

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联
接基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 期末投资目标基金明细	44
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
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	56
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	56

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.13	投资组合报告附注	56
§ 8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9	开放式基金份额变动	59
§ 10	重大事件揭示	59
10.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8	其他重大事件	64
§ 11	备查文件目录	64
11.1	备查文件目录	64
11.2	存放地点	64
11.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金 联接基金	
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式联接	
基金主代码	110020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,543,276,458.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式 联接 A	易方达沪深 300ETF 发起 式联接 C
下属分级基金的交易代码	110020	007339
报告期末下属分级基金的份额总额	7,697,637,396.62 份	2,845,639,061.99 份

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

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

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

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	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	北京市西城区金融大街25号

	188号6层	
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼； 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	510620; 519031	100033
法定代表人	刘晓艳	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州 银行大厦40-43楼; 广东省珠海市横琴新区 荣粤道188号6层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）	
	易方达沪深300ETF发起式联接A	易方达沪深300ETF发起式联接C
本期已实现收益	-160,509,771.50	-81,439,116.83
本期利润	191,754,252.69	61,806,473.37
加权平均基金份额本期利润	0.0260	0.0200
本期加权平均净值利润率	1.91%	1.49%
本期基金份额净值增长率	1.74%	1.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	易方达沪深300ETF发起式联接A	易方达沪深300ETF发起式联接C
期末可供分配利润	2,748,991,650.47	976,330,487.04

期末可供分配基金份额利润	0.3571	0.3431
期末基金资产净值	10,446,629,047.09	3,821,969,549.03
期末基金份额净值	1.3571	1.3431
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
基金份额累计净值增长率	35.71%	-0.30%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.46%	0.45%	-3.14%	0.46%	0.68%	-0.01%
过去三个月	-1.06%	0.71%	-2.03%	0.72%	0.97%	-0.01%
过去六个月	1.74%	0.85%	0.88%	0.85%	0.86%	0.00%
过去一年	-7.49%	0.83%	-9.38%	0.83%	1.89%	0.00%
过去三年	-27.55%	0.98%	-32.19%	0.99%	4.64%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.71%	1.28%	12.90%	1.32%	22.81%	-0.04%

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.47%	0.45%	-3.14%	0.46%	0.67%	-0.01%
过去三个月	-1.10%	0.71%	-2.03%	0.72%	0.93%	-0.01%
过去六个月	1.64%	0.85%	0.88%	0.85%	0.76%	0.00%
过去一年	-7.67%	0.83%	-9.38%	0.83%	1.71%	0.00%
过去三年	-27.98%	0.98%	-32.19%	0.99%	4.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-0.30%	1.09%	-11.17%	1.10%	10.87%	-0.01%

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

的比较

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

(2009 年 8 月 26 日至 2024 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

(2019 年 4 月 26 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1.自 2019 年 4 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 35.71%，同期业绩比较基准收益率为 12.90%；C 类基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为-11.17%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余	本基金的基金经理,易方达沪深 300	2016-	-	19 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

海燕	医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证军工 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员	04-16			任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证光伏产业指数发起式 (自 2023 年 04 月 11 日至 2024 年 05 月 06 日)、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 100ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接的基金经理，指数研究部总经理	2022-12-15	-	15 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。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 31 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，5 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2024 年上半年，外部环境复杂性严峻性不确定性明显上升、国内结构调整持续深化等带来新挑

战，但宏观政策效应持续释放、外需有所回暖、新质生产力加速发展等因素也形成新支撑，整体来看上半年国民经济延续恢复向好态势，生产稳定增长，需求持续恢复，整体经济运行平稳。上半年我国国内生产总值 61.7 万亿元，按不变价格计算，同比增长 5.0%。

资本市场方面，报告期内 A 股市场展现出了宽幅震荡的特点，其波动率持续保持在较高的水平。2024 年伊始，A 股市场表现相对偏弱，一方面由于外部环境的不确定性上升，国际地缘局势波动加大；另一方面国内物价、房价下行压力显性化，叠加资金与投资者情绪负反馈现象的出现，导致 A 股市场加速调整；随着国内稳增长、稳预期、稳市场政策举措积极出台并落地，特别是房地产领域支持举措密集出台，基本面的改善预期成为影响中国资产表现的关键变量。受国内宏观经济数据边际改善，以及新“国九条”发布，要求提高上市公司质量，增强稳定回报能力等偏积极因素的影响，投资者风险偏好持续回升，进而推动了 A 股市场的企稳回升。自五月下旬以来由于公布的宏观数据显示经济增长修复仍需政策支持，整体经济复苏的力度并不强，受此影响 A 股市场在回升过程中出现了波折。

沪深 300 指数作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，聚集 A 股最核心的权益资产，涵盖了各行业龙头，指数表现跟中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关，与 A 股大盘走势基本保持一致。报告期内指数中的银行、公用事业、有色金属、电子、家用电器等行业的成份股涨幅居前，对沪深 300 指数收益贡献较大，而食品饮料、医药生物、计算机、非银金融等行业的成份股表现落后，拖累了指数的表现。报告期内沪深 300 指数上涨 0.89%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.3571 元，本报告期份额净值增长率为 1.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；C 类基金份额净值为 1.3431 元，本报告期份额净值增长率为 1.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。年化跟踪误差 0.37%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，外部环境的不稳定性不确定性在上升，国内经济发展依然面临一些挑战，但在一系列稳增长、扩大内需的宏观政策支持下，我国经济发展面临的有利条件强于不利因素，经济长期回升向好的态势将不断得到巩固和增强。我国经济发展仍具有良好支撑和有利条件，市场空间广阔，产业体系完备，物质技术基础雄厚，人才红利不断增强，转型升级持续推进，改革开放不断深化，宏观政策空间较大，经济长期向好的基本趋势没有改变。影响后续 A 股市场整体表现的主要矛

