

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：二〇二五年三月三十一日

§ 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。本年度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 2025 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	54

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6	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	67
8.7	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	67
8.8	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	67
8.9	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	67
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12	投资组合报告附注	68
§ 9	基金份额持有人信息	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末上市基金前十名持有人	69
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.4	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	70
§ 10	开放式基金份额变动	70
§ 11	重大事件揭示	70
11.1	基金份额持有人大会决议	70
11.2	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	70
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4	基金投资策略的改变	71
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8	其他重大事件	73
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1	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	76
§ 13	备查文件目录	76
13.1	备查文件目录	76
13.2	存放地点	77
13.3	查阅方式	77

§ 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	75,144,188.00 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	<p>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。</p> <p>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。</p>
--------	---

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	482,133.37	35,616.47	-2,264,537.95
本期利润	10,203,374.92	-3,615,624.64	-3,157,068.98
加权平均基金份额本期利润	0.1451	-0.0658	-0.0701
本期加权平均净值利润率	17.92%	-7.94%	-8.34%
本期基金份额净值增长率	19.13%	-8.93%	-14.57%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-7,256,812.11	-13,087,165.08	-9,561,966.80
期末可供分配基金份额利润	-0.0966	-0.2417	-0.1673
期末基金资产净值	67,887,375.89	41,057,022.92	47,582,221.20
期末基金份额净值	0.9034	0.7583	0.8327
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-9.66%	-24.17%	-16.73%

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
过去三个月	-1.50%	1.43%	-0.93%	1.40%	-0.57%	0.03%
过去六个月	14.78%	1.36%	13.73%	1.38%	1.05%	-0.02%
过去一年	19.13%	1.17%	17.56%	1.19%	1.57%	-0.02%
过去三年	-7.32%	1.15%	-14.58%	1.18%	7.26%	-0.03%
过去五年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	-9.66%	1.11%	-17.50%	1.15%	7.84%	-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

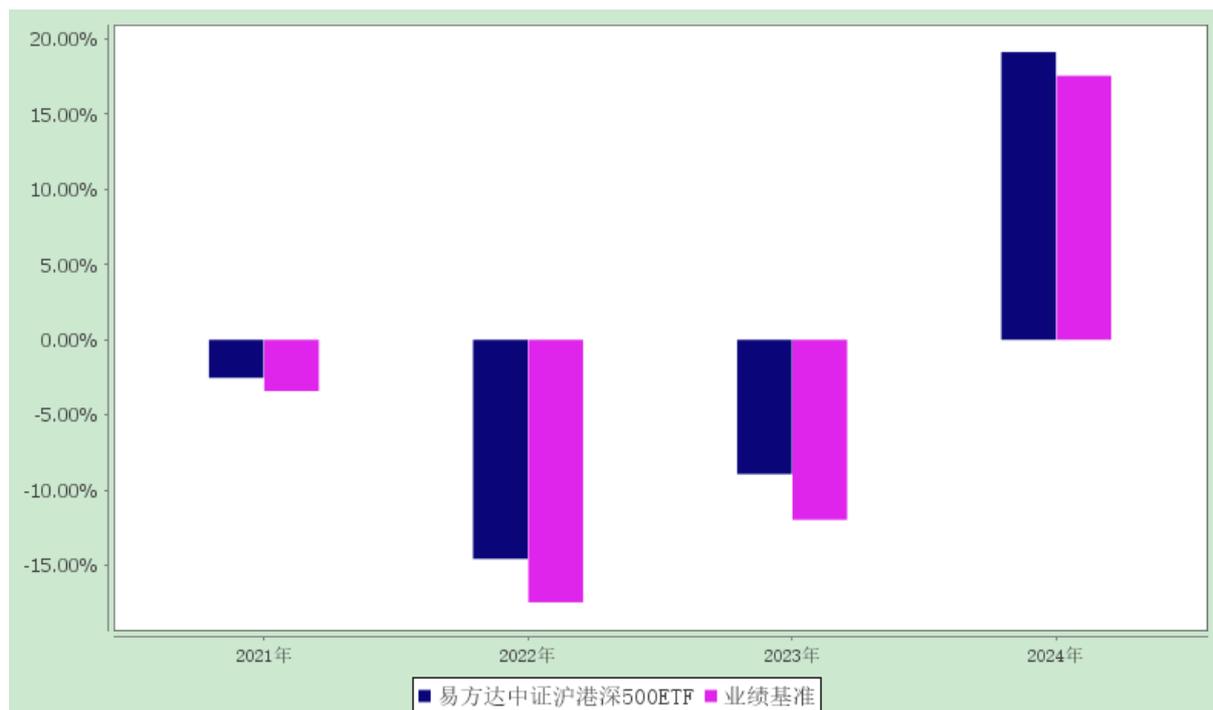
易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2021 年 8 月 3 日至 2024 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-9.66%，同期业绩比较基准收益率为-17.50%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2021 年 8 月 3 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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、易方达国证新能源汽车 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、易方达国证新能源汽车 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、易方达中证半导体材料设备主题 ETF 联接发起式的基金经理助理，指数投资部总经理助理	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。
伍 臣 东	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	2021-09-04	2024-04-27	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究支持专员、指数研究员。

	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 ETF 联接发起式、易方达中证软件服务 ETF、易方达中证 A100ETF、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、易方达中证创新药产业 ETF 联接发起式、易方达中证光伏产业 ETF 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 A100ETF 联接发起式的基金经理助理				
李博扬	本基金的基金经理助理, 易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证龙头企业指数、易方达上证 180ETF 的基金经理, 易方达恒生 ETF (QDII)、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证沪深港黄金产业股票指数发起式、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式、易方达中证生物科技主题 ETF 的基金经理助理, 研究员	2024-09-14	-	5 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任南方基金管理股份有限公司量化交易员、量化及指数研究员。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理, 本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 82 次，其中 73 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，9 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。

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，我国国内生产总值（GDP）首次突破 130 万亿元，达到 1349084 亿元，按不变价格计算，比上年增长 5.0%，消费需求持续扩大，投资增长总体平稳，净出口稳中有进，新质生产力稳步发展，顺利实现全年经济增长预期目标。回顾来看，在外部环境仍然复杂、国内有效需求仍然偏弱的情况下，9 月 26 日中共中央政治局会议果断部署一揽子增量政策，推动经济运行明显回升，社会信心有效提振，对全年发展预期目标顺利实现起到了决定性作用。全球金融条件方面，美联储在 2024 年 9、11、12 月的议息会议上分别降息 50bps、25bps、25bps。在上述几个因素的综合影响下，2024 年内，中证沪港深 500 指数上涨 17.6%。

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 0.9034 元，本报告期份额净值增长率为 19.13%，同期业绩比较基准收益率为 17.56%。年化跟踪误差 1.47%，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，美联储开启降息预期。在国内经济持续向好预期与海外金融条件有所宽松预期的推动下，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标的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、高效的工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

