股票投资	36,861,729.65
——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	826,240.49
——权证投资	-
——期货投资	826,240.49
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	37,687,970.14

6.4.7.17 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	143,084.86
合计	143,084.86

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	153,383.38
银行汇划费	38.03
指数数据费	42,520.07
合计	280,244.04

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
道富银行	境外托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,821,368.74	2,027,286.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	786,080.22	478,449.83
应支付基金管理人的净管理费	3,035,288.52	1,548,836.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	989,871.10	633,527.05

注：1.本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2.自 2025 年 1 月 27 日起本基金托管费年费率由 0.25%调整为 0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达标普500指数 (QDII-LOF) A	易方达标普500指数 (QDII-LOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,775.54	5,775.54
合计	-	5,775.54	5,775.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达标普500指数 (QDII-LOF) A	易方达标普500指数 (QDII-LOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	4,360.22	4,360.22
合计	-	4,360.22	4,360.22

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.35%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用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**易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A**

无。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
道富银行-活期存款	39,560,814.00	58,082.15	2,145,502.98	31,424.37
中国建设银行-活期存款	22,408,156.52	91,830.40	79,176,370.25	82,162.52

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和道富银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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，在报告期内投资于境外托管人道富银行发行的美股 STT。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有道富银行发行的美股 STT 758 股（2024 年 12 月 31 日:667 股），占本基金净值比例为 0.06%(2024 年 12 月 31 日:0.05%)。

6.4.11 利润分配情况

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

本报告期内未发生利润分配。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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。

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金在境内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；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。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	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、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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波

动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	61,968,970.52	-	-	-	61,968,970.52
结算备付金	6,899,650.67	-	-	-	6,899,650.67
存出保证金	1,118,994.98	-	-	-	1,118,994.98
交易性金融资产	-	-	-	952,271,922.28	952,271,922.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	434,261.67	434,261.67
应收申购款	172,816.95	-	-	2,920,857.13	3,093,674.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	70,160,433.12	-	-	955,627,041.08	1,025,787,474.20
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,787,849.65	8,787,849.65
应付管理人报酬	-	-	-	655,300.59	655,300.59
应付托管费	-	-	-	163,825.16	163,825.16

应付销售服务费	-	-	-	15,803.96	15,803.96
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	-	-	-	273,105.98	273,105.98
负债总计	-	-	-	9,895,885.34	9,895,885.34
利率敏感度缺口	70,160,433.12	-	-	945,731,155.74	1,015,891,588.86
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	75,049,336.70	-	-	-	75,049,336.70
结算备付金	7,068,583.68	-	-	-	7,068,583.68
存出保证金	1,990,278.62	-	-	-	1,990,278.62
交易性金融资产	-	-	-	881,050,982.16	881,050,982.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	436,804.21	436,804.21
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	84,108,199.00	-	-	881,487,786.37	965,595,985.37
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,309,914.33	1,309,914.33
应付管理人报酬	-	-	-	584,739.81	584,739.81

应付托管费	-	-	-	182,731.19	182,731.19
应付销售服务费	-	-	-	6,796.14	6,796.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	27,584.61	27,584.61
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	781,798.03	781,798.03
负债总计	-	-	-	2,893,564.11	2,893,564.11
利率敏感度缺口	84,108,199.00	-	-	878,594,222.26	962,702,421.26

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

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	40,442,132.51	-	-	40,442,132.51
结算备付金	6,899,650.67	-	-	6,899,650.67
存出保证金	1,118,994.98	-	-	1,118,994.98
交易性金融资产	952,271,922.28	-	-	952,271,922.28
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	434,261.67	-	-	434,261.67
应收申购款	34,502.81	-	-	34,502.81
其他资产	-	-	-	-

资产合计	1,001,201,464.92	-	-	1,001,201,464.92
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	253,584.82	-	-	253,584.82
其他负债	10.38	-	-	10.38
负债合计	253,595.20	-	-	253,595.20
资产负债表外汇风险敞口净额	1,000,947,869.72	-	-	1,000,947,869.72
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	835,870.75	-	-	835,870.75
结算备付金	7,068,583.68	-	-	7,068,583.68
存出保证金	1,990,278.62	-	-	1,990,278.62
交易性金融资产	881,050,982.16	-	-	881,050,982.16
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	436,804.21	-	-	436,804.21
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	891,382,519.42	-	-	891,382,519.42
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	58,190.74	-	-	58,190.74
其他负债	4.24	-	-	4.24
负债合计	58,194.98	-	-	58,194.98
资产负债表	891,324,324.44	-	-	891,324,324.44

外汇风险敞口净额				
----------	--	--	--	--

6.4.13.4.2 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-50,047,393.49	-44,566,216.22
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	50,047,393.49	44,566,216.22

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 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	952,271,922.28	93.74	881,050,982.16	91.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	952,271,922.28	93.74	881,050,982.16	91.52
----	----------------	-------	----------------	-------

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%	47,613,594.88	44,052,547.89
	2.业绩比较基准下降 5%	-47,613,594.88	-44,052,547.89

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	952,271,922.28
第二层次	-
第三层次	-
合计	952,271,922.28

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	952,271,922.28	92.83
	其中：普通股	934,196,627.86	91.07
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	18,075,294.42	1.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	68,868,621.19	6.71
8	其他各项资产	4,646,930.73	0.45
9	合计	1,025,787,474.20	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	952,271,922.28	93.74
合计	952,271,922.28	93.74

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	28,483,980.73	2.80
材料	18,027,764.43	1.77
工业	81,985,209.27	8.07
非必需消费品	98,697,876.60	9.72
必需消费品	52,404,334.58	5.16
保健	88,605,938.25	8.72
金融	133,594,045.27	13.15
信息技术	315,322,546.66	31.04
电信服务	92,789,951.18	9.13
公用事业	22,916,597.32	2.26
房地产	19,443,677.99	1.91
合计	952,271,922.28	93.74

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	61,775	69,866,735.14	6.88
2	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	18,837	67,074,021.54	6.60
3	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	37,849	55,589,960.33	5.47
4	Amazon.com Inc	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	23,932	37,585,810.38	3.70
5	Alphabet	-	GOOGL US	纳斯达	美国	14,632	18,459,147.06	1.82

	Inc			克证券 交易所				
			GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,803	14,988,205.43	1.48
6	Meta Platforms Inc	-	META US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,494	29,028,598.76	2.86
7	Broadcom Inc	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	11,874	23,430,585.30	2.31
8	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔 哈撒韦公 司	BRK/B US	纽约证 券交易 所	美国	4,611	16,034,444.13	1.58
9	Tesla Inc	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,045	16,020,336.17	1.58
10	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM US	纽约证 券交易 所	美国	6,987	14,500,468.54	1.43
11	Eli Lilly & Co	礼来	LLY US	纽约证 券交易 所	美国	1,978	11,037,919.36	1.09
12	Visa Inc	维萨公司	V US	纽约证 券交易 所	美国	4,302	10,934,225.32	1.08
13	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,070	10,257,336.74	1.01
14	Exxon Mobil Corp	埃克森美 孚石油公 司	XOM US	纽约证 券交易 所	美国	10,836	8,362,109.56	0.82
15	Mastercar d Inc	万事达股 份有限公 司	MA US	纽约证 券交易 所	美国	2,051	8,250,565.26	0.81
16	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,116	7,908,628.28	0.78
17	Walmart Inc	沃尔玛股 份有限公 司	WMT US	纽约证 券交易 所	美国	10,923	7,645,749.46	0.75
18	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG US	纽约证 券交易 所	美国	5,905	6,734,700.64	0.66

