

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12	投资组合报告附注	53
§ 8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末上市基金前十名持有人	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9	开放式基金份额变动	55
§ 10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	58
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500E、沪港深 500ETF 指数
基金主代码	517010
交易代码	517010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 3 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	66,144,188.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 8 月 12 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 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 3% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。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。
业绩比较基准	中证沪港深 500 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。 本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510620；519031	100140
法定代表人		刘晓艳	廖林

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	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	-402,541.79
本期利润	2,421,936.57

加权平均基金份额本期利润	0.0361
本期加权平均净值利润率	4.69%
本期基金份额净值增长率	3.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-14,082,852.19
期末可供分配基金份额利润	-0.2129
期末基金资产净值	52,061,335.81
期末基金份额净值	0.7871
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-21.29%

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	-1.87%	0.53%	-2.60%	0.55%	0.73%	-0.02%
过去三个月	3.12%	0.79%	2.13%	0.82%	0.99%	-0.03%
过去六个月	3.80%	0.93%	3.37%	0.97%	0.43%	-0.04%
过去一年	-6.05%	0.92%	-8.18%	0.94%	2.13%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-21.29%	1.06%	-27.45%	1.10%	6.16%	-0.04%

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

易方达中证沪港深 500 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 8 月 3 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-21.29%，同期业绩比较基准收益率为-27.45%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李栩	本基金的基金经理，易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证 2000ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达国证信息技术创新	2022-12-03	-	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员。

	<p>主题 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF、易方达上证科创板芯片指数发起式、易方达国证新能源电池 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达中证红利 ETF（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达国证信息技术创新主题 ETF 联接发起式、易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式、易方达中证 A50ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF 联接发起式的基金经理助理</p>				
伍臣东	<p>本基金的基金经理助理，易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证科创创业 50ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF、易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达中证创新药产业 ETF、易方达中证智能电动汽车 ETF、易方达纳斯达克 100ETF 联接（QDII-LOF）、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF、易方达中证上海环交所碳中和 ETF 联接、易方达中证绿色电力 ETF、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证软件服务 ETF、易方达中证 100ETF、易方达中证绿色电力 ETF 联接发起式、易方达中证 500 质量成长 ETF 联接发起式、易方达中证软件服务 ETF 联接发起式、易方达</p>	2021-09-04	2024-04-27	7 年	<p>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。</p>

<p>中证创新药产业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达上证科创 50 联接、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证消费 50ETF、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF 联接发起式、易方达纳斯达克 100ETF (QDII)、易方达上证科创板成长 ETF、易方达上证科创板成长 ETF 联接发起式、易方达中证 100ETF 联接发起式的基金经理助理</p>				
---	--	--	--	--

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 31 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，5 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证沪港深 500 指数，该指数选取沪港深交易所上市的互联互通范围内流动性较好、市值较大的 500 只股票作为指数样本股，以反映沪港深三地上市大市值企业股票的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

中证沪港深 500 指数成份股聚焦内地和香港证券市场中的大市值龙头企业，各市场和大类行业权重分布较为均衡，对沪港深市场整体具有较强的代表性。指数表现同时受到沪深 A 股市场和港股市场总体走势的影响，与中国宏观经济形势和全球金融条件密切相关。2024 年上半年，随着宏观政策效应持续释放，经济增长延续回升向好态势，生产稳定增长，需求持续恢复，新质生产力加速发展，国内生产总值录得 61.7 万亿元，同比增长 5.0%。物价方面，随着经济持续恢复，上半年居民消费价格（CPI）同比上涨 0.1%，核心 CPI 同比上涨 0.7%；此外，在节能降碳与大规模设备更新等政策及其他因素的推动下，国内工业品市场供需关系也有所改善。全球金融条件方面，美联储在 2024 年 6 月的议息会议上继续停止加息。在上述几个因素的综合影响下，2024 年上半年内，中证沪港深 500 指数上涨 3.4%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.7871 元，本报告期份额净值增长率为 3.80%，同期业绩比较基准收益率为 3.37%。年化跟踪误差 0.97%，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

随着中国式现代化的不断推进，宏观政策效应持续显现，国内经济动能有望迎来持续改善。另

一方面，美联储降息预期逐渐升温。在国内经济持续向好预期与海外金融条件收紧趋缓预期的推动下，一方面，A 股与港股上市企业盈利增速中枢有望得到抬升；另一方面，投资者风险偏好也有望回暖，在未来较长的一段时期内，A 股与港股市场可能在盈利增速提升与估值修复的情形下，迎来较好的投资机会。

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，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好 A 股、港股核心资产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

自本报告期初至 2024 年 1 月 10 日，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,085,684.82	2,292,325.23
结算备付金		1,071.14	21,462.40
存出保证金		2,422.13	2,862.60
交易性金融资产	6.4.7.2	49,837,826.11	39,240,350.41
其中：股票投资		49,837,826.11	39,240,350.41
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		108,102.48	1,434.16
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,409.12	-
资产总计		52,110,515.80	41,558,434.80
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		4.38	458,095.28
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,508.45	5,161.17
应付托管费		2,169.48	1,720.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	40,497.68	36,435.03
负债合计		49,179.99	501,411.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	66,144,188.00	54,144,188.00
未分配利润	6.4.7.8	-14,082,852.19	-13,087,165.08
净资产合计		52,061,335.81	41,057,022.92
负债和净资产总计		52,110,515.80	41,558,434.80

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7871 元，基金份额总额 66,144,188.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,588,721.22	668,828.43
1.利息收入		4,249.49	5,653.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,249.49	5,653.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-268,151.59	736,795.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-976,991.24	184,535.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	219.06	1,458.26
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	708,620.59	550,801.38
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	2,824,478.36	-134,971.77
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	28,144.96	61,351.46
减：二、营业总支出		166,784.65	166,844.74
1. 管理人报酬		38,469.40	35,057.95
2. 托管费		12,823.05	11,685.99
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	115,492.20	120,100.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,421,936.57	501,983.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,421,936.57	501,983.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,421,936.57	501,983.69