盾还是对中国经济基本面预期，市场对稳增长政策的关注度持续提升，政策也将是未来影响股市较为关键性的因素。党的三中全会已胜利召开，提出了“落实好宏观政策，积极扩大国内需求”的要求，并部署了以进一步全面深化改革来推进中国式现代化。本届三中全会以经济体制改革为牵引，重点部署经济、科技、教育、民生等各领域改革任务，有望激发全社会内生动力和创新活力。中长期改革红利结合我国经济的高质量建设，是中国资本市场稳健发展的基石，本届三中全会有望通过改革预期提振市场风险偏好，从中长期维度树立基本面信心。当前 A 股市场估值仍处于历史底部区域，与全球市场比较处于明显偏低水平，纵向及横向对比均具备较好的投资吸引力。

指数的长期收益表现取决于其成份股盈利的长期增长情况，沪深 300 指数作为 A 股市场的核心宽基指数，涵盖了中国经济中主要行业的龙头企业，长期来看这些企业的盈利会随着整体经济的增长而相应增长。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的各行业龙头优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，沪深 300 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	513,756,144.28	342,624,493.72
结算备付金		14,473,918.64	11,665,011.17
存出保证金		8,555,341.81	7,482,210.83
交易性金融资产	6.4.7.2	13,770,264,427.69	13,475,650,344.13
其中：股票投资		123,883,306.71	139,898,606.77
基金投资		13,339,379,615.51	12,929,291,833.74
债券投资		307,001,505.47	406,459,903.62
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		-	65,211.74
应收股利		-	-
应收申购款		25,805,924.46	104,375,880.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	1,634,442.50	3,824,827.76
资产总计		14,334,490,199.38	13,945,687,979.97
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		50,809,892.58	73,909,544.35
应付赎回款		14,165,153.70	30,404,185.48
应付管理人报酬		114,928.11	113,450.90
应付托管费		38,309.38	37,816.98
应付销售服务费		629,561.46	795,534.80
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	133,758.03	478,039.46
负债合计		65,891,603.26	105,738,571.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	10,543,276,458.61	10,410,179,339.34
未分配利润	6.4.7.8	3,725,322,137.51	3,429,770,068.66
净资产合计		14,268,598,596.12	13,839,949,408.00
负债和净资产总计		14,334,490,199.38	13,945,687,979.97

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.3571 元，C 类基金份额净值 1.3431 元；基金份额总额 10,543,276,458.61 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 7,697,637,396.62 份，C 类基金份额总额 2,845,639,061.99 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		258,716,381.92	37,853,568.15
1.利息收入		955,841.17	943,652.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	955,841.17	943,652.97
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）		-238,956,948.29	17,885,556.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,889,173.72	124,698.23
基金投资收益	6.4.7.11	-253,528,922.79	14,111,764.09
债券投资收益	6.4.7.12	3,498,381.85	2,004,878.02
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	1,676,276.99	374,900.85
股利收益	6.4.7.15	1,508,141.94	1,269,315.30
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	495,509,614.39	18,021,572.41

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,207,874.65	1,002,786.28
减：二、营业总支出		5,155,655.86	3,862,898.21
1. 管理人报酬		691,188.71	573,229.29
2. 托管费		230,396.26	191,076.41
3. 销售服务费		4,128,320.45	2,937,322.14
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		-	56,605.03
8. 其他费用	6.4.7.19	105,750.44	104,665.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		253,560,726.06	33,990,669.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		253,560,726.06	33,990,669.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		253,560,726.06	33,990,669.94

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,410,179,339.34	3,429,770,068.66	13,839,949,408.00
二、本期期初净资产	10,410,179,339.34	3,429,770,068.66	13,839,949,408.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	133,097,119.27	295,552,068.85	428,649,188.12
（一）、综合收益总额	-	253,560,726.06	253,560,726.06
（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）	133,097,119.27	41,991,342.79	175,088,462.06

其中：1.基金申购款	4,246,043,888.75	1,412,385,794.51	5,658,429,683.26
2.基金赎回款	-4,112,946,769.48	-1,370,394,451.72	-5,483,341,221.20
(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	10,543,276,458.61	3,725,322,137.51	14,268,598,596.12
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,809,708,065.44	3,120,368,100.66	9,930,076,166.10
二、本期期初净资产	6,809,708,065.44	3,120,368,100.66	9,930,076,166.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	415,879,687.72	233,437,666.19	649,317,353.91
(一)、综合收益总额	-	33,990,669.94	33,990,669.94
(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)	415,879,687.72	199,446,996.25	615,326,683.97
其中：1.基金申购款	2,733,827,833.59	1,380,033,330.44	4,113,861,164.03
2.基金赎回款	-2,317,948,145.87	-1,180,586,334.19	-3,498,534,480.06
(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	7,225,587,753.16	3,353,805,766.85	10,579,393,520.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原名易方达沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]第 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,539,280.61 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	513,756,144.28
等于：本金	513,714,480.94
加：应计利息	41,663.34
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	513,756,144.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	139,455,450.51	-	123,883,306.71	-15,572,143.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	301,387,970.00	6,322,505.47	307,001,505.47
	合计	301,387,970.00	6,322,505.47	307,001,505.47
				-708,970.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	14,404,997,113.75	-	13,339,379,615.51	-1,065,617,498.24
其他	-	-	-	-
合计	14,845,840,534.26	6,322,505.47	13,770,264,427.69	-1,081,898,612.04