(1) 持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续贯彻落实廉洁从业、执业操守和道德规范等规定。通过开展员工职业道德教育、合规谈话、合规培训和考试等多种形式引导员工珍惜职业声誉、依法履职、恪守职业道德，努力营造风清气正的公司及行业生态。

(2) 通过实现风控系统全面升级，进一步提升投资合规的控制效能。合规及投研交等业务部门协同完善内部制度和流程，贯彻理性投资、价值投资、长期投资的理念，提升公司投资、研究、交易制度建设和内部管理规范。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，巩固控制基础，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化各类法律文件审核流程，提升基金产品材料质效；坚持以实质风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，切实保护投资者合法权益。

(4) 贯彻落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，强化对社交平台、自媒体账号、社群运营、公开言论等重点领域的管理，避免误导。坚持以投资者利益为核心，持续强化投资者适当性管理，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的合理性和科学性。持续结合业务实践，完善客户投诉处理制度及多元纠纷化解机制，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同中信息披露相关规定，优化完善相关制度流程，明晰各部门和信披岗位的职责分工，强化培训与交流；加强公司级信息披露平台建设，积极探索智能审核系统，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化、智能化水平和合规风险控制能力，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面贯彻落实反洗钱“风险为本”的工作方法，持续修订完善反洗钱内控制度，建立健全客户尽职调查工作机制，加强洗钱风险识别管控，深入开展系统建设与数据治理，稳步提升反洗钱履职能力和工作水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、信息技术管理审计、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2024 年 1 月 2 日至 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遵规守信情况声明

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遵规守信、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 托管人对本年度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 年年度报告中财务指标、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 审计报告

安永华明（2025）审字第 70013033_G264 号

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他

责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 林亚小

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2025 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,821,472.84	2,292,325.23
结算备付金		327,424.16	21,462.40
存出保证金		286,054.15	2,862.60
交易性金融资产	7.4.7.2	65,503,339.31	39,240,350.41
其中：股票投资		65,503,339.31	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		7,426.50	1,434.16
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		67,945,716.96	41,558,434.80
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		24.63	458,095.28
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,895.28	5,161.17
应付托管费		2,965.10	1,720.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		683.09	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.6	45,772.97	36,435.03
负债合计		58,341.07	501,411.88
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	75,144,188.00	54,144,188.00
未分配利润	7.4.7.8	-7,256,812.11	-13,087,165.08
净资产合计		67,887,375.89	41,057,022.92
负债和净资产总计		67,945,716.96	41,558,434.80

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9034 元，基金份额总额 75,144,188.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		10,593,270.84	-3,287,220.63
1.利息收入		10,271.01	10,807.85
其中：存款利息收入	7.4.7.9	10,271.01	10,807.85
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）		860,792.55	258,637.31
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-824,580.23	-896,759.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	541.98	2,735.86
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	20,152.38	-
股利收益	7.4.7.14	1,664,678.42	1,152,661.37

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	9,721,241.55	-3,651,241.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	965.73	94,575.32
减：二、营业总支出		389,895.92	328,404.01
1. 管理人报酬		85,290.30	68,440.53
2. 托管费		28,430.06	22,813.57
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		73.19	-
8. 其他费用	7.4.7.18	276,102.37	237,149.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,203,374.92	-3,615,624.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,203,374.92	-3,615,624.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,203,374.92	-3,615,624.64

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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）	21,000,000.00	5,830,352.97	26,830,352.97
（一）、综合收益总额	-	10,203,374.92	10,203,374.92
（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）	21,000,000.00	-4,373,021.95	16,626,978.05
其中：1.基金申购款	45,000,000.00	-9,233,137.02	35,766,862.98
2.基金赎回款	-24,000,000.00	4,860,115.07	-19,139,884.93
（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	75,144,188.00	-7,256,812.11	67,887,375.89
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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）	-3,000,000.00	-3,525,198.28	-6,525,198.28
（一）、综合收益总额	-	-3,615,624.64	-3,615,624.64
（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）	-3,000,000.00	90,426.36	-2,909,573.64
其中：1.基金申购款	39,000,000.00	-6,989,628.65	32,010,371.35
2.基金赎回款	-42,000,000.00	7,080,055.01	-34,919,944.99
（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	54,144,188.00	-13,087,165.08	41,057,022.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

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

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

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减

半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

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

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

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

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

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

债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题, 根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,821,472.84	2,292,325.23
等于: 本金	1,821,303.56	2,292,100.08
加: 应计利息	169.28	225.15
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	1,821,472.84	2,292,325.23

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		60,596,143.24	-	65,503,339.31	4,907,196.07
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		60,596,143.24	-	65,503,339.31	4,907,196.07
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		44,067,475.89	-	39,240,350.41	-4,827,125.48
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		44,067,475.89	-	39,240,350.41	-4,827,125.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,375,880.00	-	-	-
IF2503	2,375,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,375,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IF2503	IF2503	2	2,362,800.00	-13,080.00
合计	-	-	-	-13,080.00
减:可抵销期货暂收款	-	-	-	-13,080.00
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	2,072.97	1,435.03
其中: 交易所市场	2,072.97	1,435.03
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	43,700.00	35,000.00
合计	45,772.97	36,435.03

7.4.7.7 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 12 月 31 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	45,000,000.00	45,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
本期末	75,144,188.00	75,144,188.00

7.4.7.8 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	482,133.37	9,721,241.55	10,203,374.92
本期基金份额交易产生的变动数	-1,279,196.80	-3,093,825.15	-4,373,021.95
其中：基金申购款	-2,745,880.23	-6,487,256.79	-9,233,137.02
基金赎回款	1,466,683.43	3,393,431.64	4,860,115.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,042,040.42	-3,214,771.69	-7,256,812.11

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,530.31	9,262.02
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	2,695.52	1,498.13
其他	45.18	47.70
合计	10,271.01	10,807.85

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-750,268.38	-660,397.03
股票投资收益——赎回差价收入	-74,311.85	-236,362.89
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	-824,580.23	-896,759.92

7.4.7.10.2 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12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
卖出股票成交总额	21,764,489.89	23,336,546.72
减：卖出股票成本总额	22,465,934.52	23,929,711.55
减：交易费用	48,823.75	67,232.20
买卖股票差价收入	-750,268.38	-660,397.03

7.4.7.10.3 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
赎回基金份额对价总额	19,139,884.93	34,919,944.99
减：现金支付赎回款总额	11,311,408.93	21,319,327.99
减：赎回股票成本总额	7,902,787.85	13,836,979.89
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-74,311.85	-236,362.89

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利息收入	0.29	2.10
债券投资收益——买卖债券（债转股）	541.69	2,733.76

及债券到期兑付) 差价收入		
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	541.98	2,735.86

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,242.11	17,236.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,699.99	14,499.96
减：应计利息总额	0.30	2.14
减：交易费用	0.13	0.70
买卖债券差价收入	541.69	2,733.76