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	54,144,188.00	-13,087,165.08	41,057,022.92
二、本期期初净资产	54,144,188.00	-13,087,165.08	41,057,022.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	12,000,000.00	-995,687.11	11,004,312.89
（一）、综合收益总额	-	2,421,936.57	2,421,936.57
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	12,000,000.00	-3,417,623.68	8,582,376.32
其中：1.基金申购款	21,000,000.00	-5,684,541.57	15,315,458.43
2.基金赎回款	-9,000,000.00	2,266,917.89	-6,733,082.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	66,144,188.00	-14,082,852.19	52,061,335.81
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	57,144,188.00	-9,561,966.80	47,582,221.20
二、本期期初净资产	57,144,188.00	-9,561,966.80	47,582,221.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	295,790.12	295,790.12

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	501,983.69	501,983.69
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	0.00	-206,193.57	-206,193.57
其中: 1.基金申购款	18,000,000.00	-2,774,001.52	15,225,998.48
2.基金赎回款	-18,000,000.00	2,567,807.95	-15,432,192.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	57,144,188.00	-9,266,176.68	47,878,011.32

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

易方达中证沪港深 500 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]234 号《关于准予易方达中证沪港深 500 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《易方达中证沪港深 500 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，《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,144,188.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,188.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、

中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,085,684.82
等于：本金	2,085,482.15
加：应计利息	202.67
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	2,085,684.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,840,473.23	-	49,837,826.11	-2,002,647.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,840,473.23	-	49,837,826.11	-2,002,647.12

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	639.50
其中：交易所市场	639.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,858.18
合计	40,497.68

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,144,188.00	54,144,188.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-9,000,000.00	-9,000,000.00
本期末	66,144,188.00	66,144,188.00

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	-3,244,976.99	-9,842,188.09	-13,087,165.08
本期期初	-3,244,976.99	-9,842,188.09	-13,087,165.08
本期利润	-402,541.79	2,824,478.36	2,421,936.57
本期基金份额交易产生的变动数	-683,280.84	-2,734,342.84	-3,417,623.68
其中：基金申购款	-1,273,341.12	-4,411,200.45	-5,684,541.57
基金赎回款	590,060.28	1,676,857.61	2,266,917.89

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,330,799.62	-9,752,052.57	-14,082,852.19

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,702.07
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	525.67
其他	21.75
合计	4,249.49

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-840,943.92
股票投资收益——赎回差价收入	-136,047.32
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	-976,991.24

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,079,054.86
减：卖出股票成本总额	8,901,601.63
减：交易费用	18,397.15
买卖股票差价收入	-840,943.92

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	6,733,082.11
减：现金支付赎回款总额	3,953,275.11
减：赎回股票成本总额	2,915,854.32
减：交易费用	-
赎回差价收入	-136,047.32

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	218.91
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	219.06

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,219.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	999.99
减：应计利息总额	0.16
减：交易费用	0.05
买卖债券差价收入	218.91

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	708,620.59
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	708,620.59

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	2,824,478.36
——股票投资	2,824,478.36
——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	-
——权证投资	-
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	2,824,478.36

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	28,144.96
合计	28,144.96

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	5,050.68
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	774.65
银行汇划费	268.49
其他	84,535.36
合计	115,492.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,469.40	35,057.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	178.61	595.66

应支付基金管理人的净管理费	38,290.79	34,462.29
---------------	-----------	-----------

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,823.05	11,685.99

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
报告期初持有的基金份额	33,000,000.00	33,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	33,000,000.00	33,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	49.8910%	57.7487%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,206,800.00	26.0141%	-	-

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	2,085,684.82	3,702.07	2,541,306.69	4,859.28

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券、托管人工商银行发行的港股工商银行和托管人工商银行发行的 A 股工商银行。于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 4,600 股（2023 年 12 月 31 日:3,800 股），占本基金净值比例为 0.11%(2023 年 12 月 31 日:0.13%)；持有工商银行发行的港股工商银行 136,000 股（2023 年 12 月 31 日:111,000 股），占本基金净值比例为 1.11%(2023 年 12 月 31 日:0.94%)；持有工商银行发行的 A 股工商银行 55,000 股（2023 年 12 月 31 日:45,000 股），占本基金净值比例为 0.60%(2023 年 12 月 31 日:0.52%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受

限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可通过港股通投资香港市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,085,684.82	-	-	-	2,085,684.82
结算备付金	1,071.14	-	-	-	1,071.14
存出保证金	2,422.13	-	-	-	2,422.13
交易性金融资产	-	-	-	49,837,826.11	49,837,826.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	108,102.48	108,102.48
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	2,089,178.09	-	-	50,021,337.71	52,110,515.80
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	-	-	-	4.38	4.38
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,508.45	6,508.45
应付托管费	-	-	-	2,169.48	2,169.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,497.68	40,497.68
负债总计	-	-	-	49,179.99	49,179.99
利率敏感度缺口	2,089,178.09	-	-	49,972,157.72	52,061,335.81
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,292,325.23	-	-	-	2,292,325.23
结算备付金	21,462.40	-	-	-	21,462.40
存出保证金	2,862.60	-	-	-	2,862.60
交易性金融资产	-	-	-	39,240,350.41	39,240,350.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,434.16	1,434.16
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,316,650.23	-	-	39,241,784.57	41,558,434.80
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	-	-	-	458,095.28	458,095.28
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,161.17	5,161.17
应付托管费	-	-	-	1,720.40	1,720.40

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	36,435.03	36,435.03
负债总计	-	-	-	501,411.88	501,411.88
利率敏感度缺口	2,316,650.23	-	-	38,740,372.69	41,057,022.92

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

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	19,710,163.39	-	19,710,163.39
资产合计	-	19,710,163.39	-	19,710,163.39
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	19,710,163.39	-	19,710,163.39
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,175,750.46	-	15,175,750.46
资产合计	-	15,175,750.46	-	15,175,750.46
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,175,750.46	-	15,175,750.46

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-985,508.17	-758,787.52
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	985,508.17	758,787.52

