

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	61
7.1 期末基金资产组合情况	61
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
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	77
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	77
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	77
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	77

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	77
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.12	投资组合报告附注	78
§ 8	基金份额持有人信息	79
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2	期末上市基金前十名持有人	80
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	81
§ 9	开放式基金份额变动	81
§ 10	重大事件揭示	81
10.1	基金份额持有人大会决议	81
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	81
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
10.4	基金投资策略的改变	82
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
10.8	其他重大事件	84
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
§ 12	备查文件目录	85
12.1	备查文件目录	85
12.2	存放地点	85
12.3	查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500ETF
场内简称	ZZ500ETF、中证 500ETF 易方达
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,114,965,150.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 14 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，基金管理人可采取包括抽样复制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。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。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。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 500 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510620; 519031	100140
法定代表人		刘晓艳	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-58,685,082.78
本期利润	-190,622,968.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0490
本期加权平均净值利润率	-7.65%
本期基金份额净值增长率	-7.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-161,889,776.79
期末可供分配基金份额利润	-0.0393
期末基金资产净值	2,508,652,923.07
期末基金份额净值	0.6096
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-6.07%

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

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

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

3.2 基金净值表现

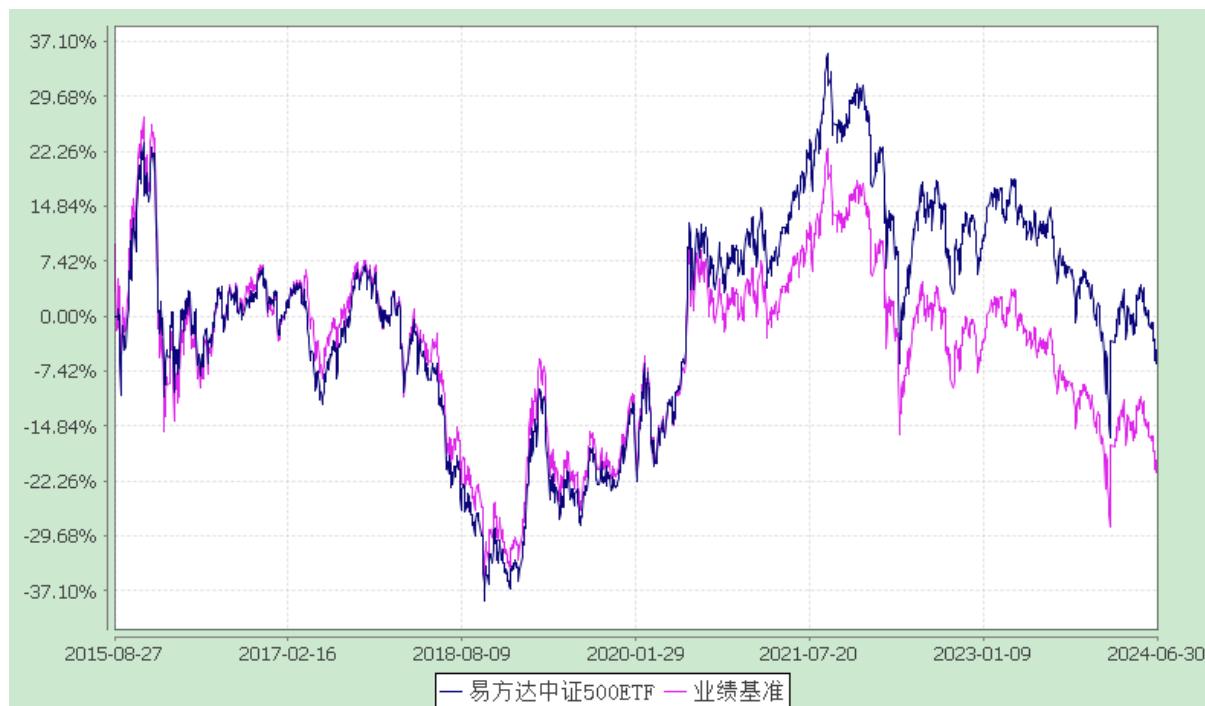
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.24%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.65%	0.00%
过去三个月	-5.27%	1.13%	-6.50%	1.14%	1.23%	-0.01%
过去六个月	-7.76%	1.60%	-8.96%	1.61%	1.20%	-0.01%
过去一年	-15.92%	1.27%	-17.60%	1.27%	1.68%	0.00%
过去三年	-21.24%	1.19%	-27.40%	1.20%	6.16%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-6.07%	1.37%	-20.77%	1.45%	14.70%	-0.08%