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	20,152.38	-

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,664,678.42	1,152,661.37
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	1,664,678.42	1,152,661.37

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	9,734,321.55	-3,651,241.11
——股票投资	9,734,321.55	-3,651,241.11
——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	-13,080.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-13,080.00	-
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	9,721,241.55	-3,651,241.11

7.4.7.16其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	965.73	94,575.32
合计	965.73	94,575.32

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。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	23,700.00	15,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
港股通证券组合费	1,741.20	1,369.91
银行汇划费	661.17	780.00
其他	170,000.00	170,000.00
合计	276,102.37	237,149.91

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9关联方关系

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
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
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	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	5,040.00	0.01%	-	-

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31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	0.50	0.01%	0.50	0.02%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本报告期内本基金的佣金协议及服务范围发生变更。2024年7月1日前，佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自2024年7月1日起，佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人

管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	85,290.30	68,440.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	601.16	925.25
应支付基金管理人的净管理费	84,689.14	67,515.28

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,430.06	22,813.57

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31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	43.9156%	60.9484%

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。

7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	18,885,000.00	25.1317%	-	-

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。

7.4.10.6 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12月31日		2023年1月1日至2023年12月31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	1,821,472.84	7,530.31	2,292,325.23	9,262.02

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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 12 月 31 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 5,100 股（2023 年 12 月 31 日:3,800 股），占本基金净值比例为 0.12%(2023 年 12 月 31 日:0.13%)；持有工商银行发行的港股工商银行 148,000 股（2023 年 12 月 31 日:111,000 股），占本基金净值比例为 1.05%(2023 年 12 月 31 日:0.94%)；持有工商银行发行的 A 股工商银行 59,900 股（2023 年 12 月 31 日:45,000 股），占本基金净值比例为 0.61%(2023 年 12 月 31 日:0.52%)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	8,000	56,812.94	57,760.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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 12 月 31 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%)。

7.4.13.2.1 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12月31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企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 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12月31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
----	------	------

7.4.13.2.3 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12月31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

7.4.13.2.4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12月31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、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 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12月31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

7.4.13.2.6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12月31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

7.4.13.3 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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,821,472.84	-	-	-	1,821,472.84
结算备付金	327,424.16	-	-	-	327,424.16
存出保证金	286,054.15	-	-	-	286,054.15
交易性金融资产	-	-	-	65,503,339.31	65,503,339.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	7,426.50	7,426.50
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,434,951.15	-	-	65,510,765.81	67,945,716.96
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	-	-	-	24.63	24.63
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,895.28	8,895.28
应付托管费	-	-	-	2,965.10	2,965.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	683.09	683.09
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	45,772.97	45,772.97
负债总计	-	-	-	58,341.07	58,341.07
利率敏感度缺口	2,434,951.15	-	-	65,452,424.74	67,887,375.89
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。

7.4.13.4.1.2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。

7.4.13.4.2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。

7.4.13.4.2.1外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	27,595,299.84	-	27,595,299.84
资产合计	-	27,595,299.84	-	27,595,299.84
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	-	27,595,299.84	-	27,595,299.84
项目	上年度末			

	2023年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
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

7.4.13.4.2.2 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12月31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%	-1,379,764.99	-758,787.52
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	1,379,764.99	758,787.52

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

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

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	65,503,339.31	96.49	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	65,503,339.31	96.49	39,240,350.41	95.58

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	3,275,166.88	1,962,017.47
	2.业绩比较基准下降 5%	-3,275,166.88	-1,962,017.47

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	65,445,579.31	39,240,350.41
第二层次	57,760.00	-
第三层次	-	-
合计	65,503,339.31	39,240,350.41

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基

金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	65,503,339.31	96.41
	其中：股票	65,503,339.31	96.41
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	2,148,897.00	3.16
8	其他各项资产	293,480.65	0.43
9	合计	67,945,716.96	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 27,595,299.84 元，占净值比例 40.65%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	330,909.00	0.49
B	采矿业	1,875,748.71	2.76
C	制造业	20,420,638.51	30.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,407,118.00	2.07
E	建筑业	733,504.60	1.08
F	批发和零售业	124,637.80	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	1,303,615.16	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,644,631.98	2.42
J	金融业	9,032,141.46	13.30
K	房地产业	301,634.00	0.44
L	租赁和商务服务业	298,563.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	329,520.00	0.49
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	105,377.25	0.16
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,908,039.47	55.84

8.2.2 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	1,148,303.49	1.69
材料	179,948.10	0.27
工业	1,126,899.00	1.66
非必需消费品	6,215,252.67	9.16
必需消费品	630,333.21	0.93

保健	645,746.22	0.95
金融	8,711,774.56	12.83
信息技术	1,633,812.37	2.41
电信服务	5,601,713.20	8.25
公用事业	840,702.63	1.24
房地产	860,814.39	1.27
合计	27,595,299.84	40.65

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 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	11,100	4,286,361.35	6.31
2	09988	阿里巴巴-W	32,600	2,487,565.69	3.66
3	00005	汇丰控股	30,800	2,161,970.03	3.18
4	600519	贵州茅台	1,100	1,676,400.00	2.47
5	601318	中国平安	18,400	968,760.00	1.43
5	02318	中国平安	12,500	533,051.78	0.79
6	03690	美团-W	10,400	1,460,994.79	2.15
7	00939	建设银行	205,000	1,230,151.54	1.81
7	601939	建设银行	11,495	101,041.05	0.15
8	300750	宁德时代	4,520	1,202,320.00	1.77
9	01398	工商银行	148,000	714,050.92	1.05
9	601398	工商银行	59,900	414,508.00	0.61
10	600036	招商银行	21,100	829,230.00	1.22
10	03968	招商银行	8,000	296,332.80	0.44
11	01299	友邦保险	18,400	959,303.36	1.41
12	01810	小米集团-W	29,800	952,061.72	1.40
13	01211	比亚迪股份	2,000	493,764.53	0.73
13	002594	比亚迪	1,600	452,256.00	0.67
14	00941	中国移动	10,500	744,813.97	1.10
14	600941	中国移动	1,600	189,056.00	0.28
15	03988	中国银行	143,000	525,722.17	0.77
15	601988	中国银行	36,000	198,360.00	0.29
16	000333	美的集团	8,400	631,848.00	0.93
16	00300	美的集团	1,100	76,958.55	0.11
17	00883	中国海洋石油	30,000	531,176.54	0.78
17	600938	中国海油	3,600	106,236.00	0.16
18	600900	长江电力	20,900	617,595.00	0.91
19	00388	香港交易所	2,200	600,592.50	0.88