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金 资产净 值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	49,837,826.11	95.73	39,240,350.41	95.58
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	49,837,826.11	95.73	39,240,350.41	95.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,491,891.24	1,962,017.47
2.业绩比较基准下降 5%	-2,491,891.24	-1,962,017.47	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	49,837,826.11
第二层次	-
第三层次	-
合计	49,837,826.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,837,826.11	95.64
	其中:股票	49,837,826.11	95.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,086,755.96	4.00
8	其他各项资产	185,933.73	0.36

9	合计	52,110,515.80	100.00
---	----	---------------	--------

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 19,710,163.39 元，占净值比例 37.86%。

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	351,986.00	0.68
B	采矿业	1,789,715.38	3.44
C	制造业	16,246,412.36	31.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,308,145.00	2.51
E	建筑业	631,664.20	1.21
F	批发和零售业	100,485.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,084,707.52	2.08
H	住宿和餐饮业	16,086.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,305,280.11	2.51
J	金融业	6,470,356.19	12.43
K	房地产业	272,344.00	0.52
L	租赁和商务服务业	221,995.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	221,652.00	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	86,758.96	0.17
R	文化、体育和娱乐业	20,075.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	30,127,662.72	57.87

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	1,226,493.16	2.36
材料	168,873.18	0.32

工业	916,131.77	1.76
非必需消费品	2,478,001.95	4.76
必需消费品	607,557.38	1.17
保健	448,051.04	0.86
金融	6,765,358.25	12.99
信息技术	905,590.30	1.74
电信服务	4,679,295.75	8.99
公用事业	704,963.17	1.35
房地产	809,847.44	1.56
合计	19,710,163.39	37.86

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	00700	腾讯控股	10,300	3,500,784.93	6.72
2	00005	汇丰控股	29,200	1,820,212.48	3.50
3	600519	贵州茅台	1,000	1,467,390.00	2.82
4	601318	中国平安	16,900	698,984.00	1.34
4	02318	中国平安	11,500	371,552.03	0.71
5	00939	建设银行	188,000	990,038.76	1.90
5	601939	建设银行	10,495	77,663.00	0.15
6	03690	美团-W	9,800	993,707.73	1.91
7	600036	招商银行	19,400	663,286.00	1.27
7	03968	招商银行	7,000	226,481.54	0.44
8	01398	工商银行	136,000	575,937.59	1.11
8	601398	工商银行	55,000	313,500.00	0.60
9	01299	友邦保险	17,600	851,347.90	1.64
10	00941	中国移动	9,500	667,625.42	1.28
10	600941	中国移动	1,400	150,500.00	0.29
11	300750	宁德时代	4,120	741,723.60	1.42
12	00883	中国海洋石油	28,000	572,432.90	1.10
12	600938	中国海油	3,300	108,900.00	0.21
13	002594	比亚迪	1,400	350,350.00	0.67
13	01211	比亚迪股份	1,500	317,612.64	0.61
14	03988	中国银行	131,000	460,310.16	0.88
14	601988	中国银行	33,000	152,460.00	0.29
15	601899	紫金矿业	25,800	453,306.00	0.87
15	02899	紫金矿业	8,000	120,327.73	0.23

16	600900	长江电力	19,200	555,264.00	1.07
17	000333	美的集团	7,700	496,650.00	0.95
18	601328	交通银行	43,100	321,957.00	0.62
18	03328	交通银行	27,000	151,057.67	0.29
19	00388	香港交易所	2,000	456,705.07	0.88
20	00857	中国石油股份	34,000	245,145.85	0.47
20	601857	中国石油	17,809	183,788.88	0.35
21	01810	小米集团-W	27,400	412,122.48	0.79
22	601088	中国神华	5,200	230,724.00	0.44
22	01088	中国神华	5,500	180,459.65	0.35
23	601166	兴业银行	22,800	401,736.00	0.77
24	000858	五粮液	3,000	384,120.00	0.74
25	601288	农业银行	50,100	218,436.00	0.42
25	01288	农业银行	48,000	146,320.86	0.28
26	00386	中国石油化工股份	38,000	175,490.11	0.34
26	600028	中国石化	22,900	144,728.00	0.28
27	600030	中信证券	15,335	279,557.05	0.54
27	06030	中信证券	3,500	36,735.37	0.07
28	002475	立讯精密	7,900	310,549.00	0.60
29	300760	迈瑞医疗	1,000	290,910.00	0.56
30	000651	格力电器	7,100	278,462.00	0.53
31	600690	海尔智家	5,902	167,498.76	0.32
31	06690	海尔智家	4,400	104,812.17	0.20
32	600276	恒瑞医药	6,960	267,681.60	0.51
33	688981	中芯国际	3,102	143,002.20	0.27
33	00981	中芯国际	7,500	117,188.11	0.23
34	600887	伊利股份	10,000	258,400.00	0.50
35	00669	创科实业	3,000	244,233.17	0.47
36	600309	万华化学	3,000	242,580.00	0.47
37	601728	中国电信	24,300	149,445.00	0.29
37	00728	中国电信	22,000	92,965.58	0.18
38	000725	京东方 A	57,900	236,811.00	0.45
39	601601	中国太保	5,400	150,444.00	0.29
39	02601	中国太保	4,400	76,541.00	0.15
40	09633	农夫山泉	6,400	216,414.68	0.42
41	300059	东方财富	19,848	209,594.88	0.40
42	601816	京沪高铁	38,500	206,745.00	0.40
43	02628	中国人寿	12,000	120,911.85	0.23
43	601628	中国人寿	2,643	82,065.15	0.16
44	01024	快手-W	4,800	202,176.87	0.39
45	300308	中际旭创	1,400	193,032.00	0.37
46	002714	牧原股份	4,300	187,480.00	0.36
47	002415	海康威视	5,900	182,369.00	0.35

