

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	78
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	80
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	80
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	80

7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	80
7.11	投资组合报告附注	81
§ 8	基金份额持有人信息	82
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	82
§ 9	开放式基金份额变动	83
§ 10	重大事件揭示	83
10.1	基金份额持有人大会决议	83
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	83
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
10.4	基金投资策略的改变	83
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	83
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	84
10.8	其他重大事件	87
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	89
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	89
§ 12	备查文件目录	89
12.1	备查文件目录	89
12.2	存放地点	89
12.3	查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）	
场内简称	标普 500LOF	
基金主代码	161125	
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	538,895,336.72 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016 年 12 月 14 日	
下属分级基金的基金简称	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
下属分级基金的交易代码	161125	012860
报告期末下属分级基金的份额总额	498,335,547.93 份	40,559,788.79 份

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

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；广东省 珠海市横琴新区荣粤道188号6 层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510627；510623；519031	100033
法定代表人		吴欣荣	张金良

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层； 广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层

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

C 类人民币份额、C 类美元份额的注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
本期已实现收益	19,803,578.52	1,340,988.17
本期利润	91,543,180.34	7,543,108.38
加权平均基金份额本期利润	0.1777	0.1527
本期加权平均净值利润率	6.03%	5.28%
本期基金份额净值增长率	6.13%	5.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
期末可供分配利润	302,016,623.03	22,857,336.76
期末可供分配基金份额利润	0.6061	0.5635
期末基金资产净值	1,543,416,327.36	123,499,090.32
期末基金份额净值	3.0971	3.0449
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）A	易方达标普 500 指数 （QDII-LOF）C
基金份额累计净值增长率	209.71%	77.90%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.45%	0.84%	12.40%	0.84%	0.05%	0.00%

过去六个月	6.13%	0.87%	5.87%	0.87%	0.26%	0.00%
过去一年	14.39%	0.76%	14.25%	0.77%	0.14%	-0.01%
过去三年	54.38%	0.90%	55.53%	0.91%	-1.15%	-0.01%
过去五年	79.49%	1.02%	79.21%	1.02%	0.28%	0.00%
过去七年	140.63%	1.23%	143.03%	1.21%	-2.40%	0.02%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	209.71%	1.13%	221.07%	1.12%	-11.36%	0.01%

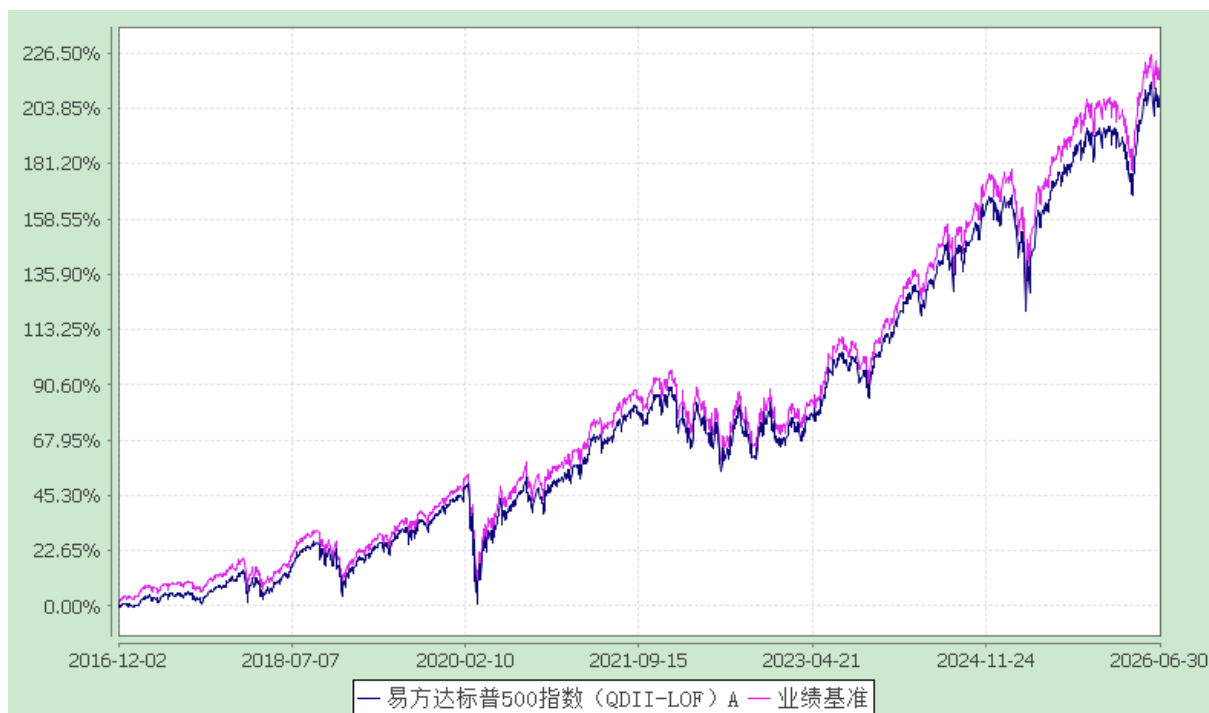
易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.35%	0.84%	12.40%	0.84%	-0.05%	0.00%
过去六个月	5.94%	0.87%	5.87%	0.87%	0.07%	0.00%
过去一年	13.98%	0.76%	14.25%	0.77%	-0.27%	-0.01%
过去三年	52.84%	0.90%	55.53%	0.91%	-2.69%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	77.90%	1.02%	80.50%	1.02%	-2.60%	0.00%

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

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A
（2016 年 12 月 2 日至 2026 年 6 月 30 日）



易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

（2021 年 7 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

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

§ 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 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘依姗	本基金的基金经理，易方达奥明日经 225ETF（QDII）、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达恒生港股通汽车主题 ETF、易方达中证港股通医疗主题 ETF、易方达恒生港股通汽车主题 ETF 联接发起式、易方达中证港股通医疗主题	2025-04-11	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任领航投资香港有限公司项目经理高级助理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理助理、研究员。

	ETF 联接发起 式、易方达中证 香港证券投资 主题（港股通） ETF 的基金经 理，易方达资产 管理（香港）有 限公司基金经 理				
--	---	--	--	--	--

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

- 2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。
- 3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 64 次，均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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

回顾 2026 年上半年，美国经济增速仍具韧性但整体呈现放缓趋势。受中东地缘局势扰动，国际油价上行，通胀压力存续。经济基本面整体韧性犹存，AI 资本开支与服务消费支撑内需，制造业 PMI 小幅回暖、企业投资意愿稳步修复；劳动力市场温和降温，就业供需逐步回归均衡。货币政策方面，美联储上半年四次议息会议均维持利率不变，联邦基金利率区间锁定在 3.50%-3.75%。年内美联储政策整体由偏鸽观望逐步转向鹰派，政策态度持续收紧。年初市场仍存在降息预期且时点延后，而二季度政策预期大幅转向，6 月点阵图显示半数票委预计存在加息可能，会议删除宽松表述、取消前瞻指引。新任主席沃什强调抗通胀优先原则，政策观望周期拉长，高利率长期化预期升温，官员政策分歧明显扩大。

市场层面，地缘风险、通胀粘性与美联储政策转向令上半年美股波动加剧、板块轮动加快、结构性分化显著。一季度油价上行叠加降息预期延后，美债收益率走高压制成长板块。二季度市场风格切换，AI 产业链带动信息技术、半导体等赛道强势上行，地缘缓和令油价回落、能源板块走势转弱。整体来看，上半年美股先抑后扬、结构分化加剧，板块轮动明显提速，报告期内以美元计价的标普 500 指数收涨 9.55%，其中信息技术、能源、工业等板块的表现较为突出。

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

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 3.0971 元，本报告期份额净值增长率为 6.13%，同期业绩比较基准收益率为 5.87%；C 类基金份额净值为 3.0449 元，本报告期份额净值增长率为 5.94%，同期业绩比较基准收益率为 5.87%。年化跟踪误差 0.32%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，AI 产业链持续扩张，算力、半导体等赛道盈利兑现有望延续，为美股提供核心基本面支撑；但经济动能放缓、中东地缘反复推升油价波动，叠加美联储鹰派政策预期，仍构成市场主要扰动因素。能源价格震荡或持续拖累通胀回落，新任美联储主席沃什坚持抗通胀优先，

后续利率路径将主导流动性与风险偏好。短期市场聚焦美国通胀演化、美联储政策信号及 AI 业绩兑现节奏。中长期来看，美国股市是全球资本市场的关键组成部分，也是美国家庭财富管理和海外投资者进行全球资产配置的重要组成部分。标普 500 指数的成份股公司大多是所在行业的全球领先企业。观察中长期趋势，标普 500 指数的表现持续且显著地超越美国 GDP 增速，未来仍将是分享美国股票投资机遇的重要途径。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C:本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,707,173.19	229,021,194.97
结算备付金		13,668,292.09	17,077,997.24
存出保证金		5,265,321.46	11,293,739.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,643,919,696.83	1,376,729,060.58
其中：股票投资		1,511,791,206.42	1,376,729,060.58
基金投资		-	-
债券投资		132,128,490.41	-
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		2,878,047.62	-
应收股利		617,832.56	622,128.92
应收申购款		-	5,646,951.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,674,056,363.75	1,640,391,073.50
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,048,896.65
应付赎回款		5,245,654.04	5,937,588.06
应付管理人报酬		1,098,960.60	1,106,410.37
应付托管费		274,740.15	276,602.61
应付销售服务费		36,304.35	47,662.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		217,473.30	39,688.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	267,813.63	358,357.23
负债合计		7,140,946.07	8,815,205.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	538,895,336.72	559,939,709.81
未分配利润	6.4.7.8	1,128,020,080.96	1,071,636,157.96
净资产合计		1,666,915,417.68	1,631,575,867.77
负债和净资产总计		1,674,056,363.75	1,640,391,073.50

