

易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58

7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
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	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 易方达
基金主代码	159361
交易代码	159361
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,938,090,279.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。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，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	方圆
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559

传真	020-38798812	021-62701216
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	510627；510623；519031	200336
法定代表人	吴欣荣	任德奇

2.4 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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,782,520,710.76
本期利润	3,429,794,647.72
加权平均基金份额本期利润	0.1595
本期加权平均净值利润率	12.49%
本期基金份额净值增长率	12.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,185,806,042.11
期末可供分配基金份额利润	0.2210
期末基金资产净值	25,954,041,462.38
期末基金份额净值	1.3705
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	37.05%

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。

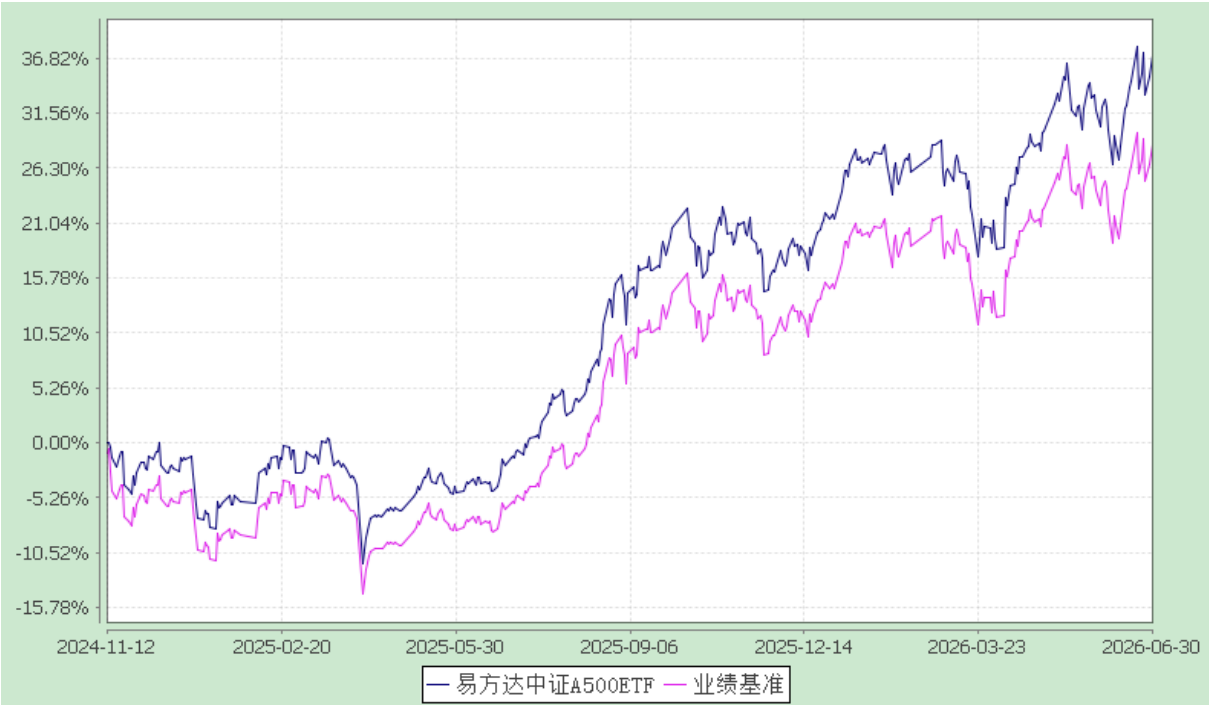
3.2 基金净值表现

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	15.08%	1.40%	14.26%	1.41%	0.82%	-0.01%
过去六个月	12.82%	1.28%	11.91%	1.29%	0.91%	-0.01%
过去一年	39.07%	1.14%	36.38%	1.14%	2.69%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	37.05%	1.12%	28.51%	1.13%	8.54%	-0.01%

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

易方达中证 A500 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
(2024 年 11 月 12 日至 2026 年 6 月 30 日)



§ 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		
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF（自 2023 年 07 月 11 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达上证科创板成长 ETF（自 2023 年 08 月 23 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达上证科创板 100ETF（自 2023 年 11 月 08 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达中证 A500ETF 联接、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF 的基金经理，指数研究发展部总经理、指数投资决策委员会委员	2024-11-12	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
靳晨鑫	本基金的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达中证 A100ETF 联接发起式、易方达中证 A100ETF、易方达中证细分有色金属产业主题 ETF 联接发起式、易方达中证工业有色金属主题 ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证细分有色金属产业主题 ETF 的基	2026-02-05	-	5 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任国盛证券有限责任公司研究助理。

	金经理，研究员				
张湛	本基金的基金经理助理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50ETF 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接、易方达中证医疗 ETF 联接、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达国证港股通科技 ETF 的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达上证科创板 100ETF（自 2023 年 12 月 02 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式（自 2024 年 08 月 31 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达创业板 ETF、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A50 增强策略 ETF 的基金经理助理	2024-12-07	-	17 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数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达中证新能源 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证新能源 ETF 联接发起式的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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 A500 指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。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。

2026 年上半年，A 股市场在全球宏观环境与国内政策调控的双重影响下，走出了一波结构分化显著的行情。从全球宏观背景来看，年初市场延续复苏与降息交易的乐观预期，但随后地缘政治冲突引发的油价波动对全球风险资产形成阶段性冲击。进入二季度，随着地缘局势缓和，市场焦点重新回到产业基本面，AI 产业趋势成为全球资本市场的核心主线。结构上，科技板块成为上半年最亮的方向，成交活跃度持续攀升，市场关注度高度集中，成交占比已接近历史极值水平。但值得注意的是，本轮科技行情并非单纯的估值扩张，而是有着较为扎实的基本面支撑，上市公司盈利兑现度较高，工业企业利润数据也印证了这一趋势。与此同时，市场内部呈现明显的 K 型分化。以 TMT 为代表的科技成长方向景气度最高，上游资源品次之，中游制造与公用事业居中，消费板块表现相对偏弱。整体来看，上半年 A 股在政策引导下保持了稳健运行，结构性机会突出，但随着部分板块估值与交易拥挤度升至高位，市场风险也在逐步累积，后续行情的演绎将更加依赖基本面的持续验证。受众多因素影响，中证 A500 指数 2026 年上半年上涨 11.91%。

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 1.3705 元，本报告期份额净值增长率为 12.82%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。年化跟踪误差 0.29%，在合同约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

在基本面修复、政策支持、估值相对低位的三重支撑下，2026 年下半年 A 股市场有望走出行情扩散、稳步回升的态势。一是经济基本面稳步修复，企业盈利边际改善。经过前期深度调整，我国经济已逐步走出底部区间，多数行业景气度回升，企业经营状况持续向好，盈利能力稳步修复。以人工智能、半导体为代表的科技制造领域产业趋势明确，相关产业链保持较高景气水平，为市场提供了坚实的业绩支撑。与此同时，传统制造业、消费服务等领域也呈现温和复苏态势，经济内生动力不断增强，整体向好的基本面为资本市场运行奠定了稳固基础。二是政策环境持续优化，制度红利不断释放。稳增长政策持续发力，财政与货币政策协同配合，在扩大有效需求、支持科技创新、防范化解风险等方面发挥了积极作用。资本市场改革纵深推进，制度体系不断完善，市场生态持续优化，投资者信心稳步恢复。下半年随着各项政策措施落地见效，政策效应将进一步显现，为市场平稳健康发展提供有力保障。三是整体估值处于低位，修复空间较为充足。经历前期调整后，市场整体估值水平已回落至历史相对低位，安全边际显著提升，下行空间有限。各类风险因素已得到较为充分的释放，市场情绪处于底部区域，随着积极因素逐步积累，市场有望迎来估值修复行情。同时，前期市场结构性分化较为显著，下半年有望呈现更为均衡的发展格局，更多板块将迎来投资机会。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	150,179,001.44	189,796,263.31
结算备付金		91,032,465.73	36,760,802.72
存出保证金		22,913,072.59	10,154,674.69
交易性金融资产	6.4.7.2	25,788,466,909.10	33,757,776,401.52
其中：股票投资		25,785,648,836.75	33,757,776,401.52
基金投资		-	-
债券投资		2,818,072.35	-
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		89,976,328.02	35,358,503.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		26,142,628,269.51	34,029,846,645.60
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 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		78,505,093.94	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,156,574.25	3,374,752.42
应付托管费		1,052,191.42	1,124,917.49
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		411,133.88	84,951.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	105,461,813.64	162,696,594.24
负债合计		188,586,807.13	167,281,215.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	18,938,090,279.00	27,875,090,279.00