48	601668	中国建筑	32,640	173,318.40	0.33
49	00002	中电控股	3,000	172,770.32	0.33
50	000568	泸州老窖	1,200	172,188.00	0.33
51	600919	江苏银行	23,000	170,890.00	0.33
52	601138	工业富联	6,200	169,880.00	0.33
53	600809	山西汾酒	800	168,704.00	0.32
54	300498	温氏股份	8,300	164,506.00	0.32
55	002371	北方华创	500	159,945.00	0.31
56	601985	中国核电	14,800	157,768.00	0.30
57	06160	百济神州	2,000	157,346.03	0.30
58	601225	陕西煤业	6,100	157,197.00	0.30
59	603259	药明康德	4,000	156,760.00	0.30
60	600406	国电南瑞	6,276	156,648.96	0.30
61	601658	邮储银行	17,400	88,218.00	0.17
61	01658	邮储银行	16,000	66,881.19	0.13
62	601919	中远海控	10,000	154,900.00	0.30
63	000001	平安银行	15,200	154,280.00	0.30
64	00016	新鸿基地产	2,500	154,128.84	0.30
65	600031	三一重工	9,300	153,450.00	0.29
66	600000	浦发银行	18,393	151,374.39	0.29
67	02020	安踏体育	2,200	150,592.20	0.29
68	300124	汇川技术	2,900	148,770.00	0.29
69	000792	盐湖股份	8,500	148,325.00	0.28
70	02015	理想汽车-W	2,300	147,571.23	0.28
71	601766	中国中车	19,100	143,441.00	0.28
72	02388	中银香港	6,500	142,674.70	0.27
73	600150	中国船舶	3,500	142,485.00	0.27
74	600050	中国联通	29,900	140,530.00	0.27
75	000063	中兴通讯	5,000	139,850.00	0.27
76	300274	阳光电源	2,240	138,947.20	0.27
77	000338	潍柴动力	8,500	138,040.00	0.27
78	00001	长和	4,000	136,536.93	0.26
79	002352	顺丰控股	3,800	135,622.00	0.26
80	601169	北京银行	23,200	135,488.00	0.26
81	603501	韦尔股份	1,345	133,652.65	0.26
82	01109	华润置地	5,500	133,274.10	0.26
83	00027	银河娱乐	4,000	132,886.21	0.26
84	601012	隆基绿能	9,468	132,741.36	0.25
85	09987	百胜中国	600	132,192.57	0.25
86	600837	海通证券	15,100	129,256.00	0.25
87	000100	TCL 科技	29,490	127,396.80	0.24
88	600016	民生银行	33,376	126,495.04	0.24
89	002230	科大讯飞	2,900	124,555.00	0.24
90	00992	联想集团	12,000	120,692.80	0.23

91	600660	福耀玻璃	2,500	119,750.00	0.23
92	300502	新易盛	1,100	116,105.00	0.22
93	002142	宁波银行	5,160	113,829.60	0.22
94	601229	上海银行	15,600	113,256.00	0.22
95	02057	中通快递-W	750	112,396.54	0.22
96	00011	恒生银行	1,200	109,959.69	0.21
97	600089	特变电工	7,890	109,434.30	0.21
98	00998	中信银行	16,000	73,160.43	0.14
98	601998	中信银行	4,800	32,160.00	0.06
99	601390	中国中铁	16,100	104,972.00	0.20
100	000625	长安汽车	7,780	104,485.40	0.20
101	600436	片仔癀	500	103,585.00	0.20
102	688041	海光信息	1,461	102,737.52	0.20
103	01171	兖矿能源	5,200	52,964.65	0.10
103	600188	兖矿能源	2,150	48,869.50	0.09
104	600104	上汽集团	7,300	101,178.00	0.19
105	601688	华泰证券	8,000	99,120.00	0.19
106	600048	保利发展	11,300	98,988.00	0.19
107	601006	大秦铁路	13,772	98,607.52	0.19
108	02313	申洲国际	1,400	97,684.14	0.19
109	600905	三峡能源	22,400	97,664.00	0.19
110	00003	香港中华煤气	18,000	97,583.75	0.19
111	00006	电能实业	2,500	96,401.83	0.19
112	002027	分众传媒	15,900	96,354.00	0.19
113	601211	国泰君安	7,100	96,205.00	0.18
114	603986	兆易创新	1,000	95,620.00	0.18
115	603019	中科曙光	2,300	95,450.00	0.18
116	601600	中国铝业	12,400	94,612.00	0.18
117	603993	洛阳钼业	11,100	94,350.00	0.18
118	601888	中国中免	1,500	93,735.00	0.18
119	01113	长实集团	3,500	93,435.62	0.18
120	600019	宝钢股份	13,900	92,435.00	0.18
121	601818	光大银行	29,100	92,247.00	0.18
122	603288	海天味业	2,644	91,138.68	0.18
123	00267	中信股份	14,000	90,720.39	0.17
124	01519	极兔速递-W	13,800	89,802.24	0.17
125	600585	海螺水泥	3,800	89,642.00	0.17
126	02328	中国财险	10,000	88,529.96	0.17
127	601989	中国重工	17,900	88,247.00	0.17
128	00836	华润电力	4,000	87,434.74	0.17
129	00688	中国海外发展	7,000	86,503.81	0.17
130	600886	国投电力	4,700	85,728.00	0.16
131	601009	南京银行	8,142	84,595.38	0.16
132	01801	信达生物	2,500	83,966.56	0.16