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 3.0971 元，C 类基金份额净值 3.0449 元；基金份额总额 538,895,336.72 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 498,335,547.93 份，C 类基金份额总额 40,559,788.79 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		107,689,420.67	54,157,098.52
1.利息收入		467,377.21	222,515.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	461,536.50	222,515.28
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		5,840.71	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		30,700,680.79	17,237,980.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,170,746.51	11,386,898.18

基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,380,349.66	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	6,379,256.14	217,452.25
股利收益	6.4.7.15	7,770,328.48	5,633,629.64
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	77,941,722.03	37,687,970.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,597,057.31	-1,134,451.83
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	176,697.95	143,084.86
减：二、营业总支出		8,603,131.95	5,159,638.10
1. 管理人报酬		6,589,835.75	3,821,368.74
2. 托管费		1,647,458.91	989,871.10
3. 销售服务费		248,776.24	67,150.65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		23,300.90	1,003.57
8. 其他费用	6.4.7.19	93,760.15	280,244.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		99,086,288.72	48,997,460.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		99,086,288.72	48,997,460.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		99,086,288.72	48,997,460.42

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	559,939,709.81	1,071,636,157.96	1,631,575,867.77
二、本期期初净资产	559,939,709.81	1,071,636,157.96	1,631,575,867.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,044,373.09	56,383,923.00	35,339,549.91

（一）、综合收益总额	-	99,086,288.72	99,086,288.72
（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）	-21,044,373.09	-42,702,365.72	-63,746,738.81
其中：1.基金申购款	58,185,951.46	110,056,158.68	168,242,110.14
2.基金赎回款	-79,230,324.55	-152,758,524.40	-231,988,848.95
（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	538,895,336.72	1,128,020,080.96	1,666,915,417.68
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	372,912,487.81	589,789,933.45	962,702,421.26
二、本期期初净资产	372,912,487.81	589,789,933.45	962,702,421.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,595,132.26	50,594,035.34	53,189,167.60
（一）、综合收益总额	-	48,997,460.42	48,997,460.42
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,595,132.26	1,596,574.92	4,191,707.18
其中：1.基金申购款	75,896,356.14	113,727,175.78	189,623,531.92
2.基金赎回款	-73,301,223.88	-112,130,600.86	-185,431,824.74
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	375,507,620.07	640,383,968.79	1,015,891,588.86
-----------	----------------	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：齐昕

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2193 号《关于准予易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 693,199,312.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,037.35 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，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。

2027 年 12 月 31 日前，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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	7,707,173.19
等于：本金	7,704,474.49
加：应计利息	2,698.70
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	7,707,173.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,105,247,496.21	-	1,511,791,206.42	406,543,710.21
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所 市场	-	-	-	-
	银行间 市场	130,918,770.00	1,485,490.41	132,128,490.41	-275,770.00
	合计	130,918,770.00	1,485,490.41	132,128,490.41	-275,770.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,236,166,266.21	1,485,490.41	1,643,919,696.83	406,267,940.21

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	71,483,344.30	-	-	-
ESU6	71,483,344.30	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	71,483,344.30	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	28	71,974,526.30	491,182.00
合计	-	-	-	491,182.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	491,182.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与

相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,019.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
其他应付款	166,534.36
合计	267,813.63

6.4.7.7 实收基金

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	505,390,913.94	505,390,913.94
本期申购	47,869,516.40	47,869,516.40
本期赎回（以“-”号填列）	-54,924,882.41	-54,924,882.41
本期末	498,335,547.93	498,335,547.93

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,548,795.87	54,548,795.87
本期申购	10,316,435.06	10,316,435.06
本期赎回（以“-”号填列）	-24,305,442.14	-24,305,442.14
本期末	40,559,788.79	40,559,788.79

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	286,258,986.25	683,149,814.16	969,408,800.41
本期期初	286,258,986.25	683,149,814.16	969,408,800.41
本期利润	19,803,578.52	71,739,601.82	91,543,180.34
本期基金份额交易产生的变动数	-4,045,941.74	-11,825,259.58	-15,871,201.32
其中：基金申购款	27,232,353.60	63,700,751.18	90,933,104.78
基金赎回款	-31,278,295.34	-75,526,010.76	-106,804,306.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	302,016,623.03	743,064,156.40	1,045,080,779.43

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,903,426.48	73,323,931.07	102,227,357.55
本期期初	28,903,426.48	73,323,931.07	102,227,357.55
本期利润	1,340,988.17	6,202,120.21	7,543,108.38
本期基金份额交易产生的变动数	-7,387,077.89	-19,444,086.51	-26,831,164.40
其中：基金申购款	5,481,277.56	13,641,776.34	19,123,053.90
基金赎回款	-12,868,355.45	-33,085,862.85	-45,954,218.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,857,336.76	60,081,964.77	82,939,301.53

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	132,662.11
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	210,051.08
其他	118,823.31
合计	461,536.50

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,170,746.51
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	15,170,746.51

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	60,620,350.89
减：卖出股票成本总额	45,440,705.93
减：交易费用	8,898.45
买卖股票差价收入	15,170,746.51

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,381,424.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,075.00
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	1,380,349.66
----	--------------

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	1,075.00
买卖债券差价收入	-1,075.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
期货投资收益	6,379,256.14

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,770,328.48
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	7,770,328.48

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	77,047,236.56
——股票投资	77,323,006.56
——债券投资	-275,770.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	894,485.47
——权证投资	-
——期货投资	894,485.47
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	77,941,722.03

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	176,697.95
合计	176,697.95

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	4,500.00
合计	93,760.15

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、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
道富银行	境外托管人

易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
---------------------	------------------

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,589,835.75	3,821,368.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,796,375.77	786,080.22
应支付基金管理人的净管理费	4,793,459.98	3,035,288.52

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

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,647,458.91	989,871.10

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

$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达标普500指数 (QDII-LOF) A	易方达标普500指数 (QDII-LOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	11,050.73	11,050.73
易方达财富	-	677.11	677.11
合计	-	11,727.84	11,727.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达标普500指数 (QDII-LOF) A	易方达标普500指数 (QDII-LOF) C	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,775.54	5,775.54
合计	-	5,775.54	5,775.54

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

$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

无。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
道富银行-活期存款	610,599.77	10,504.88	39,560,814.00	58,082.15
中国建设银行-活期存款	7,096,573.42	122,157.23	22,408,156.52	91,830.40

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于境外托管人道富银行发行的美股 STT。于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有道富银行发行的美股 STT 957 股（2025 年 12 月 31 日：953 股），占本基金净值比例为 0.07%（2025 年 12 月 31 日：0.05%）。

6.4.11 利润分配情况

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A

本报告期内未发生利润分配。

易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2026 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 2026 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 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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%(2025 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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	132,128,490.41	0.00
合计	132,128,490.41	0.00

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026 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约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，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	7,707,173.19	-	-	-	7,707,173.19
结算备付金	13,668,292.09	-	-	-	13,668,292.09
存出保证金	5,265,321.46	-	-	-	5,265,321.46
交易性金融资产	132,128,490.41	-	-	1,511,791,206.42	1,643,919,696.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,878,047.62	2,878,047.62
应收股利	-	-	-	617,832.56	617,832.56
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	158,769,277.15	-	-	1,515,287,086.60	1,674,056,363.75
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	5,245,654.04	5,245,654.04
应付管理人报酬	-	-	-	1,098,960.60	1,098,960.60
应付托管费	-	-	-	274,740.15	274,740.15
应付销售服务费	-	-	-	36,304.35	36,304.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	217,473.30	217,473.30
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	267,813.63	267,813.63
负债总计	-	-	-	7,140,946.07	7,140,946.07
利率敏感度缺口	158,769,277.15	-	-	1,508,146,140.53	1,666,915,417.68
上年度末 2025 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	229,021,194.97	-	-	-	229,021,194.97
结算备付金	17,077,997.24	-	-	-	17,077,997.24
存出保证金	11,293,739.90	-	-	-	11,293,739.90
交易性金融资产	-	-	-	1,376,729,060.58	1,376,729,060.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	622,128.92	622,128.92
应收申购款	59,042.05	-	-	5,587,909.84	5,646,951.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	257,451,974.16	-	-	1,382,939,099.34	1,640,391,073.50
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	-	-	-	1,048,896.65	1,048,896.65
应付赎回款	-	-	-	5,937,588.06	5,937,588.06
应付管理人报酬	-	-	-	1,106,410.37	1,106,410.37
应付托管费	-	-	-	276,602.61	276,602.61
应付销售服务费	-	-	-	47,662.61	47,662.61
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	39,688.20	39,688.20
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	358,357.23	358,357.23
负债总计	-	-	-	8,815,205.73	8,815,205.73
利率敏感度缺口	257,451,974.16	-	-	1,374,123,893.61	1,631,575,867.77

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	160,779.02	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-160,374.11	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	4,152,161.31	-	-	4,152,161.31
结算备付金	13,668,292.09	-	-	13,668,292.09
存出保证金	5,265,321.46	-	-	5,265,321.46

