

# 易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证 券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：国信证券股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

## 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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| 1 重要提示及目录.....                               | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| 2 基金简介.....                                  | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| 3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 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.....                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 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）.....                       | 13 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 16 |
| 7 投资组合报告.....                                | 51 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 51 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 52 |
| 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.....       | 53 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 56 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 57 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 58 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 58 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....   | 58 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 58 |

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 59 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 59 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 .....                      | 59 |
| 8    | 基金份额持有人信息 .....                     | 60 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 60 |
| 8.2  | 期末上市基金前十名持有人 .....                  | 60 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 61 |
| 8.4  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 61 |
| 9    | 开放式基金份额变动 .....                     | 61 |
| 10   | 重大事件揭示 .....                        | 62 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 62 |
| 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 .....   | 62 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 62 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 62 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 62 |
| 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 .....      | 62 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 62 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                        | 64 |
| 11   | 备查文件目录 .....                        | 65 |
| 11.1 | 备查文件目录 .....                        | 65 |
| 11.2 | 存放地点 .....                          | 65 |
| 11.3 | 查阅方式 .....                          | 65 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                              |
|--------------|------------------------------|
| 基金名称         | 易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 易方达中证 500 质量成长 ETF           |
| 场内简称         | 中证 500 成长 ETF                |
| 基金主代码        | 159606                       |
| 交易代码         | 159606                       |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                       |
| 基金合同生效日      | 2021 年 12 月 17 日             |
| 基金管理人        | 易方达基金管理有限公司                  |
| 基金托管人        | 国信证券股份有限公司                   |
| 报告期末基金份额总额   | 732,222,838.00 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         | 2021 年 12 月 29 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，本基金管理人可投资具有较高投资价值的可转换债券和可交换债券。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权。本基金参与股指期货和股票期权交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易；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。在条件许可的情况下，为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，基金管理人可根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 质量成长指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 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                       | 国信证券股份有限公司                            |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 王玉                                | 薛璐                                    |
|             | 联系电话 | 020-85102688                      | 0755-22940163                         |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn             | 03339@guosen.com.cn                   |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088                      | 0755-61897778                         |
| 传真          |      | 020-38798812                      | 0755-22940165                         |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区荣粤道<br>188号6层           | 深圳市罗湖区红岭中路1012号<br>国信证券大厦十六层至二十六<br>层 |
| 办公地址        |      | 广州市天河区珠江新城珠江东<br>路30号广州银行大厦40-43楼 | 深圳市福田区福华一路125号国<br>信金融大厦19楼           |
| 邮政编码        |      | 510620                            | 518000                                |
| 法定代表人       |      | 刘晓艳                               | 张纳沙                                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                 |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                                                           |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼                                  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |                                      |
|---------------|--------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|

|                      |                              |
|----------------------|------------------------------|
| 本期已实现收益              | -85,224,142.69               |
| 本期利润                 | -32,505,593.76               |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.0411                      |
| 本期加权平均净值利润率          | -4.47%                       |
| 本期基金份额净值增长率          | -3.71%                       |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |
| 期末可供分配利润             | -80,549,566.13               |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.1100                      |
| 期末基金资产净值             | 706,876,550.75               |
| 期末基金份额净值             | 0.9654                       |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | -3.46%                       |

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

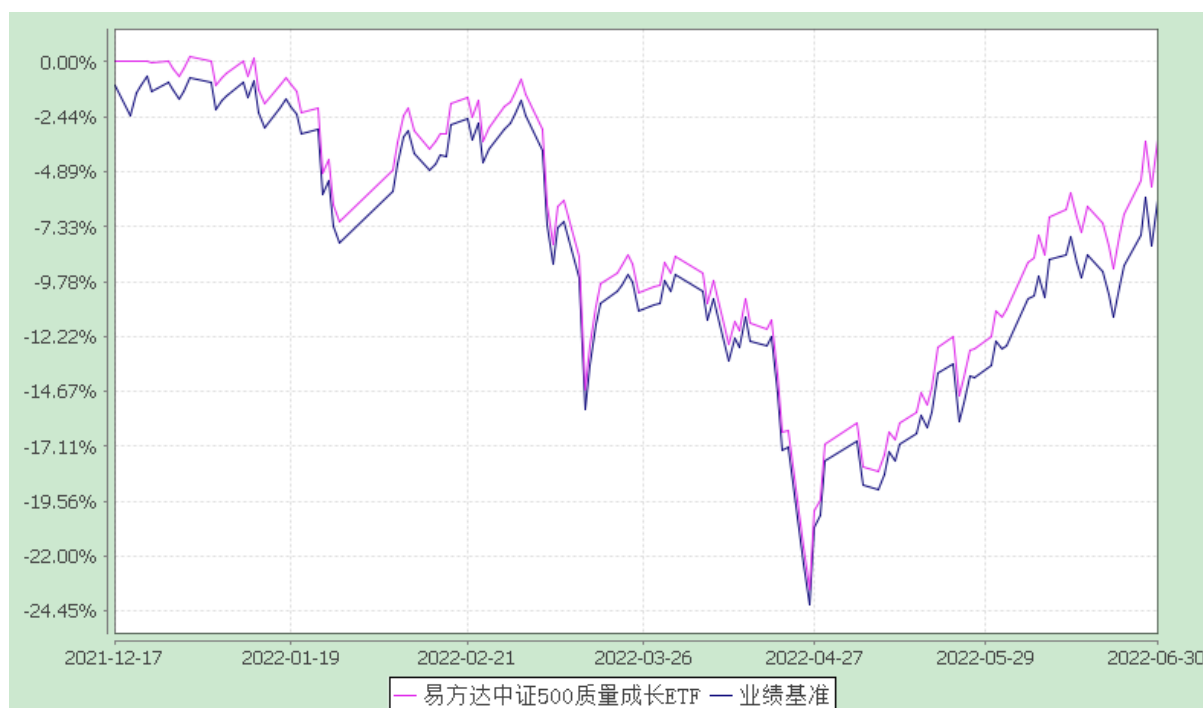
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③   | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | 8.57%    | 1.30%       | 7.14%      | 1.33%         | 1.43% | -0.03% |
| 过去三个月      | 6.54%    | 1.76%       | 4.51%      | 1.77%         | 2.03% | -0.01% |
| 过去六个月      | -3.71%   | 1.63%       | -5.53%     | 1.64%         | 1.82% | -0.01% |
| 过去一年       | -        | -           | -          | -             | -     | -      |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -     | -      |
| 自基金合同生效起至今 | -3.46%   | 1.56%       | -6.17%     | 1.58%         | 2.71% | -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 500 质量成长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

（2021 年 12 月 17 日至 2022 年 6 月 30 日）



注：1.本基金合同于 2021 年 12 月 17 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，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（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-3.46%，同期业绩比较基准收益率为-6.17%。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明 |
|----|----|-------------------------|----------|----------------|----|
|    |    | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |    |
|    |    |                         |          |                |    |

|     |                                                                                                                                                                                                                         |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 林伟斌 | 本基金的基金经理，易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达上证 50 指数（LOF）、易方达上证科创板 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接的基金经理，指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员 | 2021-12-17 | - | 14 年 | 博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）的基金经理。 |
| 伍臣东 | 本基金的基金经理，易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证科创创业 50ETF 的基金经理，易方达上证科创板 50 联接、易方达中证创新药产业 ETF、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证智能电动汽车 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证消费 50ETF 的基金经理助理                      | 2021-12-17 | - | 5 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研究支持专员、指数研究员。                                                                                                                                                                                                                                                         |

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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 22 次，其中 14 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，8 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 500 质量成长指数，该指数从中证 500 指数样本中选取 100 只盈利能力较高、盈利可持续、现金流量较为充沛且具备成长性的上市公司证券作为指数样本，为投资者提供多样化的投资标的。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。

2022 年上半年，全球经济增速放缓、通胀高企，外部环境日趋复杂、地缘政治冲突持续，面对“奥密克戎”新变种病毒的冲击，国内多地出现疫情，企业生产经营活动受到了一定考验，我国经济发展面临较大压力，按不变价格计算的 GDP 同比增长 2.5%。资本市场方面，A 股走势先抑后扬，年初在美联储加息预期升温、俄乌地缘政治冲突以及国内疫情反复的影响下，投资者避险情绪抬升，市场整体出现回调。而随着一系列稳增长政策的陆续出台、社融数据的超预期改善，市场信心有所提振，在 4 月探底后出现明显反弹，成交也有所放量，整体呈现波动加剧的特征，行业板块出现分化。中证 500 质量成长指数当前成份股以医药生物、电力设备以及化工、有色、银行、煤炭等行业构成，相较中证 500 指数体现出盈利能力更强、成长性更好的风格特征。本报告期内，成长板块波动较大，中证 500 质量成长指数表现相对抗跌，期间指数下跌 5.5%，相较于中证 500 指数具有一定