133	600795	国电电力	14,000	83,860.00	0.16
134	688012	中微公司	582	82,213.32	0.16
135	688008	澜起科技	1,431	81,795.96	0.16
136	600999	招商证券	5,800	80,678.00	0.15
137	000938	紫光股份	3,600	80,460.00	0.15
138	600438	通威股份	4,200	80,262.00	0.15
139	01093	石药集团	14,000	79,476.17	0.15
140	000425	徐工机械	11,100	79,365.00	0.15
141	600893	航发动力	2,100	76,755.00	0.15
142	600547	山东黄金	2,800	76,664.00	0.15
143	002463	沪电股份	2,100	76,650.00	0.15
144	300015	爱尔眼科	7,353	75,882.96	0.15
145	300014	亿纬锂能	1,900	75,848.00	0.15
146	601669	中国电建	13,500	75,465.00	0.14
147	002179	中航光电	1,974	75,110.70	0.14
148	000002	万科 A	10,700	74,151.00	0.14
149	002241	歌尔股份	3,800	74,138.00	0.14
150	000538	云南白药	1,440	73,656.00	0.14
151	600926	杭州银行	5,600	73,080.00	0.14
152	002304	洋河股份	900	72,666.00	0.14
153	00175	吉利汽车	9,000	72,202.11	0.14
154	02688	新奥能源	1,200	70,477.15	0.14
155	600760	中航沈飞	1,740	69,774.00	0.13
156	600584	长电科技	2,200	69,762.00	0.13
157	600111	北方稀土	4,000	68,800.00	0.13
158	02269	药明生物	6,500	68,460.13	0.13
159	00788	中国铁塔	74,000	68,213.70	0.13
160	600522	中天科技	4,300	68,155.00	0.13
161	600489	中金黄金	4,600	68,080.00	0.13
162	00066	港铁公司	3,000	67,492.69	0.13
163	002028	思源电气	1,000	66,900.00	0.13
164	002050	三花智控	3,500	66,780.00	0.13
165	600011	华能国际	6,900	66,378.00	0.13
166	688111	金山办公	290	65,975.00	0.13
167	00288	万洲国际	14,000	65,676.45	0.13
168	00762	中国联通	10,000	65,439.16	0.13
169	601916	浙商银行	23,670	65,329.20	0.13
170	002252	上海莱士	8,300	64,906.00	0.12
171	600009	上海机场	2,000	64,500.00	0.12
172	600015	华夏银行	10,000	64,000.00	0.12
173	02319	蒙牛乳业	5,000	63,887.60	0.12
174	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.12
175	600958	东方证券	8,228	62,532.80	0.12
176	688036	传音控股	808	61,844.32	0.12

177	601186	中国铁建	7,200	61,704.00	0.12
178	02331	李宁	4,000	61,697.17	0.12
179	300408	三环集团	2,100	61,299.00	0.12
180	600426	华鲁恒升	2,300	61,272.00	0.12
181	002311	海大集团	1,300	61,165.00	0.12
182	000166	申万宏源	14,100	60,771.00	0.12
183	000157	中联重科	7,800	59,904.00	0.12
184	00291	华润啤酒	2,500	59,894.63	0.12
185	601901	方正证券	7,700	59,521.00	0.11
186	600989	宝丰能源	3,400	58,922.00	0.11
187	000977	浪潮信息	1,600	58,192.00	0.11
188	600674	川投能源	3,100	58,125.00	0.11
189	601058	赛轮轮胎	4,100	57,400.00	0.11
190	003816	中国广核	12,300	56,949.00	0.11
191	01997	九龙仓置业	3,000	56,677.43	0.11
192	09868	小鹏汽车-W	2,100	56,636.36	0.11
193	300433	蓝思科技	3,100	56,575.00	0.11
194	688271	联影医疗	513	56,276.10	0.11
195	000776	广发证券	4,600	55,982.00	0.11
196	002001	新和成	2,900	55,680.00	0.11
197	601377	兴业证券	10,820	54,749.20	0.11
198	002049	紫光国微	1,040	54,704.00	0.11
199	002422	科伦药业	1,800	54,594.00	0.10
200	601111	中国国航	7,300	53,874.00	0.10
201	600115	中国东航	13,400	53,734.00	0.10
202	01928	金沙中国有限公司	3,600	53,490.35	0.10
203	00285	比亚迪电子	1,500	53,391.78	0.10
204	09626	哔哩哔哩-W	460	53,276.78	0.10
205	000768	中航西飞	2,200	52,866.00	0.10
206	02382	舜宇光学科技	1,200	52,844.17	0.10
207	688256	寒武纪	264	52,448.88	0.10
208	300122	智飞生物	1,850	51,855.50	0.10
209	002340	格林美	8,100	51,597.00	0.10
210	002460	赣锋锂业	1,800	51,570.00	0.10
211	601825	沪农商行	7,600	51,072.00	0.10
212	600160	巨化股份	2,100	50,673.00	0.10
213	601633	长城汽车	2,000	50,600.00	0.10
214	001979	招商蛇口	5,700	50,103.00	0.10
215	600029	南方航空	8,500	50,065.00	0.10
216	601800	中国交建	5,600	50,064.00	0.10
217	600010	包钢股份	35,600	49,840.00	0.10
218	601077	渝农商行	9,700	48,694.00	0.09
219	01821	ESR	5,200	48,693.30	0.09

220	01378	中国宏桥	4,500	48,545.45	0.09
221	002601	龙佰集团	2,600	48,282.00	0.09
222	600256	广汇能源	7,200	48,240.00	0.09
223	002236	大华股份	3,100	47,926.00	0.09
224	002466	天齐锂业	1,600	47,856.00	0.09
225	000786	北新建材	1,600	47,456.00	0.09
226	601117	中国化学	5,700	46,968.00	0.09
227	002648	卫星化学	2,594	46,640.12	0.09
228	000983	山西焦煤	4,500	46,395.00	0.09
229	002493	荣盛石化	4,800	46,368.00	0.09
230	600161	天坛生物	1,900	46,360.00	0.09
231	603799	华友钴业	2,090	46,251.70	0.09
232	603369	今世缘	1,000	46,200.00	0.09
233	600346	恒力石化	3,300	46,035.00	0.09
234	000661	长春高新	500	45,885.00	0.09
235	601838	成都银行	3,000	45,570.00	0.09
236	601788	光大证券	3,100	45,322.00	0.09
237	300418	昆仑万维	1,400	45,136.00	0.09
238	300782	卓胜微	580	45,089.20	0.09
239	601021	春秋航空	800	45,064.00	0.09
240	600372	中航机载	3,762	45,031.14	0.09
241	600023	浙能电力	6,300	44,793.00	0.09
242	000807	云铝股份	3,300	44,583.00	0.09
243	00020	商汤-W	37,000	44,575.29	0.09
244	00135	昆仑能源	6,000	44,356.25	0.09
245	600196	复星医药	2,000	44,280.00	0.09
246	300394	天孚通信	500	44,210.00	0.08
247	688223	晶科能源	6,223	44,183.30	0.08
248	00083	信和置业	6,000	44,082.44	0.08
249	002129	TCL 中环	5,075	43,898.75	0.08
250	01177	中国生物制药	18,000	43,863.40	0.08
251	002938	鹏鼎控股	1,100	43,736.00	0.08
252	600600	青岛啤酒	600	43,662.00	0.08
253	002384	东山精密	2,100	43,470.00	0.08
254	000630	铜陵有色	12,000	43,320.00	0.08
255	605499	东鹏饮料	200	43,150.00	0.08
256	601872	招商轮船	5,100	43,095.00	0.08
257	601868	中国能建	20,300	43,036.00	0.08
258	601360	三六零	5,600	43,008.00	0.08
259	600845	宝信软件	1,343	42,881.99	0.08
260	000975	银泰黄金	2,600	42,354.00	0.08
261	002180	纳思达	1,600	42,272.00	0.08
262	600233	圆通速递	2,700	42,255.00	0.08
263	600085	同仁堂	1,100	42,031.00	0.08