未分配利润	6.4.7.8	7,015,951,183.38	5,987,475,151.21
净资产合计		25,954,041,462.38	33,862,565,430.21
负债和净资产总计		26,142,628,269.51	34,029,846,645.60

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3705 元，基金份额总额 18,938,090,279.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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		3,457,304,868.89	290,157,444.03
1.利息收入		501,907.99	291,130.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	501,907.99	291,130.42
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）		2,798,969,799.85	53,734,166.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,556,705,868.10	-120,570,179.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-114,229.35	443,993.22
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	21,043,036.41	-413,081.79
股利收益	6.4.7.14	221,335,124.69	174,273,434.51
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	647,273,936.96	230,645,047.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	10,559,224.09	5,487,099.26
减：二、营业总支出		27,510,221.17	15,157,630.97
1. 管理人报酬		20,458,612.54	11,239,397.94
2. 托管费		6,819,537.45	3,746,465.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		75,866.37	685.87

8. 其他费用	6.4.7.18	156,204.81	171,081.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,429,794,647.72	274,999,813.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,429,794,647.72	274,999,813.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,429,794,647.72	274,999,813.06

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	27,875,090,279.00	5,987,475,151.21	33,862,565,430.21
二、本期期初净资产	27,875,090,279.00	5,987,475,151.21	33,862,565,430.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,937,000,000.00	1,028,476,032.17	-7,908,523,967.83
（一）、综合收益总额	-	3,429,794,647.72	3,429,794,647.72
（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）	-8,937,000,000.00	-2,401,318,615.55	-11,338,318,615.55
其中：1.基金申购款	9,303,000,000.00	2,694,849,769.69	11,997,849,769.69
2.基金赎回款	-18,240,000,000.00	-5,096,168,385.24	-23,336,168,385.24
（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	18,938,090,279.00	7,015,951,183.38	25,954,041,462.38
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	15,617,090,279.00	-474,201,733.99	15,142,888,545.01
二、本期期初净资产	15,617,090,279.00	-474,201,733.99	15,142,888,545.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,662,000,000.00	272,443,009.15	-1,389,556,990.85
（一）、综合收益总额	-	274,999,813.06	274,999,813.06
（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）	-1,662,000,000.00	-2,556,803.91	-1,664,556,803.91
其中：1.基金申购款	7,176,000,000.00	-318,864,542.25	6,857,135,457.75
2.基金赎回款	-8,838,000,000.00	316,307,738.34	-8,521,692,261.66
（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	13,955,090,279.00	-201,758,724.84	13,753,331,554.16

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：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 A500 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[2024]1520 号《关于准予易方达中证 A500 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 A500 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,090,279.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 89,811.00 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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>》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和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

（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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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》、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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》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。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% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，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，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，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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。

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	150,179,001.44

等于：本金	150,166,652.03
加：应计利息	12,349.41
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	150,179,001.44

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		22,803,303,967.39	-	25,785,648,836.75	2,982,344,869.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,817,993.83	78.52	2,818,072.35	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,817,993.83	78.52	2,818,072.35	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		22,806,121,961.22	78.52	25,788,466,909.10	2,982,344,869.36

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	150,853,920.67	-	-	-
IC2607	37,924,059.13	-	-	-
IC2609	4,656,640.00	-	-	-
IF2607	52,802,141.54	-	-	-
IF2609	55,471,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	150,853,920.67	-	-	-

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
IC2607	IC2607	22	39,284,080.00	1,360,020.87
IC2609	IC2609	3	5,256,840.00	600,200.00
IF2607	IF2607	36	53,157,600.00	355,458.46
IF2609	IF2609	39	56,742,660.00	1,271,580.00
合计	-	-	-	3,587,259.33
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	3,587,259.33
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-

待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,468,333.64
其中：交易所市场	1,468,333.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,697.44
应付替代款	101,730,316.42
可退替代款	2,166,466.14
合计	105,461,813.64

6.4.7.7 实收基金

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	27,875,090,279.00	27,875,090,279.00
本期申购	9,303,000,000.00	9,303,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,240,000,000.00	-18,240,000,000.00
本期末	18,938,090,279.00	18,938,090,279.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,554,238,670.74	3,433,236,480.47	5,987,475,151.21
本期期初	2,554,238,670.74	3,433,236,480.47	5,987,475,151.21
本期利润	2,782,520,710.76	647,273,936.96	3,429,794,647.72
本期基金份额交易产生的变动数	-1,150,953,339.39	-1,250,365,276.16	-2,401,318,615.55
其中：基金申购款	1,537,213,197.95	1,157,636,571.74	2,694,849,769.69
基金赎回款	-2,688,166,537.34	-2,408,001,847.90	-5,096,168,385.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,185,806,042.11	2,830,145,141.27	7,015,951,183.38

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	224,391.21
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	270,447.75
其他	7,069.03
合计	501,907.99

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	1,143,882,614.37
股票投资收益——赎回差价收入	1,412,823,253.73
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	2,556,705,868.10

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	16,419,034,353.31
减：卖出股票成本总额	15,262,515,682.90
减：交易费用	12,636,056.04
买卖股票差价收入	1,143,882,614.37

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	23,336,168,385.24
减：现金支付赎回款总额	12,178,659,300.24
减：赎回股票成本总额	9,744,685,831.27
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,412,823,253.73

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	70.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-114,299.60
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	-114,229.35

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	177,290,868.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	176,870,050.73
减：应计利息总额	528,023.93
减：交易费用	7,093.05
买卖债券差价收入	-114,299.60

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	21,043,036.41

6.4.7.14 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	221,335,124.69
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	221,335,124.69

6.4.7.15 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	645,273,717.63
——股票投资	645,273,717.63
——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	2,000,219.33
——权证投资	-
——期货投资	2,000,219.33
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	647,273,936.96

6.4.7.16 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	-
替代损益收入	10,559,224.09
合计	10,559,224.09

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	69,424.36
合计	156,204.81

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
交通银行股份有限公司	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
易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	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	1,152,756,200.30	4.27%	191,111.00	0.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券	115,287.36	4.27%	115,272.08	7.85%
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 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	19.10	0.00%	5.64	0.00%

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.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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。

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	20,458,612.54	11,239,397.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	503,041.63	516,244.64
应支付基金管理人的净管理费	19,955,570.91	10,723,153.30

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	6,819,537.45	3,746,465.96
----------------	--------------	--------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 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
报告期初持有的基金份额	237,418,900.00	-
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	237,418,900.00	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,680,781,171.00	24.7162%	3,942,028,897.00	14.1418%
广发证券股份有限公司	58,148,659.00	0.3070%	133,349,653.00	0.4784%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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
交通银行-活期存款	150,179,001.44	224,391.21	86,349,558.04	116,249.76

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
广发证券股份有限公司	920189	康美特	新股发行	200	1,628.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

广发证券股 份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
----------------	--------	------	------	-------	-----------