超额收益。

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 0.9654 元，本报告期份额净值增长率为-3.71%，同期业绩比较基准收益率为-5.53%，年化跟踪误差 0.71%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，世界经济滞胀风险依旧较大，主要经济体政策持续收紧，外部不稳定不确定因素仍然较多，对比而言，国内政策环境相对宽松、通胀相对温和，在疫情逐步得到有效控制的情况下，经济也将更加具有韧性和活力，成长风格有望阶段性受益。长期来看，中国经济步入高质量发展阶段，产业转型的过程中企业自身的盈利能力与持续的成长性将成为影响其市场表现的重要变量。

近年来，Smart Beta 指数及产品在海内外市场受关注程度逐渐提升，作为指数化投资的创新形式，Smart Beta 指数结合了传统被动投资与主动投资的各自特点。一方面，它采用了客观透明的编制方案以及定期成份股调整的调样机制；另一方面，它通过增加因子风险暴露的方式来获取相对于宽基指数的超额回报。中证 500 质量成长指数是 A 股市场上风格比较鲜明的 Smart Beta 指数，其成份股汇聚了中证 500 指数当中盈利能力强、成长性突出的上市公司，长期的投资和配置价值值得关注。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好中证 500 质量成长指数投资前景的投资者提供方便、高效的投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指

导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

#### 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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产        | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：       |         |                        |                          |
| 银行存款      | 6.4.7.1 | 10,287,386.42          | 59,483,971.45            |
| 结算备付金     |         | 3,679,984.86           | -                        |
| 存出保证金     |         | 1,752,856.00           | -                        |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 692,495,680.54         | 865,312,072.45           |
| 其中：股票投资   |         | 692,347,752.66         | 865,312,072.45           |
| 基金投资      |         | -                      | -                        |
| 债券投资      |         | 147,927.88             | -                        |
| 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     |         | 37,979.94              | -                        |
| 应收股利      |         | 62,666.69              | -                        |
| 应收申购款     |         | -                      | -                        |
| 递延所得税资产   |         | -                      | -                        |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | 91,242.77              | 57,423.57                |
| 资产总计      |         | 708,407,797.22         | 924,853,467.47           |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 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     |         | -                      | 1,341,732.82             |
| 应付赎回款     |         | -                      | -                        |
| 应付管理人报酬   |         | 280,561.76             | 184,232.33               |
| 应付托管费     |         | 56,112.34              | 36,846.48                |
| 应付销售服务费   |         | -                      | -                        |
| 应付投资顾问费   |         | -                      | -                        |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应交税费        |         | 2,456.84       | -              |
| 应付利润        |         | -              | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 1,192,115.53   | 8,666,346.17   |
| 负债合计        |         | 1,531,246.47   | 10,229,157.80  |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 732,222,838.00 | 912,222,838.00 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -25,346,287.25 | 2,401,471.67   |
| 净资产合计       |         | 706,876,550.75 | 914,624,309.67 |
| 负债和净资产总计    |         | 708,407,797.22 | 924,853,467.47 |

注：1.本基金合同生效日为 2021 年 12 月 17 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 12 月 17 日至 2021 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9654 元，基金份额总额 732,222,838.00 份。

3.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|---------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | -30,155,508.54                        |
| 1.利息收入           |          | 357,912.78                            |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 64,789.72                             |
| 债券利息收入           |          | -                                     |
| 资产支持证券利息收入       |          | -                                     |
| 买入返售金融资产收入       |          | -                                     |
| 证券出借利息收入         |          | 293,123.06                            |
| 其他利息收入           |          | -                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -83,717,163.99                        |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | -93,548,061.46                        |
| 基金投资收益           |          | -                                     |
| 债券投资收益           | 6.4.7.11 | 222,701.46                            |

|                            |          |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|
| 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 | -1,585,679.16         |
| 股利收益                       | 6.4.7.14 | 11,193,875.17         |
| 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 | 52,718,548.93         |
| 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 | 485,193.74            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>2,350,085.22</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 1,807,847.90          |
| 2. 托管费                     |          | 361,569.56            |
| 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                   |          | 1,056.03              |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18 | 179,611.73            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-32,505,593.76</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-32,505,593.76</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>-32,505,593.76</b> |

注：本基金合同生效日为 2021 年 12 月 17 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |              |                |
|-----------------|---------------------------------------|--------|--------------|----------------|
|                 | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 912,222,838.00                        | -      | 2,401,471.67 | 914,624,309.67 |
| 二、本期期初净资产       | 912,222,838.00                        | -      | 2,401,471.67 | 914,624,309.6  |

|                                          |                 |   |                |                 |
|------------------------------------------|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 产（基金净值）                                  |                 |   |                | 7               |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -180,000,000.00 | - | -27,747,758.92 | -207,747,758.92 |
| （一）、综合收益总额                               | -               | - | -32,505,593.76 | -32,505,593.76  |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -180,000,000.00 | - | 4,757,834.84   | -175,242,165.16 |
| 其中：1.基金申购款                               | 96,000,000.00   | - | -10,268,239.45 | 85,731,760.55   |
| 2.基金赎回款                                  | -276,000,000.00 | - | 15,026,074.29  | -260,973,925.71 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -               | - | -              | -               |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 732,222,838.00  | - | -25,346,287.25 | 706,876,550.75  |

注：本基金合同生效日为 2021 年 12 月 17 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 质量成长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[2021]3333 号《关于准予易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 965,222,838.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 28,838.00 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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

#### 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、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 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

新金融工具准则

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。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时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；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

#### （2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

#### 新金融工具准则

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。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，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的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金

融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，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。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。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；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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整

的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

(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。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 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，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，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(11) 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

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(4) 每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基

金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

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

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

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 59,483,971.45 元，

自应收利息转入的重分类金额为人民币 57,423.57 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 59,541,395.02 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 57,423.57 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 57,423.57 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 4,554,645.24           |
| 等于：本金          | 4,553,094.73           |
| 加：应计利息         | 1,550.51               |
| 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           | 5,732,741.18           |
| 等于：本金          | 5,732,104.79           |
| 加：应计利息         | 636.39                 |
| 合计             | 10,287,386.42          |

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |           | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |       |                |               |
|---------------|-----------|------------------------|-------|----------------|---------------|
|               |           | 成本                     | 应计利息  | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |           | 637,654,597.31         | -     | 692,347,752.66 | 54,693,155.35 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |           | -                      | -     | -              | -             |
| 债券            | 交易所<br>市场 | 147,900.00             | 27.88 | 147,927.88     | -             |
|               | 银行间<br>市场 | -                      | -     | -              | -             |
|               | 合计        | 147,900.00             | 27.88 | 147,927.88     | -             |
| 资产支持证券        |           | -                      | -     | -              | -             |
| 基金            |           | -                      | -     | -              | -             |
| 其他            |           | -                      | -     | -              | -             |

|    |                |       |                |               |
|----|----------------|-------|----------------|---------------|
| 合计 | 637,802,497.31 | 27.88 | 692,495,680.54 | 54,693,155.35 |
|----|----------------|-------|----------------|---------------|

#### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|--------|------------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义<br>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 | 11,621,960.00          | -    | -  | -  |
| IC2212 | 11,621,960.00          | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                      | -    | -  | -  |
| 合计     | 11,621,960.00          | -    | -  | -  |

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值          | 公允价值变动     |
|------------|--------|----------|---------------|------------|
| IC2212     | IC2212 | 10       | 12,520,400.00 | 898,440.00 |
| 合计         | -      | -        | -             | 898,440.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | -      | -        | -             | 898,440.00 |
| 净额         | -      | -        | -             | -          |

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | -                      |
| 其他应收款 | 15,626.53              |
| 待摊费用  | 75,616.24              |
| 合计    | 91,242.77              |

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 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      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 105,392.35             |
| 应付替代款       | 1,086,206.92           |
| 可退替代款       | 456.60                 |
| 其他应付款       | 59.66                  |
| 合计          | 1,192,115.53           |

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 912,222,838.00                        | 912,222,838.00  |
| 本期申购          | 96,000,000.00                         | 96,000,000.00   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -276,000,000.00                       | -276,000,000.00 |
| 本期末           | 732,222,838.00                        | 732,222,838.00  |