交易性金融资产	1,511,791,206.42	-	-	1,511,791,206.42
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	2,878,047.62	-	-	2,878,047.62
应收股利	617,832.56	-	-	617,832.56
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,538,372,861.46	-	-	1,538,372,861.46
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	53,467.61	-	-	53,467.61
其他负债	161.42	-	-	161.42
负债合计	53,629.03	-	-	53,629.03
资产负债表 外汇风险敞口净额	1,538,319,232.43	-	-	1,538,319,232.43
项目	上年度末			
	2025年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	3,258,675.82	-	-	3,258,675.82
结算备付金	17,077,997.24	-	-	17,077,997.24
存出保证金	11,293,739.90	-	-	11,293,739.90
交易性金融资产	1,376,729,060.58	-	-	1,376,729,060.58
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	622,128.92	-	-	622,128.92
应收申购款	9,183.62	-	-	9,183.62
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,408,990,786.08	-	-	1,408,990,786.08
以外币计价的负债				

应付清算款	1,048,896.65	-	-	1,048,896.65
应付赎回款	233,816.41	-	-	233,816.41
其他负债	581.28	-	-	581.28
负债合计	1,283,294.34	-	-	1,283,294.34
资产负债表				
外汇风险敞口净额	1,407,707,491.74	-	-	1,407,707,491.74

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-76,915,961.62	-70,385,374.59
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	76,915,961.62	70,385,374.59

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,511,791,206.42	90.69	1,376,729,060.58	84.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属	-	-	-	-

投资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,511,791,206.42	90.69	1,376,729,060.58	84.38

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	75,589,560.32	68,836,453.03
	2.业绩比较基准下降 5%	-75,589,560.32	-68,836,453.03

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	1,511,791,206.42
第二层次	132,128,490.41
第三层次	-
合计	1,643,919,696.83

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	1,511,791,206.42	90.31
	其中：普通股	1,485,293,077.34	88.72
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	26,498,129.08	1.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,128,490.41	7.89
	其中：债券	132,128,490.41	7.89
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,375,465.28	1.28
8	其他各项资产	8,761,201.64	0.52
9	合计	1,674,056,363.75	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,511,791,206.42	90.69
合计	1,511,791,206.42	90.69

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	45,168,120.75	2.71
材料	27,731,937.38	1.66
工业	133,843,522.04	8.03
非必需消费品	140,744,501.98	8.44
必需消费品	69,011,575.34	4.14
保健	134,359,952.22	8.06
金融	177,659,094.99	10.66
信息技术	574,320,174.08	34.45
电信服务	146,347,048.10	8.78
公用事业	33,256,480.89	2.00
房地产	27,701,504.02	1.66
其他-GICS 未分类	1,647,294.63	0.10
合计	1,511,791,206.42	90.69

注：1.以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2.本基金本报告期末持有的部分股票尚无 GICS 行业分类，因此将其归入“其他-GICS 未分类”。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	83,316	113,542,460.00	6.81

2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克 证券交易所	美国	50,530	99,584,626.27	5.97
3	Alphabet Inc	-	GOOGL US	纳斯达克 证券交易所	美国	20,188	49,137,820.79	2.95
			GOOG US	纳斯达克 证券交易所	美国	16,292	39,206,621.38	2.35
4	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	纳斯达克 证券交易所	美国	25,565	64,950,488.03	3.90
5	Amazon.c om Inc	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达克 证券交易所	美国	33,662	54,643,858.06	3.28
6	Broadcom Inc	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯达克 证券交易所	美国	16,276	41,875,177.22	2.51
7	Micron Technolog y Inc	美光科技 股份有限 公司	MU US	纳斯达克 证券交易所	美国	3,870	30,424,987.06	1.83
8	Meta Platforms Inc	-	META US	纳斯达克 证券交易所	美国	7,535	28,908,116.87	1.73
9	Tesla Inc	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达克 证券交易所	美国	9,659	27,669,794.79	1.66
10	Eli Lilly & Co	礼来	LLY US	纽约证 券交易 所	美国	2,714	22,171,202.79	1.33
11	Advanced Micro Devices Inc	美国超威 半导体公 司	AMD US	纳斯达克 证券交易所	美国	5,595	22,136,728.95	1.33
12	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔 哈撒韦公 司	BRK/B US	纽约证 券交易 所	美国	6,290	21,436,988.32	1.29
13	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM US	纽约证 券交易 所	美国	9,193	20,494,983.57	1.23
14	Intel Corp	英特尔公 司	INTC US	纳斯达克 证券交易所	美国	16,209	15,414,855.72	0.92
15	Johnson	强生	JNJ US	纽约证	美国	8,259	14,286,123.13	0.86

	& Johnson			券交易 所				
16	Applied Materials Inc	应用材料 公司	AMAT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,723	13,408,816.35	0.80
17	Visa Inc	维萨公司	V US	纽约证 券交易 所	美国	5,695	13,307,800.82	0.80
18	Exxon Mobil Corp	埃克森美 孚石油公 司	XOM US	纽约证 券交易 所	美国	14,221	13,242,399.63	0.79
19	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,291	12,664,317.07	0.76
20	Walmart Inc	沃尔玛股 份有限公 司	WMT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	15,041	11,602,665.51	0.70
21	Caterpill ar Inc	卡特彼勒 公司	CAT US	纽约证 券交易 所	美国	1,581	11,466,878.24	0.69
22	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	13,586	10,868,912.95	0.65
23	AbbVie Inc	艾伯维股 份有限公 司	ABBV US	纽约证 券交易 所	美国	6,077	10,415,339.16	0.62
24	Costco Wholesale Corp	开市客公 司	COST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,526	9,722,745.14	0.58
25	Mastercar d Inc	万事达股 份有限公 司	MA US	纽约证 券交易 所	美国	2,776	9,710,665.19	0.58
26	KLA Corp	科磊公司	KLAC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,494	9,234,795.38	0.55
27	General Electric Co	通用电气 公司	GE US	纽约证 券交易 所	美国	3,589	9,135,575.75	0.55
28	UnitedHe alth Group Inc	联合健康 集团	UNH US	纽约证 券交易 所	美国	3,116	8,820,817.57	0.53
29	Bank of America Corp	美国银行 公司	BAC US	纽约证 券交易 所	美国	22,457	8,715,226.69	0.52

30	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	纽约证券交易所	美国	3,426	8,229,485.69	0.49
31	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG US	纽约证券交易所	美国	7,989	7,979,016.75	0.48
32	Sandisk Corp/DE	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	纳斯达克证券交易所	美国	510	7,897,935.31	0.47
33	Merck & Co Inc	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	8,494	7,433,954.32	0.45
34	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	纽约证券交易所	美国	925	7,401,714.93	0.44
35	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO US	纽约证券交易所	美国	13,317	7,371,250.38	0.44
36	Chevron Corp	雪佛龙	CVX US	纽约证券交易所	美国	6,440	7,270,597.61	0.44
37	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	14,484	7,043,544.00	0.42
38	Goldman Sachs Group Inc/The	高盛	GS US	纽约证券交易所	美国	1,015	6,991,665.03	0.42
39	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际股份有限公司	PM US	纽约证券交易所	美国	5,348	6,589,591.25	0.40
40	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	2,783	6,463,943.63	0.39
41	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	3,135	6,364,441.76	0.38
42	Palantir Technologies Inc	帕兰提尔技术公司	PLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	7,889	6,268,817.95	0.38
43	International Business	国际商业机器公司	IBM US	纽约证券交易所	美国	3,225	6,176,820.53	0.37

	Machines Corp							
44	Marvell Technology Ltd	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,004	6,094,812.60	0.37
45	RTX Corp	-	RTX US	纽约证券交易所	美国	4,621	5,971,404.34	0.36
46	Wells Fargo & Co	富国集团公司	WFC US	纽约证券交易所	美国	10,524	5,923,462.61	0.36
47	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	纽约证券交易所	美国	4,113	5,855,885.95	0.35
48	Oracle Corp	甲骨文股份有限公司	ORCL US	纽约证券交易所	美国	5,822	5,811,155.91	0.35
49	Linde PLC	林德	LIN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,590	5,619,773.03	0.34
50	Citigroup Inc	花旗集团	C US	纽约证券交易所	美国	5,852	5,578,439.86	0.33
51	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,183	5,146,355.27	0.31
52	Amphenol Corp	安费诺公司	APH US	纽约证券交易所	美国	4,221	5,068,989.99	0.30
53	Seagate Technology Holdings PLC	-	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	770	5,060,839.25	0.30
54	Corning Inc	康宁公司	GLW US	纽约证券交易所	美国	2,694	4,686,773.86	0.28
55	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,852	4,567,704.48	0.27
56	CrowdStrike Holdings Inc	-	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	876	4,553,159.12	0.27

57	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	3,617	4,552,306.33	0.27
58	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,680	4,544,543.06	0.27
59	McDonald's Corp	麦当劳	MCD US	纽约证券交易所	美国	2,438	4,488,490.58	0.27
60	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	1,275	4,353,758.85	0.26
61	PepsiCo Inc	百事公司	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,702	4,336,164.93	0.26
62	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	纽约证券交易所	美国	7,173	4,287,966.99	0.26
63	American Express Co	美国运通	AXP US	纽约证券交易所	美国	1,826	4,206,714.93	0.25
64	Verizon Communications Inc	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	14,326	4,131,238.85	0.25
65	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	3,567	4,127,146.31	0.25
66	Boeing Co/The	波音	BA US	纽约证券交易所	美国	2,713	3,999,926.53	0.24
67	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	3,820	3,941,672.16	0.24
68	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS US	纽约证券交易所	美国	5,999	3,932,639.20	0.24
69	Eaton Corp PLC	伊顿公共有限公司	ETN US	纽约证券交易所	美国	1,342	3,894,833.87	0.23
70	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP US	纽约证券交易所	美国	2,051	3,799,610.40	0.23