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 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 8 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-6.07%，同期业绩比较基准收益率为-20.77%。

§ 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		
余海燕	<p>本基金的基金经理,易方达沪深 300 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 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、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</p>	2016-04-16	-	19 年	<p>硕士研究生,具有基金从业资格。曾任汇丰银行 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。</p>
庞亚平	<p>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 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF 联接发起式、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</p>	2022-12-17	-	15 年	<p>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。</p>

注: 1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确

定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 500 指数，该指数由沪深市场中剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后，剔除过去一年日均成交金额排名后 20% 的证券，再选取过去一年日均总市值

值排名靠前的 500 只证券组成，以综合反映中国沪深市场中小市值公司的整体表现。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。

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。

中证 500 指数作为 A 股中小盘股的代表指数，其行业分布较为均衡，以周期型与成长型行业并重，其收益表现会受到 A 股整体市场走势、市场风格以及不同行业基本面状况的影响。报告期内指数中的通信、汽车、有色金属、银行、公用事业、家用电器等行业的成份股涨幅居前，对中证 500 指数收益贡献较大，而医药生物、计算机、非银金融、电子、电力设备等行业的成份股表现不佳，拖累了指数的表现。报告期内中证 500 指数下跌 8.96%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.6096 元，本报告期份额净值增长率为-7.76%，同期业绩比较基准收益率为-8.96%。年化跟踪误差 0.54%，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。在中国经济迈向复苏、货币政策宽松、信用环境改善的宏观背景下，中小市值公司有望迎来较强的盈利复苏预期，作为 A 股中小盘股的代表指数，中证 500 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，为投资者分享中国中小市值公司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

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遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	70,153,228.39	77,687,552.30
结算备付金		21,048,341.49	14,539,067.62
存出保证金		11,781,427.22	11,551,359.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,408,233,674.30	2,223,889,738.42
其中：股票投资		2,407,880,652.63	2,223,714,833.05
基金投资		-	-
债券投资		353,021.67	174,905.37
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		1,959,262.02	156,124.70
应收股利		94,912.23	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	30,071.42	181,813.93
资产总计		2,513,300,917.07	2,328,005,655.97
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		3,593,275.60	3,554.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		322,275.98	296,925.06
应付托管费		107,425.29	98,975.05
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,602.71	21,908.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	618,414.42	2,479,300.66
负债合计		4,647,994.00	2,900,663.35
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	2,670,542,699.86	2,283,099,809.66
未分配利润	6.4.7.8	-161,889,776.79	42,005,182.96
净资产合计		2,508,652,923.07	2,325,104,992.62
负债和净资产总计		2,513,300,917.07	2,328,005,655.97

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6096 元，基金份额总额 4,114,965,150.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-187,663,121.27	87,257,935.60
1.利息收入		1,694,921.97	1,836,296.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	333,525.50	344,912.16
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		1,361,396.47	1,491,384.56
2.投资收益（损失以“-”填列）		-58,613,198.37	3,589,012.18
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-86,971,311.53	-21,880,501.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	117,473.25	282,264.08
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	-5,452,235.90	1,417,364.02
股利收益	6.4.7.14	33,692,875.81	23,769,885.50
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	-131,937,885.27	81,588,009.68
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	1,193,040.40	244,617.02
减：二、营业总支出		2,959,846.78	2,579,160.07
1. 管理人报酬		1,863,627.27	1,609,707.76
2. 托管费		621,209.05	536,569.29
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		4,904.00	11,293.79
8. 其他费用	6.4.7.18	470,106.46	421,589.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-190,622,968.05	84,678,775.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-190,622,968.05	84,678,775.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-190,622,968.05	84,678,775.53