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 2024 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	65,667,240.00	-	-	-
IF2408	12,307,980.00	-	-	-
IF2409	53,359,260.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	65,667,240.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2408	IF2408	12	12,338,640.00	30,660.00
IF2409	IF2409	51	52,381,080.00	-978,180.00
合计	-	-	-	-947,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-947,520.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	1,634,442.50
待摊费用	-
合计	1,634,442.50

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,074.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,120.85
其中：交易所市场	39,120.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	133,758.03

6.4.7.7 实收基金

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,722,363,370.84	6,722,363,370.84
本期申购	1,768,857,547.93	1,768,857,547.93
本期赎回（以“-”号填列）	-793,583,522.15	-793,583,522.15
本期末	7,697,637,396.62	7,697,637,396.62

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,687,815,968.50	3,687,815,968.50
本期申购	2,477,186,340.82	2,477,186,340.82
本期赎回（以“-”号填列）	-3,319,363,247.33	-3,319,363,247.33
本期末	2,845,639,061.99	2,845,639,061.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,379,554,540.75	-3,135,087,366.74	2,244,467,174.01
本期期初	5,379,554,540.75	-3,135,087,366.74	2,244,467,174.01
本期利润	-160,509,771.50	352,264,024.19	191,754,252.69
本期基金份额交易产生的变动数	766,737,842.82	-453,967,619.05	312,770,223.77
其中：基金申购款	1,386,599,571.43	-786,433,964.31	600,165,607.12
基金赎回款	-619,861,728.61	332,466,345.26	-287,395,383.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,985,782,612.07	-3,236,790,961.60	2,748,991,650.47

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,893,450,329.62	-1,708,147,434.97	1,185,302,894.65
本期期初	2,893,450,329.62	-1,708,147,434.97	1,185,302,894.65
本期利润	-81,439,116.83	143,245,590.20	61,806,473.37
本期基金份额交易产生的变动数	-646,926,614.37	376,147,733.39	-270,778,880.98
其中：基金申购款	1,901,223,299.95	-1,089,003,112.56	812,220,187.39
基金赎回款	-2,548,149,914.32	1,465,150,845.95	-1,082,999,068.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,165,084,598.42	-1,188,754,111.38	976,330,487.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

活期存款利息收入	806,748.22
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	142,261.34
其他	6,831.61
合计	955,841.17

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-700,056.63
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	8,589,230.35
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,889,173.72

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	43,843,577.75
减：卖出股票成本总额	44,277,185.23
减：交易费用	266,449.15
买卖股票差价收入	-700,056.63

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	2,197,499,400.00
减：现金支付申购款总额	770,847,423.13
减：申购股票成本总额	1,418,062,746.52
减：交易费用	-
申购差价收入	8,589,230.35

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	2,035,986,186.98
减：卖出/赎回基金成本总额	2,289,404,588.38
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-

减：交易费用	110,521.39
基金投资收益	-253,528,922.79

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,224,601.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-726,220.00
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	3,498,381.85

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	103,300,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,726,220.00
减：应计利息总额	3,300,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-726,220.00

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	1,676,276.99

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,508,141.94

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,508,141.94

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	497,019,454.39
——股票投资	-1,483,105.36
——债券投资	343,220.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	498,159,339.75
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,509,840.00
——权证投资	-
——期货投资	-1,509,840.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	495,509,614.39

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,207,874.65
合计	1,207,874.65

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	7,587.32
其他	600.00
合计	105,750.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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	-	-	137,791,479.30	7.21%

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
-------	----

	2024年1月1日至2024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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	82,675.38	5.52%	-	-

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。本报告期及上年度可比期间该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

2.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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	691,188.71	573,229.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,713,943.50	2,661,159.33
应支付基金管理人的净管理费	-3,022,754.79	-2,087,930.04

注：1.本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理人的管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2.对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	230,396.26	191,076.41

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,296,740.47	1,296,740.47
广发证券	-	4,538.36	4,538.36
合计	-	1,301,278.83	1,301,278.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达沪深300ETF 发起式联接A	易方达沪深300ETF发起式联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	691,061.27	691,061.27

广发证券	-	2,773.75	2,773.75
合计	-	693,835.02	693,835.02

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

无。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	513,756,144.28	806,748.22	526,780,820.54	796,505.39

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024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
万联证券股份有限公司	837023	芭薇股份	新股网上发行	200	1,154.00
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 7,822,306,700 份和 7,722,668,638 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 9.49% 和 26.50%。

6.4.11 利润分配情况

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
30158	诺瓦	2024-0	6个月	新股	126.89	188.01	1,244	87,680	233,88	-

9	星云	2-01		流通受限				.99	4.44	
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月以内	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月以内	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	307,001,505.47	406,459,903.62
合计	307,001,505.47	406,459,903.62