264	600176	中国巨石	3,800	41,990.00	0.08
265	600219	南山铝业	11,000	41,910.00	0.08
266	002625	光启技术	2,400	41,640.00	0.08
267	600570	恒生电子	2,357	41,624.62	0.08
268	601233	桐昆股份	2,600	41,496.00	0.08
269	601995	中金公司	1,400	41,454.00	0.08
270	600741	华域汽车	2,500	40,950.00	0.08
271	300661	圣邦股份	490	40,562.20	0.08
272	01038	长江基建集团	1,000	40,249.19	0.08
273	688777	中控技术	1,065	40,150.50	0.08
274	00268	金蝶国际	6,000	40,084.91	0.08
275	00004	九龙仓集团	2,000	40,066.65	0.08
276	600183	生益科技	1,900	40,014.00	0.08
277	600745	闻泰科技	1,400	39,550.00	0.08
278	002271	东方雨虹	3,200	39,488.00	0.08
279	00960	龙湖集团	4,000	39,135.72	0.08
280	601066	中信建投	2,033	39,114.92	0.08
281	002736	国信证券	4,500	39,105.00	0.08
282	601336	新华保险	1,300	39,039.00	0.07
283	000963	华东医药	1,400	38,934.00	0.07
284	03311	中国建筑国际	4,000	38,916.68	0.07
285	300347	泰格医药	800	38,880.00	0.07
286	600096	云天化	2,000	38,840.00	0.07
287	06618	京东健康	2,000	38,788.90	0.07
288	01308	海丰国际	2,000	38,697.63	0.07
289	06862	海底捞	3,000	38,442.08	0.07
290	00012	恒基地产	2,000	38,241.29	0.07
291	603392	万泰生物	580	38,210.40	0.07
292	000895	双汇发展	1,600	38,032.00	0.07
293	001965	招商公路	3,200	37,952.00	0.07
294	600362	江西铜业	1,600	37,888.00	0.07
295	601689	拓普集团	700	37,527.00	0.07
296	01193	华润燃气	1,500	37,442.70	0.07
297	601100	恒立液压	800	37,264.00	0.07
298	601555	东吴证券	6,279	37,046.10	0.07
299	601881	中国银河	3,400	36,924.00	0.07
300	600027	华电国际	5,300	36,782.00	0.07
301	601898	中煤能源	2,900	36,192.00	0.07
302	03800	协鑫科技	34,000	35,996.10	0.07
303	688126	沪硅产业	2,591	35,781.71	0.07
304	600885	宏发股份	1,280	35,430.40	0.07
305	002920	德赛西威	400	34,836.00	0.07
306	002459	晶澳科技	3,108	34,809.60	0.07
307	601618	中国中冶	11,200	34,720.00	0.07

308	601699	潞安环能	1,900	34,447.00	0.07
309	300896	爱美客	200	34,420.00	0.07
310	00322	康师傅控股	4,000	34,353.28	0.07
311	600026	中远海能	2,200	34,342.00	0.07
312	688396	华润微	912	34,145.28	0.07
313	300832	新产业	500	33,720.00	0.06
314	601108	财通证券	5,100	33,711.00	0.06
315	600515	海南机场	10,700	33,598.00	0.06
316	00384	中国燃气	5,200	33,221.55	0.06
317	000999	华润三九	780	33,212.40	0.06
318	600482	中国动力	1,700	33,116.00	0.06
319	000876	新希望	3,600	32,904.00	0.06
320	000301	东方盛虹	4,100	32,677.00	0.06
321	600765	中航重机	1,600	32,640.00	0.06
322	002074	国轩高科	1,700	32,555.00	0.06
323	600039	四川路桥	4,120	32,506.80	0.06
324	601607	上海医药	1,700	32,487.00	0.06
325	601877	正泰电器	1,700	32,402.00	0.06
326	600332	白云山	1,100	32,263.00	0.06
327	601878	浙商证券	3,000	32,160.00	0.06
328	600588	用友网络	3,200	32,000.00	0.06
329	600415	小商品城	4,300	31,906.00	0.06
330	002602	世纪华通	9,300	31,899.00	0.06
331	002916	深南电路	300	31,731.00	0.06
332	002709	天赐材料	1,800	31,608.00	0.06
333	600875	东方电气	1,700	31,365.00	0.06
334	002600	领益智造	4,400	31,328.00	0.06
335	002555	三七互娱	2,400	31,320.00	0.06
336	00868	信义玻璃	4,000	31,250.16	0.06
337	605117	德业股份	420	31,222.80	0.06
338	600803	新奥股份	1,500	31,200.00	0.06
339	300003	乐普医疗	2,100	31,164.00	0.06
340	688122	西部超导	813	31,154.16	0.06
341	300033	同花顺	300	31,110.00	0.06
342	603605	珀莱雅	280	31,077.20	0.06
343	600025	华能水电	2,800	30,184.00	0.06
344	06186	中国飞鹤	9,000	29,652.97	0.06
345	300628	亿联网络	800	29,416.00	0.06
346	603606	东方电缆	600	29,286.00	0.06
347	601727	上海电气	7,900	29,230.00	0.06
348	688599	天合光能	1,708	28,899.36	0.06
349	002202	金风科技	4,300	28,896.00	0.06
350	000408	藏格矿业	1,200	28,884.00	0.06
351	03888	金山软件	1,400	28,813.31	0.06