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,283,099,809.66	42,005,182.96	2,325,104,992.62
二、本期期初净资产	2,283,099,809.66	42,005,182.96	2,325,104,992.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	387,442,890.20	-203,894,959.75	183,547,930.45
（一）、综合收益总额	-	-190,622,968.05	-190,622,968.05
（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）	387,442,890.20	-13,271,991.70	374,170,898.50
其中：1.基金申购款	767,097,983.89	-17,731,988.08	749,365,995.81
2.基金赎回款	-379,655,093.69	4,459,996.38	-375,195,097.31
（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	2,670,542,699.86	-161,889,776.79	2,508,652,923.07
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	1,903,598,733.26	143,038,920.26	2,046,637,653.52
二、本期期初净资产	1,903,598,733.26	143,038,920.26	2,046,637,653.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,620,679.33	85,782,289.28	136,402,968.61
（一）、综合收益总额	-	84,678,775.53	84,678,775.53
（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）	50,620,679.33	1,103,513.75	51,724,193.08
其中：1.基金申购款	227,793,056.92	29,130,004.44	256,923,061.36
2.基金赎回款	-177,172,377.59	-28,026,490.69	-205,198,868.28
（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	1,954,219,412.59	228,821,209.54	2,183,040,622.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]999 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2015]2176 号《关于易方达中证 500

交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金延期募集备案的回函》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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,259,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与中证 500 指数进行对比，根据《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，易方达基金管理有限公司确定 2015 年 9 月 9 日为本基金的基金份额折算日。当日中证 500 指数收盘值为 6551.01 点，本基金资产净值为 298,052,917.95 元，折算前基金份额总额为 295,259,000 份，折算前基金份额净值为 1.0095 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.15409267，折算后基金份额总额为 45,496,515 份，折算后基金份额净值为 6.5511 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2015 年 9 月 10 日进行了变更登记。

根据《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》《易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务并调整场内份额最小申购、赎回单位及相关业务安排的公告》和《易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及场内份额恢复交易和申购、赎回业务的公告》的有关规定，本基金的基金管理人确定 2021 年 7 月 16 日为本基金的基金份额拆分日。拆分前场内基金份额总额为 144,496,515.00 份，场外基金份额总额为 733,113.00 份，拆分前基金份额净值为 7.9090 元。根据基金份额拆分公式，基金份额拆分比例为 10，拆分后场内基金份额总额为 1,444,965,150.00 份，场外基金份额总额为 7,331,130.00 份，拆分后基金份额净值为 0.7909 元。本基金登记结算机构(场内份额登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外份额登记结算机构为易方达基金管理有限公司)已根据上述拆分比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于 2021 年 7 月 16 日进行了变更登记。

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	70,153,228.39
等于：本金	70,147,116.56
加：应计利息	6,111.83
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	70,153,228.39

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	2,784,897,069.74	-	2,407,880,652.63	-377,016,417.11

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	352,995.36	26.31	353,021.67	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	352,995.36	26.31	353,021.67	-
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,785,250,065.10	26.31	2,408,233,674.30	-377,016,417.11

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	102,841,560.00	-	-	-
IC2409	46,496,600.00	-	-	-
IC2412	56,344,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	102,841,560.00	-	-	-

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
IC2409	IC2409	45	43,876,800.00	-2,619,800.00
IC2412	IC2412	55	53,171,800.00	-3,173,160.00
合计	-	-	-	-5,792,960.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-5,792,960.00
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	30,071.42
待摊费用	-
合计	30,071.42

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	77,853.12
其中：交易所市场	77,853.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,481.66
应付替代款	251,798.61
其他应付款	194,281.03
合计	618,414.42