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2024年6月30日	2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2024年6月30日					
资产					
货币资金	513,756,144.28	-	-	-	513,756,144.28
结算备付金	14,473,918.64	-	-	-	14,473,918.64
存出保证金	8,555,341.81	-	-	-	8,555,341.81
交易性金融资产	307,001,505.47	-	-	13,463,262,922.22	13,770,264,427.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	25,805,924.46	25,805,924.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,634,442.50	1,634,442.50
资产总计	843,786,910.20	-	-	13,490,703,289.18	14,334,490,199.38
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	-	-	-	50,809,892.58	50,809,892.58
应付赎回款	-	-	-	14,165,153.70	14,165,153.70
应付管理人报酬	-	-	-	114,928.11	114,928.11
应付托管费	-	-	-	38,309.38	38,309.38
应付销售服务费	-	-	-	629,561.46	629,561.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	133,758.03	133,758.03
负债总计	-	-	-	65,891,603.26	65,891,603.26
利率敏感度缺口	843,786,910.20	-	-	13,424,811,685.92	14,268,598,596.12
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	342,624,493.72	-	-	-	342,624,493.72
结算备付金	11,665,011.17	-	-	-	11,665,011.17
存出保证金	7,482,210.83	-	-	-	7,482,210.83
交易性金融资产	406,459,903.62	-	-	13,069,190,440.51	13,475,650,344.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	65,211.74	65,211.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	104,375,880.62	104,375,880.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	3,824,827.76	3,824,827.76
资产总计	768,231,619.34	-	-	13,177,456,360.63	13,945,687,979.97
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	-	-	-	73,909,544.35	73,909,544.35
应付赎回款	-	-	-	30,404,185.48	30,404,185.48
应付管理人报酬	-	-	-	113,450.90	113,450.90
应付托管费	-	-	-	37,816.98	37,816.98
应付销售服务费	-	-	-	795,534.80	795,534.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	478,039.46	478,039.46
负债总计	-	-	-	105,738,571.97	105,738,571.97
利率敏感度缺口	768,231,619.34	-	-	13,071,717,788.66	13,839,949,407

				6	8.00
--	--	--	--	---	------

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	162,369.87	546,630.42
2.市场利率上升 25 个基点	-162,156.65	-544,761.16	

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。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	123,883,306.71	0.87	139,898,606.77	1.01
交易性金融资产—基金投资	13,339,379,615.51	93.49	12,929,291,833.74	93.42
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	13,463,262,922.22	94.36	13,069,190,440.51	94.43
----	-------------------	-------	-------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	709,532,120.74	673,210,754.04
	2.业绩比较基准下降 5%	-709,532,120.74	-673,210,754.04

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	13,462,721,234.28
第二层次	307,047,116.58
第三层次	496,076.83
合计	13,770,264,427.69

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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	123,883,306.71	0.86
	其中：股票	123,883,306.71	0.86
2	基金投资	13,339,379,615.51	93.06
3	固定收益投资	307,001,505.47	2.14
	其中：债券	307,001,505.47	2.14
	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	528,230,062.92	3.69
8	其他各项资产	35,995,708.77	0.25
9	合计	14,334,490,199.38	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）、发起式	易方达基金管理有限公司	13,339,379,615.51	93.49

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,297,026.00	0.02
B	采矿业	5,913,765.00	0.04
C	制造业	72,570,793.62	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,707,605.12	0.03
E	建筑业	2,130,379.76	0.01
F	批发和零售业	367,731.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	4,031,976.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,284,722.83	0.04
J	金融业	22,884,578.38	0.16
K	房地产业	1,257,611.00	0.01
L	租赁和商务服务业	954,165.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	972,149.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	490,726.32	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	123,883,306.71	0.87

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,400	4,989,126.00	0.03
2	300750	宁德时代	27,120	4,882,413.60	0.03
3	000333	美的集团	50,100	3,231,450.00	0.02
4	000858	五粮液	19,900	2,547,996.00	0.02
5	601318	中国平安	57,500	2,378,200.00	0.02
6	002594	比亚迪	9,400	2,352,350.00	0.02
7	600036	招商银行	66,000	2,256,540.00	0.02
8	002475	立讯精密	50,900	2,000,879.00	0.01
9	600900	长江电力	65,336	1,889,517.12	0.01
10	000651	格力电器	45,900	1,800,198.00	0.01
11	300760	迈瑞医疗	5,700	1,658,187.00	0.01
12	000725	京东方 A	380,600	1,556,654.00	0.01
13	601899	紫金矿业	87,900	1,544,403.00	0.01
14	601166	兴业银行	77,600	1,367,312.00	0.01
15	300059	东方财富	129,040	1,362,662.40	0.01
16	002714	牧原股份	28,000	1,220,800.00	0.01
17	002415	海康威视	38,100	1,177,671.00	0.01
18	601328	交通银行	146,600	1,095,102.00	0.01
19	000568	泸州老窖	7,600	1,090,524.00	0.01
20	300498	温氏股份	54,300	1,076,226.00	0.01
21	601398	工商银行	186,900	1,065,330.00	0.01
22	300124	汇川技术	20,700	1,061,910.00	0.01
23	000001	平安银行	98,800	1,002,820.00	0.01
24	000792	盐湖股份	55,400	966,730.00	0.01
25	600030	中信证券	52,100	949,783.00	0.01
26	300308	中际旭创	6,840	943,099.20	0.01
27	300274	阳光电源	15,020	931,690.60	0.01
28	600276	恒瑞医药	23,939	920,693.94	0.01
29	000063	中兴通讯	32,600	911,822.00	0.01
30	000338	潍柴动力	55,300	898,072.00	0.01
31	002371	北方华创	2,800	895,692.00	0.01
32	002352	顺丰控股	25,000	892,250.00	0.01
33	002142	宁波银行	40,200	886,812.00	0.01
34	600887	伊利股份	34,093	880,963.12	0.01
35	600309	万华化学	10,112	817,656.32	0.01
36	002230	科大讯飞	19,000	816,050.00	0.01
37	601088	中国神华	17,700	785,349.00	0.01