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，在报告期内投资于托管人交通银行发行的 A 股交通银行。于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有交通银行发行的 A 股交通银行 20,740,034 股（2025 年 12 月 31 日：31,425,934 股），占本基金净值比例为 0.51%（2025 年 12 月 31 日：0.67%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
00122 0	世盟 股份	2026-0 1-27	6 个月	新股 流通 受限	28.00	27.78	57	1,596. 00	1,583. 46	-
00123 7	惠康 科技	2026-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	53.26	58.74	285	15,179 .10	16,740 .90	-
00124 8	华润 新能 源	2026-0 6-24	1 个月 以内	新股 流通 受限	10.11	10.11	25,231	255,08 5.41	255,08 5.41	-
00124 8	华润 新能 源	2026-0 6-24	6 个月	新股 流通 受限	10.11	10.11	58,873	595,20 6.03	595,20 6.03	-
00125 7	盛龙 股份	2026-0 3-24	6 个月	新股 流通 受限	7.82	20.74	1,743	13,630 .26	36,149 .82	-
00131 2	福恩 股份	2026-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	18.38	16.78	134	2,462. 92	2,248. 52	-
00136 5	天海 电子	2026-0 5-11	6 个月	新股 流通	27.19	31.31	719	19,549 .61	22,511 .89	-

				受限						
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
60329	埃泰	2026-0	6 个月	新股	33.49	33.93	72	2,411.	2,442.	-

3	克	4-09		流通受限				28	96	
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月以内	新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月以内	新股流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
000651	格力电器	2026-06-04	6 个月	大宗交易流通受限	37.13	36.53	1,083,000	40,211,790.00	39,561,990.00	-
002044	美年健康	2026-01-15	6 个月	大宗交易流通受限	7.58	4.91	1,020,000	7,731,600.00	5,008,200.00	-
300442	润泽科技	2026-01-26	6 个月	大宗交易流通受限	73.26	79.88	93,700	6,864,462.00	7,484,756.00	-
300442	润泽科技	2026-01-28	6 个月	大宗交易流通受限	73.26	79.76	127,200	9,318,672.00	10,145,472.00	-
300604	长川科技	2026-01-12	6 个月	大宗交易流通受限	112.48	332.43	78,000	8,773,440.00	25,929,540.00	-
30123	软通	2026-0	6 个月	大宗	48.81	41.22	150,00	7,321,	6,183,	-

6	动力	1-14		交易 流通 受限			0	500.00	000.00	
30123 6	软通 动力	2026-0 4-29	6 个月	大宗 交易 流通 受限	35.90	38.95	56,000	2,010, 400.00	2,181, 200.00	-
60023 3	圆通 速递	2026-0 4-23	6 个月	大宗 交易 流通 受限	21.04	15.06	420,00 0	8,836, 800.00	6,325, 200.00	-
60326 0	合盛 硅业	2026-0 2-24	6 个月	大宗 交易 流通 受限	44.14	45.62	94,000	4,149, 160.00	4,288, 280.00	-
68801 2	中微 公司	2026-0 1-16	6 个月	大宗 交易 流通 受限	341.32	455.96	140,06 1	32,084 ,080.0 0	63,862 ,213.5 6	-
68801 2	中微 公司	2026-0 6-25	6 个月	大宗 交易 流通 受限	372.36	424.72	150,00 0	55,854 ,000.0 0	63,708 ,000.0 0	-
30078 2	卓胜 微	2026-0 4-22	6 个月	非公 开发 行流 通受 限	86.78	98.96	112,18 7	9,735, 587.86	11,102 ,025.5 2	-
60108 8	中国 神华	2026-0 3-31	6 个月	非公 开发 行流 通受 限	43.70	37.71	957,00 9	41,821 ,293.3 0	36,088 ,809.3 9	-
68807 2	拓荆 科技	2026-0 6-23	6 个月	非公 开发 行流 通受 限	576.01	745.27	26,756	15,411 ,723.5 6	19,940 ,444.1 2	-
30072 4	捷佳 伟创	2026-0 4-08	6 个月	询价 转让 流通 受限	94.12	66.40	75,000	7,059, 000.00	4,980, 000.00	-
30080 3	指南 针	2026-0 4-24	6 个月	询价 转让 流通	85.11	85.76	105,00 0	8,936, 550.00	9,004, 800.00	-

				受限						
688047	龙芯中科	2026-06-17	6 个月	询价 转让 流通 受限	120.00	139.86	50,000	6,000,000.00	6,993,000.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	15,570	1,557,000.00	1,557,017.07	-
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	12,610	1,261,000.00	1,261,055.28	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	129,702	40,894,016.51	107,912,064.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	745.27	2026-07-13	890.99	26,756	15,411,723.56	19,940,444.12	非公开发行流通受限

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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 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 0.01%(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	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。

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	2,818,072.35	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,818,072.35	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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	150,179,001.44	-	-	-	150,179,001.44
结算备付金	91,032,465.73	-	-	-	91,032,465.73
存出保证金	22,913,072.59	-	-	-	22,913,072.59
交易性金融资产	-	-	2,818,072.35	25,785,648,836.75	25,788,466,909.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	89,976,328.02	89,976,328.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	264,124,539.76	-	2,818,072.35	25,875,685,657.40	26,142,628,269.51
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	-	-	-	78,505,093.94	78,505,093.94
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,156,574.25	3,156,574.25

应付托管费	-	-	-	1,052,191.42	1,052,191.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	411,133.88	411,133.88
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	105,461,813.64	105,461,813.64
负债总计	-	-	-	188,586,807.13	188,586,807.13
利率敏感度缺口	264,124,539.76	-	2,818,072.35	25,687,098,850.27	25,954,041,462.38
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	189,796,263.31	-	-	-	189,796,263.31
结算备付金	36,760,802.72	-	-	-	36,760,802.72
存出保证金	10,154,674.69	-	-	-	10,154,674.69
交易性金融资产	-	-	-	33,757,776,401.52	33,757,776,401.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	35,358,503.36	35,358,503.36
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	236,711,740.72	-	-	33,793,134,904.88	34,029,846,645.60
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,374,752.42	3,374,752.42
应付托管费	-	-	-	1,124,917.49	1,124,917.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	84,951.24	84,951.24
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	162,696,594.24	162,696,594.24
负债总计	-	-	-	167,281,215.39	167,281,215.39
利率敏感度缺口	236,711,740.72	-	-	33,625,853,689.49	33,862,565,430.21

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		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	25,785,648,836.75	99.35	33,757,776,401.52	99.69
交易性金融资产—债券投资	2,818,072.35	0.01	-	-
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	25,788,466,909.10	99.36	33,757,776,401.52	99.69

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,296,780,055.83	1,686,806,211.68
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,296,780,055.83	-1,686,806,211.68

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	25,338,047,135.40
第二层次	111,590,395.79
第三层次	338,829,377.91
合计	25,788,466,909.10

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,785,648,836.75	98.63
	其中：股票	25,785,648,836.75	98.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,818,072.35	0.01
	其中：债券	2,818,072.35	0.01
	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	241,211,467.17	0.92

8	其他各项资产	112,949,893.24	0.43
9	合计	26,142,628,269.51	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	81,124,011.26	0.31
B	采矿业	1,060,438,629.05	4.09
C	制造业	18,235,612,592.22	70.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	562,453,139.97	2.17
E	建筑业	313,939,243.90	1.21
F	批发和零售业	198,672,714.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	573,829,934.67	2.21
H	住宿和餐饮业	12,058,487.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,441,218,943.65	5.55
J	金融业	2,498,167,656.22	9.63
K	房地产业	144,039,236.76	0.55
L	租赁和商务服务业	186,277,040.80	0.72
M	科学研究和技术服务业	308,097,487.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	44,167,760.12	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,606,520.00	0.03
Q	卫生和社会工作	50,446,980.90	0.19
R	文化、体育和娱乐业	19,724,570.00	0.08
S	综合	46,576,198.00	0.18
	合计	25,785,451,145.52	99.35