## 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           | -546,938.80    | 2,948,410.47  | 2,401,471.67   |
| 本期利润           | -85,224,142.69 | 52,718,548.93 | -32,505,593.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,221,515.36   | -463,680.52   | 4,757,834.84   |
| 其中：基金申购款       | -5,281,563.87  | -4,986,675.58 | -10,268,239.45 |
| 基金赎回款          | 10,503,079.23  | 4,522,995.06  | 15,026,074.29  |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | -80,549,566.13 | 55,203,278.88 | -25,346,287.25 |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 25,543.27                             |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 定期存款利息收入  | -         |
| 其他存款利息收入  | 19,166.43 |
| 结算备付金利息收入 | 20,080.02 |
| 其他        | -         |
| 合计        | 64,789.72 |

#### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -89,782,868.38                        |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -3,765,193.08                         |
| 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               | -93,548,061.46                        |

##### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 880,325,778.24                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 968,353,789.97                        |
| 减：交易费用     | 1,754,856.65                          |
| 买卖股票差价收入   | -89,782,868.38                        |

##### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 260,973,925.71                        |
| 减：现金支付赎回款总额 | 133,159,578.71                        |
| 减：赎回股票成本总额  | 131,579,540.08                        |
| 减：交易费用      | -                                     |
| 赎回差价收入      | -3,765,193.08                         |

#### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|--------------|---------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 264.35                                |

|                              |            |
|------------------------------|------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 222,437.11 |
| 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                           | 222,701.46 |

## 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,763,827.31               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,541,100.00               |
| 减：应计利息总额               | 244.50                     |
| 减：交易费用                 | 45.70                      |
| 买卖债券差价收入               | 222,437.11                 |

## 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

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 股指期货投资收益 | -1,585,679.16              |

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 11,193,875.17              |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 1,349,091.44               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |
| 合计            | 11,193,875.17              |

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 51,820,108.93              |
| ——股票投资     | 51,820,108.93              |
| ——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                     | 898,440.00    |
| ——权证投资                     | -             |
| ——期货投资                     | 898,440.00    |
| 3.其他                       | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -             |
| 合计                         | 52,718,548.93 |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                          |
| 基金申购费收入 | -                          |
| 其他      | -                          |
| 替代损益收入  | 485,193.74                 |
| 合计      | 485,193.74                 |

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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 35,803.61                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 其他      | 84,300.75                  |
| 合计      | 179,611.73                 |

#### 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                    |
| 国信证券股份有限公司  | 基金托管人、申购赎回代办证券公司         |
| 广发证券股份有限公司  | 基金管理人股东、申购赎回代办证券公司、证券经纪商 |

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                   |              |
|-------|----------------------|--------------|
|       | 2022年1月1日至2022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  | 1,704,992,133.24     | 100.00%      |

##### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                   |              |
|-------|----------------------|--------------|
|       | 2022年1月1日至2022年6月30日 |              |
|       | 成交金额                 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券  | 1,763,812.29         | 100.00%      |

##### 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                   |            |          |              |
|-------|----------------------|------------|----------|--------------|
|       | 2022年1月1日至2022年6月30日 |            |          |              |
|       | 当期佣金                 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |

|      |            |         |   |   |
|------|------------|---------|---|---|
| 广发证券 | 701,359.61 | 100.00% | - | - |
|------|------------|---------|---|---|

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,807,847.90               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,127.01                   |

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 361,569.56                 |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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

单位：人民币元

| 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |           |               |          |
|----------------------------|----------------|-----------|---------------|----------|
| 关联方名称                      | 交易金额           | 利息收入      | 期末证券出借业务余额    | 期末应收利息余额 |
| 广发证券                       | 139,939,032.00 | 78,405.85 | 29,722,497.00 | 2,592.37 |

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

单位：人民币元

| 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                  |      |            |              |                |                |           |          |            |          |
|----------------------------|------------------|------|------------|--------------|----------------|----------------|-----------|----------|------------|----------|
| 关联方名称                      | 合约编号             | 证券名称 | 成交时间       | 交易金额         | 交易数量<br>(单位：股) | 出借期限<br>(单位：天) | 费率<br>(%) | 利息收入     | 期末证券出借业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 广发证券                       | 202203300000852  | 安科生物 | 2022-03-30 | 9,980.00     | 1,000.00       | 14             | 3.21      | 12.46    | 0.00       | 0.00     |
| 广发证券                       | 2022033100003407 | 安科生物 | 2022-03-30 | 9,980.00     | 1,000.00       | 2              | 3.21      | 1.78     | 0.00       | 0.00     |
| 广发证券                       | 2022040700000754 | 新宙邦  | 2022-04-07 | 972,000.00   | 12,000.00      | 14             | 2.00      | 756.00   | 0.00       | 0.00     |
| 广发证券                       | 2022040800000950 | 新宙邦  | 2022-04-08 | 1,006,362.00 | 12,600.00      | 14             | 2.00      | 782.73   | 0.00       | 0.00     |
| 广发证券                       | 2022061400000727 | 晶晨股份 | 2022-06-14 | 2,080,350.00 | 20,700.00      | 14             | 3.20      | 2,588.88 | 0.00       | 0.00     |
| 广发证券                       | 2022062700000888 | 康希诺  | 2022-06-27 | 314,940.00   | 1,500.00       | 14             | 3.20      | 83.98    | 298,620.00 | 83.98    |

|      |                              |      |                |                      |           |    |          |            |                  |        |
|------|------------------------------|------|----------------|----------------------|-----------|----|----------|------------|------------------|--------|
| 广发证券 | 2022<br>0628<br>0000<br>0939 | 新宙邦  | 2022-<br>06-28 | 1,044<br>,204.<br>00 | 18,600.00 | 14 | 3.2<br>0 | 185.6<br>4 | 977,616.00       | 185.64 |
| 广发证券 | 2022<br>0628<br>0001<br>0790 | 晶晨股份 | 2022-<br>06-28 | 2,025<br>,288.<br>00 | 20,700.00 | 14 | 3.2<br>0 | 360.0<br>5 | 2,090,700.0<br>0 | 360.05 |

#### 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 2022 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2021 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 |
| 广发证券股份有限公司 | 3,700,100.00        | 0.5053%          | 7,266,627.00          | 0.7966%          |

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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |           |
|-----------|----------------------------|-----------|
|           | 期末余额                       | 当期利息收入    |
| 广发证券-其他存款 | 5,732,741.18               | 19,166.43 |

注：本基金的其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

##### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------------|
|---------------------------------------|

| 关联方名称 | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式   | 基金在承销期内买入  |            |
|-------|--------|------|--------|------------|------------|
|       |        |      |        | 数量（单位：股/张） | 总金额        |
| 国信证券  | 001270 | 铖昌科技 | 新股网下发行 | 568        | 12,314.24  |
| 广发证券  | 301181 | 标榜股份 | 新股网下发行 | 2,564      | 103,201.00 |
| 广发证券  | 301220 | 亚香股份 | 新股网下发行 | 2,849      | 102,507.02 |
| 国泰君安  | 603070 | 万控智造 | 新股网下发行 | 775        | 7,300.50   |

注：国泰君安证券股份有限公司为本基金托管人国信证券股份有限公司的关联方。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 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 |
| 301097               | 天益医疗 | 2022-03-25 | 6 个月 | 新股流通受限 | 52.37 | 47.83  | 249      | 13,040.13 | 11,909.67 | -  |
| 301102               | 兆讯传媒 | 2022-03-15 | 6 个月 | 新股流通受限 | 39.88 | 31.09  | 642      | 25,602.96 | 19,959.78 | -  |
| 301103               | 何氏眼科 | 2022-03-14 | 6 个月 | 新股流通受限 | 42.50 | 32.02  | 507      | 16,575.00 | 16,234.14 | -  |
| 301110               | 青木股份 | 2022-03-04 | 6 个月 | 新股流通受限 | 63.10 | 39.85  | 202      | 12,746.20 | 8,049.70  | -  |
| 301112               | 信邦智能 | 2022-06-20 | 6 个月 | 新股流通受限 | 27.53 | 45.04  | 399      | 10,984.47 | 17,970.96 | -  |