71	Deere & Co	迪尔	DE US	纽约证券交易所	美国	868	3,750,070.91	0.22
72	Welltower Inc	沃尔塔公司	WELL US	纽约证券交易所	美国	2,410	3,725,546.63	0.22
73	Abbott Laboratories	雅培制药公司	ABT US	纽约证券交易所	美国	5,992	3,703,182.23	0.22
74	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,285	3,687,195.82	0.22
75	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW US	纽约证券交易所	美国	5,648	3,549,438.96	0.21
76	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER US	纽约证券交易所	美国	7,032	3,456,048.99	0.21
77	AT&T Inc	美国电话电报公司	T US	纽约证券交易所	美国	24,003	3,384,078.08	0.20
78	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,224	3,315,275.86	0.20
79	AppLovin Corp	-	APP US	纳斯达克证券交易所	美国	930	3,263,537.41	0.20
80	BlackRock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK US	纽约证券交易所	美国	497	3,254,897.23	0.20
81	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	2,677	3,249,810.58	0.19
82	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE US	纽约证券交易所	美国	19,604	3,215,182.88	0.19
83	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	4,388	3,091,730.41	0.19
84	Vertiv Holdings Co	维谛技术控股公司	VRT US	纽约证券交易所	美国	1,330	3,032,965.97	0.18
85	Salesforce Inc	赛富时公司	CRM US	纽约证券交易所	美国	2,826	3,015,329.55	0.18

				所				
86	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR US	纽约证券交易所	美国	2,010	2,990,560.62	0.18
87	ConocoPhillips	康菲石油	COP US	纽约证券交易所	美国	4,191	2,967,484.34	0.18
88	Prologis Inc	安博	PLD US	纽约证券交易所	美国	3,207	2,959,011.10	0.18
89	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	873	2,953,514.71	0.18
90	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL US	纽约证券交易所	美国	1,000	2,938,630.91	0.18
91	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF US	纽约证券交易所	美国	2,150	2,937,765.93	0.18
92	S&P Global Inc	标普全球	SPGI US	纽约证券交易所	美国	1,048	2,906,949.88	0.17
93	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH US	纽约证券交易所	美国	436	2,904,578.59	0.17
94	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB US	纽约证券交易所	美国	1,247	2,893,970.34	0.17
95	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW US	纽约证券交易所	美国	1,927	2,893,844.00	0.17
96	Danaher Corp	丹纳赫	DHR US	纽约证券交易所	美国	2,180	2,828,201.71	0.17
97	Altria Group Inc	高特利	MO US	纽约证券交易所	美国	5,744	2,814,814.20	0.17
98	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMJ US	纽约证券交易所	美国	7,072	2,775,364.38	0.17
99	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,947	2,747,135.17	0.16

100	Stryker Corp	史赛克公司	SYK US	纽约证券交易所	美国	1,194	2,560,346.44	0.15
101	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT US	纽约证券交易所	美国	764	2,555,764.62	0.15
102	Quanta Services Inc	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	520	2,550,142.63	0.15
103	Howmet Aerospace Inc	-	HWM US	纽约证券交易所	美国	1,383	2,532,519.97	0.15
104	Southern Co/The	南方公司	SO US	纽约证券交易所	美国	3,815	2,486,888.78	0.15
105	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	LMT US	纽约证券交易所	美国	704	2,442,796.30	0.15
106	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	950	2,428,453.64	0.15
107	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达克证券交易所	美国	340	2,413,868.78	0.14
108	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	3,563	2,409,251.26	0.14
109	Medtronic PLC	美敦力	MDT US	纽约证券交易所	美国	4,441	2,366,239.00	0.14
110	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM US	纽约证券交易所	美国	3,688	2,346,077.17	0.14
111	Cummins Inc	康明斯	CMI US	纽约证券交易所	美国	479	2,326,791.35	0.14
112	Bank of New York Mellon Corp	纽约梅隆银行	BNY US	纽约证券交易所	美国	2,361	2,325,406.15	0.14
113	PNC Financial Services Group Inc	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	1,378	2,310,878.16	0.14

114	Duke Energy Corp	杜克能源公司	DUK US	纽约证券交易所	美国	2,675	2,306,180.96	0.14
115	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,152	2,251,617.07	0.14
116	US Bancorp	美国合众银行	USB US	纽约证券交易所	美国	5,326	2,191,001.15	0.13
117	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB US	纽约证券交易所	美国	4,244	2,148,831.87	0.13
118	McKesson Corp	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	416	2,140,867.47	0.13
119	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	纽约证券交易所	美国	4,991	2,137,832.47	0.13
120	General Dynamics Corp	通用动力	GD US	纽约证券交易所	美国	882	2,127,995.42	0.13
121	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,381	2,106,440.76	0.13
122	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI US	纽约证券交易所	美国	2,094	2,083,824.41	0.13
123	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	6,391	2,068,907.79	0.12
124	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	12,255	2,049,129.08	0.12
125	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX US	纽约证券交易所	美国	2,556	2,048,477.07	0.12
126	Datadog Inc	数据狗	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,141	2,023,319.24	0.12
127	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	662	2,011,247.46	0.12

128	3M Co	3M 公司	MMM US	纽约证 券交易 所	美国	1,802	1,987,160.58	0.12
129	Elevance Health Inc	-	ELV US	纽约证 券交易 所	美国	751	1,978,118.50	0.12
130	Waste Managem ent Inc	废品管理	WM US	纽约证 券交易 所	美国	1,286	1,952,165.22	0.12
131	Adobe Inc	奥多比公 司	ADBE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,397	1,950,729.89	0.12
132	Marriott Internatio nal Inc/MD	万豪国际 集团	MAR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	751	1,895,562.62	0.11
133	Marsh & McLenna n Cos Inc	-	MRSB US	纽约证 券交易 所	美国	1,665	1,890,062.55	0.11
134	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市 场股份公 司	HOOD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,754	1,880,973.88	0.11
135	United Parcel Service Inc	联合包裹 服务股份 有限公司	UPS US	纽约证 券交易 所	美国	2,568	1,880,217.05	0.11
136	CME Group Inc	芝加哥商 业交易所	CME US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,246	1,874,047.60	0.11
137	Emerson Electric Co	艾默生电 气	EMR US	纽约证 券交易 所	美国	1,922	1,873,912.20	0.11
138	Sherwin- Williams Co/The	宣伟公司	SHW US	纽约证 券交易 所	美国	797	1,869,067.88	0.11
139	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒 比国际游 轮有限公 司	RCL US	纽约证 券交易 所	美国	862	1,864,217.30	0.11
140	Constellation Energy Corporation	美国联合 能源公司	CEG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,102	1,864,168.80	0.11
141	T-Mobile	-	TMUS US	纳斯达	美国	1,608	1,836,966.75	0.11

	US Inc			克证券 交易所				
142	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证 券交易 所	美国	1,026	1,819,950.40	0.11
143	O'Reilly Automoti ve Inc	奥莱利汽 车公司	ORLY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,863	1,795,718.78	0.11
144	Accenture PLC	埃森哲公 司	ACN US	纽约证 券交易 所	美国	2,112	1,790,022.21	0.11
145	American Tower Corp	美国发射 塔公司	AMT US	纽约证 券交易 所	美国	1,603	1,785,836.44	0.11
146	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达 克证券 交易所	美国	539	1,776,212.98	0.11
147	Hilton Worldwid e Holdings Inc	希尔顿全 球控股股 份有限公 司	HLT US	纽约证 券交易 所	美国	787	1,771,324.52	0.11
148	Coherent Corp	相干公司	COHR US	纽约证 券交易 所	美国	658	1,767,845.79	0.11
149	TransDig m Group Inc	-	TDG US	纽约证 券交易 所	美国	194	1,760,043.90	0.11
150	American Electric Power Co Inc	美国电力 公司	AEP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,888	1,759,236.94	0.11
151	Marathon Petroleum Corp	马拉松石 油公司	MPC US	纽约证 券交易 所	美国	1,004	1,748,308.17	0.10
152	Mondelez Internatio nal Inc	亿滋国际 公司	MDLZ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,404	1,734,922.58	0.10
153	Colgate-P almolive Co	高露洁棕 榄	CL US	纽约证 券交易 所	美国	2,746	1,714,666.41	0.10
154	Cigna Corp	信诺集团	CI US	纽约证 券交易 所	美国	910	1,708,642.31	0.10