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	866,802	1,100,838,540.00	4.24
2	300750	宁德时代	2,056,864	808,368,120.64	3.11

3	300502	新易盛	1,084,246	658,137,322.00	2.54
4	600519	贵州茅台	486,074	576,235,866.26	2.22
5	603986	兆易创新	519,400	423,311,000.00	1.63
6	601318	中国平安	8,290,000	395,764,600.00	1.52
7	688256	寒武纪	244,301	389,794,460.55	1.50
8	600036	招商银行	9,625,488	341,704,824.00	1.32
9	601899	紫金矿业	12,817,080	322,221,391.20	1.24
10	002371	北方华创	336,684	297,817,199.04	1.15
11	000333	美的集团	3,779,684	285,479,532.52	1.10
12	002475	立讯精密	3,965,500	279,171,200.00	1.08
13	688008	澜起科技	891,536	276,287,006.40	1.06
14	688012	中微公司	601,706	273,575,896.06	1.05
15	688041	海光信息	723,022	267,735,046.60	1.03
16	002384	东山精密	996,700	261,484,245.00	1.01
17	600900	长江电力	9,514,000	251,835,580.00	0.97
18	688981	中芯国际	1,584,411	251,636,155.02	0.97
19	000725	京东方 A	28,243,999	245,157,911.32	0.94
20	603259	药明康德	1,923,400	239,482,534.00	0.92
21	600030	中信证券	7,590,300	218,069,319.00	0.84
22	601166	兴业银行	13,166,100	218,030,616.00	0.84
23	300059	东方财富	9,841,395	200,567,630.10	0.77
24	600183	生益科技	1,133,400	196,531,560.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	3,472,500	180,708,900.00	0.70
26	300274	阳光电源	1,128,000	179,374,560.00	0.69
27	601398	工商银行	25,160,200	177,882,614.00	0.69
28	300408	三环集团	1,042,670	174,021,623.00	0.67
29	002594	比亚迪	2,112,850	168,394,145.00	0.65
30	600487	亨通光电	1,534,400	167,771,296.00	0.65
31	300476	胜宏科技	474,700	164,450,321.00	0.63
32	002463	沪电股份	1,046,878	159,962,958.40	0.62
33	601211	国泰海通	8,786,462	159,913,608.40	0.62
34	300394	天孚通信	508,838	154,015,085.84	0.59
35	688498	源杰科技	77,456	146,082,016.00	0.56
36	688525	佰维存储	293,377	145,142,403.21	0.56
37	000988	华工科技	781,373	144,249,269.53	0.56
38	301308	江波龙	197,403	138,932,231.40	0.54
39	600176	中国巨石	1,867,900	136,132,552.00	0.52
40	601288	农业银行	22,337,800	135,590,446.00	0.52
41	601328	交通银行	20,740,034	133,358,418.62	0.51
42	000651	格力电器	3,512,075	130,652,302.50	0.50
43	600522	中天科技	2,123,255	128,839,113.40	0.50
44	688072	拓荆科技	156,458	127,852,508.12	0.49
45	603019	中科曙光	1,137,304	121,953,107.92	0.47
46	688521	芯原股份	327,189	121,432,925.46	0.47

47	603993	洛阳钼业	6,789,300	119,152,215.00	0.46
48	600150	中国船舶	3,511,483	118,653,010.57	0.46
49	300604	长川科技	347,447	117,924,134.74	0.45
50	600887	伊利股份	4,918,500	117,847,260.00	0.45
51	600584	长电科技	1,113,300	115,282,215.00	0.44
52	000338	潍柴动力	4,176,473	113,808,889.25	0.44
53	000858	五粮液	1,508,493	111,628,482.00	0.43
54	688347	华虹宏力	317,093	106,638,375.90	0.41
55	601816	京沪高铁	22,828,700	103,414,011.00	0.40
56	600309	万华化学	1,460,681	99,925,187.21	0.39
57	688120	华海清科	307,788	99,163,137.84	0.38
58	300124	汇川技术	1,473,900	97,763,787.00	0.38
59	002415	海康威视	2,850,200	97,476,840.00	0.38
60	002916	深南电路	211,844	97,003,367.60	0.37
61	002281	光迅科技	376,146	96,646,953.24	0.37
62	002008	大族激光	640,393	96,129,393.23	0.37
63	600111	北方稀土	1,968,600	94,591,230.00	0.36
64	000100	TCL 科技	16,157,816	94,038,489.12	0.36
65	000063	中兴通讯	2,503,700	90,608,903.00	0.35
66	300857	协创数据	266,360	90,535,764.00	0.35
67	300136	信维通信	751,900	89,664,075.00	0.35
68	600000	浦发银行	10,355,882	89,164,144.02	0.34
69	600089	特变电工	3,927,850	88,376,625.00	0.34
70	601857	中国石油	10,069,000	87,398,920.00	0.34
71	002028	思源电气	484,200	83,766,600.00	0.32
72	601088	中国神华	2,168,717	83,393,889.71	0.32
73	300433	蓝思科技	1,547,224	83,024,039.84	0.32
74	600031	三一重工	4,611,200	79,681,536.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	1,182,494	76,897,584.82	0.30
76	300475	香农芯创	255,600	76,680,000.00	0.30
77	002050	三花智控	1,741,119	76,313,245.77	0.29
78	601601	中国太保	2,661,600	75,908,832.00	0.29
79	000001	平安银行	7,544,363	75,820,848.15	0.29
80	300223	北京君正	300,900	74,894,010.00	0.29
81	000792	盐湖股份	2,469,700	74,560,243.00	0.29
82	002714	牧原股份	2,123,276	74,293,427.24	0.29
83	600549	厦门钨业	864,200	73,629,840.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	477,340	72,794,350.00	0.28
85	002156	通富微电	944,188	71,635,543.56	0.28
86	600406	国电南瑞	3,121,300	71,321,705.00	0.27
87	601668	中国建筑	16,063,900	69,717,326.00	0.27
88	000657	中钨高新	709,000	67,865,480.00	0.26
89	002436	兴森科技	1,320,880	67,298,836.00	0.26
90	601919	中远海控	4,879,800	64,706,148.00	0.25

91	002602	世纪华通	4,584,763	64,645,158.30	0.25
92	300760	迈瑞医疗	471,464	64,038,955.12	0.25
93	601988	中国银行	11,127,535	63,649,500.20	0.25
94	600660	福耀玻璃	1,245,500	62,823,020.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	592,300	62,766,031.00	0.24
96	601728	中国电信	12,068,800	62,637,072.00	0.24
97	603501	豪威集团	659,230	62,527,965.50	0.24
98	601012	隆基绿能	4,712,400	61,826,688.00	0.24
99	601225	陕西煤业	3,014,300	61,341,005.00	0.24
100	002230	科大讯飞	1,493,850	61,008,834.00	0.24
101	600941	中国移动	702,600	60,514,938.00	0.23
102	600690	海尔智家	2,916,300	59,521,683.00	0.23
103	002352	顺丰控股	1,863,875	58,264,732.50	0.22
104	688777	中控技术	492,224	57,836,320.00	0.22
105	601985	中国核电	6,395,200	57,748,656.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	878,400	57,447,360.00	0.22
107	002709	天赐材料	1,109,621	57,067,808.03	0.22
108	603799	华友钴业	1,179,424	56,919,002.24	0.22
109	002938	鹏鼎控股	537,300	56,620,674.00	0.22
110	300757	罗博特科	91,218	56,463,942.00	0.22
111	300033	同花顺	234,092	56,416,172.00	0.22
112	000977	浪潮信息	799,379	55,956,530.00	0.22
113	600160	巨化股份	1,049,700	55,644,597.00	0.21
114	300442	润泽科技	645,700	52,918,364.00	0.20
115	002851	麦格米特	316,110	52,847,269.80	0.20
116	000425	徐工机械	6,371,334	51,544,092.06	0.20
117	000938	紫光股份	1,776,700	51,275,562.00	0.20
118	688126	沪硅产业	1,284,362	51,233,200.18	0.20
119	002202	金风科技	2,142,540	51,206,706.00	0.20
120	601600	中国铝业	6,161,800	50,649,996.00	0.20
121	600028	中国石化	11,330,500	50,534,030.00	0.19
122	600938	中国海油	1,859,200	50,477,280.00	0.19
123	300346	南大光电	536,839	49,738,133.35	0.19
124	600460	士兰微	905,900	49,516,494.00	0.19
125	002466	天齐锂业	803,900	49,295,148.00	0.19
126	002600	领益智造	2,839,000	49,228,260.00	0.19
127	601766	中国中车	9,455,000	49,166,000.00	0.19
128	600050	中国联通	12,151,300	48,605,200.00	0.19
129	300661	圣邦股份	337,765	48,462,522.20	0.19
130	300567	精测电子	152,300	48,370,480.00	0.19
131	002837	英维克	593,667	47,232,146.52	0.18
132	002080	中材科技	522,000	46,980,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	528,120	46,870,650.00	0.18
134	002185	华天科技	2,067,000	46,114,770.00	0.18