|        |      |            |        |        |        |       |        |            |            |   |
|--------|------|------------|--------|--------|--------|-------|--------|------------|------------|---|
| 301122 | 采纳股份 | 2022-01-19 | 6 个月   | 新股流通受限 | 50.31  | 70.37 | 301    | 15,143.31  | 21,181.37  | - |
| 301125 | 腾亚精工 | 2022-05-27 | 6 个月   | 新股流通受限 | 22.49  | 27.42 | 327    | 7,354.23   | 8,966.34   | - |
| 301130 | 西点药业 | 2022-02-16 | 6 个月   | 新股流通受限 | 22.55  | 37.70 | 237    | 5,344.35   | 8,934.90   | - |
| 301137 | 哈焊华通 | 2022-03-14 | 6 个月   | 新股流通受限 | 15.37  | 15.99 | 644    | 9,898.28   | 10,297.56  | - |
| 301151 | 冠龙节能 | 2022-03-30 | 6 个月   | 新股流通受限 | 30.82  | 21.46 | 703    | 21,666.46  | 15,086.38  | - |
| 301153 | 中科江南 | 2022-05-10 | 6 个月   | 新股流通受限 | 33.68  | 43.98 | 398    | 13,404.64  | 17,504.04  | - |
| 301160 | 翔楼新材 | 2022-05-25 | 6 个月   | 新股流通受限 | 31.56  | 37.66 | 392    | 12,371.52  | 14,762.72  | - |
| 301163 | 宏德股份 | 2022-04-11 | 6 个月   | 新股流通受限 | 26.27  | 32.33 | 277    | 7,276.79   | 8,955.41   | - |
| 301175 | 中科环保 | 2022-06-30 | 1 个月以内 | 新股流通受限 | 3.82   | 3.82  | 57,324 | 218,977.68 | 218,977.68 | - |
| 301175 | 中科环保 | 2022-06-30 | 6 个月   | 新股流通受限 | 3.82   | 3.82  | 6,370  | 24,333.40  | 24,333.40  | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022-02-11 | 6 个月   | 新股流通受限 | 40.25  | 30.59 | 257    | 10,344.25  | 7,861.63   | - |
| 301187 | 欧圣电气 | 2022-04-13 | 6 个月   | 新股流通受限 | 21.33  | 22.54 | 876    | 18,685.08  | 19,745.04  | - |
| 301206 | 三元生物 | 2022-01-26 | 6 个月   | 新股流通受限 | 109.30 | 45.69 | 616    | 44,922.30  | 28,145.04  | - |
| 301216 | 万凯新材 | 2022-03-21 | 6 个月   | 新股流通受限 | 35.68  | 29.84 | 854    | 30,470.72  | 25,483.36  | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022-03-10 | 6 个月   | 新股流通   | 173.98 | 87.82 | 281    | 27,140.88  | 24,677.42  | - |

|        |      |            |        |        |       |       |       |            |            |   |
|--------|------|------------|--------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
|        |      |            |        | 受限     |       |       |       |            |            |   |
| 301220 | 亚香股份 | 2022-06-15 | 6 个月   | 新股流通受限 | 35.98 | 39.15 | 285   | 10,254.30  | 11,157.75  | - |
| 301233 | 盛帮股份 | 2022-06-24 | 1 个月以内 | 新股流通受限 | 41.52 | 41.52 | 1,418 | 58,875.36  | 58,875.36  | - |
| 301233 | 盛帮股份 | 2022-06-24 | 6 个月   | 新股流通受限 | 41.52 | 41.52 | 158   | 6,560.16   | 6,560.16   | - |
| 301235 | 华康医疗 | 2022-01-21 | 6 个月   | 新股流通受限 | 39.30 | 37.93 | 418   | 16,427.40  | 15,854.74  | - |
| 301238 | 瑞泰新材 | 2022-06-10 | 6 个月   | 新股流通受限 | 19.18 | 32.07 | 2,024 | 38,820.32  | 64,909.68  | - |
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022-06-22 | 1 个月以内 | 新股流通受限 | 33.65 | 33.65 | 5,172 | 174,037.80 | 174,037.80 | - |
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022-06-22 | 6 个月   | 新股流通受限 | 33.65 | 33.65 | 575   | 19,348.75  | 19,348.75  | - |
| 301248 | 杰创智能 | 2022-04-13 | 6 个月   | 新股流通受限 | 39.07 | 29.87 | 472   | 18,441.04  | 14,098.64  | - |
| 301256 | 华融化学 | 2022-03-14 | 6 个月   | 新股流通受限 | 8.05  | 10.08 | 1,831 | 14,739.55  | 18,456.48  | - |
| 301258 | 富士莱  | 2022-03-21 | 6 个月   | 新股流通受限 | 48.30 | 41.68 | 295   | 14,248.50  | 12,295.60  | - |
| 301266 | 宇邦新材 | 2022-05-30 | 6 个月   | 新股流通受限 | 26.86 | 47.07 | 517   | 13,886.62  | 24,335.19  | - |
| 301279 | 金道科技 | 2022-04-06 | 6 个月   | 新股流通受限 | 31.20 | 22.81 | 296   | 9,235.20   | 6,751.76   | - |
| 301286 | 侨源股份 | 2022-06-06 | 6 个月   | 新股流通受限 | 16.91 | 19.79 | 784   | 13,257.44  | 15,515.36  | - |
| 301288 | 清研环境 | 2022-04-14 | 6 个月   | 新股流通受限 | 19.09 | 19.98 | 452   | 8,628.68   | 9,030.96   | - |
| 30129  | 东利   | 2022-0     | 6 个月   | 新股     | 12.68 | 20.83 | 634   | 8,039.     | 13,206     | - |

| 8                           | 机械   | 5-27       |           | 流通受限   |        |        |          | 12         | .22        |    |
|-----------------------------|------|------------|-----------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 688052                      | 纳芯微  | 2022-04-14 | 6 个月      | 新股流通受限 | 230.00 | 350.81 | 2,175    | 500,250.00 | 763,011.75 | -  |
| 688120                      | 华海清科 | 2022-05-30 | 6 个月      | 新股流通受限 | 136.66 | 217.12 | 2,833    | 387,157.78 | 615,100.96 | -  |
| 688193                      | 仁度生物 | 2022-03-23 | 6 个月      | 新股流通受限 | 72.65  | 51.57  | 1,635    | 118,782.75 | 84,316.95  | -  |
| 688209                      | 英集芯  | 2022-04-12 | 6 个月      | 新股流通受限 | 24.23  | 27.58  | 6,822    | 165,297.06 | 188,150.76 | -  |
| 688237                      | 超卓航科 | 2022-06-24 | 1 个月以内    | 新股流通受限 | 41.27  | 41.27  | 2,891    | 119,311.57 | 119,311.57 | -  |
| <b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b> |      |            |           |        |        |        |          |            |            |    |
| 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 |
| 127064                      | 杭氧转债 | 2022-05-19 | 1-6 个月(含) | 新发流通受限 | 100.00 | 100.02 | 1,479    | 147,900.00 | 147,927.88 | -  |

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 2022 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 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称 | 出借到期日                               | 期末<br>估值<br>单价 | 数量(单位:<br>股) | 期末估值总<br>额   |
|----|--------|------|-------------------------------------|----------------|--------------|--------------|
| 1  | 000519 | 中兵红箭 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 29.15          | 63,600.00    | 1,853,940.00 |
| 2  | 000559 | 万向钱潮 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 5.94           | 113,800.00   | 675,972.00   |
| 3  | 000738 | 航发控制 | 2022 年 7 月 7 日<br>-2022 年 7 月 7 日   | 28.10          | 10,700.00    | 300,670.00   |
| 4  | 000807 | 云铝股份 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 9.88           | 112,000.00   | 1,106,560.00 |
| 5  | 000825 | 太钢不锈 | 2022 年 7 月 8 日<br>-2022 年 7 月 8 日   | 5.45           | 50,500.00    | 275,225.00   |
| 6  | 000830 | 鲁西化工 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 17.29          | 79,400.00    | 1,372,826.00 |
| 7  | 000878 | 云南铜业 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 11.39          | 80,900.00    | 921,451.00   |
| 8  | 000937 | 冀中能源 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 7.46           | 87,300.00    | 651,258.00   |
| 9  | 000960 | 锡业股份 | 2022 年 7 月 7 日<br>-2022 年 7 月 7 日   | 16.77          | 69,000.00    | 1,157,130.00 |
| 10 | 000999 | 华润三九 | 2022 年 7 月 7 日<br>-2022 年 7 月 7 日   | 45.00          | 27,900.00    | 1,255,500.00 |
| 11 | 002004 | 华邦健康 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 5.58           | 10,000.00    | 55,800.00    |
| 12 | 002056 | 横店东磁 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 26.62          | 57,000.00    | 1,517,340.00 |
| 13 | 002128 | 电投能源 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 14.32          | 52,900.00    | 757,528.00   |
| 14 | 002191 | 劲嘉股份 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 10.72          | 52,600.00    | 563,872.00   |
| 15 | 002240 | 盛新锂能 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 60.36          | 39,300.00    | 2,372,148.00 |
| 16 | 002268 | 卫士通  | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 42.91          | 45,000.00    | 1,930,950.00 |
| 17 | 002326 | 永太科技 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 32.93          | 33,200.00    | 1,093,276.00 |
| 18 | 002372 | 伟星新材 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 24.04          | 51,200.00    | 1,230,848.00 |
| 19 | 002407 | 多氟多  | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 48.91          | 54,000.00    | 2,641,140.00 |
| 20 | 002497 | 雅化集团 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 32.65          | 31,100.00    | 1,015,415.00 |
| 21 | 002690 | 美亚光电 | 2022 年 7 月 1 日                      | 21.68          | 27,200.00    | 589,696.00   |