20	688981	中芯国际	3,485	329,750.70	0.49
20	00981	中芯国际	8,000	235,584.58	0.35
21	600030	中信证券	16,735	488,159.95	0.72
21	06030	中信证券	3,500	69,198.34	0.10
22	300059	东方财富	21,548	556,369.36	0.82
23	601899	紫金矿业	28,100	424,872.00	0.63
23	02899	紫金矿业	10,000	130,942.06	0.19
24	601288	农业银行	54,600	291,564.00	0.43
24	01288	农业银行	52,000	213,322.57	0.31
25	601328	交通银行	40,300	313,131.00	0.46
25	03328	交通银行	30,000	177,521.87	0.26
26	000858	五粮液	3,400	476,136.00	0.70
27	601166	兴业银行	24,800	475,168.00	0.70
28	601088	中国神华	5,700	247,836.00	0.37
28	01088	中国神华	5,500	171,132.19	0.25
29	00857	中国石油股份	36,000	203,691.76	0.30
29	601857	中国石油	19,409	173,516.46	0.26
30	02888	渣打集团	4,150	367,204.96	0.54
31	002475	立讯精密	8,700	354,612.00	0.52
32	600276	恒瑞医药	7,660	351,594.00	0.52
33	000651	格力电器	7,700	349,965.00	0.52
34	00386	中国石油化工股份	42,000	173,076.88	0.25
34	600028	中国石化	24,900	166,332.00	0.25
35	600887	伊利股份	10,900	328,962.00	0.48
36	601601	中国太保	5,900	201,072.00	0.30
36	02601	中国太保	4,800	112,013.80	0.16
37	601816	京沪高铁	50,400	310,464.00	0.46
38	600690	海尔智家	6,402	182,264.94	0.27
38	06690	海尔智家	4,800	122,237.28	0.18
39	601728	中国电信	26,500	191,330.00	0.28
39	00728	中国电信	24,000	108,235.56	0.16
40	02628	中国人寿	13,000	176,725.47	0.26
40	601628	中国人寿	2,843	119,178.56	0.18
41	00669	创科实业	3,000	284,757.30	0.42
42	000725	京东方 A	63,200	277,448.00	0.41
43	688041	海光信息	1,762	263,929.98	0.39
44	300760	迈瑞医疗	1,000	255,000.00	0.38
45	600919	江苏银行	25,100	246,482.00	0.36
46	603259	药明康德	4,300	236,672.00	0.35
47	600309	万华化学	3,300	235,455.00	0.35
48	002371	北方华创	600	234,600.00	0.35
49	09987	百胜中国	650	225,240.71	0.33
50	06160	百济神州	2,200	222,471.85	0.33

51	000063	中兴通讯	5,500	222,200.00	0.33
52	02015	理想汽车-W	2,500	217,503.65	0.32
53	601668	中国建筑	35,540	213,240.00	0.31
54	00002	中电控股	3,500	211,646.44	0.31
55	300124	汇川技术	3,600	210,888.00	0.31
56	600000	浦发银行	20,093	206,756.97	0.30
57	300308	中际旭创	1,600	197,616.00	0.29
58	01024	快手-W	5,100	195,287.95	0.29
59	000001	平安银行	16,600	194,220.00	0.29
60	002415	海康威视	6,300	193,410.00	0.28
61	300274	阳光电源	2,540	187,528.20	0.28
62	600837	海通证券	16,500	183,480.00	0.27
63	603019	中科曙光	2,500	180,800.00	0.27
64	002714	牧原股份	4,700	180,668.00	0.27
65	601658	邮储银行	19,000	107,920.00	0.16
65	01658	邮储银行	17,000	72,101.47	0.11
66	600016	民生银行	42,476	175,425.88	0.26
67	600660	福耀玻璃	2,800	174,720.00	0.26
68	601766	中国中车	20,800	174,304.00	0.26
69	688256	寒武纪	264	173,712.00	0.26
70	600406	国电南瑞	6,876	173,412.72	0.26
71	02020	安踏体育	2,400	173,021.31	0.25
72	00001	长和	4,500	172,937.97	0.25
73	00016	新鸿基地产	2,500	172,822.22	0.25
74	002352	顺丰控股	4,200	169,260.00	0.25
75	601919	中远海控	10,900	168,950.00	0.25
76	600031	三一重工	10,200	168,096.00	0.25
77	601985	中国核电	16,100	167,923.00	0.25
78	600809	山西汾酒	900	165,789.00	0.24
79	600104	上汽集团	7,900	164,004.00	0.24
80	601012	隆基绿能	10,368	162,881.28	0.24
81	000568	泸州老窖	1,300	162,760.00	0.24
82	02388	中银香港	7,000	161,732.89	0.24
83	000100	TCL 科技	32,090	161,412.70	0.24
84	603501	韦尔股份	1,545	161,313.45	0.24
85	601127	赛力斯	1,200	160,068.00	0.24
86	601225	陕西煤业	6,700	155,842.00	0.23
87	688012	中微公司	823	155,678.68	0.23
88	601169	北京银行	25,300	155,595.00	0.23
89	601229	上海银行	17,000	155,550.00	0.23
90	601688	华泰证券	8,800	154,792.00	0.23
91	002230	科大讯飞	3,200	154,624.00	0.23
92	300498	温氏股份	9,100	150,241.00	0.22
93	601138	工业富联	6,800	146,200.00	0.22

94	600050	中国联通	27,200	144,432.00	0.21
95	601211	国泰君安	7,700	143,605.00	0.21
96	600150	中国船舶	3,900	140,244.00	0.21
97	300502	新易盛	1,200	138,696.00	0.20
98	09868	小鹏汽车-W	3,200	138,239.25	0.20
99	002142	宁波银行	5,660	137,594.60	0.20
100	00175	吉利汽车	10,000	137,239.13	0.20
101	00998	中信银行	18,000	89,511.03	0.13
101	601998	中信银行	6,700	46,766.00	0.07
102	02328	中国财险	12,000	136,239.00	0.20
103	688008	澜起科技	1,948	132,269.20	0.19
104	00992	联想集团	14,000	130,682.76	0.19
105	603288	海天味业	2,844	130,539.60	0.19
106	603986	兆易创新	1,200	128,160.00	0.19
107	00267	中信股份	15,000	127,932.43	0.19
108	000338	潍柴动力	9,300	127,410.00	0.19
109	00006	电能实业	2,500	125,478.42	0.18
110	01109	华润置地	6,000	125,293.21	0.18
111	002625	光启技术	2,600	124,280.00	0.18
112	601818	光大银行	31,700	122,679.00	0.18
113	600999	招商证券	6,400	122,624.00	0.18
114	00027	银河娱乐	4,000	122,237.28	0.18
115	002027	分众传媒	17,300	121,619.00	0.18
116	02057	中通快递-W	850	119,093.37	0.18
117	00011	恒生银行	1,300	115,028.06	0.17
118	300033	同花顺	400	115,000.00	0.17
119	601888	中国中免	1,700	113,917.00	0.17
120	02269	药明生物	7,000	113,828.84	0.17
121	000625	长安汽车	8,480	113,292.80	0.17
122	601390	中国中铁	17,600	112,464.00	0.17
123	000425	徐工机械	14,100	111,813.00	0.16
124	000938	紫光股份	4,000	111,320.00	0.16
125	600089	特变电工	8,690	110,710.60	0.16
126	00003	香港中华煤气	19,000	109,263.46	0.16
127	600048	保利发展	12,300	108,978.00	0.16
128	600418	江淮汽车	2,900	108,750.00	0.16
129	002241	歌尔股份	4,200	108,402.00	0.16
130	600436	片仔癀	500	107,250.00	0.16
131	000792	盐湖股份	6,500	106,990.00	0.16
132	09633	农夫山泉	3,400	106,892.80	0.16
133	600905	三峡能源	24,400	106,628.00	0.16
134	601006	大秦铁路	15,572	105,578.16	0.16
135	300015	爱尔眼科	7,953	105,377.25	0.16
136	600019	宝钢股份	15,000	105,000.00	0.15