135	002407	多氟多	911,905	45,804,988.15	0.18
136	002138	顺络电子	626,100	45,767,910.00	0.18
137	601628	中国人寿	1,294,700	45,767,645.00	0.18
138	002179	中航光电	987,712	45,632,294.40	0.18
139	688002	睿创微纳	292,372	45,227,024.68	0.17
140	601100	恒立液压	417,100	44,863,276.00	0.17
141	000568	泸州老窖	571,817	44,327,253.84	0.17
142	601872	招商轮船	2,510,300	44,105,971.00	0.17
143	300395	菲利华	326,827	43,706,574.71	0.17
144	600879	航天电子	2,052,600	43,699,854.00	0.17
145	002241	歌尔股份	1,931,603	43,519,015.59	0.17
146	603288	海天味业	1,296,500	42,991,940.00	0.17
147	601006	大秦铁路	9,263,956	42,706,837.16	0.16
148	300390	天华新能	452,260	42,290,832.60	0.16
149	000408	藏格矿业	609,700	42,264,404.00	0.16
150	601658	邮储银行	8,571,100	42,255,523.00	0.16
151	605117	德业股份	396,028	42,050,253.04	0.16
152	688017	绿的谐波	99,799	41,702,010.14	0.16
153	688469	芯联集成	3,909,835	41,483,349.35	0.16
154	600905	三峡能源	11,110,800	41,221,068.00	0.16
155	600489	中金黄金	2,260,800	40,807,440.00	0.16
156	601888	中国中免	759,200	40,776,632.00	0.16
157	002625	光启技术	1,340,800	40,653,056.00	0.16
158	688396	华润微	413,161	40,303,855.55	0.16
159	000630	铜陵有色	6,250,671	39,754,267.56	0.15
160	600893	航发动力	1,036,500	39,739,410.00	0.15
161	600673	东阳光	1,169,700	39,278,526.00	0.15
162	600010	包钢股份	17,577,300	39,197,379.00	0.15
163	688271	联影医疗	384,551	38,928,097.73	0.15
164	601127	赛力斯	634,700	38,875,375.00	0.15
165	688111	金山办公	180,174	38,386,070.70	0.15
166	300058	蓝色光标	2,788,780	38,373,612.80	0.15
167	601689	拓普集团	676,100	38,145,562.00	0.15
168	002273	水晶光电	1,073,674	38,093,953.52	0.15
169	300037	新宙邦	410,184	38,085,584.40	0.15
170	002027	分众传媒	7,858,000	38,032,720.00	0.15
171	600118	中国卫星	459,800	37,726,590.00	0.15
172	600019	宝钢股份	6,772,900	36,776,847.00	0.14
173	300751	迈为股份	130,136	36,758,214.56	0.14
174	000426	兴业银锡	1,103,396	36,367,932.16	0.14
175	600760	中航沈飞	881,892	36,245,761.20	0.14
176	000807	云铝股份	1,615,802	35,773,856.28	0.14
177	601168	西部矿业	1,296,501	35,187,037.14	0.14
178	600362	江西铜业	806,900	34,938,770.00	0.13

179	600104	上汽集团	3,574,035	34,882,581.60	0.13
180	600989	宝丰能源	1,710,200	34,768,366.00	0.13
181	300450	先导智能	852,600	34,717,872.00	0.13
182	601727	上海电气	4,902,800	34,319,600.00	0.13
183	600875	东方电气	1,185,500	34,106,835.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	1,293,200	34,037,024.00	0.13
185	002001	新和成	1,193,920	33,931,206.40	0.13
186	688099	晶晨股份	329,201	33,874,782.90	0.13
187	605589	圣泉集团	526,400	33,463,248.00	0.13
188	600667	太极实业	1,138,100	33,209,758.00	0.13
189	002422	科伦药业	862,100	33,208,092.00	0.13
190	600885	宏发股份	962,781	33,206,316.69	0.13
191	601390	中国中铁	7,959,500	33,191,115.00	0.13
192	002738	中矿资源	560,073	33,038,706.27	0.13
193	000538	云南白药	693,860	32,868,148.20	0.13
194	000960	锡业股份	768,503	32,807,393.07	0.13
195	002126	银轮股份	658,100	32,773,380.00	0.13
196	600392	盛和资源	1,090,100	32,452,277.00	0.13
197	600547	山东黄金	1,404,700	32,434,523.00	0.12
198	600795	国电电力	6,932,000	32,372,440.00	0.12
199	000831	中国稀土	576,964	32,015,732.36	0.12
200	600418	江淮汽车	1,226,500	31,680,495.00	0.12
201	600585	海螺水泥	1,865,300	31,616,835.00	0.12
202	601669	中国电建	6,699,500	31,487,650.00	0.12
203	002648	卫星化学	1,308,649	30,740,165.01	0.12
204	300316	晶盛机电	508,600	30,719,440.00	0.12
205	600141	兴发集团	653,842	30,710,958.74	0.12
206	002812	恩捷股份	458,239	30,660,771.49	0.12
207	002129	TCL 中环	2,514,675	30,226,393.50	0.12
208	600096	云天化	992,400	30,168,960.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	3,624,265	29,936,428.90	0.12
210	301358	湖南裕能	393,300	29,839,671.00	0.11
211	601179	中国西电	1,994,000	29,750,480.00	0.11
212	300782	卓胜微	279,024	29,384,023.98	0.11
213	600346	恒力石化	1,641,600	29,072,736.00	0.11
214	601868	中国能建	10,875,800	29,038,386.00	0.11
215	600482	中国动力	882,000	28,929,600.00	0.11
216	002195	岩山科技	4,412,896	28,860,339.84	0.11
217	000066	中国长城	1,502,491	28,622,453.55	0.11
218	002558	巨人网络	1,033,500	28,483,260.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	2,350,800	28,468,188.00	0.11
220	300418	昆仑万维	699,143	28,217,411.48	0.11
221	600580	卧龙电驱	850,360	28,146,916.00	0.11
222	600066	宇通客车	1,032,700	27,686,687.00	0.11

