

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券
投资基金联接基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 期末投资目标基金明细	48
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.7 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	59
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	60

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.13	投资组合报告附注	60
§8	基金份额持有人信息	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
§9	开放式基金份额变动	63
§10	重大事件揭示	63
10.1	基金份额持有人大会决议	63
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4	基金投资策略的改变	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8	其他重大事件	67
§11	备查文件目录	68
11.1	备查文件目录	68
11.2	存放地点	69
11.3	查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金 联接基金	
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式联接	
基金主代码	110020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,756,350,680.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式 联接 A	易方达沪深 300ETF 发起 式联接 C
下属分级基金的交易代码	110020	007339
报告期末下属分级基金的份额总额	4,314,245,419.15 份	442,105,261.37 份

注：自 2019 年 4 月 25 日起,本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金主代码	510310
基金运作方式	交易型开放式（ETF）、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 25 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避

	免跟踪误差进一步扩大。本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可投资存托凭证。此外，为更好地实现投资目标，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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道	北京市西城区金融大街25号

	188号6层	
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	刘晓艳	田国立

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	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年1月1日至2022年6月30日）	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
本期已实现收益	44,637,121.96	4,635,316.38
本期利润	-448,213,210.57	47,450,490.56
加权平均基金份额本期利润	-0.1155	0.0831
本期加权平均净值利润率	-7.27%	5.40%
本期基金份额净值增长率	-8.01%	-8.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
期末可供分配利润	2,839,084,899.23	286,275,123.09
期末可供分配基金份额利润	0.6581	0.6475
期末基金资产净值	7,153,330,318.38	728,380,384.46

期末基金份额净值	1.6581	1.6475
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
基金份额累计净值增长率	65.81%	22.30%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.84%	1.00%	9.12%	1.02%	0.72%	-0.02%
过去三个月	6.69%	1.35%	5.93%	1.36%	0.76%	-0.01%
过去六个月	-8.01%	1.36%	-8.72%	1.38%	0.71%	-0.02%
过去一年	-11.48%	1.17%	-13.40%	1.18%	1.92%	-0.01%
过去三年	25.27%	1.19%	16.70%	1.20%	8.57%	-0.01%
自基金合同生效起至今	65.81%	1.34%	44.20%	1.38%	21.61%	-0.04%

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.81%	1.00%	9.12%	1.02%	0.69%	-0.02%
过去三个月	6.63%	1.35%	5.93%	1.36%	0.70%	-0.01%
过去六个月	-8.10%	1.36%	-8.72%	1.38%	0.62%	-0.02%
过去一年	-11.66%	1.17%	-13.40%	1.18%	1.74%	-0.01%
过去三年	24.54%	1.19%	16.70%	1.20%	7.84%	-0.01%
自基金合同生效起至今	22.30%	1.21%	13.46%	1.22%	8.84%	-0.01%

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

(2009 年 8 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

(2019 年 4 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1.自 2019 年 4 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26

日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 65.81%，同期业绩比较基准收益率为 44.20%；C 类基金份额净值增长率为 22.30%，同期业绩比较基准收益率为 13.46%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
余海燕	本基金的基金经理,易方达沪深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企联接（QDII）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达日兴资管日经 225ETF（QDII）、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员	2016-04-16	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 的基金经理。

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

本基金为易方达沪深 300ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达沪深 300ETF 跟踪沪深 300 指数，该指数由中国 A 股市场中规模大、流动性好的最具有代表性的 300 只证券组成，以综合反映中国 A 股市场上市公司证券的整体表现。

2022 年上半年，受国内局部地区疫情反复、地缘政治风险加剧以及大宗商品价格大幅波动等不

稳定因素的影响，我国企业生产经营活动受到了一定考验。随着国内疫情逐步得到控制，叠加“稳增长”政策发力，流动性投放增加，我国社会经济活动逐渐回归正轨。在上述多重因素持续变化的影响下，报告期内 A 股市场整体走势先抑后扬，波动率维持在较高水平。沪深 300 指数作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，聚集 A 股最核心的权益资产，涵盖了各行业龙头，指数表现跟中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关。报告期内指数中的煤炭、房地产、建筑装饰、汽车等行业的成份股表现较好，对沪深 300 指数收益贡献较大，而电子、非银金融、医药生物、计算机等行业的成份股表现落后，拖累了指数的表现。报告期内沪深 300 指数下跌 9.22%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，依据基金申购赎回变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.6581 元，本报告期份额净值增长率为-8.01%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%；C 类基金份额净值为 1.6475 元，本报告期份额净值增长率为-8.10%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%，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，伴随国内稳增长一揽子政策措施的实施，中国经济复苏进程仍将延续。国内经济的复苏情况或将成为下半年对 A 股市场最重要的边际影响因素。统筹疫情防控和社会经济发展仍是下一阶段我国社会经济工作的重中之重，以稳增长为导向的货币与财政政策将着力于增强经济发展的韧性。货币政策保持流动性合理充裕，发挥总量和结构双重功能，通过“宽信用”“降成本”促进居民和企业扩张资产负债表，畅通经济正向循环。财政政策积极靠前发力，为提振内需、基建投资等稳增长措施提供精准有力支持，保持经济运行在合理区间。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的各行业龙头优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，沪深 300 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

指数的长期收益表现取决于其成份股盈利的长期增长情况，沪深 300 指数作为 A 股市场的核心主流指数，涵盖了中国经济中主要行业的龙头企业，长期来看这些企业的盈利增速会随着整体经济的增长而相应增长。巴菲特曾经在其公司的股东大会上给中国投资者建议：“投资他们自己能够理解的东西，如果他们不理解整体市场或者具体行业，他们应该投资指数基金。”大道至简，高效、便捷、低成本的指数基金可以为投资者提供分享中国经济增长及企业盈利的重要工具。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	234,552,272.45	222,249,070.24
结算备付金		16,763,234.68	7,632,091.07
存出保证金		6,763,226.68	3,702,313.12
交易性金融资产	6.4.7.2	7,625,394,677.99	6,671,938,342.21
其中：股票投资		139,969,034.95	139,551,594.44
基金投资		7,283,778,463.90	6,377,262,791.55
债券投资		201,647,179.14	155,123,956.22
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		31,463,291.07	12,207,848.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	1,999,652.97	4,150,290.90
资产总计		7,916,936,355.84	6,921,879,956.48
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 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		6,362,092.79	4,330,054.26
应付赎回款		27,333,015.28	5,767,578.42
应付管理人报酬		71,966.89	68,730.79
应付托管费		23,989.01	22,910.28
应付销售服务费		146,546.25	78,065.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,164.42	652,864.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,283,878.36	729,362.38
负债合计		35,225,653.00	11,649,566.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,756,350,680.52	3,835,418,192.72
未分配利润	6.4.7.8	3,125,360,022.32	3,074,812,197.75
净资产合计		7,881,710,702.84	6,910,230,390.47
负债和净资产总计		7,916,936,355.84	6,921,879,956.48