19	Johnson & Johnson	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	6,049	6,614,437.23	0.65
20	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	纽约证券交易所	美国	2,499	6,558,948.13	0.65
21	Oracle Corp	甲骨文	ORCL US	纽约证券交易所	美国	4,110	6,432,498.19	0.63
22	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV US	纽约证券交易所	美国	4,483	5,956,917.75	0.59
23	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC US	纽约证券交易所	美国	16,474	5,580,484.34	0.55
24	Palantir Technologies Inc	-	PLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	5,401	5,270,621.76	0.52
25	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH US	纽约证券交易所	美国	2,304	5,145,450.49	0.51
26	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	PM US	纽约证券交易所	美国	3,939	5,135,651.73	0.51
27	Cisco Systems Inc	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	10,089	5,010,839.75	0.49
28	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO US	纽约证券交易所	美国	9,808	4,967,467.08	0.49
29	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM US	纽约证券交易所	美国	2,343	4,944,226.97	0.49
30	General Electric Co	通用电气航空航天	GE US	纽约证券交易所	美国	2,681	4,939,882.06	0.49
31	Salesforce Inc	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	2,425	4,733,790.69	0.47
32	Wells Fargo &	富国银行	WFC US	纽约证券交易	美国	8,182	4,692,761.82	0.46

	Co			所				
33	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT US	纽约证券交易所	美国	4,368	4,252,864.70	0.42
34	Chevron Corp	雪佛龙	CVX US	纽约证券交易所	美国	4,124	4,227,264.69	0.42
35	Advanced Micro Devices Inc	美国超威半导体公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,116	4,181,054.78	0.41
36	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS US	纽约证券交易所	美国	4,552	4,040,983.31	0.40
37	Linde PLC	林德	LIN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,199	4,027,047.67	0.40
38	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	705	3,975,021.32	0.39
39	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS US	纽约证券交易所	美国	772	3,911,337.34	0.39
40	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	519	3,819,639.40	0.38
41	AT&T Inc	美国电话电报公司	T US	纽约证券交易所	美国	18,229	3,776,499.82	0.37
42	McDonald's Corp	麦当劳	MCD US	纽约证券交易所	美国	1,805	3,775,208.33	0.37
43	Merck & Co Inc	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	6,313	3,577,417.86	0.35
44	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER US	纽约证券交易所	美国	5,305	3,543,195.60	0.35
45	RTX Corp	-	RTX US	纽约证券交易所	美国	3,355	3,506,977.38	0.35
46	Intuitive Surgical	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券	美国	899	3,497,159.29	0.34

	Inc			交易所				
47	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,312	3,436,252.85	0.34
48	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN US	纽约证券交易所	美国	1,589	3,399,878.35	0.33
49	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	82	3,398,313.98	0.33
50	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT US	纽约证券交易所	美国	1,183	3,287,604.45	0.32
51	Verizon Communications Inc	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	10,600	3,283,377.79	0.32
52	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,454	3,264,795.21	0.32
53	American Express Co	美国运通	AXP US	纽约证券交易所	美国	1,410	3,219,664.82	0.32
54	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,809	3,202,480.89	0.32
55	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	纽约证券交易所	美国	3,143	3,169,276.72	0.31
56	S&P Global Inc	标普全球	SPGI US	纽约证券交易所	美国	800	3,019,726.56	0.30
57	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	1,066	2,952,307.43	0.29
58	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX US	纽约证券交易所	美国	3,783	2,908,768.47	0.29
59	Boeing Co/The	波音	BA US	纽约证券交易所	美国	1,925	2,887,387.31	0.28
60	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR US	纽约证券交易所	美国	1,504	2,873,157.37	0.28

61	Citigroup Inc	花旗集团	C US	纽约证券交易所	美国	4,696	2,861,460.79	0.28
62	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW US	纽约证券交易所	美国	4,328	2,826,836.07	0.28
63	BlackRock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK US	纽约证券交易所	美国	374	2,809,174.23	0.28
64	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	959	2,783,522.39	0.27
65	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,379	2,756,279.98	0.27
66	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,064	2,704,923.40	0.27
67	Honeywell International Inc	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,616	2,694,025.15	0.27
68	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	纽约证券交易所	美国	695	2,632,641.37	0.26
69	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	纽约证券交易所	美国	5,277	2,622,405.21	0.26
70	Eaton Corp PLC	伊顿公共有限公司	ETN US	纽约证券交易所	美国	996	2,545,326.42	0.25
71	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP US	纽约证券交易所	美国	1,535	2,528,222.81	0.25
72	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	2,855	2,523,864.29	0.25
73	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	14,543	2,523,566.28	0.25
74	Micron Technology	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克证券	美国	2,851	2,515,430.03	0.25

	y Inc	公司		交易所				
75	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	3,165	2,511,978.15	0.25
76	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF US	纽约证券交易所	美国	1,643	2,502,393.72	0.25
77	Stryker Corp	史赛克	SYK US	纽约证券交易所	美国	873	2,472,472.99	0.24
78	Palo Alto Networks Inc	-	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	1,682	2,464,022.19	0.24
79	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	9,578	2,447,087.38	0.24
80	Deere & Co	迪尔	DE US	纽约证券交易所	美国	650	2,366,049.73	0.23
81	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,034	2,282,774.46	0.22
82	CrowdStrike Holdings Inc	-	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	626	2,282,362.55	0.22
83	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW US	纽约证券交易所	美国	1,434	2,277,591.49	0.22
84	Danaher Corp	丹纳赫	DHR US	纽约证券交易所	美国	1,602	2,265,403.97	0.22
85	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,216	2,240,967.09	0.22
86	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,277	2,175,867.49	0.21
87	Amphenol Corp	安费诺公司	APH US	纽约证券交易所	美国	3,068	2,168,805.25	0.21
88	KLA Corp	-	KLAC US	纳斯达克	美国	335	2,148,101.86	0.21

				克证券 交易所				
89	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,218	2,077,430.59	0.20
90	ConocoPh illips	康菲石油	COP US	纽约证 券交易 所	美国	3,232	2,076,278.05	0.20
91	Vertex Pharmace uticals Inc	福泰制药	VRTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	651	2,074,742.68	0.20
92	Medtronic PLC	美敦力	MDT US	纽约证 券交易 所	美国	3,257	2,032,417.38	0.20
93	Blackston e Inc	黑石集团 股份有限 公司	BX US	纽约证 券交易 所	美国	1,879	2,012,001.99	0.20
94	Chubb Ltd	邱博保险 集团	CB US	纽约证 券交易 所	美国	964	1,999,325.97	0.20
95	Marsh & McLenna n Cos Inc	-	MMC US	纽约证 券交易 所	美国	1,248	1,953,315.07	0.19
96	Starbucks Corp	星巴克	SBUX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,915	1,912,072.44	0.19
97	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证 券交易 所	美国	2,602	1,905,695.34	0.19
98	Interconti nental Exchange Inc	洲际交易 所（ICE）	ICE US	纽约证 券交易 所	美国	1,447	1,900,472.93	0.19
99	American Tower Corp	美国发射 塔公司	AMT US	纽约证 券交易 所	美国	1,177	1,862,242.07	0.18
100	Constellat ion Energy Corpotati on	美国联合 能源公司	CEG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	803	1,855,339.32	0.18
101	Southern Co/The	南方公司	SO US	纽约证 券交易 所	美国	2,812	1,848,536.36	0.18