223	000625	长安汽车	3,855,640	27,644,938.80	0.11
224	600426	华鲁恒升	1,151,000	27,531,920.00	0.11
225	600157	永泰能源	16,959,200	27,304,312.00	0.11
226	002532	天山铝业	2,517,600	27,013,848.00	0.10
227	600221	海航控股	19,982,773	26,976,743.55	0.10
228	600895	张江高科	722,500	26,913,125.00	0.10
229	000157	中联重科	3,859,180	26,898,484.60	0.10
230	688036	传音控股	447,618	26,387,081.10	0.10
231	600711	盛屯矿业	2,402,300	26,353,231.00	0.10
232	002340	格林美	3,964,207	26,203,408.27	0.10
233	300803	指南针	291,345	26,087,046.15	0.10
234	605499	东鹏饮料	210,320	25,959,797.60	0.10
235	600011	华能国际	3,419,600	25,954,764.00	0.10
236	000933	神火股份	1,223,687	25,942,164.40	0.10
237	600048	保利发展	5,583,200	25,850,216.00	0.10
238	600143	金发科技	1,662,500	25,685,625.00	0.10
239	600436	片仔癀	234,626	25,639,929.28	0.10
240	600438	通威股份	2,100,000	25,431,000.00	0.10
241	600115	中国东航	6,616,600	25,209,246.00	0.10
242	300017	网宿科技	1,937,342	25,204,819.42	0.10
243	002821	凯莱英	155,150	25,134,300.00	0.10
244	002236	大华股份	1,523,544	25,123,240.56	0.10
245	002493	荣盛石化	2,328,375	25,030,031.25	0.10
246	002131	利欧股份	5,259,700	24,983,575.00	0.10
247	600570	恒生电子	1,177,600	24,953,344.00	0.10
248	600886	国投电力	1,866,400	24,841,784.00	0.10
249	002456	欧菲光	2,609,500	24,685,870.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	2,021,400	24,479,154.00	0.09
251	688047	龙芯中科	161,065	24,171,423.55	0.09
252	603659	璞泰来	832,200	24,075,546.00	0.09
253	601233	桐昆股份	1,109,600	24,022,840.00	0.09
254	003816	中国广核	6,116,483	23,915,448.53	0.09
255	300339	润和软件	619,000	23,837,690.00	0.09
256	601360	三六零	2,720,700	23,642,883.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	2,045,100	23,580,003.00	0.09
258	000301	东方盛虹	2,054,781	23,527,242.45	0.09
259	688213	思特威	219,002	23,448,544.14	0.09
260	300759	康龙化成	803,700	23,251,041.00	0.09
261	600026	中远海能	1,294,800	23,228,712.00	0.09
262	002074	国轩高科	843,770	23,212,112.70	0.09
263	688578	艾力斯	209,969	22,928,614.80	0.09
264	688235	百济神州	89,474	22,780,975.14	0.09
265	002555	三七互娱	1,203,300	22,706,271.00	0.09
266	300438	鹏辉能源	274,030	22,703,385.50	0.09

267	600009	上海机场	967,400	22,346,940.00	0.09
268	688122	西部超导	353,655	22,213,070.55	0.09
269	600196	复星医药	988,300	22,207,101.00	0.09
270	000768	中航西飞	1,079,700	22,112,256.00	0.09
271	000975	山金国际	1,291,496	21,955,432.00	0.08
272	601111	中国国航	3,623,000	21,919,150.00	0.08
273	002472	双环传动	527,869	21,911,842.19	0.08
274	300207	欣旺达	1,148,588	21,811,686.12	0.08
275	300001	特锐德	574,137	21,719,602.71	0.08
276	600029	南方航空	4,190,200	21,705,236.00	0.08
277	600415	小商品城	2,131,500	21,656,040.00	0.08
278	002517	恺英网络	1,326,700	21,558,875.00	0.08
279	600674	川投能源	1,516,000	21,481,720.00	0.08
280	603129	春风动力	83,562	21,375,159.60	0.08
281	600219	南山铝业	5,355,700	21,369,243.00	0.08
282	002601	龙佰集团	1,295,277	21,346,164.96	0.08
283	300458	全志科技	540,232	21,317,554.72	0.08
284	601186	中国铁建	3,576,600	21,280,770.00	0.08
285	002128	电投能源	917,861	21,220,946.32	0.08
286	002595	豪迈科技	450,545	20,995,397.00	0.08
287	601877	正泰电器	837,200	20,988,604.00	0.08
288	600233	圆通速递	1,349,300	20,961,675.00	0.08
289	601117	中国化学	2,848,200	20,934,270.00	0.08
290	300115	长盈精密	738,285	20,627,682.90	0.08
291	301236	软通动力	493,836	20,582,838.20	0.08
292	600372	中航机载	1,880,500	20,403,425.00	0.08
293	002155	湖南黄金	852,070	20,338,910.90	0.08
294	600839	四川长虹	2,870,700	20,037,486.00	0.08
295	002465	海格通信	1,542,500	19,697,725.00	0.08
296	300568	星源材质	1,045,160	19,565,395.20	0.08
297	300454	深信服	201,337	19,368,619.40	0.07
298	300347	泰格医药	401,456	19,269,888.00	0.07
299	000963	华东医药	681,050	19,151,126.00	0.07
300	000547	航天发展	993,400	19,023,610.00	0.07
301	600741	华域汽车	1,225,300	19,016,656.00	0.07
302	002920	德赛西威	232,025	18,910,037.50	0.07
303	688506	百利天恒	64,215	18,881,136.45	0.07
304	300024	机器人	973,200	18,811,956.00	0.07
305	603650	彤程新材	191,640	18,776,887.20	0.07
306	002130	沃尔核材	979,000	18,561,840.00	0.07
307	002497	雅化集团	896,119	18,253,944.03	0.07
308	688676	金盘科技	214,535	18,158,242.40	0.07
309	300012	华测检测	1,306,700	18,110,862.00	0.07
310	688331	荣昌生物	138,484	18,038,925.84	0.07

311	001979	招商蛇口	2,800,200	18,005,286.00	0.07
312	000878	云南铜业	1,130,010	17,944,558.80	0.07
313	002432	九安医疗	253,700	17,931,516.00	0.07
314	300496	中科创达	287,244	17,748,806.76	0.07
315	002271	东方雨虹	1,482,412	17,596,230.44	0.07
316	300083	创世纪	1,291,800	17,594,316.00	0.07
317	002414	高德红外	1,325,271	17,573,093.46	0.07
318	000034	神州数码	631,700	17,529,675.00	0.07
319	300866	安克创新	166,860	17,436,870.00	0.07
320	601021	春秋航空	380,400	17,338,632.00	0.07
321	002444	巨星科技	556,140	17,295,954.00	0.07
322	300474	景嘉微	284,500	17,206,560.00	0.07
323	603979	金诚信	291,060	17,181,271.80	0.07
324	000733	振华科技	301,719	17,089,364.16	0.07
325	000661	长春高新	253,709	16,897,019.40	0.07
326	688266	泽璟制药	144,098	16,810,472.68	0.06
327	601319	中国人保	2,483,200	16,786,432.00	0.06
328	300763	锦浪科技	185,774	16,784,680.90	0.06
329	002756	永兴材料	293,120	16,602,316.80	0.06
330	600699	均胜电子	760,100	16,425,761.00	0.06
331	300748	金力永磁	531,754	16,404,610.90	0.06
332	601615	明阳智能	1,406,200	16,269,734.00	0.06
333	300073	当升科技	338,600	16,266,344.00	0.06
334	002078	太阳纸业	1,300,800	16,246,992.00	0.06
335	002025	航天电器	212,500	16,196,750.00	0.06
336	300142	沃森生物	1,240,589	16,115,251.11	0.06
337	601677	明泰铝业	966,900	16,050,540.00	0.06
338	300432	富临精工	797,100	16,013,739.00	0.06
339	603606	东方电缆	384,934	15,978,610.34	0.06
340	300919	中伟新材	364,780	15,959,125.00	0.06
341	000423	东阿阿胶	350,145	15,882,577.20	0.06
342	600039	四川路桥	2,030,800	15,880,856.00	0.06
343	603087	甘李药业	278,700	15,819,012.00	0.06
344	601800	中国交建	2,765,000	15,788,150.00	0.06
345	000002	万科 A	5,290,900	15,661,064.00	0.06
346	002252	上海莱士	3,585,909	15,562,845.06	0.06
347	600226	亨通股份	1,618,600	15,522,374.00	0.06
348	688599	天合光能	1,092,650	15,428,218.00	0.06
349	688608	恒玄科技	91,831	15,353,224.89	0.06
350	688169	石头科技	161,295	15,318,186.15	0.06
351	300724	捷佳伟创	221,000	15,287,600.00	0.06
352	688223	晶科能源	3,192,798	15,165,790.50	0.06
353	601633	长城汽车	970,200	14,640,318.00	0.06
354	002064	华峰化学	1,542,320	14,636,616.80	0.06