|    |        |      |                                     |        |            |              |
|----|--------|------|-------------------------------------|--------|------------|--------------|
|    |        |      | -2022 年 7 月 1 日                     |        |            |              |
| 22 | 002958 | 青农商行 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 3.32   | 326,200.00 | 1,082,984.00 |
| 23 | 300012 | 华测检测 | 2022 年 7 月 11 日<br>-2022 年 7 月 11 日 | 23.21  | 16,200.00  | 376,002.00   |
| 24 | 300037 | 新宙邦  | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 52.56  | 18,600.00  | 977,616.00   |
| 25 | 300244 | 迪安诊断 | 2022 年 7 月 6 日<br>-2022 年 7 月 6 日   | 31.10  | 1,000.00   | 31,100.00    |
| 26 | 300357 | 我武生物 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 52.03  | 29,500.00  | 1,534,885.00 |
| 27 | 300363 | 博腾股份 | 2022 年 7 月 5 日<br>-2022 年 7 月 5 日   | 77.99  | 7,900.00   | 616,121.00   |
| 28 | 600079 | 人福医药 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 16.00  | 85,500.00  | 1,368,000.00 |
| 29 | 600096 | 云天化  | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 31.48  | 87,600.00  | 2,757,648.00 |
| 30 | 600141 | 兴发集团 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 43.99  | 53,500.00  | 2,353,465.00 |
| 31 | 600233 | 圆通速递 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 20.39  | 20,000.00  | 407,800.00   |
| 32 | 600348 | 华阳股份 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 15.46  | 110,400.00 | 1,706,784.00 |
| 33 | 600392 | 盛和资源 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 22.60  | 95,000.00  | 2,147,000.00 |
| 34 | 600415 | 小商品城 | 2022 年 7 月 11 日<br>-2022 年 7 月 11 日 | 5.57   | 181,400.00 | 1,010,398.00 |
| 35 | 600486 | 扬农化工 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 133.28 | 12,800.00  | 1,705,984.00 |
| 36 | 600497 | 驰宏锌锗 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 5.19   | 186,400.00 | 967,416.00   |
| 37 | 600499 | 科达制造 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 20.64  | 108,700.00 | 2,243,568.00 |
| 38 | 600566 | 济川药业 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 27.16  | 33,900.00  | 920,724.00   |
| 39 | 600580 | 卧龙电驱 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 14.42  | 59,100.00  | 852,222.00   |
| 40 | 600582 | 天地科技 | 2022 年 7 月 6 日<br>-2022 年 7 月 6 日   | 4.78   | 122,700.00 | 586,506.00   |
| 41 | 600597 | 光明乳业 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 12.63  | 54,300.00  | 685,809.00   |
| 42 | 600648 | 外高桥  | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 13.60  | 35,700.00  | 485,520.00   |
| 43 | 600787 | 中储股份 | 2022 年 7 月 1 日                      | 5.69   | 67,100.00  | 381,799.00   |

|    |        |      |                                     |        |            |              |
|----|--------|------|-------------------------------------|--------|------------|--------------|
|    |        |      | -2022 年 7 月 1 日                     |        |            |              |
| 44 | 600808 | 马钢股份 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 3.79   | 70,000.00  | 265,300.00   |
| 45 | 600928 | 西安银行 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 3.67   | 94,400.00  | 346,448.00   |
| 46 | 600985 | 淮北矿业 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 14.56  | 95,700.00  | 1,393,392.00 |
| 47 | 601016 | 节能风电 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 4.80   | 227,900.00 | 1,093,920.00 |
| 48 | 601168 | 西部矿业 | 2022 年 7 月 5 日<br>-2022 年 7 月 5 日   | 11.83  | 127,600.00 | 1,509,508.00 |
| 49 | 601615 | 明阳智能 | 2022 年 7 月 13 日<br>-2022 年 7 月 13 日 | 33.80  | 141,200.00 | 4,772,560.00 |
| 50 | 601699 | 潞安环能 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 14.62  | 91,400.00  | 1,336,268.00 |
| 51 | 601860 | 紫金银行 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 2.87   | 280,700.00 | 805,609.00   |
| 52 | 601866 | 中远海发 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 3.00   | 320,200.00 | 960,600.00   |
| 53 | 601872 | 招商轮船 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 5.76   | 232,100.00 | 1,336,896.00 |
| 54 | 601958 | 金钼股份 | 2022 年 7 月 7 日<br>-2022 年 7 月 7 日   | 8.84   | 50,200.00  | 443,768.00   |
| 55 | 601997 | 贵阳银行 | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 5.81   | 278,300.00 | 1,616,923.00 |
| 56 | 603026 | 石大胜华 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 145.35 | 11,400.00  | 1,656,990.00 |
| 57 | 603077 | 和邦生物 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 4.26   | 418,000.00 | 1,780,680.00 |
| 58 | 603198 | 迎驾贡酒 | 2022 年 7 月 14 日<br>-2022 年 7 月 14 日 | 65.14  | 23,400.00  | 1,524,276.00 |
| 59 | 603233 | 大参林  | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 31.30  | 29,900.00  | 935,870.00   |
| 60 | 603568 | 伟明环保 | 2022 年 7 月 8 日<br>-2022 年 7 月 8 日   | 33.37  | 27,600.00  | 921,012.00   |
| 61 | 603605 | 珀莱雅  | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 165.18 | 12,500.00  | 2,064,750.00 |
| 62 | 603707 | 健友股份 | 2022 年 7 月 12 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 28.20  | 10,200.00  | 287,640.00   |
| 63 | 603866 | 桃李面包 | 2022 年 7 月 6 日<br>-2022 年 7 月 6 日   | 16.55  | 44,300.00  | 733,165.00   |
| 64 | 603883 | 老百姓  | 2022 年 7 月 1 日<br>-2022 年 7 月 1 日   | 33.88  | 15,860.00  | 537,336.80   |
| 65 | 688099 | 晶晨股份 | 2022 年 7 月 12 日                     | 101.0  | 20,700.00  | 2,090,700.00 |

|    |        |     |                                     |            |                  |                   |
|----|--------|-----|-------------------------------------|------------|------------------|-------------------|
|    |        |     | -2022 年 7 月 12 日                    | 0          |                  | 0                 |
| 66 | 688185 | 康希诺 | 2022 年 7 月 11 日<br>-2022 年 7 月 12 日 | 199.0<br>8 | 3,500.00         | 696,780.00        |
| 合计 | -      | -   | -                                   | -          | 5,489,160.0<br>0 | 77,648,287.<br>80 |

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金属股票基金，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。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对于约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2022 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 0.02%(2021 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |

|        |      |      |
|--------|------|------|
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级    | 0.00 | 0.00 |
| 合计     | 0.00 | 0.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 0.00              | 0.00                |
| AAA 以下 | 147,927.88        | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 147,927.88        | 0.00                |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021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 2022 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(所有者权益)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，期末除本报告“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<br>2022 年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上      | 不计息            | 合计             |
|------------------------|---------------|-------|------------|----------------|----------------|
| 资产                     |               |       |            |                |                |
| 银行存款                   | 10,287,386.42 | -     | -          | -              | 10,287,386.42  |
| 结算备付金                  | 3,679,984.86  | -     | -          | -              | 3,679,984.86   |
| 存出保证金                  | 1,752,856.00  | -     | -          | -              | 1,752,856.00   |
| 交易性金融资产                | -             | -     | 147,927.88 | 692,347,752.66 | 692,495,680.54 |
| 衍生金融资产                 | -             | -     | -          | -              | -              |
| 买入返售金融资产               | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应收清算款                  | -             | -     | -          | 37,979.94      | 37,979.94      |
| 应收股利                   | -             | -     | -          | 62,666.69      | 62,666.69      |
| 应收申购款                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 递延所得税资产                | -             | -     | -          | -              | -              |
| 其他资产                   | -             | -     | -          | 91,242.77      | 91,242.77      |
| 资产总计                   | 15,720,227.28 | -     | 147,927.88 | 692,539,642.06 | 708,407,797.22 |
| 负债                     |               |       |            |                |                |
| 短期借款                   | -             | -     | -          | -              | -              |