102	Altria Group Inc	高特利	MO US	纽约证券交易所	美国	4,350	1,825,732.92	0.18
103	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	925	1,825,074.33	0.18
104	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT US	纽约证券交易所	美国	542	1,796,965.23	0.18
105	Prologis Inc	安博	PLD US	纽约证券交易所	美国	2,379	1,790,226.12	0.18
106	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT US	纽约证券交易所	美国	565	1,769,152.42	0.17
107	Fiserv Inc	-	FI US	纽约证券交易所	美国	1,433	1,768,628.99	0.17
108	Intel Corp	英特尔	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	10,903	1,748,324.83	0.17
109	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMJ US	纽约证券交易所	美国	5,141	1,703,581.36	0.17
110	Welltower Inc	-	WELL US	纽约证券交易所	美国	1,535	1,689,254.57	0.17
111	KKR & Co Inc	-	KKR US	纽约证券交易所	美国	1,764	1,679,872.30	0.17
112	McKesson Corp	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	319	1,673,371.57	0.16
113	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK US	纽约证券交易所	美国	1,954	1,650,572.72	0.16
114	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH US	纽约证券交易所	美国	322	1,610,021.68	0.16
115	Mondelez International Inc	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	3,320	1,602,816.27	0.16
116	Cigna Corp	信诺集团	CI US	纽约证券交易所	美国	672	1,590,281.27	0.16

				所				
117	TransDig m Group Inc	-	TDG US	纽约证 券交易 所	美国	146	1,589,305.41	0.16
118	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证 券交易 所	美国	3,164	1,562,383.92	0.15
119	NIKE Inc	耐克公司	NKE US	纽约证 券交易 所	美国	3,061	1,556,662.20	0.15
120	Elevance Health Inc	-	ELV US	纽约证 券交易 所	美国	556	1,548,131.44	0.15
121	DoorDash Inc	-	DASH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	863	1,522,907.18	0.15
122	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	687	1,515,468.82	0.15
123	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉 格尔有限 公司	AJG US	纽约证 券交易 所	美国	654	1,498,713.61	0.15
124	3M Co	3M 公司	MMM US	纽约证 券交易 所	美国	1,367	1,489,791.14	0.15
125	Synopsys Inc	新思科技 公司	SNPS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	404	1,482,708.70	0.15
126	Waste Managem ent Inc	废品管理	WM US	纽约证 券交易 所	美国	900	1,474,227.77	0.15
127	Sherwin- Williams Co/The	宣伟公司	SHW US	纽约证 券交易 所	美国	595	1,462,496.25	0.14
128	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒 比国际游 轮有限公 司	RCL US	纽约证 券交易 所	美国	651	1,459,310.25	0.14
129	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	254	1,446,390.69	0.14
130	Moody's Corp	穆迪	MCO US	纽约证 券交易	美国	394	1,414,728.78	0.14

				所				
131	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR US	纽约证券交易所	美国	1,466	1,399,232.70	0.14
132	Aon PLC	怡安公共有限公司	AON US	纽约证券交易所	美国	545	1,391,876.66	0.14
133	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	2,150	1,387,189.93	0.14
134	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB US	纽约证券交易所	美国	3,070	1,380,369.21	0.14
135	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	864	1,378,457.73	0.14
136	Coinbase Global Inc	-	COIN US	纳斯达克证券交易所	美国	547	1,372,432.69	0.14
137	Howmet Aerospace Inc	-	HWM US	纽约证券交易所	美国	1,029	1,371,070.69	0.13
138	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	3,388	1,361,824.86	0.13
139	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	纽约证券交易所	美国	1,881	1,359,190.07	0.13
140	General Dynamics Corp	通用动力	GD US	纽约证券交易所	美国	647	1,350,856.60	0.13
141	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL US	纽约证券交易所	美国	2,044	1,330,065.02	0.13
142	PNC Financial Services Group Inc	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	995	1,327,833.68	0.13
143	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	纽约证券交易所	美国	436	1,312,318.56	0.13
144	Johnson	江森自控	JCI US	纽约证	美国	1,723	1,302,745.37	0.13

	Controls International plc	国际有限公司		券交易所				
145	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,445	1,300,806.39	0.13
146	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS US	纽约证券交易所	美国	1,160	1,295,005.06	0.13
147	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC US	纽约证券交易所	美国	356	1,274,179.83	0.13
148	Ecolab Inc	艺康集团	ECL US	纽约证券交易所	美国	659	1,271,087.89	0.13
149	US Bancorp	美国合众银行	USB US	纽约证券交易所	美国	3,917	1,268,820.69	0.12
150	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,636	1,238,136.57	0.12
151	HCA Healthcare Inc	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	451	1,236,849.31	0.12
152	Autodesk Inc	欧特克	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	545	1,207,767.85	0.12
153	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW US	纽约证券交易所	美国	677	1,198,265.53	0.12
154	Bank of New York Mellon Corp	纽约梅隆银行	BK US	纽约证券交易所	美国	1,822	1,188,344.92	0.12
155	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO US	纽约证券交易所	美国	1,167	1,185,194.21	0.12
156	Vistra Corp	-	VST US	纽约证券交易所	美国	853	1,183,459.25	0.12
157	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	1,373	1,175,617.72	0.12

158	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM US	纽约证券交易所	美国	2,799	1,167,351.04	0.11
159	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT US	纽约证券交易所	美国	608	1,159,225.89	0.11
160	Air Products & Chemicals Inc	空气产品公司	APD US	纽约证券交易所	美国	572	1,154,956.50	0.11
161	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	43	1,142,697.90	0.11
162	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	纽约证券交易所	美国	3,654	1,133,928.68	0.11
163	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,850	1,132,887.82	0.11
164	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV US	纽约证券交易所	美国	584	1,118,483.72	0.11
165	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	271	1,099,658.60	0.11
166	Marriott International Inc/MD	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	559	1,093,292.82	0.11
167	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR US	纽约证券交易所	美国	2,078	1,088,743.03	0.11
168	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC US	纽约证券交易所	美国	590	1,081,108.24	0.11
169	Axon Enterprise Inc	-	AXON US	纳斯达克证券交易所	美国	182	1,078,694.21	0.11
170	Truist Financial	-	TFC US	纽约证券交易	美国	3,435	1,057,115.12	0.10

	Corp			所				
171	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽约证券交易所	美国	4,970	1,046,000.31	0.10
172	American Electric Power Co Inc	美国电力	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,393	1,034,687.44	0.10
173	Quanta Services Inc	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	380	1,028,478.93	0.10
174	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	653	1,021,345.88	0.10
175	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	271	1,018,489.82	0.10
176	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,070	1,013,684.96	0.10
177	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL US	纽约证券交易所	美国	702	1,011,650.63	0.10
178	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR US	纽约证券交易所	美国	802	1,000,862.91	0.10
179	Workday Inc	-	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	563	967,270.03	0.10
180	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC US	纽约证券交易所	美国	812	965,561.42	0.10
181	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA US	纽约证券交易所	美国	1,767	942,748.32	0.09
182	Cencora Inc	-	COR US	纽约证券交易所	美国	439	942,316.23	0.09
183	Aflac Inc	家庭人寿保险	AFL US	纽约证券交易所	美国	1,236	933,113.20	0.09
184	Realty Income	-	O US	纽约证券交易所	美国	2,253	929,152.85	0.09