注：1.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.6581 元，C 类基金份额净值 1.6475 元；基金份额总额 4,756,350,680.52 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 4,314,245,419.15 份，C 类基金份额总额 442,105,261.37 份。

2.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：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-399,159,261.87	100,193,376.62
1.利息收入		522,920.26	1,848,331.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	522,920.26	438,398.67
债券利息收入		-	1,409,932.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		49,251,315.58	241,517,054.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,274,670.93	22,096,751.13
基金投资收益	6.4.7.11	37,815,285.59	216,490,294.09
债券投资收益	6.4.7.12	3,003,112.11	669,031.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-3,434,888.10	1,372,147.57
股利收益	6.4.7.15	1,593,135.05	888,829.85
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-450,035,158.35	-145,360,503.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,101,660.64	2,188,494.93
减：二、营业总支出		1,603,458.14	2,627,985.09
1. 管理人报酬		409,911.05	372,497.87
2. 托管费		136,637.04	124,165.96
3. 销售服务费		877,336.28	437,856.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		75,580.19	773,375.51
8. 其他费用	6.4.7.19	103,993.58	920,089.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-400,762,720.01	97,565,391.53
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-400,762,720.01	97,565,391.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-400,762,720.01	97,565,391.53

注：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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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 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）	3,835,418,192.72	-	3,074,812,197.75	6,910,230,390.47
二、本期期初净资产（基金净值）	3,835,418,192.72	-	3,074,812,197.75	6,910,230,390.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	920,932,487.80	-	50,547,824.57	971,480,312.37
（一）、综合收益总额	-	-	-400,762,720.01	-400,762,720.01
（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）	920,932,487.80	-	451,310,544.58	1,372,243,032.38
其中：1.基金申购款	3,025,698,504.73	-	1,618,259,831.99	4,643,958,336.72
2.基金赎回款	-2,104,766,016.93	-	-1,166,949,287.41	-3,271,715,304.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,756,350,680.52	-	3,125,360,022.32	7,881,710,702.84

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
产（基金净值）				84
一、上期期末净资产（基金净值）	3,339,990,465.39	-	2,828,170,366.18	6,168,160,831.57
二、本期期初净资产（基金净值）	3,339,990,465.39	-	2,828,170,366.18	6,168,160,831.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	133,709,216.48	-	203,135,903.46	336,845,119.94
（一）、综合收益总额	-	-	97,565,391.53	97,565,391.53
（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）	133,709,216.48	-	105,570,511.93	239,279,728.41
其中：1.基金申购款	1,590,254,866.29	-	1,390,128,951.88	2,980,383,818.17
2.基金赎回款	-1,456,545,649.81	-	-1,284,558,439.95	-2,741,104,089.76
（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）	3,473,699,681.87	-	3,031,306,269.64	6,505,005,951.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原名易方达沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]第 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限

公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达沪深 300 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,《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,539,280.61 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会 2013 年 9 月 17 日下发的《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2013]812 号),易方达沪深 300 指数证券投资基金自 2013 年 9 月 17 日起变更为易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金,修改基金合同中基金名称、投资范围、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会等条款。

自 2019 年 4 月 25 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其

他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值

中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计

算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4 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。

6.4.5 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a)金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 222,249,070.24 元、7,632,091.07 元、3,702,313.12 元、3,180,601.59 元、12,207,848.94 元和 969,689.31 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 222,270,555.80 元、7,635,700.95 元、3,702,420.72 元、0.00 元、12,207,848.94 元和 969,689.31 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 6,671,938,342.21 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 6,675,093,740.76 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,330,054.26 元、5,767,578.42 元、68,730.79 元、22,910.28 元、78,065.31 元、559,496.71 元和 9,865.67 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,330,054.26 元、5,767,578.42 元、68,730.79 元、22,910.28 元、78,065.31 元、559,496.71 元和 9,865.67 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b)修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	234,552,272.45
等于：本金	234,528,072.23
加：应计利息	24,200.22
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	234,552,272.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	139,054,755.56	-	139,969,034.95	914,279.39	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	14,999.94	1.12	15,001.06	-
	银行间 市场	199,891,500.00	1,652,178.08	201,632,178.08	88,500.00
	合计	199,906,499.94	1,652,179.20	201,647,179.14	88,500.00
	资产支持证券	-	-	-	-
基金	6,613,766,840.34	-	7,283,778,463.90	670,011,623.56	
其他	-	-	-	-	

合计	6,952,728,095.84	1,652,179.20	7,625,394,677.99	671,014,402.95
----	------------------	--------------	------------------	----------------

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 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	40,108,380.00	-	-	-
IF2209	40,108,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	40,108,380.00	-	-	-

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
IF2209	IF2209	34	45,361,440.00	5,253,060.00
合计	-	-	-	5,253,060.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	5,253,060.00
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 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1,999,652.97
待摊费用	-
合计	1,999,652.97

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	35,814.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,048,720.47
其中：交易所市场	1,048,170.47
银行间市场	550.00
应付利息	-
预提费用	199,343.16
合计	1,283,878.36

6.4.7.7 实收基金

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	3,558,280,186.16	3,558,280,186.16
本期申购	1,389,222,771.92	1,389,222,771.92
本期赎回（以“-”号填列）	-633,257,538.93	-633,257,538.93
本期末	4,314,245,419.15	4,314,245,419.15