|                          |               |       |            |                |                |
|--------------------------|---------------|-------|------------|----------------|----------------|
| 交易性金融负债                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 衍生金融负债                   | -             | -     | -          | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款                | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应付清算款                    | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -          | 280,561.76     | 280,561.76     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -          | 56,112.34      | 56,112.34      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应付投资顾问费                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应交税费                     | -             | -     | -          | 2,456.84       | 2,456.84       |
| 应付利润                     | -             | -     | -          | -              | -              |
| 递延所得税负债                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 其他负债                     | -             | -     | -          | 1,192,115.53   | 1,192,115.53   |
| 负债总计                     | -             | -     | -          | 1,531,246.47   | 1,531,246.47   |
| 利率敏感度缺口                  | 15,720,227.28 | -     | 147,927.88 | 691,008,395.59 | 706,876,550.75 |
| 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上      | 不计息            | 合计             |
| 资产                       |               |       |            |                |                |
| 银行存款                     | 59,483,971.45 | -     | -          | -              | 59,483,971.45  |
| 结算备付金                    | -             | -     | -          | -              | -              |
| 存出保证金                    | -             | -     | -          | -              | -              |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -          | 865,312,072.45 | 865,312,072.45 |
| 衍生金融资产                   | -             | -     | -          | -              | -              |
| 买入返售金融资产                 | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应收证券清算款                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应收利息                     | -             | -     | -          | 57,423.57      | 57,423.57      |
| 应收股利                     | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应收申购款                    | -             | -     | -          | -              | -              |
| 递延所得税资产                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 其他资产                     | -             | -     | -          | -              | -              |
| 资产总计                     | 59,483,971.45 | -     | -          | 865,369,496.02 | 924,853,467.47 |

|           |               |   |   |                |                |
|-----------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 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 | -             | - | - | -              | -              |
| 应付证券清算款   | -             | - | - | 1,341,732.82   | 1,341,732.82   |
| 应付赎回款     | -             | - | - | -              | -              |
| 应付管理人报酬   | -             | - | - | 184,232.33     | 184,232.33     |
| 应付托管费     | -             | - | - | 36,846.48      | 36,846.48      |
| 应付销售服务费   | -             | - | - | -              | -              |
| 应付交易费用    | -             | - | - | -              | -              |
| 应交税费      | -             | - | - | -              | -              |
| 应付利息      | -             | - | - | -              | -              |
| 应付利润      | -             | - | - | -              | -              |
| 递延所得税负债   | -             | - | - | -              | -              |
| 其他负债      | -             | - | - | 8,666,346.17   | 8,666,346.17   |
| 负债总计      | -             | - | - | 10,229,157.80  | 10,229,157.80  |
| 利率敏感度缺口   | 59,483,971.45 | - | - | 855,140,338.22 | 914,624,309.67 |

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

|               | 2022 年 6 月 30 日 |               | 2021 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  | 692,347,752.66  | 97.94         | 865,312,072.45   | 94.61         |
| 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            | 692,347,752.66  | 97.94         | 865,312,072.45   | 94.61         |

#### 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<br>2022 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 34,519,525.94               | 43,254,678.54            |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -34,519,525.94              | -43,254,678.54           |

#### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 689,584,389.68         |
| 第二层次          | 719,130.29             |

|      |                |
|------|----------------|
| 第三层次 | 2,192,160.57   |
| 合计   | 692,495,680.54 |

#### 6.4.14.2 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

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              | 692,347,752.66 | 97.73         |
|    | 其中：股票             | 692,347,752.66 | 97.73         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 147,927.88     | 0.02          |
|    | 其中：债券             | 147,927.88     | 0.02          |
|    | 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 | 13,967,371.28  | 1.97   |
| 8 | 其他各项资产       | 1,944,745.40   | 0.27   |
| 9 | 合计           | 708,407,797.22 | 100.00 |

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 77,648,287.80 元，占净值比例 10.98%。

## 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         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 82,387,955.60  | 11.66        |
| C  | 制造业              | 432,013,056.11 | 61.12        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,471,040.00   | 0.77         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 19,295,166.00  | 2.73         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 26,385,156.00  | 3.73         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 28,864,130.13  | 4.08         |
| J  | 金融业              | 63,214,389.53  | 8.94         |
| K  | 房地产业             | 6,055,243.00   | 0.86         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 5,107,040.78   | 0.72         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 12,147,721.74  | 1.72         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,868,393.08   | 0.69         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 6,538,470.69   | 0.92         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 692,347,762.66 | 97.94        |