	Corp			所				
185	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	769	928,522.18	0.09
186	FedEx Corp	联邦快递	FDX US	纽约证券交易所	美国	568	924,261.74	0.09
187	Phillips 66	菲利浦 66	PSX US	纽约证券交易所	美国	1,079	921,488.64	0.09
188	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	3,050	917,016.66	0.09
189	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP US	纽约证券交易所	美国	240	916,982.30	0.09
190	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	1,555	908,674.39	0.09
191	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证券交易所	美国	2,235	904,290.10	0.09
192	PACCAR Inc	帕卡	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,324	900,977.39	0.09
193	American International Group Inc	美国国际集团	AIG US	纽约证券交易所	美国	1,464	896,999.50	0.09
194	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	1,653	896,598.97	0.09
195	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG US	纽约证券交易所	美国	507	895,048.85	0.09
196	Becton Dickinson and Co	碧迪	BDX US	纽约证券交易所	美国	724	892,741.85	0.09
197	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG US	纽约证券交易所	美国	775	891,882.82	0.09
198	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券	美国	853	888,220.33	0.09

				交易所				
199	General Motors Co	通用汽车公司	GM US	纽约证券交易所	美国	2,507	883,152.69	0.09
200	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢公众有限公司	SLB US	纽约证券交易所	美国	3,631	878,559.23	0.09
201	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI US	纽约证券交易所	美国	162	873,712.86	0.09
202	Public Storage	公共存储	PSA US	纽约证券交易所	美国	414	869,597.23	0.09
203	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW US	纽约证券交易所	美国	1,521	851,568.52	0.08
204	Cummins Inc	康明斯	CMI US	纽约证券交易所	美国	359	841,654.50	0.08
205	FAIR ISAAC CORP	费埃哲公司	FICO US	纽约证券交易所	美国	64	837,480.61	0.08
206	L3Harris Technologies Inc	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	466	836,779.06	0.08
207	MetLife Inc	大都会集团	MET US	纽约证券交易所	美国	1,440	829,000.24	0.08
208	Crown Castle International Corp	冠城股份有限公司	CCI US	纽约证券交易所	美国	1,117	821,445.13	0.08
209	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWV US	纽约证券交易所	美国	110	819,132.83	0.08
210	Keurig Dr Pepper Inc	-	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	3,449	816,251.78	0.08
211	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS US	纽约证券交易所	美国	1,392	811,232.02	0.08

212	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	363	809,455.12	0.08
213	Target Corp	塔吉特公司	TGT US	纽约证券交易所	美国	1,140	805,063.31	0.08
214	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI US	纽约证券交易所	美国	194	800,958.29	0.08
215	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB US	纳斯达克证券交易所	美国	867	800,142.78	0.08
216	Ford Motor Co	福特汽车	F US	纽约证券交易所	美国	10,208	792,863.63	0.08
217	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,250	790,363.13	0.08
218	Exelon Corp	-	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,538	788,877.43	0.08
219	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	819	788,090.13	0.08
220	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	205	787,085.92	0.08
221	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,733	777,102.68	0.08
222	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	838	765,340.53	0.08
223	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE US	纽约证券交易所	美国	760	762,327.90	0.08
224	Yum! Brands Inc	百胜餐饮集团	YUM US	纽约证券交易所	美国	715	758,444.36	0.07
225	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME US	纽约证券交易所	美国	584	756,525.43	0.07
226	Kroger Co/The	克罗格公司	KR US	纽约证券交易所	美国	1,471	755,338.46	0.07

				所				
227	Corning Inc	康宁公司	GLW US	纽约证券交易所	美国	1,974	743,153.31	0.07
228	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG US	纽约证券交易所	美国	1,233	743,019.30	0.07
229	Kenvue Inc	-	KVUE US	纽约证券交易所	美国	4,930	738,659.43	0.07
230	Take-Two Interactive Software Inc	-	TTWO US	纳斯达克证券交易所	美国	420	730,155.72	0.07
231	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH US	纽约证券交易所	美国	606	728,802.75	0.07
232	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	249	728,700.31	0.07
233	Baker Hughes Company	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,636	723,478.47	0.07
234	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,474	718,575.97	0.07
235	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技解决方案公司	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,270	709,403.66	0.07
236	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU US	纽约证券交易所	美国	919	706,821.27	0.07
237	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD US	纽约证券交易所	美国	381	703,676.06	0.07
238	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS US	纽约证券交易所	美国	989	701,047.28	0.07
239	Hess Corp	赫斯公司	HES US	纽约证	美国	698	692,243.21	0.07

				券交易 所				
240	Sysco Corp	-	SY Y US	纽约证 券交易 所	美国	1,274	690,753.07	0.07
241	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔 自动化	ROK US	纽约证 券交易 所	美国	290	689,582.93	0.07
242	Microchip Technology Inc	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,367	688,627.18	0.07
243	Targa Resources Corp	-	TRGP US	纽约证 券交易 所	美国	551	686,639.17	0.07
244	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	591	675,648.00	0.07
245	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统 有限公司	MPWR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	128	670,164.08	0.07
246	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动 公司	WAB US	纽约证 券交易 所	美国	447	669,897.85	0.07
247	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证 券交易 所	美国	1,119	665,830.55	0.07
248	Hartford Insurance Group Inc/T	哈特福德 保险集团 股份有限 公司	HIG US	纽约证 券交易 所	美国	732	664,810.88	0.07
249	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,230	655,626.11	0.06
250	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A US	纽约证 券交易 所	美国	763	644,572.01	0.06
251	EQT Corp	-	EQT US	纽约证 券交易 所	美国	1,542	643,768.89	0.06
252	Nasdaq Inc	纳斯达克 股份有限	NDAQ US	纳斯达 克证券	美国	1,004	642,682.50	0.06

		公司		交易所				
253	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED US	纽约证券交易所	美国	891	640,063.67	0.06
254	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI US	纽约证券交易所	美国	693	639,560.49	0.06
255	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克证券交易所	美国	980	638,754.72	0.06
256	VICI Properties Inc	-	VICI US	纽约证券交易所	美国	2,706	631,500.19	0.06
257	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	160	628,765.61	0.06
258	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN US	纽约证券交易所	美国	413	617,081.06	0.06
259	DexCom Inc	-	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	986	616,125.96	0.06
260	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL US	纽约证券交易所	美国	697	611,718.12	0.06
261	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	327	610,543.68	0.06
262	CoStar Group Inc	-	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,053	606,055.67	0.06
263	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	808	602,708.30	0.06
264	GE Healthcare Technologies Inc	-	GEHC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,131	599,698.61	0.06
265	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL US	纽约证券交易所	美国	1,666	586,531.87	0.06
266	Gartner	-	IT US	纽约证	美国	202	584,517.16	0.06