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 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	277,138,006.56	277,138,006.56
本期申购	1,636,475,732.81	1,636,475,732.81
本期赎回（以“-”号填列）	-1,471,508,478.00	-1,471,508,478.00
本期末	442,105,261.37	442,105,261.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,814,125,540.97	41,007,543.60	2,855,133,084.57
本期利润	44,637,121.96	-492,850,332.53	-448,213,210.57
本期基金份额交易产生的变动数	603,049,568.78	-170,884,543.55	432,165,025.23
其中：基金申购款	1,107,659,441.66	-299,743,406.48	807,916,035.18
基金赎回款	-504,609,872.88	128,858,862.93	-375,751,009.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,461,812,231.71	-622,727,332.48	2,839,084,899.23

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	216,502,259.86	3,176,853.32	219,679,113.18
本期利润	4,635,316.38	42,815,174.18	47,450,490.56
本期基金份额交易产生的变动数	128,634,402.17	-109,488,882.82	19,145,519.35
其中：基金申购款	1,287,202,604.99	-476,858,808.18	810,343,796.81
基金赎回款	-1,158,568,202.82	367,369,925.36	-791,198,277.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349,771,978.41	-63,496,855.32	286,275,123.09

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	433,968.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	84,700.52
其他	4,251.56
合计	522,920.26

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 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	2,934,498.65
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	7,340,172.28
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,274,670.93

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	591,372,711.11
减：卖出股票成本总额	585,631,591.47
减：交易费用	2,806,620.99
买卖股票差价收入	2,934,498.65

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	2,990,600,400.00
减：现金支付申购款总额	1,260,186,208.74
减：申购股票成本总额	1,723,074,018.98
减：交易费用	-
申购差价收入	7,340,172.28

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,704,515,689.25
减：卖出/赎回基金成本总额	1,665,890,579.03
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	732,795.36
减：交易费用	77,029.27
基金投资收益	37,815,285.59

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,612,760.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,390,352.04
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	3,003,112.11

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	164,908,458.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	159,826,395.71
减：应计利息总额	3,690,599.21
减：交易费用	1,111.39
买卖债券差价收入	1,390,352.04

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-3,434,888.10

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,593,135.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,593,135.05

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-455,477,270.35
——股票投资	-8,221,030.03
——债券投资	-212,060.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-447,044,180.32
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	5,442,112.00
——权证投资	-
——期货投资	5,442,112.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-450,035,158.35

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	1,101,660.64
其他	-
合计	1,101,660.64

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,050.42
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	103,993.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售

	机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	18,518,158.62	0.76%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	11,110.93	0.57%	2,573.10	0.25%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
-	-	-	-	-

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	409,911.05	372,497.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,722,848.68	1,490,461.01

注：本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理人的管理费每日计提，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，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	136,637.04	124,165.96

注：本基金托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

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，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时

联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	163,287.93	163,287.93
广发证券	-	994.03	994.03
合计	-	164,281.96	164,281.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达沪深300ETF 发起式联接A	易方达沪深300ETF发起式联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	196,592.32	196,592.32
广发证券	-	161.81	161.81
合计	-	196,754.13	196,754.13

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

无。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	234,552,272.45	433,968.18	200,981,129.66	356,078.17

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	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
广发证券	600958	东方证券	配股	6,048	51,166.08
上年度可比期间					

2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30

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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 3,455,794,688 份和 2,776,465,145 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 62.61%和 59.80%。本基金在报告期内因赎回目标 ETF 基金份额而持有托管行发行的股票建设银行。于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有建设银行的 A 股（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.11 利润分配情况

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

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	2022-0	6 个月	新股	27.53	45.04	399	10,984	17,970	-

	智能	6-20		流通受限				.47	.96	
301116	益客食品	2022-01-10	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
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	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
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	-
301158	德石股份	2022-01-07	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
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	-

30118 1	标榜 股份	2022-0 2-11	6 个月	新股 流通 受限	40.25	30.59	257	10,344 .25	7,861. 63	-
30118 7	欧圣 电气	2022-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	21.33	22.54	876	18,685 .08	19,745 .04	-
30119 6	唯科 科技	2022-0 1-04	6 个月	新股 流通 受限	64.08	37.52	271	17,365 .68	10,167 .92	-
30120 1	诚达 药业	2022-0 1-12	6 个月	新股 流通 受限	72.69	71.54	353	25,659 .57	25,253 .62	-
30120 6	三元 生物	2022-0 1-26	6 个月	新股 流通 受限	109.30	45.69	945	68,859 .00	43,177 .05	-
30121 6	万凯 新材	2022-0 3-21	6 个月	新股 流通 受限	35.68	29.84	1,120	39,961 .60	33,420 .80	-
30121 9	腾远 钴业	2022-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	173.98	87.82	578	55,847 .58	50,759 .96	-
30122 0	亚香 股份	2022-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	35.98	39.15	285	10,254 .30	11,157 .75	-
30123 3	盛帮 股份	2022-0 6-24	1 个月 以内	新股 流通 受限	41.52	41.52	1,418	58,875 .36	58,875 .36	-
30123 3	盛帮 股份	2022-0 6-24	6 个月	新股 流通 受限	41.52	41.52	158	6,560. 16	6,560. 16	-
30123 5	华康 医疗	2022-0 1-21	6 个月	新股 流通 受限	39.30	37.93	418	16,427 .40	15,854 .74	-
30123 8	瑞泰 新材	2022-0 6-10	6 个月	新股 流通 受限	19.18	32.07	3,497	67,072 .46	112,14 8.79	-
30123 9	普瑞 眼科	2022-0 6-22	1 个月 以内	新股 流通 受限	33.65	33.65	5,172	174,03 7.80	174,03 7.80	-
30123 9	普瑞 眼科	2022-0 6-22	6 个月	新股 流通 受限	33.65	33.65	575	19,348 .75	19,348 .75	-
30124 8	杰创 智能	2022-0 4-13	6 个月	新股 流通	39.07	29.87	472	18,441 .04	14,098 .64	-