355	600588	用友网络	1,593,900	14,632,002.00	0.06
356	001965	招商公路	1,583,900	14,508,524.00	0.06
357	000786	北新建材	794,475	14,372,052.75	0.06
358	688390	固德威	132,315	14,357,500.65	0.06
359	002831	裕同科技	400,697	14,248,785.32	0.05
360	688180	君实生物	417,198	14,109,636.36	0.05
361	300677	英科医疗	356,363	13,958,738.71	0.05
362	002294	信立泰	432,800	13,801,992.00	0.05
363	000519	中兵红箭	648,700	13,668,109.00	0.05
364	603806	福斯特	811,300	13,621,727.00	0.05
365	601618	中国中冶	5,555,200	13,554,688.00	0.05
366	600177	雅戈尔	1,796,900	13,530,657.00	0.05
367	600516	方大炭素	2,190,800	13,517,236.00	0.05
368	688188	柏楚电子	126,155	13,460,738.50	0.05
369	688065	凯赛生物	280,461	13,420,058.85	0.05
370	601607	上海医药	868,900	13,381,060.00	0.05
371	302132	中航成飞	228,566	13,329,969.12	0.05
372	603260	合盛硅业	280,868	13,306,529.68	0.05
373	300972	万辰集团	76,700	13,300,547.00	0.05
374	002176	江特电机	1,324,800	13,261,248.00	0.05
375	000623	吉林敖东	741,112	13,139,915.76	0.05
376	300699	光威复材	452,200	12,955,530.00	0.05
377	000617	中油资本	1,963,362	12,938,555.58	0.05
378	300832	新产业	305,335	12,824,070.00	0.05
379	002085	万丰奥威	1,154,257	12,800,710.13	0.05
380	300558	贝达药业	196,300	12,773,241.00	0.05
381	002318	久立特材	530,700	12,683,730.00	0.05
382	300251	光线传媒	1,138,600	12,627,074.00	0.05
383	002459	晶澳科技	1,541,620	12,487,122.00	0.05
384	002065	东华软件	1,741,800	12,436,452.00	0.05
385	300342	天银机电	264,447	12,429,009.00	0.05
386	600499	科达制造	894,800	12,348,240.00	0.05
387	600085	同仁堂	533,100	12,319,941.00	0.05
388	002266	浙富控股	2,428,300	12,287,198.00	0.05
389	002044	美年健康	2,462,200	12,262,466.00	0.05
390	688472	阿特斯	1,132,795	12,256,841.90	0.05
391	605090	九丰能源	329,400	12,243,798.00	0.05
392	600515	海南机场	4,440,800	12,167,792.00	0.05
393	603596	伯特利	488,528	12,135,035.52	0.05
394	300409	道氏技术	606,700	12,091,531.00	0.05
395	000400	许继电气	554,000	12,021,800.00	0.05
396	688617	惠泰医疗	66,037	11,989,677.72	0.05
397	002223	鱼跃医疗	466,700	11,975,522.00	0.05
398	301550	斯菱智驱	130,381	11,920,734.83	0.05

399	688005	容百科技	389,072	11,905,603.20	0.05
400	002405	四维图新	1,838,500	11,895,095.00	0.05
401	300003	乐普医疗	1,002,700	11,881,995.00	0.05
402	000032	深桑达 A	471,582	11,765,970.90	0.05
403	000415	渤海租赁	2,883,800	11,737,066.00	0.05
404	600521	华海药业	815,000	11,736,000.00	0.05
405	601216	君正集团	2,628,000	11,720,880.00	0.05
406	600862	中航高科	649,000	11,701,470.00	0.05
407	000683	博源化工	2,020,245	11,636,611.20	0.04
408	000999	华润三九	516,528	11,616,714.72	0.04
409	000039	中集集团	1,431,150	11,606,626.50	0.04
410	603766	隆鑫通用	958,000	11,428,940.00	0.04
411	600803	新奥股份	722,100	11,409,180.00	0.04
412	600704	物产中大	2,406,400	11,358,208.00	0.04
413	600312	平高电气	631,900	11,159,354.00	0.04
414	600018	上港集团	2,352,400	11,103,328.00	0.04
415	603605	珀莱雅	184,800	11,073,216.00	0.04
416	000887	中鼎股份	612,269	10,953,492.41	0.04
417	600332	白云山	546,500	10,951,860.00	0.04
418	600765	中航重机	845,700	10,926,444.00	0.04
419	000967	盈峰环境	1,034,870	10,897,181.10	0.04
420	688116	天奈科技	285,039	10,888,489.80	0.04
421	300122	智飞生物	929,154	10,861,810.26	0.04
422	600166	福田汽车	3,685,400	10,724,514.00	0.04
423	600153	建发股份	1,351,500	10,717,395.00	0.04
424	000830	鲁西化工	887,700	10,652,400.00	0.04
425	002410	广联达	1,281,993	10,461,062.88	0.04
426	600323	瀚蓝环境	380,400	10,445,784.00	0.04
427	002007	华兰生物	850,695	10,369,972.05	0.04
428	300896	爱美客	117,704	10,263,788.80	0.04
429	601799	星宇股份	111,100	10,067,882.00	0.04
430	688114	华大智造	194,346	9,927,193.68	0.04
431	603568	伟明环保	637,224	9,800,505.12	0.04
432	600398	海澜之家	1,863,300	9,745,059.00	0.04
433	002603	以岭药业	648,300	9,724,500.00	0.04
434	688009	中国通号	2,008,964	9,562,668.64	0.04
435	600486	扬农化工	188,600	9,562,020.00	0.04
436	601000	唐山港	2,303,200	9,558,280.00	0.04
437	600529	山东药玻	515,900	9,518,355.00	0.04
438	002389	航天彩虹	535,500	9,515,835.00	0.04
439	601018	宁波港	3,017,800	9,506,070.00	0.04
440	600208	衢州发展	3,307,300	9,359,659.00	0.04
441	600316	洪都航空	334,600	9,348,724.00	0.04
442	000738	航发控制	510,674	9,340,227.46	0.04