155	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG US	纽约证券交易所	美国	1,121	1,707,571.98	0.10
156	Intuit Inc	财捷集团	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	956	1,699,428.52	0.10
157	CRH PLC	-	CRH US	纽约证券交易所	美国	2,322	1,692,195.35	0.10
158	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI US	纽约证券交易所	美国	217	1,674,372.11	0.10
159	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,094	1,668,306.80	0.10
160	Aon PLC	怡安公共有限公司	AON US	纽约证券交易所	美国	738	1,667,221.28	0.10
161	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	869	1,663,324.42	0.10
162	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC US	纽约证券交易所	美国	776	1,662,689.44	0.10
163	Ecolab Inc	艺康集团	ECL US	纽约证券交易所	美国	875	1,660,386.74	0.10
164	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX US	纽约证券交易所	美国	123	1,660,360.18	0.10
165	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW US	纽约证券交易所	美国	901	1,659,771.85	0.10
166	DoorDash Inc	-	DASH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,319	1,657,739.48	0.10
167	Honeywell Aerospace Inc	-	HONA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,094	1,647,294.63	0.10
168	Travelers Cos Inc/The	旅行家集团	TRV US	纽约证券交易所	美国	732	1,645,839.27	0.10

169	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢有限公司	SLB US	纽约证券交易所	美国	5,196	1,645,254.90	0.10
170	General Motors Co	通用汽车公司	GM US	纽约证券交易所	美国	3,122	1,639,000.58	0.10
171	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	纽约证券交易所	美国	578	1,634,872.23	0.10
172	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所（ICE）	ICE US	纽约证券交易所	美国	1,946	1,631,701.34	0.10
173	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	1,840	1,625,783.62	0.10
174	Ciena Corp	-	CIEN US	纽约证券交易所	美国	486	1,623,801.38	0.10
175	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,113	1,613,516.17	0.10
176	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁门公司	NOC US	纽约证券交易所	美国	465	1,613,019.66	0.10
177	Monolithic Power Systems Inc	芯源系统有限公司	MPWR US	纳斯达克证券交易所	美国	171	1,609,984.79	0.10
178	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,450	1,603,926.08	0.10
179	FedEx Corp	联邦快递	FDX US	纽约证券交易所	美国	752	1,603,788.23	0.10
180	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	8,826	1,602,612.67	0.10
181	Moody's Corp	穆迪	MCO US	纽约证券交易所	美国	519	1,601,007.48	0.10
182	Phillips 66	菲利浦 66	PSX US	纽约证券交易所	美国	1,385	1,594,664.96	0.10

				所				
183	Lumentum Holdings Inc	-	LITE US	纳斯达克证券交易所	美国	269	1,572,079.27	0.09
184	Air Products & Chemicals Inc	空气产品公司	APD US	纽约证券交易所	美国	778	1,553,525.70	0.09
185	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,834	1,500,441.81	0.09
186	KKR & Co Inc	-	KKR US	纽约证券交易所	美国	2,398	1,499,000.36	0.09
187	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽约证券交易所	美国	6,839	1,489,154.45	0.09
188	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX US	纽约证券交易所	美国	5,112	1,486,003.25	0.09
189	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	344	1,460,922.79	0.09
190	Truist Financial Corp	-	TFC US	纽约证券交易所	美国	4,304	1,460,429.14	0.09
191	Delta Air Lines Inc	达美航空公司	DAL US	纽约证券交易所	美国	2,269	1,447,415.28	0.09
192	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL US	纽约证券交易所	美国	890	1,442,321.14	0.09
193	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	2,278	1,438,416.99	0.09
194	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS US	纽约证券交易所	美国	601	1,432,959.35	0.09
195	HCA Healthcare Inc	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	537	1,426,004.47	0.09

196	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE US	纽约证券交易所	美国	4,603	1,414,224.33	0.08
197	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWG US	纽约证券交易所	美国	152	1,408,363.35	0.08
198	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,444	1,407,379.86	0.08
199	Flextronics International Ltd	伟创力国际有限公司	FLEX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,270	1,401,880.06	0.08
200	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG US	纽约证券交易所	美国	896	1,400,966.17	0.08
201	Target Corp	塔吉特公司	TGT US	纽约证券交易所	美国	1,569	1,395,737.92	0.08
202	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证券交易所	美国	2,976	1,384,186.29	0.08
203	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	1,004	1,378,638.13	0.08
204	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR US	纽约证券交易所	美国	1,127	1,378,435.30	0.08
205	Targa Resources Corp	-	TRGP US	纽约证券交易所	美国	749	1,367,879.77	0.08
206	Realty Income Corp	-	O US	纽约证券交易所	美国	3,206	1,352,942.78	0.08
207	Cintas Corp	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,167	1,351,850.32	0.08
208	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR US	纽约证券交易所	美国	2,685	1,341,371.00	0.08
209	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA US	纽约证券交易所	美国	2,301	1,327,251.59	0.08

210	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	4,001	1,308,837.24	0.08
211	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME US	纽约证券交易所	美国	792	1,305,080.68	0.08
212	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH US	纽约证券交易所	美国	806	1,304,105.91	0.08
213	Baker Hughes Company	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,449	1,303,739.07	0.08
214	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	2,196	1,300,338.66	0.08
215	Ford Motor Co	福特汽车	F US	纽约证券交易所	美国	13,687	1,295,768.96	0.08
216	Cencora Inc	-	COR US	纽约证券交易所	美国	670	1,291,323.48	0.08
217	L3Harris Technologies Inc	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	652	1,290,424.99	0.08
218	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK US	纽约证券交易所	美国	382	1,288,081.22	0.08
219	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO US	纽约证券交易所	美国	1,587	1,278,800.76	0.08
220	Aflac Inc	家庭人寿保险公司	AFL US	纽约证券交易所	美国	1,583	1,264,149.01	0.08
221	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	57	1,240,731.98	0.07
222	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	1,575	1,232,122.46	0.07
223	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW US	纽约证券交易所	美国	1,976	1,217,441.29	0.07
224	Fifth	五三银行	FITB US	纽约证	美国	3,117	1,196,711.16	0.07

	Third Bancorp			券交易所				
225	Vistra Corp	-	VST US	纽约证券交易所	美国	1,107	1,196,017.27	0.07
226	Public Storage	公共存储	PSA US	纽约证券交易所	美国	549	1,190,219.69	0.07
227	Nucor Corp	纽柯公司	NUE US	纽约证券交易所	美国	784	1,189,428.33	0.07
228	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	2,156	1,179,149.32	0.07
229	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,889	1,173,360.06	0.07
230	NIKE Inc	耐克公司	NKE US	纽约证券交易所	美国	4,196	1,173,148.92	0.07
231	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,534	1,167,555.13	0.07
232	Humana Inc	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	415	1,122,751.66	0.07
233	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN US	纽约证券交易所	美国	3,965	1,115,855.63	0.07
234	Exelon Corp	爱克斯龙公司	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	3,511	1,114,827.32	0.07
235	State Street Corp	道富集团	STT US	纽约证券交易所	美国	957	1,105,458.11	0.07
236	Carvana Co	-	CVNA US	纽约证券交易所	美国	2,458	1,101,905.27	0.07
237	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB US	纽约证券交易所	美国	593	1,088,877.65	0.07
238	Electronic	-	EA US	纳斯达克	美国	779	1,087,878.90	0.07

	Arts Inc			克证券 交易所				
239	MetLife Inc	大都会集团	MET US	纽约证 券交易 所	美国	1,868	1,076,472.83	0.06
240	Axon Enterprise Inc	-	AXON US	纳斯达 克证券 交易所	美国	281	1,072,930.68	0.06
241	Keurig Dr Pepper Inc	克里格胡 椒博士	KDP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,721	1,052,408.89	0.06
242	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证 券交易 所	美国	4,498	1,041,604.56	0.06
243	United Airlines Holdings Inc	美国联合 航空控股 股份有限 公司	UAL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,117	1,034,581.36	0.06
244	Yum! Brands Inc	百胜餐饮 集团	YUM US	纽约证 券交易 所	美国	948	1,032,173.37	0.06
245	Take-Two Interactiv e Software Inc	-	TTWO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	602	1,024,958.45	0.06
246	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证 券交易 所	美国	1,673	1,011,843.65	0.06
247	DR Horton Inc	霍顿房屋 公司	DHI US	纽约证 券交易 所	美国	905	1,003,970.25	0.06
248	Republic Services Inc	公共服务 公司	RSG US	纽约证 券交易 所	美国	691	1,002,825.20	0.06
249	IDEXX Laboratori es Inc	爱德士股 份有限公 司	IDXX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	276	989,606.33	0.06
250	Becton Dickinson and Co	碧迪	BDX US	纽约证 券交易 所	美国	952	981,220.21	0.06
251	Autodesk Inc	欧特克公 司	ADSK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	741	981,213.81	0.06

252	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP US	纽约证券交易所	美国	311	971,740.80	0.06
253	Jabil Inc	捷普集团	JBL US	纽约证券交易所	美国	370	971,422.32	0.06
254	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED US	纽约证券交易所	美国	1,287	969,741.46	0.06
255	Block Inc	-	XYZ US	纽约证券交易所	美国	1,849	957,094.91	0.06
256	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI US	纽约证券交易所	美国	250	953,594.11	0.06
257	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG US	纽约证券交易所	美国	1,722	951,874.49	0.06
258	Old Dominion Freight Line Inc	奥多明尼昂货运	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	640	944,154.20	0.06
259	American International Group Inc	美国国际集团	AIG US	纽约证券交易所	美国	1,858	943,151.23	0.06
260	Sysco Corp	-	SY Y US	纽约证券交易所	美国	1,652	940,409.30	0.06
261	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE US	纽约证券交易所	美国	1,013	929,285.80	0.06
262	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN US	纽约证券交易所	美国	564	912,473.71	0.05
263	Interactive Brokers Group Inc	盈透证券股份有限公司	IBKR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,529	906,422.91	0.05
264	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	449	902,168.34	0.05
265	PayPal Holdings	贝宝	PYPL US	纳斯达克证券	美国	3,048	896,400.53	0.05