				受限						
30125 6	华融 化学	2022-0 3-14	6 个月	新股 流通 受限	8.05	10.08	1,831	14,739 .55	18,456 .48	-
30125 8	富士 莱	2022-0 3-21	6 个月	新股 流通 受限	48.30	41.68	295	14,248 .50	12,295 .60	-
30125 9	艾布 鲁	2022-0 4-18	6 个月	新股 流通 受限	18.39	24.94	483	8,882. 37	12,046 .02	-
30126 6	宇邦 新材	2022-0 5-30	6 个月	新股 流通 受限	26.86	47.07	517	13,886 .62	24,335 .19	-
30127 9	金道 科技	2022-0 4-06	6 个月	新股 流通 受限	31.20	22.81	296	9,235. 20	6,751. 76	-
30128 6	侨源 股份	2022-0 6-06	6 个月	新股 流通 受限	16.91	19.79	784	13,257 .44	15,515 .36	-
30128 8	清研 环境	2022-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	19.09	19.98	452	8,628. 68	9,030. 96	-
30129 8	东利 机械	2022-0 5-27	6 个月	新股 流通 受限	12.68	20.83	634	8,039. 12	13,206 .22	-
60094 1	中国 移动	2021-1 2-24	6 个月	新股 流通 受限	57.58	60.26	87,363	5,030, 361.54	5,264, 494.38	-
68811 9	中钢 洛耐	2022-0 5-27	6 个月	新股 流通 受限	5.06	7.01	33,327	168,63 4.62	233,62 2.27	-
68820 9	英集 芯	2022-0 4-12	6 个月	新股 流通 受限	24.23	27.58	6,822	165,29 7.06	188,15 0.76	-
68823 7	超卓 航科	2022-0 6-24	1 个月 以内	新股 流通 受限	41.27	41.27	2,891	119,31 1.57	119,31 1.57	-
68826 7	中触 媒	2022-0 2-09	6 个月	新股 流通 受限	41.90	31.90	3,390	142,04 1.00	108,14 1.00	-
68828 3	坤恒 顺维	2022-0 2-08	6 个月	新股 流通 受限	33.80	45.41	1,595	53,911 .00	72,428 .95	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022-06-15	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	150	15,000.00	15,001.06	-

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金属股票基金，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。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 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.07%)。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	201,632,178.08	153,220,287.67
合计	201,632,178.08	153,220,287.67

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 2022年6月30日	上年度末 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 2022年6月30日	上年度末 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	上年度末
--------	-----	------

	2022年6月30日	2021年12月31日
AAA	15,001.06	5,059,067.10
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	15,001.06	5,059,067.10

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 2022年6月30日	上年度末 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 2022年6月30日	上年度末 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 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	234,552,272.45	-	-	-	234,552,272.45
结算备付金	16,763,234.68	-	-	-	16,763,234.68
存出保证金	6,763,226.68	-	-	-	6,763,226.68

交易性金融资产	201,632,178.08	-	15,001.06	7,423,747,498.85	7,625,394,677.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	31,463,291.07	31,463,291.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,999,652.97	1,999,652.97
资产总计	459,710,911.89	-	15,001.06	7,457,210,442.89	7,916,936,355.84
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	-	-	-	6,362,092.79	6,362,092.79
应付赎回款	-	-	-	27,333,015.28	27,333,015.28
应付管理人报酬	-	-	-	71,966.89	71,966.89
应付托管费	-	-	-	23,989.01	23,989.01
应付销售服务费	-	-	-	146,546.25	146,546.25
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,164.42	4,164.42
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,283,878.36	1,283,878.36
负债总计	-	-	-	35,225,653.00	35,225,653.00
利率敏感度缺口	459,710,911.89	-	15,001.06	7,421,984,789.89	7,881,710,702.84
上年度末					
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	222,249,070.24	-	-	-	222,249,070.24

结算备付金	7,632,091.07	-	-	-	7,632,091.07
存出保证金	3,702,313.12	-	-	-	3,702,313.12
交易性金融资产	150,065,000.00	-	5,058,956.22	6,516,814,385.99	6,671,938,342.21
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	-	-	-	3,180,601.59	3,180,601.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	12,207,848.94	12,207,848.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	969,689.31	969,689.31
资产总计	383,648,474.43	-	5,058,956.22	6,533,172,525.83	6,921,879,956.48
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	-	-	-	4,330,054.26	4,330,054.26
应付赎回款	-	-	-	5,767,578.42	5,767,578.42
应付管理人报酬	-	-	-	68,730.79	68,730.79
应付托管费	-	-	-	22,910.28	22,910.28
应付销售服务费	-	-	-	78,065.31	78,065.31
应付交易费用	-	-	-	559,496.71	559,496.71
应交税费	-	-	-	652,864.57	652,864.57
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,865.67	169,865.67
负债总计	-	-	-	11,649,566.01	11,649,566.01
利率敏感度缺口	383,648,474.43	-	5,058,956.22	6,521,522,959.82	6,910,230,390.47

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

假设	除市场利率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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	296,812.44	54,924.47
	2.市场利率上升 25 个基点	-295,839.37	-54,863.12

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 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	139,969,034.95	1.78	139,551,594.44	2.02
交易性金融资产—基金投资	7,283,778,463.90	92.41	6,377,262,791.55	92.29
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	7,423,747,498.85	94.19	6,516,814,385.99	94.31

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	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	355,068,029.68	300,270,116.87
	2.业绩比较基准下降 5%	-355,068,029.68	-300,270,116.87

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
	2022 年 6 月 30 日
第一层次	7,416,573,671.71
第二层次	202,218,381.55
第三层次	6,602,624.73
合计	7,625,394,677.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、和债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	139,969,034.95	1.77
	其中：股票	139,969,034.95	1.77
2	基金投资	7,283,778,463.90	92.00
3	固定收益投资	201,647,179.14	2.55
	其中：债券	201,647,179.14	2.55
	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	251,315,507.13	3.17
8	其他各项资产	40,226,170.72	0.51
9	合计	7,916,936,355.84	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 (%)
1	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)、发起式	易方达基金管理有限公司	7,283,778,463.90	92.41

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	2,401,377.40	0.03
B	采矿业	3,017,945.00	0.04
C	制造业	81,474,947.91	1.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,783,890.00	0.04
E	建筑业	2,092,870.00	0.03
F	批发和零售业	479,332.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,230,649.80	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,572,630.47	0.13
J	金融业	24,648,714.31	0.31
K	房地产业	3,086,956.00	0.04
L	租赁和商务服务业	1,917,655.78	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,919,880.19	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	255,357.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	64,269.00	0.00
Q	卫生和社会工作	1,769,023.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	253,536.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	139,969,034.95	1.78