## 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<br>比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 601615 | 明阳智能 | 706,410   | 23,876,658.00 | 3.38             |
| 2  | 600256 | 广汇能源 | 2,203,020 | 23,219,830.80 | 3.28             |
| 3  | 300769 | 德方纳米 | 41,720    | 17,050,129.60 | 2.41             |
| 4  | 300390 | 天华超净 | 171,600   | 14,997,840.00 | 2.12             |
| 5  | 600096 | 云天化  | 451,400   | 14,210,072.00 | 2.01             |
| 6  | 000983 | 山西焦煤 | 1,004,800 | 13,454,272.00 | 1.90             |
| 7  | 002407 | 多氟多  | 270,400   | 13,225,264.00 | 1.87             |
| 8  | 603456 | 九洲药业 | 240,900   | 12,454,530.00 | 1.76             |
| 9  | 600563 | 法拉电子 | 60,400    | 12,391,664.00 | 1.75             |
| 10 | 002497 | 雅化集团 | 373,200   | 12,184,980.00 | 1.72             |
| 11 | 300012 | 华测检测 | 522,700   | 12,131,867.00 | 1.72             |
| 12 | 300363 | 博腾股份 | 155,400   | 12,119,646.00 | 1.71             |
| 13 | 002240 | 盛新锂能 | 198,400   | 11,975,424.00 | 1.69             |
| 14 | 600141 | 兴发集团 | 267,700   | 11,776,123.00 | 1.67             |
| 15 | 600233 | 圆通速递 | 570,100   | 11,624,339.00 | 1.64             |
| 16 | 603605 | 珀莱雅  | 69,180    | 11,427,152.40 | 1.62             |
| 17 | 300037 | 新宙邦  | 217,380   | 11,425,492.80 | 1.62             |
| 18 | 600499 | 科达制造 | 543,900   | 11,226,096.00 | 1.59             |
| 19 | 002756 | 永兴材料 | 71,500    | 10,883,015.00 | 1.54             |
| 20 | 601077 | 渝农商行 | 2,903,300 | 10,742,210.00 | 1.52             |
| 21 | 600392 | 盛和资源 | 475,300   | 10,741,780.00 | 1.52             |
| 22 | 688099 | 晶晨股份 | 104,348   | 10,539,148.00 | 1.49             |
| 23 | 601128 | 常熟银行 | 1,338,900 | 10,229,196.00 | 1.45             |
| 24 | 002268 | 卫士通  | 225,400   | 9,671,914.00  | 1.37             |
| 25 | 600546 | 山煤国际 | 486,600   | 9,469,236.00  | 1.34             |
| 26 | 000519 | 中兵红箭 | 318,200   | 9,275,530.00  | 1.31             |
| 27 | 603077 | 和邦生物 | 2,090,300 | 8,904,678.00  | 1.26             |
| 28 | 600486 | 扬农化工 | 64,565    | 8,605,223.20  | 1.22             |
| 29 | 600348 | 华阳股份 | 551,800   | 8,530,828.00  | 1.21             |
| 30 | 603026 | 石大胜华 | 57,200    | 8,314,020.00  | 1.18             |
| 31 | 601997 | 贵阳银行 | 1,393,800 | 8,097,978.00  | 1.15             |
| 32 | 603444 | 吉比特  | 20,233    | 7,850,404.00  | 1.11             |
| 33 | 300357 | 我武生物 | 147,600   | 7,679,628.00  | 1.09             |
| 34 | 601577 | 长沙银行 | 966,801   | 7,666,731.93  | 1.08             |
| 35 | 603198 | 迎驾贡酒 | 117,200   | 7,634,408.00  | 1.08             |
| 36 | 002056 | 横店东磁 | 285,400   | 7,597,348.00  | 1.07             |
| 37 | 601168 | 西部矿业 | 640,300   | 7,574,749.00  | 1.07             |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 38 | 002030 | 达安基因 | 412,362   | 7,088,502.78 | 1.00 |
| 39 | 300724 | 捷佳伟创 | 79,100    | 7,067,585.00 | 1.00 |
| 40 | 600867 | 通化东宝 | 678,000   | 7,010,520.00 | 0.99 |
| 41 | 600985 | 淮北矿业 | 479,030   | 6,974,676.80 | 0.99 |
| 42 | 600079 | 人福医药 | 431,500   | 6,904,000.00 | 0.98 |
| 43 | 000830 | 鲁西化工 | 397,100   | 6,865,859.00 | 0.97 |
| 44 | 601872 | 招商轮船 | 1,173,400 | 6,758,784.00 | 0.96 |
| 45 | 601699 | 潞安环能 | 457,200   | 6,684,264.00 | 0.95 |
| 46 | 000738 | 航发控制 | 235,400   | 6,614,740.00 | 0.94 |
| 47 | 300832 | 新产业  | 146,100   | 6,590,571.00 | 0.93 |
| 48 | 002326 | 永太科技 | 197,900   | 6,516,847.00 | 0.92 |
| 49 | 300244 | 迪安诊断 | 203,500   | 6,328,850.00 | 0.90 |
| 50 | 000999 | 华润三九 | 139,900   | 6,295,500.00 | 0.89 |
| 51 | 002372 | 伟星新材 | 256,400   | 6,163,856.00 | 0.87 |
| 52 | 600325 | 华发股份 | 799,900   | 6,055,243.00 | 0.86 |
| 53 | 300308 | 中际旭创 | 193,700   | 6,014,385.00 | 0.85 |
| 54 | 000960 | 锡业股份 | 344,900   | 5,783,973.00 | 0.82 |
| 55 | 000807 | 云铝股份 | 560,205   | 5,534,825.40 | 0.78 |
| 56 | 002958 | 青农商行 | 1,648,000 | 5,471,360.00 | 0.77 |
| 57 | 601016 | 节能风电 | 1,139,800 | 5,471,040.00 | 0.77 |
| 58 | 002966 | 苏州银行 | 869,770   | 5,305,597.00 | 0.75 |
| 59 | 603658 | 安图生物 | 106,300   | 5,197,007.00 | 0.74 |
| 60 | 600415 | 小商品城 | 913,300   | 5,087,081.00 | 0.72 |
| 61 | 300482 | 万孚生物 | 121,400   | 4,942,194.00 | 0.70 |
| 62 | 600497 | 驰宏锌锗 | 932,500   | 4,839,675.00 | 0.68 |
| 63 | 300699 | 光威复材 | 81,900    | 4,821,453.00 | 0.68 |
| 64 | 601866 | 中远海发 | 1,601,436 | 4,804,308.00 | 0.68 |
| 65 | 688185 | 康希诺  | 23,720    | 4,722,177.60 | 0.67 |
| 66 | 603233 | 大参林  | 149,720   | 4,686,236.00 | 0.66 |
| 67 | 603568 | 伟明环保 | 138,600   | 4,625,082.00 | 0.65 |
| 68 | 000878 | 云南铜业 | 405,100   | 4,614,089.00 | 0.65 |
| 69 | 600566 | 济川药业 | 169,500   | 4,603,620.00 | 0.65 |
| 70 | 600580 | 卧龙电驱 | 296,300   | 4,272,646.00 | 0.60 |
| 71 | 601860 | 紫金银行 | 1,405,800 | 4,034,646.00 | 0.57 |
| 72 | 603707 | 健友股份 | 138,200   | 3,897,240.00 | 0.55 |
| 73 | 002128 | 电投能源 | 265,300   | 3,799,096.00 | 0.54 |
| 74 | 603866 | 桃李面包 | 222,400   | 3,680,720.00 | 0.52 |
| 75 | 600597 | 光明乳业 | 272,000   | 3,435,360.00 | 0.49 |
| 76 | 000559 | 万向钱潮 | 569,300   | 3,381,642.00 | 0.48 |
| 77 | 000937 | 冀中能源 | 436,800   | 3,258,528.00 | 0.46 |
| 78 | 000825 | 太钢不锈 | 586,500   | 3,196,425.00 | 0.45 |
| 79 | 002831 | 裕同科技 | 106,300   | 3,141,165.00 | 0.44 |
| 80 | 601187 | 厦门银行 | 497,000   | 2,962,120.00 | 0.42 |
| 81 | 002690 | 美亚光电 | 136,508   | 2,959,493.44 | 0.42 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 82  | 002867 | 周大生  | 190,200 | 2,953,806.00 | 0.42 |
| 83  | 600582 | 天地科技 | 615,100 | 2,940,178.00 | 0.42 |
| 84  | 600901 | 江苏租赁 | 570,800 | 2,928,204.00 | 0.41 |
| 85  | 002948 | 青岛银行 | 792,980 | 2,870,587.60 | 0.41 |
| 86  | 002191 | 劲嘉股份 | 263,520 | 2,824,934.40 | 0.40 |
| 87  | 603883 | 老百姓  | 80,050  | 2,712,094.00 | 0.38 |
| 88  | 600648 | 外高桥  | 178,500 | 2,427,600.00 | 0.34 |
| 89  | 600808 | 马钢股份 | 613,100 | 2,323,649.00 | 0.33 |
| 90  | 601958 | 金钼股份 | 251,800 | 2,225,912.00 | 0.31 |
| 91  | 002004 | 华邦健康 | 392,600 | 2,190,708.00 | 0.31 |
| 92  | 601568 | 北元集团 | 335,300 | 2,125,802.00 | 0.30 |
| 93  | 002815 | 崇达技术 | 151,100 | 1,935,591.00 | 0.27 |
| 94  | 600787 | 中储股份 | 336,500 | 1,914,685.00 | 0.27 |
| 95  | 600968 | 海油发展 | 707,800 | 1,826,124.00 | 0.26 |
| 96  | 600928 | 西安银行 | 472,100 | 1,732,607.00 | 0.25 |
| 97  | 601156 | 东航物流 | 64,800  | 1,283,040.00 | 0.18 |
| 98  | 601665 | 齐鲁银行 | 240,400 | 1,173,152.00 | 0.17 |
| 99  | 603355 | 莱克电气 | 43,900  | 1,107,597.00 | 0.16 |
| 100 | 002946 | 新乳业  | 61,400  | 797,586.00   | 0.11 |
| 101 | 688052 | 纳芯微  | 2,175   | 763,011.75   | 0.11 |
| 102 | 688120 | 华海清科 | 2,833   | 615,100.96   | 0.09 |
| 103 | 301175 | 中科环保 | 63,694  | 243,311.08   | 0.03 |
| 104 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,747   | 193,386.55   | 0.03 |
| 105 | 688209 | 英集芯  | 6,822   | 188,150.76   | 0.03 |
| 106 | 688237 | 超卓航科 | 2,891   | 119,311.57   | 0.02 |
| 107 | 688193 | 仁度生物 | 1,635   | 84,316.95    | 0.01 |
| 108 | 301233 | 盛帮股份 | 1,576   | 65,435.52    | 0.01 |
| 109 | 301238 | 瑞泰新材 | 2,024   | 64,909.68    | 0.01 |
| 110 | 601089 | 福元医药 | 1,749   | 36,816.45    | 0.01 |
| 111 | 301206 | 三元生物 | 616     | 28,145.04    | 0.00 |
| 112 | 301216 | 万凯新材 | 854     | 25,483.36    | 0.00 |
| 113 | 301219 | 腾远钴业 | 281     | 24,677.42    | 0.00 |
| 114 | 301266 | 宇邦新材 | 517     | 24,335.19    | 0.00 |
| 115 | 301122 | 采纳股份 | 301     | 21,181.37    | 0.00 |
| 116 | 301102 | 兆讯传媒 | 642     | 19,959.78    | 0.00 |
| 117 | 301187 | 欧圣电气 | 876     | 19,745.04    | 0.00 |
| 118 | 301256 | 华融化学 | 1,831   | 18,456.48    | 0.00 |
| 119 | 301112 | 信邦智能 | 399     | 17,970.96    | 0.00 |
| 120 | 301153 | 中科江南 | 398     | 17,504.04    | 0.00 |
| 121 | 301103 | 何氏眼科 | 507     | 16,234.14    | 0.00 |
| 122 | 301235 | 华康医疗 | 418     | 15,854.74    | 0.00 |
| 123 | 301286 | 侨源股份 | 784     | 15,515.36    | 0.00 |
| 124 | 301151 | 冠龙节能 | 703     | 15,086.38    | 0.00 |
| 125 | 301160 | 翔楼新材 | 392     | 14,762.72    | 0.00 |