38	601288	农业银行	170,200	742,072.00	0.01
39	000100	TCL 科技	166,350	718,632.00	0.01
40	601816	京沪高铁	131,000	703,470.00	0.00
41	000625	长安汽车	50,600	679,558.00	0.00
42	601857	中国石油	60,500	624,360.00	0.00
43	002027	分众传媒	102,800	622,968.00	0.00
44	601668	中国建筑	111,000	589,410.00	0.00
45	601138	工业富联	21,300	583,620.00	0.00
46	600919	江苏银行	78,300	581,769.00	0.00
47	600690	海尔智家	20,300	576,114.00	0.00
48	600809	山西汾酒	2,700	569,376.00	0.00
49	600406	国电南瑞	21,560	538,137.60	0.00
50	601985	中国核电	50,400	537,264.00	0.00
51	601225	陕西煤业	20,800	536,016.00	0.00
52	603259	药明康德	13,600	532,984.00	0.00
53	601919	中远海控	34,100	528,209.00	0.00
54	600941	中国移动	4,900	526,750.00	0.00
55	000938	紫光股份	23,500	525,225.00	0.00
56	600028	中国石化	83,000	524,560.00	0.00
57	600031	三一重工	31,730	523,545.00	0.00
58	601988	中国银行	112,400	519,288.00	0.00
59	002304	洋河股份	6,400	516,736.00	0.00
60	600000	浦发银行	62,700	516,021.00	0.00
61	601601	中国太保	18,343	511,035.98	0.00
62	601728	中国电信	82,811	509,287.65	0.00
63	300014	亿纬锂能	12,600	502,992.00	0.00
64	300015	爱尔眼科	47,551	490,726.32	0.00
65	600150	中国船舶	12,000	488,520.00	0.00
66	601766	中国中车	65,000	488,150.00	0.00
67	688981	中芯国际	10,518	484,879.80	0.00
68	000002	万科 A	69,500	481,635.00	0.00
69	600050	中国联通	101,800	478,460.00	0.00
70	002241	歌尔股份	24,500	477,995.00	0.00
71	603501	韦尔股份	4,700	467,039.00	0.00
72	601169	北京银行	79,000	461,360.00	0.00
73	601012	隆基绿能	32,400	454,248.00	0.00
74	600837	海通证券	51,500	440,840.00	0.00
75	002050	三花智控	23,000	438,840.00	0.00
76	600016	民生银行	113,500	430,165.00	0.00
77	002179	中航光电	11,010	418,930.50	0.00
78	600660	福耀玻璃	8,636	413,664.40	0.00
79	002252	上海莱士	52,200	408,204.00	0.00
80	300408	三环集团	13,900	405,741.00	0.00
81	002311	海大集团	8,600	404,630.00	0.00

82	000538	云南白药	7,900	404,085.00	0.00
83	000596	古井贡酒	1,900	401,033.00	0.00
84	000166	申万宏源	91,800	395,658.00	0.00
85	000425	徐工机械	54,600	390,390.00	0.00
86	000977	浪潮信息	10,700	389,159.00	0.00
87	000157	中联重科	50,600	388,608.00	0.00
88	601229	上海银行	53,100	385,506.00	0.00
89	600938	中国海油	11,400	376,200.00	0.00
90	600089	特变电工	27,040	375,044.80	0.00
91	002049	紫光国微	7,100	373,460.00	0.00
92	300433	蓝思科技	20,400	372,300.00	0.00
93	003816	中国广核	80,200	371,326.00	0.00
94	688012	中微公司	2,558	361,343.08	0.00
95	601390	中国中铁	54,900	357,948.00	0.00
96	603986	兆易创新	3,700	353,794.00	0.00
97	600436	片仔癀	1,700	352,189.00	0.00
98	688041	海光信息	4,955	348,435.60	0.00
99	300122	智飞生物	12,350	346,170.50	0.00
100	000768	中航西飞	14,300	343,629.00	0.00
101	600104	上汽集团	24,700	342,342.00	0.00
102	601688	华泰证券	27,300	338,247.00	0.00
103	601006	大秦铁路	46,900	335,804.00	0.00
104	600048	保利发展	38,300	335,508.00	0.00
105	002460	赣锋锂业	11,700	335,205.00	0.00
106	600905	三峡能源	76,400	333,104.00	0.00
107	601888	中国中免	5,300	331,197.00	0.00
108	601211	国泰君安	24,200	327,910.00	0.00
109	603019	中科曙光	7,900	327,850.00	0.00
110	001979	招商蛇口	37,000	325,230.00	0.00
111	601600	中国铝业	42,400	323,512.00	0.00
112	603993	洛阳钼业	37,800	321,300.00	0.00
113	000661	长春高新	3,500	321,195.00	0.00
114	002466	天齐锂业	10,700	320,037.00	0.00
115	600019	宝钢股份	47,200	313,880.00	0.00
116	601818	光大银行	99,000	313,830.00	0.00
117	002648	卫星化学	17,300	311,054.00	0.00
118	603288	海天味业	8,998	310,161.06	0.00
119	000786	北新建材	10,400	308,464.00	0.00
120	002001	新和成	16,000	307,200.00	0.00
121	300896	爱美客	1,780	306,338.00	0.00
122	600585	海螺水泥	12,900	304,311.00	0.00
123	300782	卓胜微	3,900	303,186.00	0.00
124	601658	邮储银行	59,200	300,144.00	0.00
125	601989	中国重工	60,800	299,744.00	0.00