137	600438	通威股份	4,700	103,917.00	0.15
138	01113	长实集团	3,500	103,392.37	0.15
139	600584	长电科技	2,500	102,150.00	0.15
140	601600	中国铝业	13,600	99,960.00	0.15
141	09992	泡泡玛特	1,200	99,623.38	0.15
142	600760	中航沈飞	1,940	98,396.80	0.14
143	300014	亿纬锂能	2,100	98,154.00	0.14
144	600585	海螺水泥	4,100	97,498.00	0.14
145	601009	南京银行	9,142	97,362.30	0.14
146	600893	航发动力	2,300	95,335.00	0.14
147	600958	东方证券	8,928	94,279.68	0.14
148	601989	中国重工	19,500	93,795.00	0.14
149	000977	浪潮信息	1,800	93,384.00	0.14
150	600111	北方稀土	4,400	93,368.00	0.14
151	000538	云南白药	1,540	92,323.00	0.14
152	002050	三花智控	3,900	91,689.00	0.14
153	002463	沪电股份	2,300	91,195.00	0.13
154	600926	杭州银行	6,200	90,582.00	0.13
155	300408	三环集团	2,300	88,573.00	0.13
156	600188	兖矿能源	3,125	44,281.25	0.07
156	01171	兖矿能源	5,200	43,097.90	0.06
157	600015	华夏银行	10,900	87,309.00	0.13
158	00288	万洲国际	15,500	86,265.26	0.13
159	00688	中国海外发展	7,500	86,121.72	0.13
159	02313	申洲国际	1,500	86,121.72	0.13
161	002179	中航光电	2,174	85,438.20	0.13
162	000002	万科 A	11,700	84,942.00	0.13
163	600886	国投电力	5,100	84,762.00	0.12
164	01801	信达生物	2,500	84,732.66	0.12
165	601825	沪农商行	9,900	84,249.00	0.12
166	002304	洋河股份	1,000	83,530.00	0.12
167	688111	金山办公	290	83,053.10	0.12
168	00788	中国铁塔	80,000	82,973.18	0.12
169	02382	舜宇光学科技	1,300	82,885.21	0.12
170	000776	广发证券	5,100	82,671.00	0.12
171	000166	申万宏源	15,400	82,390.00	0.12
172	02319	蒙牛乳业	5,000	81,306.31	0.12
173	603993	洛阳钼业	12,100	80,465.00	0.12
174	601669	中国电建	14,700	80,262.00	0.12
175	002028	思源电气	1,100	79,970.00	0.12
176	01928	金沙中国有限公司	4,000	77,416.94	0.11
177	688036	传音控股	808	76,760.00	0.11
178	00066	港铁公司	3,000	75,287.05	0.11

179	600009	上海机场	2,200	75,130.00	0.11
180	601916	浙商银行	25,770	74,990.70	0.11
181	601336	新华保险	1,500	74,550.00	0.11
182	300433	蓝思科技	3,400	74,460.00	0.11
183	600570	恒生电子	2,657	74,369.43	0.11
184	601377	兴业证券	11,820	73,993.20	0.11
185	002311	海大集团	1,500	73,575.00	0.11
186	002049	紫光国微	1,140	73,381.80	0.11
187	601186	中国铁建	7,900	72,443.00	0.11
188	600010	包钢股份	38,800	72,168.00	0.11
189	601901	方正证券	8,500	70,805.00	0.10
190	601727	上海电气	8,700	70,557.00	0.10
191	600547	山东黄金	3,100	70,153.00	0.10
192	00291	华润啤酒	3,000	70,147.53	0.10
193	002384	东山精密	2,400	70,080.00	0.10
194	600795	国电电力	15,300	70,074.00	0.10
195	002460	赣锋锂业	2,000	70,020.00	0.10
196	00836	华润电力	4,000	69,934.54	0.10
197	603799	华友钴业	2,390	69,931.40	0.10
198	01519	极兔速递-W	12,200	69,254.83	0.10
199	02331	李宁	4,500	68,591.78	0.10
200	601838	成都银行	4,000	68,440.00	0.10
201	00762	中国联通	10,000	68,434.36	0.10
202	000768	中航西飞	2,400	67,776.00	0.10
203	601995	中金公司	2,000	67,380.00	0.10
204	600522	中天科技	4,700	67,304.00	0.10
205	02688	新奥能源	1,300	67,235.13	0.10
206	09626	哔哩哔哩-W	500	65,748.84	0.10
207	688271	联影医疗	513	64,843.20	0.10
208	605499	东鹏饮料	260	64,615.20	0.10
209	601058	赛轮轮胎	4,500	64,485.00	0.09
210	601077	渝农商行	10,600	64,130.00	0.09
211	600989	宝丰能源	3,800	63,992.00	0.09
212	601800	中国交建	6,100	63,745.00	0.09
213	001979	招商蛇口	6,200	63,488.00	0.09
214	600415	小商品城	4,700	63,027.00	0.09
215	002422	科伦药业	2,100	62,853.00	0.09
216	00135	昆仑能源	8,000	62,229.89	0.09
217	601360	三六零	6,000	62,100.00	0.09
218	01093	石药集团	14,000	61,970.60	0.09
219	601788	光大证券	3,400	61,574.00	0.09
220	000157	中联重科	8,500	61,455.00	0.09
221	300782	卓胜微	680	60,996.00	0.09
222	00020	商汤-W	44,000	60,711.18	0.09