	Inc			交易所				
266	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	1,126	895,517.70	0.05
267	ON Semiconductor Corp	安森美半导体	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,375	885,365.92	0.05
268	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME US	纽约证券交易所	美国	156	881,747.83	0.05
269	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM US	纽约证券交易所	美国	1,024	880,931.61	0.05
270	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A US	纽约证券交易所	美国	973	880,265.17	0.05
271	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU US	纽约证券交易所	美国	1,194	877,709.92	0.05
272	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG US	纽约证券交易所	美国	7,574	867,672.43	0.05
273	Waters Corp	沃特世公司	WAT US	纽约证券交易所	美国	338	863,373.66	0.05
274	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	1,658	862,744.88	0.05
275	Kenvue Inc	科赴股份有限公司	KVUE US	纽约证券交易所	美国	6,603	859,422.04	0.05
276	Carnival Corp Ltd	嘉年华公司	CCL US	纽约证券交易所	美国	4,414	858,908.84	0.05
277	Hartford Insurance Group Inc/T	哈特福德保险集团股份有限公司	HIG US	纽约证券交易所	美国	947	854,743.70	0.05
278	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,142	853,796.31	0.05
279	Occidental	西方石油	OXY US	纽约证券交易所	美国	2,564	848,185.08	0.05

	Petroleum Corp			所				
280	Huntington Bancshares Inc/OH	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	6,980	842,885.65	0.05
281	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,544	828,873.45	0.05
282	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	688	823,687.36	0.05
283	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	504	817,015.40	0.05
284	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	208	816,991.97	0.05
285	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	349	804,354.42	0.05
286	Qnity Electronics Inc	启诺迪电子股份有限公司	Q US	纽约证券交易所	美国	721	801,959.70	0.05
287	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,197	791,295.95	0.05
288	Coinbase Global Inc	-	COIN US	纳斯达克证券交易所	美国	784	780,617.41	0.05
289	EQT Corp	-	EQT US	纽约证券交易所	美国	2,146	777,142.90	0.05
290	Crown Castle International Corp	冠城股份有限公司	CCI US	纽约证券交易所	美国	1,501	774,199.97	0.05
291	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,145	766,824.59	0.05
292	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	520	765,212.79	0.05

293	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	643	761,316.41	0.05
294	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV US	纽约证券交易所	美国	574	755,385.20	0.05
295	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	716	743,048.21	0.04
296	Kroger Co/The	克罗格公司	KR US	纽约证券交易所	美国	1,960	741,290.18	0.04
297	Steel Dynamics Inc	-	STLD US	纳斯达克证券交易所	美国	469	732,966.85	0.04
298	Ameren Corp	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	952	732,948.74	0.04
299	Teledyne Technologies Inc	-	TDY US	纽约证券交易所	美国	161	731,292.46	0.04
300	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	1,670	730,110.09	0.04
301	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS US	纽约证券交易所	美国	1,484	726,316.01	0.04
302	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证券交易所	美国	726	722,224.84	0.04
303	Extra Space Storage Inc	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	727	719,456.48	0.04
304	Casey's General Stores Inc	凯西杂货公司	CASY US	纳斯达克证券交易所	美国	132	714,547.05	0.04
305	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP US	纳斯达克证券交易所	美国	673	709,378.94	0.04
306	Dover Corp	都福	DOV US	纽约证券交易所	美国	461	704,199.93	0.04
307	Live	-	LYV US	纽约证	美国	563	702,142.02	0.04

	Nation Entertain ment Inc			券交易 所				
308	CenterPoi nt Energy Inc	中点能源	CNP US	纽约证 券交易 所	美国	2,334	700,088.05	0.04
309	Citizens Financial Group Inc	公民金融 集团股份 有限公司	CFG US	纽约证 券交易 所	美国	1,461	697,247.29	0.04
310	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证 券交易 所	美国	698	695,891.72	0.04
311	Edison Internatio nal	爱迪生国 际	EIX US	纽约证 券交易 所	美国	1,372	695,702.10	0.04
312	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证 券交易 所	美国	592	694,601.74	0.04
313	Expedia Group Inc	亿客行集 团股份有 限公司	EXPE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	397	691,880.92	0.04
314	VICI Properties Inc	-	VICI US	纽约证 券交易 所	美国	3,822	691,129.95	0.04
315	GE HealthCar e Technolog ies Inc	-	GEHC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,561	680,542.47	0.04
316	Ingersoll- Rand Inc.	英格索兰 股份有限 公司	IR US	纽约证 券交易 所	美国	1,216	679,045.64	0.04
317	Hubbell Inc	哈贝尔公 司	HUBB US	纽约证 券交易 所	美国	189	673,494.48	0.04
318	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提 金融	CINF US	纳斯达 克证券 交易所	美国	532	670,836.05	0.04
319	Halliburto n Co	哈利伯顿	HAL US	纽约证 券交易 所	美国	2,873	664,323.95	0.04
320	ResMed Inc	瑞思迈股 份有限公 司	RMD US	纽约证 券交易 所	美国	499	662,326.79	0.04

321	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL US	纽约证券交易所	美国	822	661,805.75	0.04
322	FAIR ISAAC CORP	费埃哲公司	FICO US	纽约证券交易所	美国	81	659,139.70	0.04
323	PPL Corp	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	2,645	654,839.09	0.04
324	Eversource Energy	-	ES US	纽约证券交易所	美国	1,330	654,657.58	0.04
325	Veeva Systems Inc	-	VEEV US	纽约证券交易所	美国	536	647,879.51	0.04
326	Williams-Sonoma Inc	-	WSM US	纽约证券交易所	美国	407	646,161.66	0.04
327	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS US	纽约证券交易所	美国	1,319	643,224.12	0.04
328	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	1,907	637,080.35	0.04
329	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD US	纽约证券交易所	美国	73	635,172.48	0.04
330	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	767	633,614.14	0.04
331	Hershey Co/The	好时公司	HSY US	纽约证券交易所	美国	530	633,335.37	0.04
332	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK US	纽约证券交易所	美国	692	620,155.33	0.04
333	PulteGroup Inc	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	663	619,589.14	0.04
334	Cboe Global Markets Inc	-	CBOE US	巴兹全球市场	美国	374	618,147.61	0.04

335	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	596	617,134.83	0.04
336	Dollar General Corp	达乐公司	DG US	纽约证券交易所	美国	787	617,010.12	0.04
337	AvalonBay Communities Inc	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	478	614,301.09	0.04
338	Texas Pacific Land Corp	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL US	纽约证券交易所	美国	206	614,028.79	0.04
339	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF US	纽约证券交易所	美国	1,184	613,275.23	0.04
340	DexCom Inc	德康医疗	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,327	608,713.63	0.04
341	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证券交易所	美国	2,948	606,371.70	0.04
342	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克证券交易所	美国	377	605,876.69	0.04
343	Workday Inc	-	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	725	604,498.02	0.04
344	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST US	纽约证券交易所	美国	242	591,717.37	0.04
345	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,239	590,962.52	0.04
346	Copart Inc	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	3,048	585,213.78	0.04
347	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV US	纽约证券交易所	美国	1,668	584,161.09	0.04
348	Willis	韦莱韬睿	WTW US	纳斯达克	美国	328	583,894.10	0.04

	Towers Watson PLC	惠悦公共有限公司		克证券交易所				
349	Quest Diagnostics Inc	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	397	573,097.39	0.03
350	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	738	571,456.44	0.03
351	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR US	纽约证券交易所	美国	1,229	568,614.59	0.03
352	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	1,086	565,842.76	0.03
353	FirstEnergy Corp	第一能源	FE US	纽约证券交易所	美国	1,747	565,661.45	0.03
354	Verisk Analytics Inc	威瑞斯克分析公司	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	453	553,910.68	0.03
355	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI US	纽约证券交易所	美国	394	552,826.72	0.03
356	Smurfit WestRock PLC	斯墨菲特 韦斯特罗克集团	SW US	纽约证券交易所	美国	1,750	551,376.41	0.03
357	NiSource Inc	-	NI US	纽约证券交易所	美国	1,697	549,587.53	0.03
358	F5 Inc	-	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	193	546,780.96	0.03
359	Ares Management Corp	阿瑞斯管理公司	ARES US	纽约证券交易所	美国	715	542,056.71	0.03
360	Church & Dwight Co Inc	切迟杜威股份有限公司	CHD US	纽约证券交易所	美国	815	537,769.59	0.03
361	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	652	537,103.49	0.03
362	Veralto Corp	-	VLTO US	纽约证券交易	美国	885	534,531.69	0.03

				所				
363	Laboratory Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证券交易所	美国	279	532,067.51	0.03
364	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	265	522,388.88	0.03
365	Expand Energy Corp	-	EXE US	纳斯达克证券交易所	美国	836	519,227.87	0.03
366	Corpay Inc	-	CPAY US	纽约证券交易所	美国	226	512,990.31	0.03
367	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW US	纳斯达克证券交易所	美国	397	509,257.67	0.03
368	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纽约证券交易所	美国	456	506,178.46	0.03
369	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	295	505,438.25	0.03
370	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	纽约证券交易所	美国	350	501,959.92	0.03
371	KeyCorp	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	3,133	491,853.57	0.03
372	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	670	491,832.80	0.03
373	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	985	488,597.28	0.03
374	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG US	纽约证券交易所	美国	300	486,870.38	0.03
375	WR Berkley	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	1,012	486,137.25	0.03