126	002493	荣盛石化	31,000	299,460.00	0.00
127	688111	金山办公	1,315	299,162.50	0.00
128	002601	龙佰集团	16,100	298,977.00	0.00
129	300661	圣邦股份	3,530	292,213.40	0.00
130	600886	国投电力	16,000	291,840.00	0.00
131	601009	南京银行	27,700	287,803.00	0.00
132	002236	大华股份	18,600	287,556.00	0.00
133	002938	鹏鼎控股	7,200	286,272.00	0.00
134	600795	国电电力	47,700	285,723.00	0.00
135	002129	TCL 中环	33,000	285,450.00	0.00
136	601628	中国人寿	9,000	279,450.00	0.00
137	688008	澜起科技	4,867	278,197.72	0.00
138	600438	通威股份	14,504	277,171.44	0.00
139	600999	招商证券	19,900	276,809.00	0.00
140	688271	联影医疗	2,464	270,300.80	0.00
141	002180	纳思达	10,200	269,484.00	0.00
142	300347	泰格医药	5,500	267,300.00	0.00
143	600547	山东黄金	9,700	265,586.00	0.00
144	600893	航发动力	7,200	263,160.00	0.00
145	000895	双汇发展	10,900	259,093.00	0.00
146	601669	中国电建	46,000	257,140.00	0.00
147	002736	国信证券	29,500	256,355.00	0.00
148	002271	东方雨虹	20,600	254,204.00	0.00
149	000963	华东医药	9,100	253,071.00	0.00
150	002920	德赛西威	2,900	252,561.00	0.00
151	600674	川投能源	13,400	251,250.00	0.00
152	300033	同花顺	2,400	248,880.00	0.00
153	600926	杭州银行	19,000	247,950.00	0.00
154	600584	长电科技	7,700	244,167.00	0.00
155	000983	山西焦煤	23,500	242,285.00	0.00
156	688256	寒武纪	1,206	239,596.02	0.00
157	600760	中航沈飞	5,911	237,031.10	0.00
158	600111	北方稀土	13,600	233,920.00	0.00
159	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
160	002916	深南电路	2,200	232,694.00	0.00
161	600489	中金黄金	15,600	230,880.00	0.00
162	600011	华能国际	23,600	227,032.00	0.00
163	601916	浙商银行	80,500	222,180.00	0.00
164	600015	华夏银行	34,100	218,240.00	0.00
165	600009	上海机场	6,700	216,075.00	0.00
166	000301	东方盛虹	27,100	215,987.00	0.00
167	600958	东方证券	28,200	214,320.00	0.00
168	000876	新希望	23,400	213,876.00	0.00
169	600426	华鲁恒升	8,000	213,120.00	0.00

170	002074	国轩高科	11,100	212,565.00	0.00
171	601186	中国铁建	24,700	211,679.00	0.00
172	002709	天赐材料	11,900	208,964.00	0.00
173	002555	三七互娱	15,900	207,495.00	0.00
174	600989	宝丰能源	11,800	204,494.00	0.00
175	601901	方正证券	26,400	204,072.00	0.00
176	300316	晶盛机电	6,900	198,237.00	0.00
177	000408	藏格矿业	8,200	197,374.00	0.00
178	002812	恩捷股份	6,200	196,230.00	0.00
179	688036	传音控股	2,540	194,411.60	0.00
180	300628	亿联网络	5,280	194,145.60	0.00
181	300751	迈为股份	1,620	193,557.60	0.00
182	000807	云铝股份	14,300	193,193.00	0.00
183	300418	昆仑万维	5,900	190,216.00	0.00
184	002459	晶澳科技	16,980	190,176.00	0.00
185	300450	先导智能	11,400	189,582.00	0.00
186	300142	沃森生物	16,600	188,908.00	0.00
187	601377	兴业证券	36,900	186,714.00	0.00
188	601111	中国国航	24,900	183,762.00	0.00
189	600115	中国东航	45,700	183,257.00	0.00
190	002007	华兰生物	11,400	180,006.00	0.00
191	000999	华润三九	4,070	173,300.60	0.00
192	300496	中科创达	3,800	173,242.00	0.00
193	300999	金龙鱼	6,300	172,305.00	0.00
194	601633	长城汽车	6,800	172,040.00	0.00
195	300759	康龙化成	9,250	171,865.00	0.00
196	000733	振华科技	4,100	170,273.00	0.00
197	600029	南方航空	28,900	170,221.00	0.00
198	601800	中国交建	19,000	169,860.00	0.00
199	600010	包钢股份	121,100	169,540.00	0.00
200	600188	兖矿能源	7,400	168,202.00	0.00
201	601117	中国化学	20,400	168,096.00	0.00
202	600346	恒力石化	12,000	167,400.00	0.00
203	002821	凯莱英	2,540	167,132.00	0.00
204	001965	招商公路	13,900	164,854.00	0.00
205	603799	华友钴业	7,400	163,762.00	0.00
206	300413	芒果超媒	7,800	163,020.00	0.00
207	601021	春秋航空	2,800	157,724.00	0.00
208	603369	今世缘	3,400	157,080.00	0.00
209	601838	成都银行	10,300	156,457.00	0.00
210	600372	中航机载	12,965	155,191.05	0.00
211	600023	浙能电力	21,600	153,576.00	0.00
212	601788	光大证券	10,500	153,510.00	0.00
213	600196	复星医药	6,900	152,766.00	0.00