	Inc			券交易 所				
267	Ingersoll-Rand Inc.	英格索兰股份有限公司	IR US	纽约证 券交易 所	美国	978	582,352.40	0.06
268	State Street Corp	道富集团	STT US	纽约证 券交易 所	美国	758	577,024.11	0.06
269	Extra Space Storage Inc	-	EXR US	纽约证 券交易 所	美国	545	575,227.87	0.06
270	Seagate Technology Holdings PLC	-	STX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	553	571,360.01	0.06
271	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WTW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	260	570,468.83	0.06
272	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证 券交易 所	美国	492	565,567.77	0.06
273	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM US	纽约证 券交易 所	美国	768	563,909.84	0.06
274	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG US	纽约证 券交易 所	美国	5,621	560,924.56	0.06
275	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证 券交易 所	美国	301	558,874.55	0.06
276	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证 券交易 所	美国	402	558,256.12	0.05
277	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	222	558,162.06	0.05
278	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL US	纽约证 券交易 所	美国	601	556,547.93	0.05
279	AvalonBay	-	AVB US	纽约证 券交易	美国	380	553,574.54	0.05

	Communi ties Inc			所				
280	Old Dominion Freight Line Inc	-	ODFL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	471	547,227.01	0.05
281	Nucor Corp	纽柯公司	NUE US	纽约证 券交易 所	美国	588	545,267.13	0.05
282	Broadridg e Financial Solutions Inc	布罗德里 奇金融解 决方案股 份有限公 司	BR US	纽约证 券交易 所	美国	308	535,844.40	0.05
283	DuPont De Nemours Inc.	杜邦公司	DD US	纽约证 券交易 所	美国	1,083	531,762.07	0.05
284	Humana Inc	-	HUM US	纽约证 券交易 所	美国	302	528,540.63	0.05
285	Tractor Supply Co	拖拉机供 应公司	TSCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,370	517,530.27	0.05
286	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证 券交易 所	美国	545	516,784.35	0.05
287	General Mills Inc	通用磨坊	GIS US	纽约证 券交易 所	美国	1,374	509,598.83	0.05
288	Occidenta l Petroleum Corp	西方石油	OXY US	纽约证 券交易 所	美国	1,682	505,832.55	0.05
289	Keysight Technolog ies Inc	是德科技 公司	KEYS US	纽约证 券交易 所	美国	430	504,393.52	0.05
290	American Water Works Co Inc	美国自来 水股份有 限公司	AWK US	纽约证 券交易 所	美国	506	503,891.42	0.05
291	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,693	498,475.44	0.05

292	Dollar General Corp	达乐公司	DG US	纽约证券交易所	美国	608	497,830.81	0.05
293	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF US	纽约证券交易所	美国	1,034	494,008.97	0.05
294	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	606	493,460.19	0.05
295	Brown & Brown Inc	-	BRO US	纽约证券交易所	美国	620	492,077.87	0.05
296	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV US	纽约证券交易所	美国	435	490,733.84	0.05
297	Diamondback Energy Inc	-	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	497	488,845.05	0.05
298	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL US	纽约证券交易所	美国	2,423	487,749.49	0.05
299	Constellation Brands Inc	星座品牌股份有限公司	STZ US	纽约证券交易所	美国	416	484,457.40	0.05
300	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股股份有限公司	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	845	481,683.22	0.05
301	Lululemon Athletica Inc	露露乐蒙公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	283	481,309.47	0.05
302	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	438	480,886.54	0.05
303	Lennar Corp	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	605	479,046.71	0.05
304	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证券交易所	美国	1,059	478,737.46	0.05

305	Ameren Corp	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	696	478,508.31	0.05
306	SBA Communications Corp	-	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	284	477,439.68	0.05
307	Teledyne Technologies Inc	-	TDY US	纽约证券交易所	美国	130	476,764.91	0.05
308	GoDaddy Inc	-	GDDY US	纽约证券交易所	美国	369	475,632.70	0.05
309	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	1,218	473,276.81	0.05
310	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	111	471,073.39	0.05
311	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	1,241	468,888.16	0.05
312	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证券交易所	美国	422	465,555.40	0.05
313	Hershey Co/The	好时公司	HSY US	纽约证券交易所	美国	382	453,804.41	0.04
314	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	425	453,074.95	0.04
315	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI US	纽约证券交易所	美国	290	452,504.41	0.04
316	Corpay Inc	-	CPAY US	纽约证券交易所	美国	190	451,319.66	0.04
317	Expand Energy Corp	-	EXE US	纳斯达克证券交易所	美国	535	447,862.78	0.04
318	Super Micro Computer Inc	-	SMCI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,272	446,272.28	0.04

319	Church & Dwight Co Inc	切迟杜威股份有限公司	CHD US	纽约证券交易所	美国	647	445,144.44	0.04
320	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	348	444,902.12	0.04
321	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	5,414	444,151.33	0.04
322	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE US	纽约证券交易所	美国	3,030	443,571.91	0.04
323	International Paper Co	国际纸业	IP US	纽约证券交易所	美国	1,315	440,836.97	0.04
324	Eversource Energy	-	ES US	纽约证券交易所	美国	962	438,123.79	0.04
325	PPL Corp	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	1,790	434,262.87	0.04
326	Dover Corp	都福	DOV US	纽约证券交易所	美国	330	432,851.19	0.04
327	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	209	432,087.37	0.04
328	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	475	431,128.47	0.04
329	WR Berkley Corp	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	816	429,168.95	0.04
330	Cboe Global Markets Inc	-	CBOE US	巴兹全球市场	美国	256	427,381.02	0.04
331	Jabil Inc	捷普集团	JBL US	纽约证券交易所	美国	273	426,232.35	0.04
332	Ulta Beauty	-	ULTA US	纳斯达克证券	美国	127	425,314.90	0.04

	Inc			交易所				
333	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	纽约证券交易所	美国	246	423,031.17	0.04
334	NVR Inc	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	8	422,967.89	0.04
335	Veralto Corp	-	VLTO US	纽约证券交易所	美国	577	416,975.21	0.04
336	PulteGroup Inc	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	552	416,730.17	0.04
337	Kellanova	-	K US	纽约证券交易所	美国	730	415,606.12	0.04
338	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,239	413,845.68	0.04
339	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD US	纽约证券交易所	美国	49	412,058.18	0.04
340	Live Nation Entertainment Inc	-	LYV US	纽约证券交易所	美国	380	411,522.14	0.04
341	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP US	纽约证券交易所	美国	1,564	411,342.89	0.04
342	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN US	纽约证券交易所	美国	1,786	406,699.11	0.04
343	Huntington Bancshares Inc/OH	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,389	406,605.90	0.04
344	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	815	404,197.46	0.04
345	Laboratory Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证券交易所	美国	215	404,028.88	0.04