	Corp			所				
376	Snap-on Inc	实耐宝	SNA US	纽约证券交易所	美国	175	479,623.58	0.03
377	Dow Inc	陶氏公司	DOW US	纽约证券交易所	美国	2,566	478,164.41	0.03
378	Constellation Brands Inc	星座品牌股份有限公司	STZ US	纽约证券交易所	美国	502	475,558.70	0.03
379	HP Inc	惠普	HPQ US	纽约证券交易所	美国	3,157	471,754.13	0.03
380	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS US	纽约证券交易所	美国	1,756	465,002.48	0.03
381	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF US	纽约证券交易所	美国	861	464,560.73	0.03
382	NVR Inc	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	10	464,053.86	0.03
383	Ulta Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯达克证券交易所	美国	151	463,808.53	0.03
384	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,864	460,741.58	0.03
385	International Paper Co	国际纸业	IP US	纽约证券交易所	美国	1,770	459,306.66	0.03
386	Brown & Brown Inc	-	BRO US	纽约证券交易所	美国	1,047	457,454.44	0.03
387	Amcor PLC	安姆科公共有限公司	AMCR US	纽约证券交易所	美国	1,549	457,346.15	0.03
388	Evergy Inc	-	EVRG US	纳斯达克证券交易所	美国	774	455,627.55	0.03

				交易所				
389	SBA Communi- cations Corp	-	SBAC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	378	454,299.83	0.03
390	General Mills Inc	通用磨坊	GIS US	纽约证 券交易 所	美国	1,901	450,573.73	0.03
391	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	864	448,937.48	0.03
392	Lennar Corp	莱纳公司	LEN US	纽约证 券交易 所	美国	725	446,830.80	0.03
393	Viatis Inc	晖致	VTRS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,118	445,390.90	0.03
394	Estee Lauder Cos Inc	雅诗兰黛	EL US	纽约证 券交易 所	美国	826	444,157.18	0.03
395	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证 券交易 所	美国	410	443,220.68	0.03
396	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	462	442,542.86	0.03
397	Fortive Corp	福迪威公 司	FTV US	纽约证 券交易 所	美国	1,054	438,546.09	0.03
398	Loews Corp	罗斯公司	L US	纽约证 券交易 所	美国	568	437,963.21	0.03
399	Cognizant Technolog y Solutions Corp	高知特科 技解决方 案公司	CTSH US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,641	432,873.08	0.03
400	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯 房地产信 托公司	ESS US	纽约证 券交易 所	美国	216	428,973.91	0.03
401	Incyte Corp	因赛特公 司	INCY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	551	425,418.08	0.03
402	Global	环汇有限	GPN US	纽约证	美国	851	420,563.27	0.03

	Payments Inc	公司		券交易所				
403	DuPont De Nemours Inc.	杜邦公司	DD US	纽约证券交易所	美国	455	420,342.87	0.03
404	Generac Holdings Inc	-	GNRC US	纽约证券交易所	美国	210	418,802.92	0.03
405	Lennox International Inc	雷诺士国际有限公司	LII US	纽约证券交易所	美国	107	417,546.65	0.03
406	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	2,410	416,101.72	0.02
407	IDEX Corp	艺达思集团	IEX US	纽约证券交易所	美国	268	414,256.65	0.02
408	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	514	413,829.88	0.02
409	CF Industries Holdings Inc	-	CF US	纽约证券交易所	美国	556	409,965.51	0.02
410	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,884	405,611.16	0.02
411	Ball Corp	波尔	BALL US	纽约证券交易所	美国	950	403,750.15	0.02
412	Masco Corp	马斯可	MAS US	纽约证券交易所	美国	722	400,134.52	0.02
413	Fox Corp	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	704	250,100.61	0.02
			FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	460	146,750.38	0.01
414	Weyerhaeuser Co	惠好	WY US	纽约证券交易所	美国	2,416	393,935.92	0.02
415	Fedex	联邦快递	FDXF US	纽约证	美国	383	393,894.78	0.02

	Freight Holding Co Inc	货运控股股份有限公司		券交易所				
416	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH US	纽约证券交易所	美国	666	390,509.35	0.02
417	Textron Inc	德事隆	TXT US	纽约证券交易所	美国	623	389,227.88	0.02
418	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH US	纽约证券交易所	美国	1,890	388,881.28	0.02
419	Nordson Corp	诺信公司	NDSN US	纳斯达克证券交易所	美国	189	388,353.50	0.02
420	Albemarle Corp	雅保公司	ALB US	纽约证券交易所	美国	418	384,424.50	0.02
421	Genuine Parts Co	原配部件	GPC US	纽约证券交易所	美国	467	375,257.84	0.02
422	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL US	纽约证券交易所	美国	137	374,552.98	0.02
423	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	392	370,952.13	0.02
424	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN US	纽约证券交易所	美国	949	370,037.90	0.02
425	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR US	纽约证券交易所	美国	394	367,504.59	0.02
426	Healthpeak Properties Inc	-	DOC US	纽约证券交易所	美国	2,485	362,196.85	0.02
427	Super Micro	超微电脑	SMCI US	纳斯达克证券	美国	1,788	357,177.49	0.02

	Computer Inc			交易所				
428	Jacobs Solutions Inc	嘉科解决方案股份有限公司	J US	纽约证券交易所	美国	416	357,000.13	0.02
429	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK US	纽约证券交易所	美国	554	355,137.22	0.02
430	Bunge Global SA	-	BG US	纽约证券交易所	美国	484	351,832.84	0.02
431	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	2,144	346,226.93	0.02
432	Everest Group Ltd	-	EG US	纽约证券交易所	美国	141	343,061.15	0.02
433	Best Buy Co Inc	百思买	BBY US	纽约证券交易所	美国	661	341,612.13	0.02
434	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK US	纽约证券交易所	美国	503	340,155.89	0.02
435	EchoStar Corp	回声星通信公司	ECHO US	纳斯达克证券交易所	美国	481	332,518.35	0.02
436	PTC Inc	-	PTC US	纳斯达克证券交易所	美国	425	328,859.20	0.02
437	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO US	纳斯达克证券交易所	美国	666	325,280.82	0.02
438	Regency Centers Corp	-	REG US	纳斯达克证券交易所	美国	589	319,886.59	0.02
439	Leidos Holdings Inc	-	LDOS US	纽约证券交易所	美国	456	319,801.18	0.02
440	Gen Digital Inc	-	GEN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,884	319,381.90	0.02
441	TKO	-	TKO US	纽约证	美国	232	318,095.73	0.02

	Group Holdings Inc			券交易所				
442	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙公司	LVS US	纽约证券交易所	美国	993	312,393.30	0.02
443	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ US	纽约证券交易所	美国	170	310,918.27	0.02
444	Globe Life Inc	-	GL US	纽约证券交易所	美国	255	310,327.76	0.02
445	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB US	纽约证券交易所	美国	863	309,466.52	0.02
446	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	153	304,763.12	0.02
447	Revvity Inc	-	RVTY US	纽约证券交易所	美国	402	304,627.86	0.02
448	JM Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	382	292,698.43	0.02
449	UDR Inc	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	1,075	292,282.96	0.02
450	Pinnacle West Capital Corp	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	401	292,235.29	0.02
451	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC US	纽约证券交易所	美国	850	291,894.74	0.02
452	Aptiv PLC	安波福公共有限公司	APTIV US	纽约证券交易所	美国	693	289,710.76	0.02
453	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	551	287,690.10	0.02
454	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY US	纽约证券交易所	美国	259	286,389.15	0.02

455	Camden Property Trust	-	CPT US	纽约证券交易所	美国	367	286,179.24	0.02
456	Lululemon Athletica Inc	露露乐蒙公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	367	285,404.36	0.02
457	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	158	283,299.93	0.02
458	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ US	纽约证券交易所	美国	1,574	282,910.21	0.02
459	Apa Corp	-	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,268	281,281.72	0.02
460	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX US	纽约证券交易所	美国	432	280,813.95	0.02
461	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证券交易所	美国	984	279,738.37	0.02
462	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB US	纳斯达克证券交易所	美国	797	277,819.74	0.02
463	Charter Communications Inc	特许通讯公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	286	277,013.33	0.02
464	Allegion PLC	安朗杰公共有限公司	ALLE US	纽约证券交易所	美国	288	275,576.64	0.02
465	CoStar Group Inc	科斯塔集团	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,421	274,089.14	0.02
466	Bio-Technologie Corp	-	TECH US	纳斯达克证券交易所	美国	555	267,060.50	0.02
467	Hasbro Inc	孩之宝	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	473	266,068.29	0.02
468	Baxter International Inc	百特	BAX US	纽约证券交易所	美国	1,824	264,860.10	0.02