214	688223	晶科能源	21,329	151,435.90	0.00
215	605499	东鹏饮料	700	151,025.00	0.00
216	600845	宝信软件	4,728	150,965.04	0.00
217	300832	新产业	2,200	148,368.00	0.00
218	601872	招商轮船	17,400	147,030.00	0.00
219	300919	中伟股份	4,740	146,892.60	0.00
220	601868	中国能建	69,200	146,704.00	0.00
221	601360	三六零	19,100	146,688.00	0.00
222	600233	圆通速递	9,300	145,545.00	0.00
223	600600	青岛啤酒	2,000	145,540.00	0.00
224	600085	同仁堂	3,800	145,198.00	0.00
225	603392	万泰生物	2,200	144,936.00	0.00
226	600570	恒生电子	8,200	144,812.00	0.00
227	300223	北京君正	2,600	144,144.00	0.00
227	600741	华域汽车	8,800	144,144.00	0.00
229	600219	南山铝业	37,500	142,875.00	0.00
230	600176	中国巨石	12,900	142,545.00	0.00
231	601995	中金公司	4,800	142,128.00	0.00
232	000617	中油资本	25,700	141,864.00	0.00
233	000708	中信特钢	10,400	141,128.00	0.00
234	601100	恒立液压	3,000	139,740.00	0.00
235	601689	拓普集团	2,600	139,386.00	0.00
236	301269	华大九天	1,800	138,690.00	0.00
237	300454	深信服	2,700	136,431.00	0.00
238	600745	闻泰科技	4,800	135,600.00	0.00
239	601336	新华保险	4,500	135,135.00	0.00
240	600183	生益科技	6,400	134,784.00	0.00
241	601066	中信建投	7,000	134,680.00	0.00
242	600362	江西铜业	5,600	132,608.00	0.00
243	002410	广联达	13,800	132,204.00	0.00
244	002841	视源股份	4,400	129,932.00	0.00
245	601877	正泰电器	6,800	129,608.00	0.00
246	600027	华电国际	18,300	127,002.00	0.00
247	601881	中国银河	11,600	125,976.00	0.00
248	601998	中信银行	18,600	124,620.00	0.00
249	601898	中煤能源	9,900	123,552.00	0.00
250	688126	沪硅产业	8,784	121,307.04	0.00
251	601618	中国中冶	38,200	118,420.00	0.00
252	600026	中远海能	7,500	117,075.00	0.00
253	601699	潞安环能	6,400	116,032.00	0.00
254	600515	海南机场	36,700	115,238.00	0.00
255	601607	上海医药	6,000	114,660.00	0.00
256	601878	浙商证券	10,500	112,560.00	0.00
257	600332	白云山	3,800	111,454.00	0.00

258	600039	四川路桥	14,084	111,122.76	0.00
259	600588	用友网络	11,100	111,000.00	0.00
260	600875	东方电气	6,000	110,700.00	0.00
261	300979	华利集团	1,800	109,530.00	0.00
262	600803	新奥股份	5,100	106,080.00	0.00
263	688396	华润微	2,821	105,618.24	0.00
264	600025	华能水电	9,700	104,566.00	0.00
265	605117	德业股份	1,384	102,886.56	0.00
266	601319	中国人保	19,400	99,910.00	0.00
267	688599	天合光能	5,849	98,965.08	0.00
268	601799	星宇股份	869	97,362.76	0.00
269	002603	以岭药业	6,300	96,579.00	0.00
270	600460	士兰微	5,400	94,554.00	0.00
271	603260	合盛硅业	2,000	93,420.00	0.00
272	601238	广汽集团	11,900	92,106.00	0.00
273	603195	公牛集团	1,143	88,148.16	0.00
274	600018	上港集团	15,000	86,700.00	0.00
275	300442	润泽科技	3,600	86,220.00	0.00
276	600132	重庆啤酒	1,400	84,980.00	0.00
277	600918	中泰证券	14,900	84,483.00	0.00
278	601865	福莱特	4,200	84,420.00	0.00
279	603806	福斯特	5,740	84,378.00	0.00
280	688009	中国通号	13,783	82,698.00	0.00
281	603659	璞泰来	5,800	81,954.00	0.00
282	600061	国投资本	13,800	77,970.00	0.00
283	300957	贝泰妮	1,600	77,312.00	0.00
284	601059	信达证券	5,300	75,313.00	0.00
285	000800	一汽解放	9,600	75,168.00	0.00
286	688363	华熙生物	1,328	75,124.96	0.00
287	688187	时代电气	1,460	72,094.80	0.00
288	688303	大全能源	3,429	69,917.31	0.00
289	600732	爱旭股份	7,400	66,970.00	0.00
290	603899	晨光股份	2,100	65,688.00	0.00
291	603833	欧派家居	1,100	58,916.00	0.00
292	601808	中海油服	3,200	55,040.00	0.00
293	601698	中国卫通	3,500	49,315.00	0.00
294	601236	红塔证券	7,600	48,792.00	0.00
295	688082	盛美上海	554	46,818.54	0.00
296	603296	华勤技术	600	33,138.00	0.00
297	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
298	001289	龙源电力	1,700	29,325.00	0.00
299	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
300	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
301	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00