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,000	6,135,000.00	0.08
2	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.07
3	000858	五粮液	19,600	3,957,828.00	0.05
4	002594	比亚迪	9,200	3,068,108.00	0.04

5	000333	美的集团	49,500	2,989,305.00	0.04
6	300750	宁德时代	5,300	2,830,200.00	0.04
7	600036	招商银行	64,800	2,734,560.00	0.03
8	601318	中国平安	56,709	2,647,743.21	0.03
9	300059	东方财富	103,920	2,639,568.00	0.03
10	601012	隆基绿能	31,712	2,112,970.56	0.03
11	000568	泸州老窖	7,500	1,849,050.00	0.02
12	002415	海康威视	46,100	1,668,820.00	0.02
13	002475	立讯精密	48,660	1,644,221.40	0.02
14	000651	格力电器	47,800	1,611,816.00	0.02
15	601166	兴业银行	76,100	1,514,390.00	0.02
16	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.02
17	000001	平安银行	97,900	1,466,542.00	0.02
18	000002	万科 A	68,700	1,408,350.00	0.02
19	002142	宁波银行	39,100	1,400,171.00	0.02
20	002714	牧原股份	24,920	1,377,328.40	0.02
21	600900	长江电力	59,500	1,375,640.00	0.02
22	002129	TCL 中环	22,800	1,342,692.00	0.02
23	300124	汇川技术	18,700	1,231,769.00	0.02
24	300015	爱尔眼科	27,390	1,226,250.30	0.02
25	002460	赣锋锂业	8,200	1,219,340.00	0.02
26	000725	京东方 A	308,400	1,215,096.00	0.02
27	601888	中国中免	5,200	1,211,236.00	0.02
28	603259	药明康德	10,800	1,123,092.00	0.01
29	002304	洋河股份	6,100	1,117,215.00	0.01
30	600030	中信证券	51,075	1,106,284.50	0.01
31	600887	伊利股份	26,800	1,043,860.00	0.01
32	300498	温氏股份	48,100	1,024,049.00	0.01
33	002271	东方雨虹	19,850	1,021,679.50	0.01
34	300014	亿纬锂能	10,300	1,004,250.00	0.01
35	300122	智飞生物	8,100	899,181.00	0.01
36	601398	工商银行	183,400	874,818.00	0.01
37	600276	恒瑞医药	23,440	869,389.60	0.01
38	002352	顺丰控股	15,300	853,893.00	0.01
39	600438	通威股份	14,200	850,012.00	0.01
40	600809	山西汾酒	2,600	844,480.00	0.01
41	000063	中兴通讯	32,000	816,960.00	0.01
42	002241	歌尔股份	24,200	813,120.00	0.01
43	600309	万华化学	8,300	805,017.00	0.01
44	300142	沃森生物	16,200	783,918.00	0.01
45	000661	长春高新	3,300	770,286.00	0.01
46	002371	北方华创	2,700	748,224.00	0.01
47	002230	科大讯飞	17,900	737,838.00	0.01
48	000625	长安汽车	41,756	723,213.92	0.01

49	601328	交通银行	143,800	716,124.00	0.01
50	601899	紫金矿业	75,400	703,482.00	0.01
51	002027	分众传媒	102,000	686,460.00	0.01
52	000100	TCL 科技	141,600	678,264.00	0.01
53	000338	潍柴动力	53,500	667,145.00	0.01
54	603288	海天味业	7,335	662,790.60	0.01
55	600048	保利发展	37,600	656,496.00	0.01
56	603799	华友钴业	6,700	640,654.00	0.01
57	300347	泰格医药	5,201	595,254.45	0.01
58	300760	迈瑞医疗	1,900	595,080.00	0.01
59	600031	三一重工	31,100	592,766.00	0.01
60	601668	中国建筑	109,700	583,604.00	0.01
61	601088	中国神华	17,300	576,090.00	0.01
62	600436	片仔癀	1,600	570,768.00	0.01
63	600690	海尔智家	19,800	543,708.00	0.01
64	002812	恩捷股份	2,100	525,945.00	0.01
65	002410	广联达	9,600	522,624.00	0.01
66	601816	京沪高铁	102,800	516,056.00	0.01
67	601288	农业银行	167,000	504,340.00	0.01
68	002311	海大集团	8,400	504,084.00	0.01
69	002050	三花智控	18,200	500,136.00	0.01
70	600837	海通证券	50,500	495,405.00	0.01
71	600000	浦发银行	61,500	492,615.00	0.01
72	000792	盐湖股份	16,400	491,344.00	0.01
73	002179	中航光电	7,700	487,564.00	0.01
74	002466	天齐锂业	3,900	486,720.00	0.01
75	603501	韦尔股份	2,800	484,484.00	0.01
76	600016	民生银行	129,900	483,228.00	0.01
77	600406	国电南瑞	17,600	475,200.00	0.01
78	002493	荣盛石化	30,650	471,703.50	0.01
79	601919	中远海控	33,162	460,951.80	0.01
80	688981	中芯国际	10,140	458,023.80	0.01
81	600585	海螺水泥	12,600	444,528.00	0.01
82	000538	云南白药	7,320	442,054.80	0.01
83	600919	江苏银行	61,896	440,699.52	0.01
84	601688	华泰证券	30,800	437,360.00	0.01
85	600104	上汽集团	24,500	436,345.00	0.01
86	601225	陕西煤业	20,300	429,954.00	0.01
87	001979	招商蛇口	32,000	429,760.00	0.01
88	002001	新和成	18,804	428,919.24	0.01
89	603986	兆易创新	3,000	426,630.00	0.01
90	000768	中航西飞	14,000	424,060.00	0.01
91	601601	中国太保	18,000	423,540.00	0.01
92	000895	双汇发展	14,300	418,990.00	0.01