|     |        |      |     |           |      |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 126 | 301248 | 杰创智能 | 472 | 14,098.64 | 0.00 |
| 127 | 301298 | 东利机械 | 634 | 13,206.22 | 0.00 |
| 128 | 301258 | 富士莱  | 295 | 12,295.60 | 0.00 |
| 129 | 301097 | 天益医疗 | 249 | 11,909.67 | 0.00 |
| 130 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 131 | 301220 | 亚香股份 | 285 | 11,157.75 | 0.00 |
| 132 | 301137 | 哈焊华通 | 644 | 10,297.56 | 0.00 |
| 133 | 301288 | 清研环境 | 452 | 9,030.96  | 0.00 |
| 134 | 301125 | 腾亚精工 | 327 | 8,966.34  | 0.00 |
| 135 | 301163 | 宏德股份 | 277 | 8,955.41  | 0.00 |
| 136 | 301130 | 西点药业 | 237 | 8,934.90  | 0.00 |
| 137 | 301110 | 青木股份 | 202 | 8,049.70  | 0.00 |
| 138 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63  | 0.00 |
| 139 | 301279 | 金道科技 | 296 | 6,751.76  | 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  | 601615 | 明阳智能 | 19,888,210.00 | 2.17           |
| 2  | 300769 | 德方纳米 | 16,117,453.22 | 1.76           |
| 3  | 688099 | 晶晨股份 | 15,017,661.16 | 1.64           |
| 4  | 600141 | 兴发集团 | 14,601,673.99 | 1.60           |
| 5  | 605358 | 立昂微  | 14,213,945.00 | 1.55           |
| 6  | 600096 | 云天化  | 14,115,478.61 | 1.54           |
| 7  | 300751 | 迈为股份 | 14,036,191.01 | 1.53           |
| 8  | 300390 | 天华超净 | 13,116,539.20 | 1.43           |
| 9  | 600765 | 中航重机 | 12,997,911.88 | 1.42           |
| 10 | 300363 | 博腾股份 | 12,653,135.81 | 1.38           |
| 11 | 600233 | 圆通速递 | 12,566,200.42 | 1.37           |
| 12 | 601077 | 渝农商行 | 12,288,891.00 | 1.34           |
| 13 | 002497 | 雅化集团 | 12,108,368.00 | 1.32           |
| 14 | 002240 | 盛新锂能 | 11,921,231.30 | 1.30           |
| 15 | 300012 | 华测检测 | 11,915,566.00 | 1.30           |
| 16 | 603613 | 国联股份 | 11,488,504.55 | 1.26           |
| 17 | 603077 | 和邦生物 | 11,454,574.64 | 1.25           |
| 18 | 600256 | 广汇能源 | 11,213,241.80 | 1.23           |
| 19 | 002407 | 多氟多  | 10,930,065.84 | 1.20           |
| 20 | 000807 | 云铝股份 | 10,284,005.20 | 1.12           |

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  | 600188 | 兖矿能源 | 22,968,741.00 | 2.51           |
| 2  | 000733 | 振华科技 | 20,305,333.80 | 2.22           |
| 3  | 300751 | 迈为股份 | 15,943,075.50 | 1.74           |
| 4  | 600867 | 通化东宝 | 15,562,242.04 | 1.70           |
| 5  | 002408 | 齐翔腾达 | 15,523,809.85 | 1.70           |
| 6  | 600373 | 中文传媒 | 14,247,987.58 | 1.56           |
| 7  | 000723 | 美锦能源 | 13,611,416.63 | 1.49           |
| 8  | 000932 | 华菱钢铁 | 13,297,785.00 | 1.45           |
| 9  | 603613 | 国联股份 | 13,164,431.88 | 1.44           |
| 10 | 605358 | 立昂微  | 13,042,452.00 | 1.43           |
| 11 | 601000 | 唐山港  | 12,866,094.26 | 1.41           |
| 12 | 002430 | 杭氧股份 | 12,098,971.60 | 1.32           |
| 13 | 601717 | 郑煤机  | 10,917,548.99 | 1.19           |
| 14 | 600765 | 中航重机 | 10,880,983.80 | 1.19           |
| 15 | 601928 | 凤凰传媒 | 10,393,940.00 | 1.14           |
| 16 | 603228 | 景旺电子 | 10,257,613.00 | 1.12           |
| 17 | 600901 | 江苏租赁 | 10,257,576.00 | 1.12           |
| 18 | 002013 | 中航机电 | 9,942,920.00  | 1.09           |
| 19 | 000630 | 铜陵有色 | 9,831,008.19  | 1.07           |
| 20 | 601636 | 旗滨集团 | 9,421,742.45  | 1.03           |

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 | 837,268,477.33 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 880,325,778.24 |

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） | 147,927.88 | 0.02 |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 147,927.88 | 0.02 |

#### 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<br>比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|------------------|
| 1  | 127064 | 杭氧转债 | 1,479 | 147,927.88 | 0.02             |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 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 | 1,752,856.00 |
| 2  | 应收清算款 | 37,979.94    |
| 3  | 应收股利  | 62,666.69    |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | -            |
| 6  | 其他应收款 | 15,626.53    |
| 7  | 待摊费用  | 75,616.24    |
| 8  | 其他    | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 1,944,745.40 |
|---|----|--------------|

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|----------|
| 1  | 601615 | 明阳智能 | 4,772,560.00    | 0.68             | 转融通流通受限  |
| 2  | 600096 | 云天化  | 2,757,648.00    | 0.39             | 转融通流通受限  |
| 3  | 002407 | 多氟多  | 2,641,140.00    | 0.37             | 转融通流通受限  |
| 4  | 002497 | 雅化集团 | 1,015,415.00    | 0.14             | 转融通流通受限  |

### 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<br>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<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 11,914   | 61,459.03     | 57,391,557.00 | 7.84%      | 674,831,281.00 | 92.16%     |

#### 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  | 申万宏源证券有限公司               | 11,653,410.00 | 1.59%    |
| 2  | 中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 8,714,100.00  | 1.19%    |
| 3  | 陆瑞霞                      | 6,819,039.00  | 0.93%    |
| 4  | 方正证券股份有限公司               | 5,608,420.00  | 0.77%    |

|    |              |              |       |
|----|--------------|--------------|-------|
| 5  | 中信证券股份有限公司   | 5,045,850.00 | 0.69% |
| 6  | 中国国际金融股份有限公司 | 4,545,738.00 | 0.62% |
| 7  | 郭奕恒          | 4,010,800.00 | 0.55% |
| 8  | 广发证券股份有限公司   | 3,700,100.00 | 0.51% |
| 9  | 胡志强          | 3,634,236.00 | 0.50% |
| 10 | 何衍东          | 3,161,100.00 | 0.43% |

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00      | 0.0000%  |

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>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（2021 年 12 月 17 日）基金份额总额 | 965,222,838.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 912,222,838.00 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 96,000,000.00  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 276,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 732,222,838.00 |

## 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 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

基金托管人于 2022 年 4 月 14 日发布公告，国信证券股份有限公司资产托管部总经理胡忠孝因工作安排离任，孙英担任国信证券股份有限公司资产托管部副总经理（主持工作）。

### 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

本报告期，基金管理人和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 |    |
| 广发证券 | 6      | 1,704,992,133.24 | 100.00%      | 701,359.61 | 100.00%    | -  |

注：a) 本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

b) 本基金选择的证券经纪商为广发证券股份有限公司。广发证券股份有限公司系本基金管理人的股东。

c) 沪深交易所 A 股股票交易佣金率为 0.049%（包括经手费、证管费、过户费），其中深交所股票大宗交易佣金率为 0.0493%（包括经手费、证管费、过户费）。北交所和新三板股票交易佣金率为 0.05%（包含经手费）。基金交易佣金率为 0.05%，货币 ETF 及国债 ETF 不收取佣金。港股通股票交易佣金率为 0.05%（包含交易征费和交易费）。债券、回购交易佣金率为 0.0001%

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

e) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订经纪服务协议。

#### 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 |
|      |      |              |        |                |      |              |

|      |              |         |   |   |   |   |
|------|--------------|---------|---|---|---|---|
| 广发证券 | 1,763,812.29 | 100.00% | - | - | - | - |
|------|--------------|---------|---|---|---|---|

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                             | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告        | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |
| 2  | 易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告                           | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-07 |
| 3  | 易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加开源证券为申购赎回代办证券公司的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-12 |
| 4  | 易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金增加浙商证券为申购赎回代办证券公司的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-25 |
| 5  | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江阴标榜汽车部件股份有限公司首次公开发行股票的公告     | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-02-12 |
| 6  | 易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办证券公司的公告      | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-02-23 |
| 7  | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购万控智造股份有限公司首次公开发行股票的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-04 |
| 8  | 易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华安证券为申购赎回代办证券公司的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-08 |
| 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               | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-11 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                            | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-21 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告              | 上海证券报                       | 2022-04-22 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                            | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-13 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告                          | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金       | 2022-05-14 |

|    |                                            |                             |            |
|----|--------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    |                                            | 电子披露网站                      |            |
| 14 | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金重大关联交易事项的公告               | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-28 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购昆山亚香香料股份有限公司首次公开发行股票的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-16 |

## 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中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日