302	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
303	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
304	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
305	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
306	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
307	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
308	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
309	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
310	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
311	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
312	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
313	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
314	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
315	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
316	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
317	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
318	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
319	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
320	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
321	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
322	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
323	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
324	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
325	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
326	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
327	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	105,562,920.12	0.76
2	601318	中国平安	57,039,587.11	0.41
3	600036	招商银行	49,892,523.00	0.36
4	600900	长江电力	33,682,232.42	0.24
5	601166	兴业银行	30,540,736.16	0.22
6	601899	紫金矿业	30,003,581.14	0.22
7	600030	中信证券	26,186,911.16	0.19
8	600276	恒瑞医药	25,329,082.22	0.18
9	601398	工商银行	23,842,689.00	0.17

10	600887	伊利股份	23,541,315.54	0.17
11	601328	交通银行	22,682,067.00	0.16
12	600309	万华化学	20,310,914.00	0.15
13	600919	江苏银行	17,814,493.40	0.13
14	601088	中国神华	17,040,285.01	0.12
15	601288	农业银行	16,843,622.00	0.12
16	688012	中微公司	16,751,189.52	0.12
17	603259	药明康德	16,690,842.44	0.12
18	601012	隆基绿能	16,614,764.52	0.12
19	688271	联影医疗	16,400,692.26	0.12
20	601816	京沪高铁	16,145,074.00	0.12

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

7.5.2 累计卖出金额超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	688111	金山办公	1,989,358.22	0.01
2	688347	华虹公司	1,742,911.97	0.01
3	002415	海康威视	1,589,762.00	0.01
4	688036	传音控股	1,582,444.38	0.01
5	002594	比亚迪	1,328,871.00	0.01
6	600519	贵州茅台	1,265,273.00	0.01
7	300750	宁德时代	1,135,778.00	0.01
8	300059	东方财富	1,109,062.00	0.01
9	688256	寒武纪	1,064,247.57	0.01
10	002475	立讯精密	1,030,029.00	0.01
11	603501	韦尔股份	822,508.00	0.01
12	000333	美的集团	789,103.00	0.01
13	000858	五粮液	649,341.00	0.00
14	601799	星宇股份	609,004.00	0.00
15	601318	中国平安	583,030.00	0.00
16	600132	重庆啤酒	548,672.00	0.00
17	600036	招商银行	548,577.00	0.00
18	605117	德业股份	481,330.00	0.00
19	603486	科沃斯	480,642.00	0.00
20	605499	东鹏饮料	471,768.00	0.00

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

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,447,807,737.05
卖出股票收入（成交）总额	43,843,577.75

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

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	71,173,743.17	0.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	235,827,762.30	1.65
	其中：政策性金融债	235,827,762.30	1.65
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	307,001,505.47	2.15

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	190409	19 农发 09	1,000,000	103,070,491.80	0.72
2	210218	21 国开 18	800,000	81,734,360.66	0.57
3	220020	22 附息国 债 20	700,000	71,173,743.17	0.50
4	220322	22 进出 22	500,000	51,022,909.84	0.36

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

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

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证

券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,555,341.81
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,805,924.46
6	其他应收款	1,634,442.50
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,995,708.77

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
易方达沪深 300ETF 发起式联 接 A	490,678	15,687.76	393,043,820.50	5.11%	7,304,593,576. 12	94.89%
易方达沪深 300ETF 发起式联 接 C	148,679	19,139.48	1,508,681,395. 35	53.02%	1,336,957,666. 64	46.98%
合计	639,357	16,490.44	1,901,725,215. 85	18.04%	8,641,551,242. 76	81.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 A	3,671,025.36	0.0477%
	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 C	2,175,260.74	0.0764%
	合计	5,846,286.10	0.0555%

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 金投资和部门负责人 持有本开放式基金	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 A	0~10
	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 A	50~100
	易方达沪深 300ETF 发 起式联接 C	0
	合计	50~100

注：自 2024 年 9 月 2 日起，本基金基金经理庞亚平每月定投本基金 A 类份额 1000 元起，当沪深 300 指数市盈率达到近五年估值分位数 80% 分位时，将停止定投。

近五年估值分位数 = (当前指数市盈率 PE(TTM) - 近五年最低指数市盈率 PE(TTM)) / (近五年最

高指数市盈率 PE(TTM)-近五年最低指数市盈率 PE(TTM)) *100%

估值统计范围为当前交易日五年前至当前交易日,例如 2024 年 9 月 2 日的估值统计范围为 2019 年 9 月 2 日至 2024 年 9 月 2 日,2024 年 11 月 1 日的估值统计范围为 2019 年 11 月 1 日至 2024 年 11 月 1 日。

具体数据可通过证券行情软件等途径查询。

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
基金合同生效日(2009 年 8 月 26 日)基金份额总额	16,746,252,366.35	-
本报告期期初基金份额总额	6,722,363,370.84	3,687,815,968.50
本报告期基金总申购份额	1,768,857,547.93	2,477,186,340.82
减:本报告期基金总赎回份额	793,583,522.15	3,319,363,247.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	7,697,637,396.62	2,845,639,061.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	128,404.76	0.01%	77.04	0.05%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	20,045,228.90	1.35%	2,004.54	1.35%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	1,469,416,069.49	98.65%	146,942.48	98.60%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

汇丰前海	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司、申港证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、汇丰前海证券有限责任公司、万联证券股份有限公司。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期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
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	2,039,170,473.16	100.00%
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰 前海	-	-	-	-	-	-	-	-	-
南京 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
万联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮 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关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-13
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-01-19
3	易方达基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-20
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报	2024-03-29
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-20
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》；
- 4.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日