223	600489	中金黄金	5,000	60,150.00	0.09
224	600029	南方航空	9,200	59,708.00	0.09
225	000661	长春高新	600	59,664.00	0.09
226	601689	拓普集团	1,215	59,535.00	0.09
227	002466	天齐锂业	1,800	59,400.00	0.09
228	002001	新和成	2,700	59,319.00	0.09
229	06862	海底捞	4,000	58,896.14	0.09
230	600674	川投能源	3,400	58,650.00	0.09
231	00285	比亚迪电子	1,500	58,409.97	0.09
232	600115	中国东航	14,600	58,400.00	0.09
233	600745	闻泰科技	1,500	58,170.00	0.09
234	00083	信和置业	8,000	58,155.31	0.09
235	600066	宇通客车	2,200	58,036.00	0.09
236	601633	长城汽车	2,200	57,926.00	0.09
237	600160	巨化股份	2,400	57,888.00	0.09
238	601881	中国银河	3,800	57,874.00	0.09
239	002252	上海莱士	8,000	57,760.00	0.09
240	300418	昆仑万维	1,500	57,720.00	0.09
241	601878	浙商证券	4,700	57,528.00	0.08
242	601066	中信建投	2,233	57,499.75	0.08
243	002340	格林美	8,800	57,464.00	0.08
244	06618	京东健康	2,200	57,247.79	0.08
245	300442	润泽科技	1,100	57,156.00	0.08
246	600600	青岛啤酒	700	56,644.00	0.08
247	01177	中国生物制药	19,000	56,303.23	0.08
248	09926	康方生物	1,000	56,210.63	0.08
249	600426	华鲁恒升	2,600	56,186.00	0.08
250	002736	国信证券	5,000	56,000.00	0.08
251	003816	中国广核	13,500	55,755.00	0.08
252	01821	ESR	5,000	55,284.59	0.08
253	688169	石头科技	252	55,261.08	0.08
254	600346	恒力石化	3,600	55,260.00	0.08
255	01997	九龙仓置业	3,000	55,173.46	0.08
256	688126	沪硅产业	2,926	55,067.32	0.08
257	002920	德赛西威	500	55,055.00	0.08
258	300394	天孚通信	600	54,816.00	0.08
259	600196	复星医药	2,200	54,670.00	0.08
260	000786	北新建材	1,800	54,558.00	0.08
261	002236	大华股份	3,400	54,400.00	0.08
262	002648	卫星化学	2,894	54,378.26	0.08
263	603369	今世缘	1,200	54,276.00	0.08
264	300122	智飞生物	2,050	53,915.00	0.08
265	01038	长江基建集团	1,000	53,478.81	0.08
266	600256	广汇能源	7,900	53,167.00	0.08

267	688777	中控技术	1,065	52,898.55	0.08
268	601555	东吴证券	6,779	52,876.20	0.08
269	601100	恒立液压	1,000	52,770.00	0.08
270	601117	中国化学	6,300	52,227.00	0.08
271	000596	古井贡酒	300	51,990.00	0.08
272	601021	春秋航空	900	51,903.00	0.08
273	000963	华东医药	1,500	51,900.00	0.08
274	600372	中航机载	4,162	51,317.46	0.08
275	002601	龙佰集团	2,900	51,243.00	0.08
276	601868	中国能建	22,200	50,838.00	0.07
277	600011	华能国际	7,500	50,775.00	0.07
278	601111	中国国航	6,400	50,624.00	0.07
279	600183	生益科技	2,100	50,505.00	0.07
280	002916	深南电路	400	50,000.00	0.07
281	03888	金山软件	1,600	49,857.99	0.07
282	002202	金风科技	4,800	49,584.00	0.07
283	002129	TCL 中环	5,575	49,450.25	0.07
284	600460	士兰微	1,900	49,438.00	0.07
285	300347	泰格医药	900	49,158.00	0.07
286	600096	云天化	2,200	49,060.00	0.07
287	01378	中国宏桥	4,500	49,006.04	0.07
288	600482	中国动力	2,000	48,940.00	0.07
289	001965	招商公路	3,500	48,825.00	0.07
290	000807	云铝股份	3,600	48,708.00	0.07
290	600085	同仁堂	1,200	48,708.00	0.07
292	688223	晶科能源	6,834	48,589.74	0.07
293	301269	华大九天	400	48,440.00	0.07
294	300661	圣邦股份	590	48,250.20	0.07
295	000066	中国长城	3,300	48,081.00	0.07
296	603392	万泰生物	680	47,912.80	0.07
297	002180	纳思达	1,700	47,889.00	0.07
298	600741	华域汽车	2,700	47,547.00	0.07
299	00268	金蝶国际	6,000	47,394.73	0.07
300	600885	宏发股份	1,480	47,093.60	0.07
301	002493	荣盛石化	5,200	47,060.00	0.07
302	002459	晶澳科技	3,408	46,860.00	0.07
303	000895	双汇发展	1,800	46,728.00	0.07
304	600176	中国巨石	4,100	46,699.00	0.07
305	600219	南山铝业	11,900	46,529.00	0.07
306	601108	财通证券	5,600	45,752.00	0.07
307	01193	华润燃气	1,600	45,561.17	0.07
308	06186	中国飞鹤	9,000	45,422.26	0.07
309	03311	中国建筑国际	4,000	45,413.00	0.07
310	600845	宝信软件	1,543	45,148.18	0.07

311	601168	西部矿业	2,800	44,996.00	0.07
312	000975	山金国际	2,900	44,573.00	0.07
313	601877	正泰电器	1,900	44,479.00	0.07
314	600515	海南机场	11,700	44,226.00	0.07
315	002271	东方雨虹	3,400	44,132.00	0.07
316	000933	神火股份	2,600	43,940.00	0.06
317	000423	东阿阿胶	700	43,904.00	0.06
318	002938	鹏鼎控股	1,200	43,776.00	0.06
319	00012	恒基地产	2,000	43,709.09	0.06
320	300759	康龙化成	1,700	43,690.00	0.06
321	002709	天赐材料	2,200	43,384.00	0.06
322	600161	天坛生物	2,100	43,050.00	0.06
323	688396	华润微	912	43,037.28	0.06
324	600233	圆通速递	3,000	42,570.00	0.06
325	300832	新产业	600	42,510.00	0.06
326	000630	铜陵有色	13,100	42,313.00	0.06
327	002555	三七互娱	2,700	42,228.00	0.06
328	603606	东方电缆	800	42,040.00	0.06
329	601319	中国人保	5,500	41,910.00	0.06
330	00960	龙湖集团	4,500	41,671.80	0.06
331	002078	太阳纸业	2,800	41,636.00	0.06
332	300223	北京君正	600	40,920.00	0.06
333	00004	九龙仓集团	2,000	40,467.95	0.06
334	000983	山西焦煤	4,900	40,376.00	0.06
335	002074	国轩高科	1,900	40,318.00	0.06
336	02618	京东物流	3,400	40,301.26	0.06
337	601618	中国中冶	12,200	40,260.00	0.06
338	601607	上海医药	1,900	39,900.00	0.06
339	600298	安琪酵母	1,100	39,655.00	0.06
340	600023	浙能电力	6,900	39,054.00	0.06
341	000999	华润三九	880	39,019.20	0.06
342	601898	中煤能源	3,200	38,976.00	0.06
343	603260	合盛硅业	700	38,892.00	0.06
344	000783	长江证券	5,700	38,874.00	0.06
345	000408	藏格矿业	1,400	38,822.00	0.06
346	002600	领益智造	4,800	38,400.00	0.06
347	01308	海丰国际	2,000	38,338.06	0.06
348	300316	晶盛机电	1,200	38,280.00	0.06
349	300450	先导智能	1,900	38,038.00	0.06
350	000301	东方盛虹	4,600	37,766.00	0.06
351	600588	用友网络	3,500	37,555.00	0.06
352	00322	康师傅控股	4,000	37,486.10	0.06
353	00270	粤海投资	6,000	37,282.37	0.05
354	002128	电投能源	1,900	37,202.00	0.05