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,517,965,150.00	2,283,099,809.66
本期申购	1,182,000,000.00	767,097,983.89

本期赎回（以“-”号填列）	-585,000,000.00	-379,655,093.69
本期末	4,114,965,150.00	2,670,542,699.86

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	1,803,725,325.63	-1,761,720,142.67	42,005,182.96
本期期初	1,803,725,325.63	-1,761,720,142.67	42,005,182.96
本期利润	-58,685,082.78	-131,937,885.27	-190,622,968.05
本期基金份额交易产生的变动数	302,954,048.04	-316,226,039.74	-13,271,991.70
其中：基金申购款	598,414,691.60	-616,146,679.68	-17,731,988.08
基金赎回款	-295,460,643.56	299,920,639.94	4,459,996.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,047,994,290.89	-2,209,884,067.68	-161,889,776.79

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	112,413.89
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	220,286.06
其他	825.55
合计	333,525.50

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	-69,371,197.32
股票投资收益——赎回差价收入	-17,600,114.21
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	-86,971,311.53

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	491,526,101.19
减：卖出股票成本总额	560,454,158.10

减：交易费用	443,140.41
买卖股票差价收入	-69,371,197.32

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	375,195,097.31
减：现金支付赎回款总额	191,048,981.31
减：赎回股票成本总额	201,746,230.21
减：交易费用	-
赎回差价收入	-17,600,114.21

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	87.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	117,385.98
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	117,473.25

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	670,386.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	552,897.58
减：应计利息总额	76.02
减：交易费用	26.84
买卖债券差价收入	117,385.98

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-5,452,235.90

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	33,692,875.81
其中：证券出借权益补偿收入	1,677,632.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	33,692,875.81

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-129,239,845.27
——股票投资	-129,239,845.27
——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	-2,698,040.00
——权证投资	-
——期货投资	-2,698,040.00
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	-131,937,885.27

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	1,193,040.40
合计	1,193,040.40

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	372,725.44
存托服务费	804.04
银行汇划费	2,095.32
合计	470,106.46

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

根据相关法规、基金合同及公告，本基金于 2024 年 8 月 30 日进行基金份额合并，合并比例为 0.24798687。本基金的登记结算机构按照上述合并比例对各基金份额持有人持有的本基金基金份额进行合并及变更登记。

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	128,362.00	0.01%	-	-

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
广发证券	77.02	0.06%	7.80	0.01%
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
-	-	-	-	-

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	1,863,627.27	1,609,707.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	1,863,627.27	1,609,707.76

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	621,209.05	536,569.29

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	150,379,884.00	106,468.92	0.00	0.00

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

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	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	176,934,199.00	1.70~4.00	2.55	160,135.32	3,501,393.80	1,241.12
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	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	118,390,624.00	1.70~5.70	3.35	127,448.71	28,896,950.80	12,954.51

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自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自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,706,533,322.00	65.7729%	2,549,032,277.00	72.4576%
广发证券股份有限公司	4,796,431.00	0.1166%	9,013,307.00	0.2562%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	70,153,228.39	112,413.89	80,463,673.32	117,674.29

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-

				受限						
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	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
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	-
60337	盛景	2024-0	6 个月	新股	38.18	38.90	72	2,748.	2,800.	-

5	微	1-17		流通受限				96	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	-
688169	石头科技	2024-06-17	6 个月	询价转让流通受限	376.88	368.46	5,098	1,921,334.24	1,878,409.08	-