352	000932	华菱钢铁	6,500	28,795.00	0.06
353	300316	晶盛机电	1,000	28,730.00	0.06
354	00968	信义光能	8,000	28,694.66	0.06
355	00241	阿里健康	10,000	28,566.88	0.05
356	002812	恩捷股份	900	28,485.00	0.05
357	300142	沃森生物	2,500	28,450.00	0.05
358	300450	先导智能	1,700	28,271.00	0.05
359	603260	合盛硅业	600	28,026.00	0.05
360	600460	士兰微	1,600	28,016.00	0.05
361	600298	安琪酵母	1,000	27,930.00	0.05
362	03808	中国重汽	1,500	27,791.11	0.05
363	300223	北京君正	500	27,720.00	0.05
364	300496	中科创达	600	27,354.00	0.05
365	09896	名创优品	800	27,343.89	0.05
366	601238	广汽集团	3,500	27,090.00	0.05
367	002007	华兰生物	1,700	26,843.00	0.05
368	688180	君实生物	923	26,813.15	0.05
369	03998	波司登	6,000	26,668.51	0.05
370	601615	明阳智能	2,800	26,432.00	0.05
371	002821	凯莱英	400	26,320.00	0.05
372	000066	中国长城	3,000	26,250.00	0.05
373	300759	康龙化成	1,400	26,012.00	0.05
374	688072	拓荆科技	216	25,943.76	0.05
375	06969	思摩尔国际	3,000	25,929.24	0.05
376	601319	中国人保	5,000	25,750.00	0.05
377	600018	上港集团	4,400	25,432.00	0.05
378	000783	长江证券	5,200	25,116.00	0.05
379	300413	芒果超媒	1,200	25,080.00	0.05
380	00270	粤海投资	6,000	25,025.69	0.05
381	600918	中泰证券	4,400	24,948.00	0.05
382	000733	振华科技	600	24,918.00	0.05
383	01929	周大福	3,200	24,678.87	0.05
384	300999	金龙鱼	900	24,615.00	0.05
385	688009	中国通号	4,080	24,480.00	0.05
386	603806	福斯特	1,652	24,284.40	0.05
387	600132	重庆啤酒	400	24,280.00	0.05
388	603816	顾家家居	750	24,217.50	0.05
389	601865	福莱特	1,200	24,120.00	0.05
390	603659	璞泰来	1,705	24,091.65	0.05
391	300751	迈为股份	200	23,896.00	0.05
392	02618	京东物流	3,100	23,709.60	0.05
393	601696	中银证券	2,600	23,608.00	0.05
394	01209	华润万象生活	1,000	23,592.78	0.05
395	603939	益丰药房	960	23,568.00	0.05

396	603589	口子窖	600	23,514.00	0.05
397	301269	华大九天	300	23,115.00	0.04
398	603198	迎驾贡酒	400	23,000.00	0.04
399	300919	中伟股份	740	22,932.60	0.04
400	300037	新宙邦	800	22,848.00	0.04
401	01876	百威亚太	2,700	22,670.97	0.04
402	600702	舍得酒业	400	22,668.00	0.04
403	600061	国投资本	4,000	22,600.00	0.04
404	601799	星宇股份	200	22,408.00	0.04
405	603195	公牛集团	290	22,364.80	0.04
406	603345	安井食品	300	22,293.00	0.04
407	002064	华峰化学	3,100	22,227.00	0.04
408	000617	中油资本	4,000	22,080.00	0.04
409	601966	玲珑轮胎	1,200	22,044.00	0.04
410	688303	大全能源	1,066	21,735.74	0.04
411	01044	恒安国际	1,000	21,721.78	0.04
412	000708	中信特钢	1,600	21,712.00	0.04
413	300146	汤臣倍健	1,600	21,680.00	0.04
414	601059	信达证券	1,500	21,315.00	0.04
415	00881	中升控股	2,000	20,845.61	0.04
416	601018	宁波港	6,100	20,740.00	0.04
417	002841	视源股份	700	20,671.00	0.04
418	01972	太古地产	1,800	20,436.73	0.04
419	300454	深信服	400	20,212.00	0.04
420	300144	宋城演艺	2,500	20,075.00	0.04
421	002603	以岭药业	1,300	19,929.00	0.04
422	002410	广联达	2,080	19,926.40	0.04
423	601216	君正集团	5,300	19,557.00	0.04
424	000723	美锦能源	4,100	19,516.00	0.04
425	300442	润泽科技	800	19,160.00	0.04
426	06110	滔搏	5,000	18,938.11	0.04
427	603486	科沃斯	400	18,872.00	0.04
428	603899	晨光股份	600	18,768.00	0.04
429	601136	首创证券	900	18,414.00	0.04
430	000629	钒钛股份	7,300	18,250.00	0.04
431	00101	恒隆地产	3,000	18,235.35	0.04
432	688047	龙芯中科	203	17,849.79	0.03
433	603290	斯达半导	200	17,222.00	0.03
434	300601	康泰生物	1,100	17,171.00	0.03
435	002939	长城证券	2,500	16,750.00	0.03
436	300763	锦浪科技	400	16,656.00	0.03
437	688187	时代电气	331	16,344.78	0.03
438	600754	锦江酒店	700	16,086.00	0.03
439	603833	欧派家居	300	16,068.00	0.03