93	002202	金风科技	27,900	412,920.00	0.01
94	600111	北方稀土	11,500	404,340.00	0.01
95	000963	华东医药	8,900	401,924.00	0.01
96	300274	阳光电源	4,000	393,000.00	0.00
97	600089	特变电工	14,300	391,677.00	0.00
98	688599	天合光能	6,000	391,500.00	0.00
99	000166	申万宏源	91,000	390,390.00	0.00
100	601988	中国银行	110,300	359,578.00	0.00
101	601211	国泰君安	23,600	358,720.00	0.00
102	601169	北京银行	77,500	351,850.00	0.00
103	600660	福耀玻璃	8,400	351,204.00	0.00
104	300408	三环集团	11,600	349,160.00	0.00
105	000876	新希望	22,800	348,840.00	0.00
106	601229	上海银行	52,100	341,255.00	0.00
107	600745	闻泰科技	4,000	340,440.00	0.00
108	601985	中国核电	49,300	338,198.00	0.00
109	600050	中国联通	97,300	336,658.00	0.00
110	601766	中国中车	63,700	331,240.00	0.00
111	601390	中国中铁	53,800	330,332.00	0.00
112	000786	北新建材	9,300	321,966.00	0.00
113	600893	航发动力	7,000	318,570.00	0.00
114	002709	天赐材料	5,100	316,506.00	0.00
115	601669	中国电建	40,100	315,587.00	0.00
116	603659	璞泰来	3,700	312,280.00	0.00
117	000157	中联重科	50,100	308,616.00	0.00
118	300601	康泰生物	6,820	308,127.60	0.00
119	601658	邮储银行	57,000	307,230.00	0.00
120	002049	紫光国微	1,600	303,552.00	0.00
121	002236	大华股份	18,200	298,844.00	0.00
122	002555	三七互娱	13,500	286,605.00	0.00
123	002459	晶澳科技	3,620	285,618.00	0.00
124	600028	中国石化	70,000	285,600.00	0.00
125	600905	三峡能源	45,000	283,050.00	0.00
126	300628	亿联网络	3,700	281,755.00	0.00
127	002008	大族激光	8,500	281,605.00	0.00
128	601009	南京银行	27,000	281,340.00	0.00
129	600999	招商证券	19,500	280,995.00	0.00
130	600019	宝钢股份	46,600	280,532.00	0.00
131	600010	包钢股份	119,300	280,355.00	0.00
132	600958	东方证券	27,448	280,244.08	0.00
133	000938	紫光股份	14,440	280,136.00	0.00
134	601628	中国人寿	9,000	279,720.00	0.00
135	000425	徐工机械	51,700	278,663.00	0.00
136	600196	复星医药	6,200	273,358.00	0.00

137	000977	浪潮信息	10,300	272,744.00	0.00
138	601857	中国石油	50,900	269,770.00	0.00
139	000069	华侨城 A	41,400	268,686.00	0.00
140	300450	先导智能	4,200	265,356.00	0.00
141	002736	国信证券	27,300	261,261.00	0.00
142	600570	恒生电子	6,000	261,240.00	0.00
143	601818	光大银行	86,600	260,666.00	0.00
144	300413	芒果超媒	7,600	253,536.00	0.00
145	002007	华兰生物	11,100	253,080.00	0.00
146	600346	恒力石化	11,100	246,864.00	0.00
147	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.00
148	002841	视源股份	3,200	241,024.00	0.00
149	601633	长城汽车	6,500	240,760.00	0.00
150	002601	龙佰集团	12,000	240,600.00	0.00
151	300896	爱美客	400	240,004.00	0.00
152	300003	乐普医疗	12,800	237,696.00	0.00
153	600926	杭州银行	15,600	233,688.00	0.00
154	688119	中钢洛耐	33,327	233,622.27	0.00
155	000703	恒逸石化	22,200	233,322.00	0.00
156	600426	华鲁恒升	7,800	227,760.00	0.00
157	600009	上海机场	4,000	226,800.00	0.00
158	601989	中国重工	59,700	221,487.00	0.00
159	600176	中国巨石	12,600	219,366.00	0.00
160	002120	韵达股份	12,700	216,662.00	0.00
161	601877	正泰电器	6,000	214,680.00	0.00
162	603993	洛阳钼业	37,000	212,010.00	0.00
163	300033	同花顺	2,200	211,530.00	0.00
164	600763	通策医疗	1,200	209,328.00	0.00
165	601006	大秦铁路	31,200	205,608.00	0.00
166	000066	中国长城	19,000	205,580.00	0.00
167	601138	工业富联	20,800	204,672.00	0.00
168	600584	长电科技	7,500	202,500.00	0.00
169	600383	金地集团	15,000	201,600.00	0.00
170	000596	古井贡酒	800	199,728.00	0.00
171	003816	中国广核	70,900	198,520.00	0.00
172	601377	兴业证券	28,100	198,105.00	0.00
173	600600	青岛啤酒	1,900	197,448.00	0.00
174	601066	中信建投	6,800	196,588.00	0.00
175	600588	用友网络	9,000	195,390.00	0.00
176	601600	中国铝业	41,100	195,225.00	0.00
177	600029	南方航空	26,600	194,446.00	0.00
178	600760	中航沈飞	3,200	193,440.00	0.00
179	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
180	600741	华域汽车	8,300	190,900.00	0.00