346	HP Inc	惠普	HPQ US	纽约证 券交易 所	美国	2,307	403,954.21	0.04
347	Equity Residential	公寓物业 权益信托	EQR US	纽约证 券交易 所	美国	828	400,034.88	0.04
348	Smurfit WestRock PLC	斯墨菲 特·韦斯特 罗克集团	SW US	纽约证 券交易 所	美国	1,283	396,310.48	0.04
349	Hubbell Inc	哈贝尔公 司	HUBB US	纽约证 券交易 所	美国	131	382,997.34	0.04
350	Amcor PLC	安姆科公 共有限公 司	AMCR US	纽约证 券交易 所	美国	5,818	382,751.87	0.04
351	ON Semicond uctor Corp	安森美半 导体公司	ON US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,016	381,185.14	0.04
352	Edison Internatio nal	爱迪生国 际	EIX US	纽约证 券交易 所	美国	1,030	380,465.27	0.04
353	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证 券交易 所	美国	2,250	378,833.11	0.04
354	PTC Inc	-	PTC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	307	378,749.93	0.04
355	Texas Pacific Land Corp	德克萨斯 州太平洋 土地公司	TPL US	纽约证 券交易 所	美国	50	378,113.67	0.04
356	NetApp Inc	美国网域 存储技术 有限公司	NTAP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	487	371,458.68	0.04
357	Western Digital Corp	西部数据 公司	WDC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	806	369,211.52	0.04
358	Weyerhae user Co	惠好	WY US	纽约证 券交易 所	美国	2,004	368,544.49	0.04
359	Trimble Inc	天宝股份 有限公司	TRMB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	676	367,683.45	0.04

360	Williams-Sonoma Inc	-	WSM US	纽约证券交易所	美国	313	366,053.65	0.04
361	Coterra Energy Inc	-	CTRA US	纽约证券交易所	美国	2,005	364,278.96	0.04
362	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN US	纽约证券交易所	美国	635	363,838.71	0.04
363	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH US	纽约证券交易所	美国	1,549	363,708.42	0.04
364	Leidos Holdings Inc	-	LDOS US	纽约证券交易所	美国	319	360,259.69	0.04
365	Waters Corp	沃特世公司	WAT US	纽约证券交易所	美国	144	359,803.84	0.04
366	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF US	纽约证券交易所	美国	683	359,609.77	0.04
367	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	518	357,836.94	0.04
368	Insulet Corp	-	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	159	357,605.14	0.04
369	FirstEnergy Corp	第一能源	FE US	纽约证券交易所	美国	1,230	354,492.44	0.03
370	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证券交易所	美国	560	352,014.13	0.03
371	NiSource Inc	-	NI US	纽约证券交易所	美国	1,206	348,266.18	0.03
372	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS US	纽约证券交易所	美国	171	346,915.78	0.03
373	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV US	纽约证券交易所	美国	1,477	342,996.30	0.03

374	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL US	纽约证券交易所	美国	2,335	340,658.45	0.03
375	Expedia Group Inc	亿客行集团股份有限公司	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	282	340,518.57	0.03
376	Molina Healthcare Inc	-	MOH US	纽约证券交易所	美国	159	339,074.96	0.03
377	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC US	纽约证券交易所	美国	616	334,343.27	0.03
378	Quest Diagnostics Inc	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	259	333,047.92	0.03
379	Jacobs Solutions Inc	嘉科解决方案股份有限公司	J US	纽约证券交易所	美国	353	332,172.28	0.03
380	Fortive Corp	福迪威公司	FTV US	纽约证券交易所	美国	890	332,128.26	0.03
381	Genuine Parts Co	原配部件	GPC US	纽约证券交易所	美国	382	331,732.53	0.03
382	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团股份有限公司	CFG US	纽约证券交易所	美国	1,016	325,472.91	0.03
383	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	353	317,364.15	0.03
384	Dow Inc	陶氏公司	DOW US	纽约证券交易所	美国	1,667	315,996.07	0.03
385	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	143	315,661.90	0.03
386	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	553	314,440.00	0.03
387	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克证券交易所	美国	265	314,034.18	0.03
388	Ball Corp	波尔	BALL US	纽约证	美国	781	313,591.71	0.03

				券交易 所				
389	Snap-on Inc	实耐宝	SNA US	纽约证 券交易 所	美国	140	311,865.84	0.03
390	Estee Lauder Cos Inc	雅诗兰黛	EL US	纽约证 券交易 所	美国	534	308,873.55	0.03
391	Aptiv PLC	安波福公 共有限公 司	APTV US	纽约证 券交易 所	美国	632	308,643.33	0.03
392	Lennox Internatio nal Inc	雷诺士国 际有限公 司	LII US	纽约证 券交易 所	美国	75	307,769.69	0.03
393	Dollar Tree Inc	美元树公 司	DLTR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	434	307,700.68	0.03
394	LyondellB asell Industries NV	利安德巴 塞尔工业 公司	LYB US	纽约证 券交易 所	美国	738	305,677.09	0.03
395	F5 Inc	-	FFIV US	纳斯达 克证券 交易所	美国	143	301,289.44	0.03
396	Tyson Foods Inc	泰森食品 公司	TSN US	纽约证 券交易 所	美国	752	301,139.97	0.03
397	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈邦美 控股股份 有限公司	ZBH US	纽约证 券交易 所	美国	461	301,003.45	0.03
398	Steel Dynamics Inc	-	STLD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	325	297,821.03	0.03
399	Domino's Pizza Inc	达美乐披 萨公司	DPZ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	92	296,761.19	0.03
400	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证 券交易 所	美国	716	289,183.96	0.03
401	Gen Digital Inc	-	GEN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,374	289,175.94	0.03
402	Packaging	美国包装	PKG US	纽约证	美国	214	288,694.17	0.03

	Corp of America	公司		券交易所				
403	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	271	287,136.53	0.03
404	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达克证券交易所	美国	444	285,803.38	0.03
405	FactSet Research Systems Inc	-	FDS US	纽约证券交易所	美国	89	284,968.98	0.03
406	Baxter International Inc	百特	BAX US	纽约证券交易所	美国	1,308	283,525.23	0.03
407	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	385	282,937.22	0.03
408	Loews Corp	罗斯公司	L US	纽约证券交易所	美国	429	281,491.47	0.03
409	Builders FirstSource Inc	-	BLDR US	纽约证券交易所	美国	333	278,167.23	0.03
410	CF Industries Holdings Inc	-	CF US	纽约证券交易所	美国	421	277,266.90	0.03
411	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纽约证券交易所	美国	339	277,257.95	0.03
412	Evergy Inc	-	EVERG US	纳斯达克证券交易所	美国	557	274,847.36	0.03
413	KeyCorp	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	2,183	272,226.24	0.03
414	Avery	艾利丹尼	AVY US	纽约证	美国	207	260,016.75	0.03

	Dennison Corp	森		券交易所				
415	IDEX Corp	艺达思集团	IEX US	纽约证券交易所	美国	206	258,908.09	0.03
416	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX US	纽约证券交易所	美国	301	258,719.46	0.03
417	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	554	258,415.72	0.03
418	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST US	纽约证券交易所	美国	164	256,873.48	0.03
419	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	593	256,698.16	0.03
420	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK US	纽约证券交易所	美国	345	254,553.73	0.03
421	Textron Inc	德事隆	TXT US	纽约证券交易所	美国	442	254,045.69	0.03
422	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO US	纳斯达克证券交易所	美国	486	247,571.30	0.02
423	Best Buy Co Inc	百思买	BBY US	纽约证券交易所	美国	513	246,525.65	0.02
424	Fox Corp	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	424	170,095.21	0.02
			FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	205	75,767.70	0.01
425	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	475	244,620.10	0.02
426	Revvity Inc	-	RVTY US	纽约证券交易所	美国	353	244,410.07	0.02
427	Jack	-	JKHY US	纳斯达克	美国	189	243,765.58	0.02