443	600008	首创环保	3,423,700	9,312,464.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	2,658,309	9,224,332.23	0.04
445	600998	九州通	1,957,700	9,181,613.00	0.04
446	600170	上海建工	4,133,800	9,177,036.00	0.04
447	603486	科沃斯	180,100	9,140,075.00	0.04
448	600820	隧道股份	1,710,800	8,913,268.00	0.03
449	600161	天坛生物	767,766	8,890,730.28	0.03
450	300118	东方日升	708,600	8,822,070.00	0.03
451	603885	吉祥航空	849,900	8,745,471.00	0.03
452	688303	大全能源	500,475	8,723,279.25	0.03
453	601238	广汽集团	1,716,600	8,720,328.00	0.03
454	002607	中公教育	4,781,400	8,606,520.00	0.03
455	603816	顾家家居	383,400	8,572,824.00	0.03
456	603939	益丰药房	471,400	8,475,772.00	0.03
457	688166	博瑞医药	237,232	8,305,492.32	0.03
458	600763	通策医疗	243,450	8,248,086.00	0.03
459	601567	三星电气	546,200	8,160,228.00	0.03
460	600038	中直股份	318,800	8,062,452.00	0.03
461	603392	万泰生物	296,600	7,999,302.00	0.03
462	300676	华大基因	227,700	7,983,162.00	0.03
463	300049	福瑞医科	205,300	7,982,064.00	0.03
464	300573	兴齐眼药	194,515	7,928,431.40	0.03
465	601880	辽港股份	5,707,500	7,876,350.00	0.03
466	600511	国药股份	294,900	7,679,196.00	0.03
467	600535	天士力	579,000	7,660,170.00	0.03
468	600816	建元信托	3,054,700	7,453,468.00	0.03
469	300100	双林股份	266,900	7,414,482.00	0.03
470	002244	滨江集团	965,500	7,337,800.00	0.03
471	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.03
472	000833	粤桂股份	311,600	7,297,672.00	0.03
473	601155	新城控股	702,800	7,210,728.00	0.03
474	002120	韵达股份	1,123,000	7,142,280.00	0.03
475	688063	派能科技	133,565	7,115,007.55	0.03
476	300144	宋城演艺	1,221,600	7,097,496.00	0.03
477	000998	隆平高科	905,913	6,830,584.02	0.03
478	002544	普天科技	370,146	6,744,060.12	0.03
479	600064	南京高科	941,800	6,715,034.00	0.03
480	601866	中远海发	3,025,600	6,686,576.00	0.03
481	600635	大众公用	1,504,500	6,439,260.00	0.02
482	600754	锦江酒店	354,100	6,370,259.00	0.02
483	300457	赢合科技	300,900	6,342,972.00	0.02
484	000035	中国天楹	1,297,800	6,268,374.00	0.02
485	600655	豫园股份	1,512,700	6,217,197.00	0.02
486	603899	晨光股份	287,000	5,920,810.00	0.02

487	300601	康泰生物	520,200	5,899,068.00	0.02
488	600004	白云机场	801,300	5,817,438.00	0.02
489	600663	陆家嘴	917,800	5,763,784.00	0.02
490	600258	首旅酒店	520,900	5,688,228.00	0.02
491	600859	王府井	610,300	5,602,554.00	0.02
492	002091	江苏国泰	758,200	5,481,786.00	0.02
493	300070	碧水源	1,682,100	5,365,899.00	0.02
494	000069	华侨城 A	3,118,084	5,113,657.76	0.02
495	600864	哈投股份	970,600	5,037,414.00	0.02
496	301078	孩子王	685,500	4,633,980.00	0.02
497	002292	奥飞娱乐	687,100	4,507,376.00	0.02
498	603833	欧派家居	141,900	4,272,609.00	0.02
499	002891	中宠股份	149,932	4,006,183.04	0.02
500	600325	华发股份	1,706,100	3,941,091.00	0.02
501	002572	索菲亚	445,800	3,254,340.00	0.01
502	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.01
503	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.01
504	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
505	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
506	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.00
507	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
508	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
509	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
510	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
511	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
512	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
513	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
514	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
515	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
516	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
517	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
518	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
519	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
520	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
521	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
522	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
523	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
524	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
525	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
526	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
527	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
528	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
529	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
530	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00

531	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
532	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
533	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
534	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
535	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
536	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
537	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
538	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
539	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
540	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
541	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
542	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
543	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	547,885,038.96	1.62
2	601318	中国平安	274,131,494.27	0.81
3	688041	海光信息	261,936,773.46	0.77
4	601899	紫金矿业	249,510,511.80	0.74
5	600036	招商银行	217,635,315.73	0.64
6	688012	中微公司	172,331,834.87	0.51
7	688008	澜起科技	168,373,324.19	0.50
8	603986	兆易创新	147,432,004.10	0.44
9	688981	中芯国际	146,765,099.57	0.43
10	600900	长江电力	145,745,010.36	0.43
11	601166	兴业银行	144,776,197.00	0.43
12	300750	宁德时代	131,341,601.91	0.39
13	601088	中国神华	123,503,482.24	0.36
14	600030	中信证券	118,698,072.05	0.35
15	688498	源杰科技	115,610,952.50	0.34
16	600276	恒瑞医药	110,842,638.16	0.33
17	601398	工商银行	107,987,535.00	0.32
18	301308	江波龙	107,681,617.17	0.32
19	600183	生益科技	106,366,513.81	0.31
20	002371	北方华创	102,411,133.44	0.30

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	901,316,989.28	2.66
2	601318	中国平安	545,313,191.52	1.61
3	601899	紫金矿业	489,860,116.52	1.45
4	600036	招商银行	413,564,980.88	1.22
5	688041	海光信息	356,366,884.14	1.05
6	600900	长江电力	276,799,763.98	0.82
7	601166	兴业银行	274,971,245.84	0.81
8	688008	澜起科技	240,302,052.97	0.71
9	688981	中芯国际	235,162,801.56	0.69
10	603986	兆易创新	228,747,448.20	0.68
11	600030	中信证券	225,236,742.51	0.67
12	600276	恒瑞医药	215,083,484.79	0.64
13	601398	工商银行	204,546,684.75	0.60
14	601088	中国神华	201,700,559.76	0.60
15	603259	药明康德	198,352,441.54	0.59
16	601211	国泰海通	175,228,912.41	0.52
17	688012	中微公司	170,127,549.49	0.50
18	601288	农业银行	166,523,275.22	0.49
19	688256	寒武纪	164,571,784.46	0.49
20	603993	洛阳钼业	159,994,012.15	0.47

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,831,567,964.29
卖出股票收入（成交）总额	16,419,034,353.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,818,072.35	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,818,072.35	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111025	圣泉转债	15,570	1,557,017.07	0.01
2	113704	春风转债	12,610	1,261,055.28	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	22,913,072.59
2	应收清算款	89,976,328.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	112,949,893.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		交通银行股份有限公司 一易方达中证 A500 交 易型开放式指数证券投 资基金联接基金	
		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
25,258	749,785.8 2	18,002,523, 377.00	95.06%	935,566,90 2.00	4.94%	4,680,781,1 71.00	24.72%

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。

8.2 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	13,100.00	0.0001%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 12 日）基金份额总额	2,000,090,279.00
本报告期期初基金份额总额	27,875,090,279.00
本报告期基金总申购份额	9,303,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,240,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,938,090,279.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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	

长江证券	1	2,966,212,935.08	10.99%	296,629.56	10.99%	-
广发证券	2	1,152,756,200.30	4.27%	115,287.36	4.27%	-
国泰海通	2	10,534,225,259.23	39.05%	1,053,488.42	39.05%	-
国投证券	2	10,932,832,084.88	40.52%	1,093,367.68	40.52%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	838,845,954.36	3.11%	83,888.25	3.11%	-
中信证券	2	554,303,720.96	2.05%	55,433.02	2.05%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

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

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 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单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	140,506,064.39	79.20%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	36,892,010.27	20.80%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2026-01-22
3	易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	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	2026-02-05
4	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
5	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
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配中国神华（601088）非公开发行 A 股的公告	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	2026-04-02
7	易方达基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	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	2026-04-09
8	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
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配卓胜微（300782）非公开发行 A 股的公告	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	2026-04-24
10	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2026-05-16
12	易方达基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	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	2026-06-15
13	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	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	2026-06-15

14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配拓荆科技（688072）非公开发行 A 股的公告	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	2026-06-25
----	---	----------------------------	------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期 初 份 额	申 购 份 额	赎 回 份 额	持有份 额	份额占 比
交通银行股份有限公司－易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2026 年 03 月 19 日~2026 年 03 月 23 日,2026 年 03 月 30 日~2026 年 06 月 30 日	3,942,028,897.00	1,605,818,374.00	867,066,100.00	4,680,781,171.00	24.72 %
产品特有风险							
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六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 A500 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广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