355	600362	江西铜业	1,800	37,152.00	0.05
356	03800	协鑫科技	37,000	37,004.56	0.05
357	02367	巨子生物	800	36,967.52	0.05
358	06969	思摩尔国际	3,000	36,949.00	0.05
359	601567	三星医疗	1,200	36,912.00	0.05
360	600765	中航重机	1,800	36,846.00	0.05
361	300896	爱美客	200	36,500.00	0.05
362	601872	招商轮船	5,600	35,896.00	0.05
363	688599	天合光能	1,859	35,878.70	0.05
364	300999	金龙鱼	1,100	35,871.00	0.05
365	605117	德业股份	420	35,616.00	0.05
366	601238	广汽集团	3,800	35,492.00	0.05
367	603296	华勤技术	500	35,475.00	0.05
368	00384	中国燃气	5,600	35,108.03	0.05
369	000876	新希望	3,900	35,022.00	0.05
370	300413	芒果超媒	1,300	34,957.00	0.05
371	09896	名创优品	800	34,856.15	0.05
372	688122	西部超导	813	34,812.66	0.05
373	300628	亿联网络	900	34,740.00	0.05
374	600803	新奥股份	1,600	34,688.00	0.05
375	601233	桐昆股份	2,900	34,220.00	0.05
376	600332	白云山	1,200	34,104.00	0.05
377	300037	新宙邦	900	33,696.00	0.05
378	688072	拓荆科技	216	33,192.72	0.05
379	600061	国投资本	4,400	33,088.00	0.05
380	600039	四川路桥	4,520	32,905.60	0.05
381	00019	太古股份公司 A	500	32,619.76	0.05
382	600027	华电国际	5,800	32,538.00	0.05
383	601696	中银证券	2,900	32,364.00	0.05
384	00881	中升控股	2,500	32,318.80	0.05
385	603605	珀莱雅	380	32,186.00	0.05
386	01209	华润万象生活	1,200	32,115.07	0.05
387	002007	华兰生物	1,900	32,015.00	0.05
388	03692	翰森制药	2,000	32,003.94	0.05
389	002812	恩捷股份	1,000	31,990.00	0.05
390	03808	中国重汽	1,500	31,670.57	0.05
391	688472	阿特斯	2,516	31,600.96	0.05
392	600918	中泰证券	4,800	31,536.00	0.05
393	600642	申能股份	3,300	31,317.00	0.05
394	00241	阿里健康	10,000	30,744.53	0.05
395	688303	大全能源	1,266	30,561.24	0.05
396	601216	君正集团	5,800	30,508.00	0.04
397	002821	凯莱英	400	30,436.00	0.04
398	300919	中伟股份	840	30,340.80	0.04

399	000617	中油资本	4,400	30,316.00	0.04
400	603659	璞泰来	1,905	30,308.55	0.04
401	600875	东方电气	1,900	30,191.00	0.04
402	601699	潞安环能	2,100	30,156.00	0.04
403	000932	华菱钢铁	7,100	29,678.00	0.04
404	000733	振华科技	700	29,519.00	0.04
405	600025	华能水电	3,100	29,481.00	0.04
406	600018	上港集团	4,800	29,376.00	0.04
407	01972	太古地产	2,000	29,299.91	0.04
408	00868	信义玻璃	4,000	29,225.82	0.04
409	00968	信义光能	10,000	29,077.66	0.04
410	03998	波司登	8,000	28,744.28	0.04
411	600026	中远海能	2,400	27,840.00	0.04
412	002064	华峰化学	3,400	27,812.00	0.04
413	688009	中国通号	4,411	27,612.86	0.04
414	603806	福斯特	1,852	27,409.60	0.04
415	688047	龙芯中科	203	26,852.84	0.04
416	601799	星宇股份	200	26,696.00	0.04
417	03668	兖煤澳大利亚	900	26,128.22	0.04
418	601018	宁波港	6,700	25,795.00	0.04
419	00144	招商局港口	2,000	25,632.79	0.04
420	601865	福莱特	1,300	25,597.00	0.04
421	603939	益丰药房	1,060	25,577.80	0.04
422	601059	信达证券	1,700	25,466.00	0.04
423	600985	淮北矿业	1,800	25,326.00	0.04
424	600132	重庆啤酒	400	25,208.00	0.04
425	002603	以岭药业	1,500	24,015.00	0.04
426	01585	雅迪控股	2,000	23,965.92	0.04
427	300979	华利集团	300	23,595.00	0.03
428	02380	中国电力	8,000	23,484.37	0.03
429	601966	玲珑轮胎	1,300	23,452.00	0.03
430	603816	顾家家居	850	23,443.00	0.03
431	000629	钒钛股份	8,000	23,040.00	0.03
432	002939	长城证券	2,800	22,960.00	0.03
433	601698	中国卫通	1,100	22,440.00	0.03
434	601136	首创证券	1,000	22,000.00	0.03
435	002414	高德红外	2,914	21,651.02	0.03
436	603198	迎驾贡酒	400	21,576.00	0.03
437	01929	周大福	3,400	21,189.65	0.03
438	603899	晨光股份	700	21,175.00	0.03
439	300751	迈为股份	200	21,030.00	0.03
440	01044	恒安国际	1,000	20,789.60	0.03
441	603833	欧派家居	300	20,682.00	0.03
442	000708	中信特钢	1,800	20,538.00	0.03

443	603195	公牛集团	290	20,369.60	0.03
444	01876	百威亚太	2,900	20,114.51	0.03
445	688728	格科微	1,479	19,877.76	0.03
446	601231	环旭电子	1,200	19,800.00	0.03
447	000987	越秀资本	2,663	18,694.26	0.03
448	300765	新诺威	700	18,613.00	0.03
449	01548	金斯瑞生物科技	2,000	18,224.47	0.03
450	00293	国泰航空	2,000	17,668.84	0.03
451	00101	恒隆地产	3,000	17,307.69	0.03
452	601808	中海油服	1,100	16,775.00	0.02
453	02588	中银航空租赁	300	16,765.95	0.02
454	002032	苏泊尔	300	15,963.00	0.02
455	688187	时代电气	331	15,861.52	0.02
456	600606	绿地控股	7,200	15,120.00	0.02
457	02282	美高梅中国	1,600	14,727.74	0.02
458	600968	海油发展	3,400	14,518.00	0.02
459	000877	天山股份	2,500	14,150.00	0.02
460	06110	滔搏	5,000	13,798.00	0.02
461	600377	宁沪高速	900	13,779.00	0.02
462	600236	桂冠电力	2,000	13,600.00	0.02
463	000800	一汽解放	1,600	13,120.00	0.02
464	688363	华熙生物	244	12,453.76	0.02
465	600350	山东高速	1,100	11,308.00	0.02
466	001286	陕西能源	1,200	11,136.00	0.02
467	601298	青岛港	1,100	10,021.00	0.01
468	001872	招商港口	400	8,188.00	0.01
469	002945	华林证券	500	7,665.00	0.01
470	601061	中信金属	1,000	7,260.00	0.01
471	001289	龙源电力	200	3,142.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	09988	阿里巴巴-W	2,622,745.31	6.39
2	00700	腾讯控股	2,587,594.47	6.30
3	00005	汇丰控股	1,490,639.08	3.63
4	03690	美团-W	821,648.24	2.00
5	01299	友邦保险	738,025.72	1.80
6	00939	建设银行	693,252.27	1.69