	Henry & Associates Inc			克证券交易所				
428	Juniper Networks Inc	瞻博网络股份有限公司	JNPR US	纽约证券交易所	美国	849	242,680.62	0.02
429	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	489	238,387.82	0.02
430	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL US	纽约证券交易所	美国	121	237,578.76	0.02
431	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙公司	LVS US	纽约证券交易所	美国	761	237,029.19	0.02
432	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	1,563	235,190.51	0.02
433	News Corp	新闻集团	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	884	188,074.18	0.02
			NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	180	44,210.08	0.00
434	Everest Group Ltd	-	EG US	纽约证券交易所	美国	95	231,120.77	0.02
435	Globe Life Inc	-	GL US	纽约证券交易所	美国	255	226,884.31	0.02
436	UDR Inc	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	771	225,352.23	0.02
437	Allegion PLC	安朗杰公共有限公司	ALLE US	纽约证券交易所	美国	217	223,878.34	0.02
438	Regency Centers Corp	-	REG US	纳斯达克证券交易所	美国	436	222,319.49	0.02
439	Solventum Corp	-	SOLV US	纽约证券交易所	美国	409	222,049.46	0.02
440	Pinnacle West	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	346	221,606.06	0.02

	Capital Corp			所				
441	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	163	220,920.05	0.02
442	TKO Group Holdings Inc	-	TKO US	纽约证券交易所	美国	169	220,123.73	0.02
443	Masco Corp	马斯可	MAS US	纽约证券交易所	美国	474	218,384.83	0.02
444	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	167	216,562.33	0.02
445	Camden Property Trust	-	CPT US	纽约证券交易所	美国	266	214,582.90	0.02
446	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	207	212,790.82	0.02
447	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	397	211,783.17	0.02
448	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	808	211,005.75	0.02
449	Paycom Software Inc	-	PAYC US	纽约证券交易所	美国	127	210,375.51	0.02
450	Healthpeak Properties Inc	-	DOC US	纽约证券交易所	美国	1,671	209,454.98	0.02
451	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW US	纳斯达克证券交易所	美国	301	206,747.17	0.02
452	Bunge Global SA	-	BG US	纽约证券交易所	美国	355	204,015.80	0.02
453	Conagra	康尼格拉	CAG US	纽约证	美国	1,392	203,978.87	0.02

	Brands Inc	品牌股份有限公司		券交易所				
454	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ US	纽约证券交易所	美国	143	202,166.52	0.02
455	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	383	200,284.38	0.02
456	JM Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	279	196,129.89	0.02
457	Nordson Corp	诺信公司	NDSN US	纳斯达克证券交易所	美国	127	194,892.81	0.02
458	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	112	193,593.74	0.02
459	Pool Corp	-	POOL US	纳斯达克证券交易所	美国	92	191,966.16	0.02
460	MarketAxess Holdings Inc	-	MKTX US	纳斯达克证券交易所	美国	119	190,257.41	0.02
461	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	332	189,562.02	0.02
462	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,692	186,045.71	0.02
463	BXP Inc	波士顿地产公司	BXP US	纽约证券交易所	美国	384	185,468.44	0.02
464	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL US	纽约证券交易所	美国	850	184,065.50	0.02
465	Paramount Global	派拉蒙全球	PARA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,949	179,982.24	0.02
466	Viatis Inc	晖致	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,815	179,952.53	0.02

467	EPAM Systems Inc	-	EPAM US	纽约证券交易所	美国	138	174,678.14	0.02
468	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	纽约证券交易所	美国	499	171,784.28	0.02
469	Alexandria Real Estate Equities Inc	亚历山大房地产股份有限公司	ARE US	纽约证券交易所	美国	330	171,576.61	0.02
470	Interpublic Group of Cos Inc	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	968	169,634.77	0.02
471	CarMax Inc	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	351	168,876.46	0.02
472	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	纽约证券交易所	美国	1,161	168,549.81	0.02
473	LKQ Corp	-	LKQ US	纳斯达克证券交易所	美国	635	168,236.76	0.02
474	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE US	纳斯达克证券交易所	美国	67	166,329.57	0.02
475	Hasbro Inc	孩之宝	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	313	165,404.18	0.02
476	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK US	纽约证券交易所	美国	338	163,928.36	0.02
477	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN US	纽约证券交易所	美国	305	163,010.63	0.02
478	Dayforce Inc	-	DAY US	纽约证券交易所	美国	402	159,398.97	0.02
479	Walgreens Boots	沃博联股份有限公司	WBA US	纳斯达克证券	美国	1,812	148,911.48	0.01

	Alliance Inc	司		交易所				
480	Match Group Inc	-	MTCH US	纳斯达克证券交易所	美国	672	148,598.79	0.01
481	AES Corp	爱伊斯公司	AES US	纽约证券交易所	美国	1,940	146,098.44	0.01
482	Lamb Weston Holdings Inc	蓝威斯顿控股股份有限公司	LW US	纽约证券交易所	美国	373	138,447.68	0.01
483	Bio-Technologie Corp	-	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	370	136,274.69	0.01
484	Charles River Laboratories International Inc	查理斯河实验室国际有限公司	CRL US	纽约证券交易所	美国	125	135,771.80	0.01
485	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	677	133,711.41	0.01
486	Ralliant Corp	-	RAL US	纽约证券交易所	美国	296	102,747.67	0.01
487	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	151	101,252.46	0.01
488	Generac Holdings Inc	-	GNRC US	纽约证券交易所	美国	97	99,442.76	0.01
489	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN US	纽约证券交易所	美国	542	92,537.07	0.01
490	AO Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	194	91,061.54	0.01
491	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ US	纽约证券交易所	美国	797	89,974.22	0.01
492	MGM Resorts	美高梅国际酒店集	MGM US	纽约证券交易	美国	356	87,641.59	0.01

	International	团		所				
493	DaVita Inc	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	84	85,658.38	0.01
494	Campbell Soup Co	金宝汤公司	CPB US	纳斯达克证券交易所	美国	366	80,304.46	0.01
495	Enphase Energy Inc	-	ENPH US	纳斯达克证券交易所	美国	281	79,758.62	0.01
496	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B US	纽约证券交易所	美国	404	77,825.72	0.01
497	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT US	纽约证券交易所	美国	114	77,519.48	0.01
498	Apa Corp	-	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	577	75,547.07	0.01
499	Caesars Entertainment Inc	凯撒娱乐集团	CZR US	纳斯达克证券交易所	美国	335	68,082.94	0.01
500	Mohawk Industries Inc	-	MHK US	纽约证券交易所	美国	83	62,292.13	0.01
501	Albemarle Corp	雅保公司	ALB US	纽约证券交易所	美国	102	45,760.21	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Apple Inc	AAPL US	4,490,748.80	0.47
2	Microsoft Corp	MSFT US	4,147,186.09	0.43
3	NVIDIA Corp	NVDA US	4,020,575.42	0.42
4	Alphabet Inc	GOOGL US	1,685,880.86	0.18
		GOOG US	1,392,049.75	0.14