440	601231	环旭电子	1,000	16,050.00	0.03
441	002414	高德红外	2,714	15,985.46	0.03
442	600732	爱旭股份	1,740	15,747.00	0.03
443	000069	华侨城 A	7,600	15,504.00	0.03
444	601808	中海油服	900	15,480.00	0.03
445	002032	苏泊尔	300	15,030.00	0.03
446	01066	威高股份	4,400	14,938.75	0.03
447	688728	格科微	1,226	14,846.86	0.03
448	00293	国泰航空	2,000	14,584.63	0.03
449	000877	天山股份	2,700	14,580.00	0.03
450	300957	贝泰妮	300	14,496.00	0.03
451	002080	中材科技	1,100	14,190.00	0.03
452	601698	中国卫通	1,000	14,090.00	0.03
453	688363	华熙生物	244	13,803.08	0.03
454	603737	三棵树	380	13,782.60	0.03
455	002568	百润股份	800	13,464.00	0.03
456	00017	新世界发展	2,000	13,343.38	0.03
457	603688	石英股份	450	13,324.50	0.03
458	300979	华利集团	200	12,170.00	0.02
459	000987	越秀资本	2,363	11,720.48	0.02
460	603882	金域医学	400	10,876.00	0.02
461	600377	宁沪高速	800	10,080.00	0.02
462	600606	绿地控股	6,600	8,910.00	0.02
463	688561	奇安信	348	8,219.76	0.02
464	001872	招商港口	400	7,700.00	0.01
465	601061	中信金属	800	5,496.00	0.01
466	002945	华林证券	400	3,992.00	0.01
467	001289	龙源电力	200	3,450.00	0.01

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	00700	腾讯控股	961,903.51	2.34
2	00005	汇丰控股	642,707.56	1.57
3	01299	友邦保险	347,301.96	0.85
4	00939	建设银行	268,098.52	0.65
4	601939	建设银行	730.00	0.00
5	03690	美团-W	248,826.96	0.61
6	00941	中国移动	241,175.70	0.59

7	300760	迈瑞医疗	226,330.00	0.55
8	01398	工商银行	170,889.57	0.42
8	601398	工商银行	55,269.00	0.13
9	002594	比亚迪	134,413.00	0.33
9	01211	比亚迪股份	79,513.06	0.19
10	300750	宁德时代	212,842.00	0.52
11	000333	美的集团	161,007.00	0.39
12	00388	香港交易所	159,665.87	0.39
13	600519	贵州茅台	155,800.00	0.38
14	01810	小米集团-W	132,245.78	0.32
15	02318	中国平安	120,276.57	0.29
15	601318	中国平安	8,340.00	0.02
16	000568	泸州老窖	126,758.00	0.31
17	02057	中通快递-W	123,590.98	0.30
18	03988	中国银行	119,432.53	0.29
18	601988	中国银行	912.00	0.00
19	000858	五粮液	115,782.00	0.28
20	09633	农夫山泉	113,830.49	0.28

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	00700	腾讯控股	532,346.26	1.30
2	600519	贵州茅台	489,128.00	1.19
3	00005	汇丰控股	395,411.55	0.96
4	00941	中国移动	332,465.58	0.81
4	600941	中国移动	19,340.00	0.05
5	02888	渣打集团	317,682.65	0.77
6	01211	比亚迪股份	107,179.77	0.26
6	002594	比亚迪	100,058.00	0.24
7	300760	迈瑞医疗	166,919.00	0.41
8	01299	友邦保险	164,229.19	0.40
9	03690	美团-W	146,853.66	0.36
10	00939	建设银行	130,948.00	0.32
10	601939	建设银行	1,429.00	0.00
11	300750	宁德时代	116,764.00	0.28
12	01398	工商银行	88,388.13	0.22
12	601398	工商银行	6,666.00	0.02
13	01088	中国神华	80,686.71	0.20
13	601088	中国神华	10,585.00	0.03
14	000333	美的集团	88,970.00	0.22

15	000568	泸州老窖	80,959.00	0.20
16	600028	中国石化	47,311.00	0.12
16	00386	中国石油化工股份	30,433.53	0.07
17	02318	中国平安	63,528.09	0.15
17	601318	中国平安	12,198.00	0.03
18	03968	招商银行	63,686.13	0.16
18	600036	招商银行	9,946.00	0.02
19	01810	小米集团-W	72,341.68	0.18
20	02020	安踏体育	70,083.19	0.17

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	13,331,650.29
卖出股票收入（成交）总额	8,079,054.86

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,422.13
2	应收清算款	-
3	应收股利	108,102.48
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-

9	合计	185,933.73
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有限 公司—易方达中证沪港 深 500 交易型开放式指 数证券投资基金发起式 联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
703	94,088.46	54,071,178. 00	81.75%	12,073,010. 00	18.25%	17,206,800. 00	26.01%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	易方达基金管理有限公司	33,000,000.00	49.89%

2	东方证券股份有限公司	1,735,232.00	2.62%
3	冀国军	1,121,000.00	1.69%
4	管瑜	1,000,000.00	1.51%
5	贺晗	938,000.00	1.42%
6	中信证券股份有限公司	803,104.00	1.21%
7	中国国际金融股份有限公司	698,442.00	1.06%
8	屠强	475,300.00	0.72%
9	华泰证券股份有限公司	320,000.00	0.48%
10	BARCLAYS BANK PLC	307,600.00	0.47%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,206,800.00	26.01%

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	1,000.00	0.0015%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 3 日）基金份额总额	234,144,188.00
本报告期期初基金份额总额	54,144,188.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	9,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,144,188.00

§ 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	16,332,583.75	76.28%	1,633.15	76.28%	-
中信证券	3	5,078,121.40	23.72%	507.89	23.72%	-

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华金证券股份有限公司。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下:

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,219.11	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	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	2024-01-09

2	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	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	2024-01-10
3	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	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	2024-01-11
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-01-19
5	关于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年港股通非交易日暂停申购、赎回业务的公告	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	2024-02-24
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	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	2024-03-11
7	关于旗下部分基金 2024 年 3 月 29 日至 2024 年 4 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2024-03-26
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报	2024-03-29
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	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	2024-04-19
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-20
11	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	2024-04-23
12	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	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	2024-04-30
13	关于旗下部分基金 2024 年 5 月 15 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2024-05-10
14	关于旗下部分基金 2024 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2024-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024年01月01日~2024年06月30日	33,000,000.00	0.00	0.00	33,000,000.00	49.89%
中国工商银行股份有限公司—易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2024年04月26日~2024年06月30日	0.00	20,376,900.00	3,170,100.00	17,206,800.00	26.01%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日