6	601939	建设银行	3,802.00	0.01
7	300750	宁德时代	590,687.00	1.44
8	002594	比亚迪	357,053.00	0.87
8	01211	比亚迪股份	205,844.58	0.50
9	01398	工商银行	425,019.88	1.04
9	601398	工商银行	85,497.00	0.21
10	00941	中国移动	509,346.27	1.24
11	000333	美的集团	402,927.00	0.98
11	00300	美的集团	76,807.40	0.19
12	02888	渣打集团	460,205.70	1.12
13	300760	迈瑞医疗	453,367.00	1.10
14	01810	小米集团-W	370,154.12	0.90
15	00388	香港交易所	366,784.90	0.89
16	000858	五粮液	358,665.00	0.87
17	02318	中国平安	295,163.40	0.72
17	601318	中国平安	41,925.00	0.10
18	03988	中国银行	298,253.67	0.73
18	601988	中国银行	23,042.00	0.06
19	00883	中国海洋石油	284,854.72	0.69
19	600938	中国海油	3,100.00	0.01
20	03968	招商银行	217,286.39	0.53
20	600036	招商银行	29,979.00	0.07

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	1,852,133.85	4.51
2	00005	汇丰控股	1,182,944.57	2.88
3	600519	贵州茅台	803,800.00	1.96
4	03690	美团-W	640,552.22	1.56
5	00941	中国移动	536,453.33	1.31
5	600941	中国移动	29,610.00	0.07
6	01299	友邦保险	495,987.73	1.21
7	00939	建设银行	482,162.05	1.17
7	601939	建设银行	8,905.00	0.02
8	300750	宁德时代	414,732.00	1.01
9	300760	迈瑞医疗	378,613.00	0.92
10	002594	比亚迪	260,087.00	0.63
10	01211	比亚迪股份	107,179.77	0.26

11	01398	工商银行	297,803.18	0.73
11	601398	工商银行	41,073.00	0.10
12	02888	渣打集团	317,682.65	0.77
13	01810	小米集团-W	302,927.68	0.74
14	02318	中国平安	198,502.83	0.48
14	601318	中国平安	99,334.00	0.24
15	000333	美的集团	275,799.00	0.67
16	09633	农夫山泉	268,628.28	0.65
17	03968	招商银行	161,567.63	0.39
17	600036	招商银行	85,522.00	0.21
18	01088	中国神华	204,272.61	0.50
18	601088	中国神华	31,727.00	0.08
19	000858	五粮液	232,262.00	0.57
20	03988	中国银行	200,445.37	0.49
20	601988	中国银行	18,928.00	0.05

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。

8.4.3 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	32,741,308.72
卖出股票收入（成交）总额	21,764,489.89

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	286,054.15
2	应收清算款	-
3	应收股利	7,426.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,480.65

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
875	85,879.07	60,657,488. 00	80.72%	14,486,700. 00	19.28%	18,885,000 .00	25.13%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 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	43.92%
2	中信证券股份有限公司	6,169,577.00	8.21%
3	东方证券股份有限公司	1,885,316.00	2.51%
4	贺晗	938,000.00	1.25%
5	李长安	520,000.00	0.69%
6	冀国军	495,000.00	0.66%
7	屠强	448,200.00	0.60%
8	BARCLAYS BANK PLC	403,400.00	0.54%
9	王旭东	315,500.00	0.42%
10	华泰证券股份有限公司	314,195.00	0.42%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达	18,885,000.00	25.13%

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		
---------------------------------	--	--

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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	0.0013%

9.4 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

§ 10 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	45,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	75,144,188.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2024 年 8 月 28 日发布公告，自 2024 年 8 月 26 日起陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员；本基金管理人于 2024 年 10 月 21 日发布公告，自 2024 年 10 月 20 日起关秀霞女士不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金首次聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 23,700.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人；高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-26
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停受理 ETF 公募基金产品注册申请三个月；出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度机制不完善，规定执行不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成并恢复 ETF 基金产品注册
其他	/

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	215,395.60	0.40%	21.52	0.39%	-

高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	5,040.00	0.01%	0.50	0.01%	-
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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	6,605,577.83	12.12%	660.62	12.12%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	2,259,534.02	4.15%	225.92	4.14%	-
中信建投	2	20,553,544.10	37.71%	2,055.30	37.71%	-
中信证券	3	24,865,457.06	45.62%	2,486.78	45.62%	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为长城证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为方正证券股份有限公司、华金证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司。

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有调整，调整后的标准如下：

1) 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，采取规范化的方式提供专业化的服务，在业内具有良好的声誉；

2) 具有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力；

3) 具有较突出的综合及专项服务能力和服务意愿；

4) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金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。

d) 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，报告的主要内容为报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，

包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

11.7.2 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
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	2,023.00	62.40%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,219.11	37.60%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	上海证券报、基金管理人	2024-01-11

	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	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
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
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华宝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	2024-07-11
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-07-18
17	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加民生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	2024-07-23
18	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更	上海证券报、基金管理	2024-08-28

	公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	上海证券报	2024-08-30
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分沪市 ETF 2024 年 9 月 6 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	2024-09-06
21	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加爱建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	2024-09-06
22	关于旗下部分基金 2024 年 9 月 18 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	2024-09-11
23	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	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	2024-09-14
24	关于旗下部分基金 2024 年 10 月 11 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	2024-10-08
25	易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	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	2024-10-08
26	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	2024-10-21
27	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-10-25
28	易方达基金管理有限公司关于易方达私募基金管理有限公司股东变更的公告	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	2024-11-02
29	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加大同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	2024-11-25
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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	2024-12-04
31	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国新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	2024-12-06
32	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加江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	2024-12-06

33	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中原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	2024-12-06
34	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加西南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	2024-12-13
35	关于旗下部分基金 2024 年 12 月 24 日至 2024 年 12 月 26 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	2024-12-19
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年 12 月 31 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	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	2024-12-26

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 12 月 31 日	33,000,000.00	0.00	0.00	33,000,000.00	43.92%
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 12 月 31 日	0.00	26,887,900.00	8,002,900.00	18,885,000.00	25.13%
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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日