5	Amazon.com Inc	AMZN US	2,966,162.63	0.31
6	Meta Platforms Inc	META US	2,101,807.66	0.22
7	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	1,743,827.57	0.18
8	Broadcom Inc	AVGO US	1,715,898.90	0.18
9	Tesla Inc	TSLA US	1,435,055.66	0.15
10	JPMorgan Chase & Co	JPM US	1,217,130.43	0.13
11	DoorDash Inc	DASH US	1,180,488.31	0.12
12	Eli Lilly & Co	LLY US	1,164,092.29	0.12
13	Coinbase Global Inc	COIN US	1,048,522.39	0.11
14	Visa Inc	V US	1,040,466.82	0.11
15	Exxon Mobil Corp	XOM US	864,210.94	0.09
16	UnitedHealth Group Inc	UNH US	803,833.71	0.08
17	Costco Wholesale Corp	COST US	753,401.79	0.08
18	Mastercard Inc	MA US	682,691.51	0.07
19	Netflix Inc	NFLX US	646,629.49	0.07
20	Walmart Inc	WMT US	607,203.74	0.06

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	NVIDIA Corp	NVDA US	3,556,832.96	0.37
2	Apple Inc	AAPL US	3,499,526.58	0.36
3	Microsoft Corp	MSFT US	3,289,035.95	0.34
4	Alphabet Inc	GOOGL US	1,496,440.29	0.16
		GOOG US	1,362,239.67	0.14
5	Amazon.com Inc	AMZN US	2,003,276.16	0.21
6	Meta Platforms Inc	META US	1,831,425.72	0.19
7	Broadcom Inc	AVGO US	1,498,698.94	0.16
8	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	1,471,948.87	0.15
9	Tesla Inc	TSLA US	1,346,483.99	0.14
10	JPMorgan Chase & Co	JPM US	1,243,184.32	0.13
11	Visa Inc	V US	1,012,299.22	0.11
12	Eli Lilly & Co	LLY US	919,753.66	0.10
13	Exxon Mobil Corp	XOM US	878,386.61	0.09
14	Netflix Inc	NFLX US	677,273.70	0.07
15	Costco Wholesale Corp	COST US	637,695.45	0.07
16	Mastercard Inc	MA US	624,976.28	0.06

17	UnitedHealth Group Inc	UNH US	540,781.38	0.06
18	Walmart Inc	WMT US	510,166.89	0.05
19	Procter & Gamble Co/The	PG US	496,570.53	0.05
20	General Electric Co	GE US	469,435.64	0.05

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	71,469,125.91
卖出收入（成交）总额	49,083,688.93

注：“买入成本”或“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Sep25	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”适用于金融资产与金融负债相抵销的情形，故将“其他衍生工具期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为 323,940.90 元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，META（Facebook）在报告编制日前一年内曾受到欧盟委员会（EC）、土耳其政府、意大利政府、印度竞争委员会（CCI）、韩国个人信息保护委员

会（PIPC）、韩国公平贸易委员会（KFTC）、台湾地区数字事务部（MODA）的处罚。博通公司在本报告期内被美国国际贸易委员会（USITC）调查。谷歌在本报告期内被中国国家市场监督管理总局、英国竞争与市场管理局（CMA）调查。谷歌在报告编制日前一年内曾受到印度竞争委员会（CCI）、美国证券交易委员会（SEC）的处罚。苹果公司在本报告期内被美国国际贸易委员会（USITC）、英国竞争与市场管理局（CMA）调查。苹果公司在报告编制日前一年内曾受到欧盟委员会（EC）、法国竞争管理局（FCA）的处罚。特斯拉公司在本报告期内被美国国家公路交通安全管理局（NHTSA）调查。特斯拉公司在报告编制日前一年内曾受到美国职业安全与健康管理局（OSHA）的处罚。微软在本报告期内被法国反垄断机构调查。亚马逊公司在报告编制日前一年内曾受到卢森堡国家数据保护委员会（CNPD）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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	1,118,994.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	434,261.67
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,093,674.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,646,930.73

7.11.4 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。

7.11.5 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达标普 500 指数(QDII-LOF) A	194,150	1,822.96	74,510,798.95	21.05%	279,417,617.07	78.95%
易方达标普 500 指数(QDII-LOF) C	64,052	336.90	4,707.33	0.02%	21,574,496.72	99.98%
合计	258,202	1,454.32	74,515,506.28	19.84%	300,992,113.79	80.16%

注：本基金 A 类份额包含 A 类人民币份额及 A 类美元份额；本基金 C 类份额包含 C 类人民币份额及 C 类美元份额。下同。

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	上海浦东发展银行股份有限公司－兴证全球积极配置混合型基金中基金（FOF－LOF）	16,117,017.00	9.20%
2	招商银行股份有限公司－兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	13,912,075.00	7.94%
3	杨巧伟	6,744,915.00	3.85%
4	中欧基金－浦发银行－中欧基金智赢 1 号集合资产管理计划	3,886,732.00	2.22%
5	林晓辉	3,347,523.00	1.91%

6	招商银行股份有限公司－兴证全球优选积极三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	3,328,054.00	1.90%
7	唐廉	2,994,063.00	1.71%
8	工银理财有限责任公司－工银理财恒睿睿盈私银尊享 120 天持盈混合类开放式理财产品	2,673,157.00	1.53%
9	上海宁苑资产管理有限公司－宁苑沛华稳定增长一号私募证券投资基金	2,332,271.00	1.33%
10	马国芳	2,223,400.00	1.27%

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	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	605,255.57	0.1710%
	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C	7,087.55	0.0328%
	合计	612,343.12	0.1631%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	0~10
	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	0
	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C
基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	693,199,312.42	-
本报告期期初基金份额总额	362,034,146.65	10,878,341.16
本报告期基金总申购份额	53,305,747.42	22,590,608.72

减：本报告期基金总赎回份额	61,411,478.05	11,889,745.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	353,928,416.02	21,579,204.05

注：本基金 A 类份额变动含 A 类人民币份额及 A 类美元份额；本基金 C 类份额变动含 C 类人民币份额及 C 类美元份额。

§ 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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	
Haitong International Securities Company Limited	1	42,916,385.47	35.70%	2,324.26	37.65%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	51,761,759.95	43.06%	2,863.15	46.38%	-
CLSA Limited	1	774,721.47	0.64%	58.14	0.94%	-
Goldman Sachs	1	24,744,578.19	20.59%	927.33	15.02%	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金新增交易账户的证券经营机构为 UBS Securities Asia Limited，无减少交易账户。

b）本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。本报告期内交易账户的开立标准如下：

1）交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2）研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3）提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟

通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 本报告期内交易账户的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。
- 2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLS A Limit	-	-	-	-	-	-	-	-

ed								
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2025 年 1 月 9 日暂停赎回业务的公告	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	2025-01-06
2	关于旗下部分基金 2025 年 1 月 20 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-01-15
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2025-01-21
4	易方达基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同、托管协议的公告	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	2025-01-25
5	关于旗下部分基金 2025 年 2 月 17 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2025-02-12

	期定额投资业务的提示性公告	子披露网站	
6	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）恢复申购及定期定额投资业务并暂停大额申购业务的公告	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	2025-02-25
7	关于易方达基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同、托管协议的公告	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	证券时报	2025-03-31
15	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	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	2025-04-11
16	关于旗下部分基金 2025 年 4 月 18 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-04-15
17	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
18	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
19	关于旗下部分基金 2025 年 5 月 26 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-05-21
20	关于旗下部分基金 2025 年 6 月 19 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-06-16

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日