469	Insulet Corp	-	PODD US	纳斯达克证券交易所	美国	252	261,313.80	0.02
470	News Corp	新闻集团	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,198	202,599.35	0.01
			NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	302	57,716.38	0.00
471	GoDaddy Inc	-	GDDY US	纽约证券交易所	美国	441	254,946.15	0.02
472	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	132	251,631.97	0.02
473	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	215	246,976.17	0.01
474	Solventum Corp	索尔文图姆公司	SOLV US	纽约证券交易所	美国	469	246,441.18	0.01
475	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	533	246,128.22	0.01
476	BXP Inc	波士顿地产公司	BXP US	纽约证券交易所	美国	523	236,202.90	0.01
477	Charles River Laboratories International Inc	查尔斯河实验室国际有限公司	CRL US	纽约证券交易所	美国	152	234,785.89	0.01
478	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT US	纽约证券交易所	美国	275	231,202.81	0.01
479	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	纽约证券交易所	美国	1,597	229,613.62	0.01
480	Jack Henry &	-	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	243	227,966.41	0.01

	Associate s Inc			交易所				
481	AES Corp	爱伊斯公 司	AES US	纽约证 券交易 所	美国	2,267	226,354.95	0.01
482	Gartner Inc	-	IT US	纽约证 券交易 所	美国	255	225,121.36	0.01
483	MGM Resorts Internatio nal	美高梅国 际酒店集 团	MGM US	纽约证 券交易 所	美国	688	224,032.84	0.01
484	Franklin Resources Inc	富兰克林 资源	BEN US	纽约证 券交易 所	美国	975	220,933.68	0.01
485	Builders FirstSourc e Inc	-	BLDR US	纽约证 券交易 所	美国	352	214,522.64	0.01
486	Domino's Pizza Inc	达美乐披 萨公司	DPZ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	103	207,678.78	0.01
487	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证 券交易 所	美国	196	198,491.69	0.01
488	Alexandri a Real Estate Equities Inc	亚历山大 房地产股 份有限公 司	ARE US	纽约证 券交易 所	美国	547	196,895.97	0.01
489	Henry Schein Inc	亨利香恩 公司	HSIC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	317	180,324.30	0.01
490	FactSet Research Systems Inc	-	FDS US	纽约证 券交易 所	美国	115	180,210.97	0.01
491	Trade Desk Inc/The	-	TTD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,419	174,737.18	0.01
492	Wynn Resorts Ltd	永利渡假 村有限公 司	WYNN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	264	174,575.35	0.01
493	DaVita Inc	-	DVA US	纽约证 券交易	美国	113	171,227.66	0.01

				所				
494	AO Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	364	155,493.39	0.01
495	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL US	纽约证券交易所	美国	850	143,689.56	0.01
496	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	961	138,694.38	0.01
497	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	纽约证券交易所	美国	499	132,410.98	0.01
498	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE US	纳斯达克证券交易所	美国	81	132,265.98	0.01
499	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B US	纽约证券交易所	美国	561	101,827.38	0.01
500	Paramount Skydance	-	PSKY US	纳斯达克证券交易所	美国	762	51,172.47	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	NVIDIA Corp	NVDA US	6,741,786.15	0.41
2	Marvell Technology Ltd	MRVL US	6,400,844.16	0.39
3	Alphabet Inc	GOOGL US	3,433,239.02	0.21
		GOOG US	2,595,166.28	0.16
4	Apple Inc	AAPL US	5,359,071.20	0.33
5	Microsoft Corp	MSFT US	4,565,924.20	0.28
6	Amazon.com Inc	AMZN US	3,333,797.85	0.20
7	Broadcom Inc	AVGO US	2,490,639.04	0.15
8	Vertiv Holdings Co	VRT US	2,411,732.05	0.15
9	Meta Platforms Inc	META US	2,343,086.33	0.14
10	Tesla Inc	TSLA US	1,731,464.64	0.11
11	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	1,403,597.64	0.09

12	Lumentum Holdings Inc	LITE US	1,351,015.56	0.08
13	Flextronics International Ltd	FLEX US	1,277,197.00	0.08
14	Eli Lilly & Co	LLY US	1,212,815.83	0.07
15	JPMorgan Chase & Co	JPM US	1,212,340.80	0.07
16	Coherent Corp	COHR US	1,170,798.18	0.07
17	Ciena Corp	CIEN US	1,158,777.36	0.07
18	Exxon Mobil Corp	XOM US	924,113.20	0.06
19	Johnson & Johnson	JNJ US	889,288.05	0.05
20	Walmart Inc	WMT US	829,968.14	0.05

注：1.买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	NVIDIA Corp	NVDA US	5,109,070.90	0.31
2	Apple Inc	AAPL US	4,027,867.82	0.25
3	Alphabet Inc	GOOGL US	2,309,066.32	0.14
		GOOG US	1,350,380.13	0.08
4	Microsoft Corp	MSFT US	2,845,005.54	0.17
5	Amazon.com Inc	AMZN US	2,188,610.82	0.13
6	Broadcom Inc	AVGO US	1,907,241.64	0.12
7	Meta Platforms Inc	META US	1,255,008.30	0.08
8	Tesla Inc	TSLA US	1,108,147.92	0.07
9	JPMorgan Chase & Co	JPM US	1,072,864.34	0.07
10	Micron Technology Inc	MU US	936,762.09	0.06
11	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	877,812.28	0.05
12	Eli Lilly & Co	LLY US	842,146.98	0.05
13	Exxon Mobil Corp	XOM US	805,722.87	0.05
14	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	775,711.69	0.05
15	Devon Energy Corp	DVN US	756,112.39	0.05
16	Visa Inc	V US	705,978.45	0.04
17	Salesforce Inc	CRM US	616,504.62	0.04
18	Johnson & Johnson	JNJ US	564,919.55	0.03
19	Intel Corp	INTC US	554,209.09	0.03
20	Caterpillar Inc	CAT US	547,363.47	0.03

注：1.卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	103,033,003.58
卖出收入（成交）总额	60,620,350.89

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
未评级	132,128,490.41	7.93

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪、惠誉提供的债券信用评级信息，债券投资以全价列示。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	240202	24 国开 02	120,000,000	121,997,687.67	7.32
2	240312	24 进出 12	10,000,000	10,130,802.74	0.61

注：1.债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

2.数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Sep26	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”适用于金融资产与金融负债相抵销的情形，故将“其他衍生工具期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为 491,182.00 元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，META（Facebook）在本报告期内被中华人民共和国商务部、美国商务部（USDOC）、得克萨斯州总检察长办公室调查。META（Facebook）在报告编制日前一年内曾受到台湾地区数字事务部（MODA）的处罚。博通公司在报告编制日前一年内曾受到韩国公平交易委员会（KFTC）的处罚。谷歌在本报告期内被土耳其竞争委员会、得克萨斯州总检察长办公室调查。谷歌在报告编制日前一年内曾受到欧盟委员会（EU Commission）、法国国家信息自由委员会（CNIL）的处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。苹果公司在本报告期内被得克萨斯州总检察长办公室调查。苹果公司在报告编制日前一年内曾受到意大利竞争与市场管理局（AGCM）的处罚。特斯拉公司在本报告期内被美国国家公路交通安全管理局（NHTSA）调查。特斯拉公司在报告编制日前一年内曾受到美国佛罗里达州联邦法院的处罚。微软公司在本报告期内被瑞士竞争委员会（COMCO）、英国竞争与市场管理局（CMA）、意大利竞争与市场管理局（AGCM）调查。亚马逊公司在本报告期内被得克萨斯州总检察长办公室调查。英伟达公司在本报告期内被美国加州联邦法院调查。

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

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

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,265,321.46
2	应收清算款	2,878,047.62
3	应收股利	617,832.56
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	8,761,201.64

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达标普 500 指数(QDII-LOF) A	556,503	895.48	114,975,343.34	23.07%	383,360,204.59	76.93%
易方达标普 500 指数(QDII-LOF) C	348,429	116.41	48,028.07	0.12%	40,511,760.72	99.88%
合计	904,932	595.51	115,023,371.41	21.34%	423,871,965.31	78.66%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）A	702,653.65	0.1410%
	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）C	23,504.01	0.0579%
	合计	726,157.66	0.1347%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) A	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C
基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	693,199,312.42	-
本报告期期初基金份额总额	505,390,913.94	54,548,795.87
本报告期基金总申购份额	47,869,516.40	10,316,435.06
减：本报告期基金总赎回份额	54,924,882.41	24,305,442.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	498,335,547.93	40,559,788.79

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生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。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
UBS Securities Asia Limited	1	2,973,489.12	1.83%	122.45	1.60%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	20,272,612.22	12.45%	995.76	12.98%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	116,834,432.72	71.73%	5,497.43	71.67%	-
Goldman Sachs	1	22,804,766.95	14.00%	1,054.84	13.75%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	-	-	-	-	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holding(Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
State Street Securities	1	-	-	-	-	-

Hong Kong Limited						
招商证券	1	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易账户，新增交易账户的证券经营机构为 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited。

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

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

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

3）提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

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

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

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

c）本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2）基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
UBS	-	-	-	-	-	-	-	-

Secur ities Asia Limit ed								
Haito ng Inter natio nal Secur ities Com pany Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigr oup Glob al Mark ets Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	10,00 0,000. 00	100.00%	-	-	-	-
Chin a Intl Capit al Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Merc hants Secur ities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-

Co Ltd								
CLS A Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Huat ai Financial Holding(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
The Hong kong and Shan ghai Bank ing Corp oratio n Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	关于旗下部分基金 2026 年 1 月 19 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-14
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2026-01-22
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
6	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）暂停申购及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
7	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金定期定额投资最低金额限制的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
8	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
9	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	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（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证券时报	2026-03-31
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2026-04-22
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
14	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
15	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
16	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2026-05-29

	金销售业务的公告	子披露网站	
17	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
18	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 3 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§ 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

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
二〇二六年八月三十一日