181	601186	中国铁建	24,100	190,390.00	0.00
182	688111	金山办公	965	190,220.80	0.00
183	601838	成都银行	11,400	189,012.00	0.00
184	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.00
185	603806	福斯特	2,840	186,076.80	0.00
186	300759	康龙化成	1,950	185,679.00	0.00
187	600795	国电电力	46,700	182,597.00	0.00
188	601111	中国国航	15,700	182,277.00	0.00
189	300661	圣邦股份	1,000	182,020.00	0.00
190	600150	中国船舶	9,400	178,412.00	0.00
191	601238	广汽集团	11,600	176,784.00	0.00
192	600547	山东黄金	9,500	176,320.00	0.00
193	603019	中科曙光	6,000	174,120.00	0.00
194	002821	凯莱英	600	173,400.00	0.00
195	002074	国轩高科	3,800	173,280.00	0.00
196	601100	恒立液压	2,800	172,816.00	0.00
197	601800	中国交建	18,500	171,680.00	0.00
198	600989	宝丰能源	11,600	169,940.00	0.00
199	300496	中科创达	1,300	169,624.00	0.00
200	300433	蓝思科技	15,300	169,371.00	0.00
201	300316	晶盛机电	2,500	168,975.00	0.00
202	600015	华夏银行	32,200	167,762.00	0.00
203	600460	士兰微	3,200	166,400.00	0.00
204	300782	卓胜微	1,220	164,700.00	0.00
205	600886	国投电力	15,600	163,800.00	0.00
206	002920	德赛西威	1,100	162,800.00	0.00
207	600011	华能国际	23,100	162,624.00	0.00
208	688012	中微公司	1,390	162,282.50	0.00
209	002602	世纪华通	33,640	162,144.80	0.00
210	601868	中国能建	67,900	160,923.00	0.00
211	600085	同仁堂	3,000	158,640.00	0.00
212	603486	科沃斯	1,300	158,457.00	0.00
213	601788	光大证券	10,000	157,600.00	0.00
214	600115	中国东航	28,700	157,563.00	0.00
215	603392	万泰生物	1,008	156,542.40	0.00
216	002252	上海莱士	26,300	155,959.00	0.00
217	603369	今世缘	3,000	153,000.00	0.00
218	603833	欧派家居	1,000	150,680.00	0.00
219	300751	迈为股份	300	147,270.00	0.00
220	600132	重庆啤酒	1,000	146,600.00	0.00
221	601916	浙商银行	43,800	145,416.00	0.00
222	300207	欣旺达	4,600	145,360.00	0.00
223	601901	方正证券	21,600	144,936.00	0.00
224	601336	新华保险	4,400	141,636.00	0.00

225	603260	合盛硅业	1,200	141,552.00	0.00
226	600352	浙江龙盛	13,700	139,466.00	0.00
227	600188	兖矿能源	3,500	138,180.00	0.00
228	688126	沪硅产业	6,000	137,880.00	0.00
229	601799	星宇股份	800	136,800.00	0.00
230	601995	中金公司	3,000	133,470.00	0.00
231	600845	宝信软件	2,400	131,040.00	0.00
232	601618	中国中冶	37,400	130,900.00	0.00
233	688005	容百科技	1,011	130,863.84	0.00
234	601117	中国化学	13,800	129,858.00	0.00
235	300763	锦浪科技	600	127,800.00	0.00
235	601360	三六零	15,000	127,800.00	0.00
237	002938	鹏鼎控股	4,200	126,882.00	0.00
238	603185	上机数控	800	124,792.00	0.00
239	300999	金龙鱼	2,300	124,246.00	0.00
240	603882	金域医学	1,500	123,825.00	0.00
241	601155	新城控股	4,800	122,064.00	0.00
242	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
243	002648	卫星化学	4,600	118,910.00	0.00
244	688396	华润微	1,985	117,253.95	0.00
245	601021	春秋航空	2,000	116,700.00	0.00
246	603290	斯达半导	300	115,770.00	0.00
247	000301	东方盛虹	6,800	114,988.00	0.00
248	600489	中金黄金	15,300	113,067.00	0.00
249	603899	晨光股份	2,000	112,160.00	0.00
250	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
251	600918	中泰证券	14,600	111,690.00	0.00
252	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.00
253	688169	石头科技	175	107,922.50	0.00
254	000708	中信特钢	5,300	106,795.00	0.00
255	601878	浙商证券	9,200	104,696.00	0.00
256	300454	深信服	1,000	103,780.00	0.00
257	688008	澜起科技	1,704	103,228.32	0.00
258	601865	福莱特	2,700	102,870.00	0.00
259	600183	生益科技	6,000	101,940.00	0.00
260	600018	上港集团	17,100	99,693.00	0.00
261	600219	南山铝业	27,000	99,630.00	0.00
262	600362	江西铜业	5,500	98,065.00	0.00
263	300595	欧普康视	1,700	97,223.00	0.00
264	300529	健帆生物	1,900	96,691.00	0.00
265	600332	白云山	3,000	94,770.00	0.00
266	300957	贝泰妮	400	87,012.00	0.00
267	300919	中伟股份	700	86,730.00	0.00
268	601216	君正集团	17,700	86,376.00	0.00

269	600061	国投资本	13,500	85,860.00	0.00
270	601319	中国人保	16,800	85,008.00	0.00
271	300223	北京君正	800	85,000.00	0.00
272	688036	传音控股	904	80,663.92	0.00
273	600606	绿地控股	20,100	79,596.00	0.00
274	600655	豫园股份	8,200	77,408.00	0.00
275	601998	中信银行	16,100	76,475.00	0.00
276	603195	公牛集团	500	76,455.00	0.00
277	601966	玲珑轮胎	3,000	76,110.00	0.00
278	002916	深南电路	800	74,968.00	0.00
279	603160	汇顶科技	1,200	74,316.00	0.00
280	600161	天坛生物	3,000	72,840.00	0.00
281	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
282	688363	华熙生物	504	71,658.72	0.00
283	601898	中煤能源	6,900	71,622.00	0.00
284	600025	华能水电	9,500	66,405.00	0.00
285	601881	中国银河	6,800	65,756.00	0.00
286	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
287	002791	坚朗五金	500	64,860.00	0.00
288	002414	高德红外	4,996	64,298.52	0.00
289	002607	中公教育	11,100	64,269.00	0.00
290	002032	苏泊尔	1,100	61,974.00	0.00
291	002568	百润股份	1,980	59,479.20	0.00
292	000408	藏格矿业	1,800	59,292.00	0.00
293	603087	甘李药业	1,200	57,564.00	0.00
294	688561	奇安信	1,026	57,250.80	0.00
295	002600	领益智造	10,700	53,714.00	0.00
296	688065	凯赛生物	470	52,546.00	0.00
297	605499	东鹏饮料	300	51,258.00	0.00
298	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
299	002064	华峰化学	5,600	47,264.00	0.00
300	300866	安克创新	700	46,424.00	0.00
301	601236	红塔证券	5,000	45,650.00	0.00
302	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
303	601808	中海油服	3,000	41,850.00	0.00
304	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
305	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
306	000800	一汽解放	3,500	32,690.00	0.00
307	300979	华利集团	400	29,232.00	0.00
308	000877	天山股份	2,300	28,290.00	0.00
309	601698	中国卫通	2,400	27,144.00	0.00
310	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
311	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
312	601825	沪农商行	3,700	23,199.00	0.00

313	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
314	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
315	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
316	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
317	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
318	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
319	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
320	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
321	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
322	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
323	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
324	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
325	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
326	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
327	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
328	001289	龙源电力	600	13,056.00	0.00
329	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
330	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
331	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
332	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
333	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
334	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
335	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
336	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
337	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
338	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
339	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
340	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
341	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
342	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
343	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
344	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	144,352,307.39	2.09
2	600036	招商银行	90,052,702.43	1.30
3	601318	中国平安	84,087,207.19	1.22

4	601012	隆基绿能	52,601,011.31	0.76
5	601166	兴业银行	49,837,524.52	0.72
6	600900	长江电力	45,185,044.02	0.65
7	600887	伊利股份	33,541,849.46	0.49
8	603259	药明康德	32,414,959.20	0.47
9	600030	中信证券	31,943,719.91	0.46
10	601888	中国中免	29,939,727.00	0.43
11	601398	工商银行	27,453,913.00	0.40
12	601899	紫金矿业	25,522,429.45	0.37
13	600276	恒瑞医药	24,701,195.39	0.36
14	600436	片仔癀	24,093,023.60	0.35
15	601328	交通银行	22,469,595.87	0.33
16	600809	山西汾酒	22,116,832.67	0.32
17	603288	海天味业	21,241,498.62	0.31
18	600309	万华化学	20,272,612.04	0.29
19	600438	通威股份	20,051,247.16	0.29
20	600048	保利发展	19,810,271.00	0.29

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。

7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	42,682,476.64	0.62
2	600036	招商银行	25,165,586.00	0.36
3	601318	中国平安	24,004,329.32	0.35
4	601012	隆基绿能	18,506,511.60	0.27
5	600900	长江电力	14,158,295.32	0.20
6	601166	兴业银行	13,932,562.00	0.20
7	600887	伊利股份	9,717,046.11	0.14
8	600030	中信证券	9,554,972.85	0.14
9	603259	药明康德	9,399,306.00	0.14
10	601888	中国中免	8,463,138.16	0.12
11	601816	京沪高铁	8,192,427.79	0.12
12	600905	三峡能源	8,055,818.00	0.12
13	601398	工商银行	7,823,443.00	0.11
14	601899	紫金矿业	7,448,203.58	0.11
15	600436	片仔癀	7,235,163.00	0.10
16	600276	恒瑞医药	6,900,810.16	0.10
17	600438	通威股份	6,715,841.25	0.10
18	601328	交通银行	6,507,886.00	0.09
19	600809	山西汾酒	6,416,475.20	0.09
20	600309	万华化学	5,863,723.28	0.08

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。

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,861,219,487.99
卖出股票收入（成交）总额	591,372,711.11

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。

7.6 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	201,632,178.08	2.56
	其中：政策性金融债	201,632,178.08	2.56
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）	15,001.06	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	201,647,179.14	2.56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	210411	21 农发 11	500,000	50,825,890.41	0.64
2	220201	22 国开 01	500,000	50,528,849.32	0.64

3	220401	22 农发 01	500,000	50,259,671.23	0.64
4	220206	22 国开 06	500,000	50,017,767.12	0.63
5	113060	浙 22 转债	150	15,001.06	0.00

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。本基金在出现大额净申赎等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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日

前一年内曾受到国家外汇管理局福建省分局、中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。

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

除上述主体外，基金管理人未发现本基金目标 ETF 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.13.2 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。

7.13.3 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	6,763,226.68
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,463,291.07
6	其他应收款	1,999,652.97
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,226,170.72

7.13.4 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。

7.13.5 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 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,264,494.38	0.07	新股流通受限

§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

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
易方达沪深 300ETF 发起式联 接 A	407,567	10,585.36	151,534,212.24	3.51%	4,162,711,206. 91	96.49%
易方达沪深 300ETF 发起式联 接 C	25,124	17,596.93	189,713,457.51	42.91%	252,391,803.86	57.09%
合计	432,691	10,992.49	341,247,669.75	7.17%	4,415,103,010. 77	92.83%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 A	387,694.24	0.0090%
	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 C	76,764.25	0.0174%
	合计	464,458.49	0.0098%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基	易方达沪深 300ETF 发	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	起式联接 A	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	0
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（2009 年 8 月 26 日）基金份额总额	16,746,252,366.35	-
本报告期期初基金份额总额	3,558,280,186.16	277,138,006.56
本报告期基金总申购份额	1,389,222,771.92	1,636,475,732.81
减：本报告期基金总赎回份额	633,257,538.93	1,471,508,478.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	4,314,245,419.15	442,105,261.37

§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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
安信证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	60,775.00	0.00%	36.45	0.00%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	11,933,313.13	0.49%	9,546.55	0.49%	-
方正证券	2	71,936,153.27	2.96%	57,549.08	2.96%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	18,518,158.62	0.76%	11,110.93	0.57%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	555,059,601.09	22.82%	444,047.63	22.86%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	2,289,972.21	0.09%	1,832.00	0.09%	-

华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	6,665,160.05	0.27%	5,332.06	0.27%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	899,842,656.13	37.00%	719,874.12	37.07%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	816,392,027.63	33.57%	653,113.62	33.63%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	704,653.37	0.03%	563.71	0.03%	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	48,799,091.98	2.01%	39,039.28	2.01%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为安信证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、申港证券股份有限公司。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例		权证成交总额的比例		基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	136,384,114.74	14.42%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	5,505,274.40	49.07%	-	-	-	-	267,179,942.20	28.24%
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	4,521.40	0.04%	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	5,683,313.60	50.66%	-	-	-	419,750,150.06	44.37%	
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	
兴业证券	25,228.00	0.22%	-	-	-	73,395,762.90	7.76%	
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	
中信证券	-	-	-	-	-	49,365,874.86	5.22%	
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	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	2022-01-21

4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-21
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	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-30
7	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
8	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
9	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
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金参与东方证券股份有限公司 A 股配股的公告	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	2022-04-30
11	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
12	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电子披露网站	2022-05-14
13	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.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》；
- 4.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.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