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
113685	升 24 转债	2024-06-17	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	3,530	353,000.00	353,021.67	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	000009	中国宝安	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.60	17,000.00	146,200.00
2	000021	深科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	15.12	38,800.00	586,656.00
3	000027	深圳能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.30	16,900.00	123,370.00
4	000031	大悦城	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.34	119,200.00	278,928.00
5	000039	中集集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.26	15,100.00	139,826.00
6	000050	深天马 A	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.28	10,100.00	73,528.00
7	000060	中金岭南	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.24	21,600.00	91,584.00
8	000066	中国长城	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.75	15,900.00	139,125.00
9	000155	川能动力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	10.77	20,200.00	217,554.00
10	000156	华数传媒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.28	72,500.00	455,300.00
11	000400	许继电气	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 11 日	34.41	12,800.00	440,448.00
12	000401	冀东水泥	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.06	105,500.00	428,330.00
13	000423	东阿阿胶	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	62.60	3,700.00	231,620.00
14	000513	丽珠集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	37.21	3,000.00	111,630.00
15	000519	中兵红箭	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	14.67	57,500.00	843,525.00
16	000537	中绿电	2024 年 7 月 9 日	9.53	4,600.00	43,838.00

			-2024 年 7 月 9 日			
17	000539	粤电力 A	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.08	89,900.00	456,692.00
18	000559	万向钱潮	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.46	110,300.00	491,938.00
19	000563	陕国投 A	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.75	25,300.00	69,575.00
20	000591	太阳能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	4.71	74,500.00	350,895.00
21	000598	兴蓉环境	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	7.52	40,200.00	302,304.00
22	000623	吉林敖东	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.40	7,600.00	101,840.00
23	000629	钒钛股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.50	32,700.00	81,750.00
24	000630	铜陵有色	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.61	62,500.00	225,625.00
25	000636	风华高科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.06	7,600.00	99,256.00
26	000683	远兴能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.91	21,500.00	148,565.00
27	000703	恒逸石化	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.09	18,100.00	128,329.00
28	000709	河钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.94	29,700.00	57,618.00
29	000723	美锦能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.76	24,900.00	118,524.00
30	000728	国元证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.06	21,500.00	130,290.00
31	000729	燕京啤酒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.83	11,600.00	102,428.00
32	000738	航发控制	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 9 日	20.07	6,800.00	136,476.00
33	000739	普洛药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.57	4,300.00	58,351.00
34	000750	国海证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.91	31,500.00	91,665.00
35	000778	新兴铸管	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.48	19,700.00	68,556.00
36	000783	长江证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.83	122,300.00	590,709.00
37	000825	太钢不锈	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.38	18,800.00	63,544.00
38	000830	鲁西化工	2024 年 7 月 9 日	11.59	8,300.00	96,197.00

			-2024 年 7 月 9 日			
39	000831	中国稀土	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	25.35	62,900.00	1,594,515.00
40	000878	云南铜业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	12.46	46,000.00	573,160.00
41	000883	湖北能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.01	16,100.00	96,761.00
42	000887	中鼎股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.24	72,500.00	887,400.00
43	000893	亚钾国际	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.16	51,500.00	832,240.00
44	000898	鞍钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.12	19,700.00	41,764.00
45	000932	华菱钢铁	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.43	34,100.00	151,063.00
46	000933	神火股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.23	15,400.00	311,542.00
47	000937	冀中能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	6.70	79,200.00	530,640.00
48	000958	电投产融	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.66	13,300.00	48,678.00
49	000959	首钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.72	12,900.00	35,088.00
50	000960	锡业股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.49	8,100.00	125,469.00
51	000967	盈峰环境	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.23	10,500.00	44,415.00
52	000987	越秀资本	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.96	12,400.00	61,504.00
53	000988	华工科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	29.93	23,000.00	688,390.00
54	000997	新大陆	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.91	6,800.00	94,588.00
55	000998	隆平高科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.83	8,700.00	85,521.00
56	001286	陕西能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	11.53	5,600.00	64,568.00
57	001872	招商港口	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	19.25	1,900.00	36,575.00
58	002008	大族激光	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	20.80	29,200.00	607,360.00
59	002019	亿帆医药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.36	57,300.00	708,228.00
60	002025	航天电器	2024 年 7 月 9 日	46.38	2,300.00	106,674.00

			-2024 年 7 月 9 日			
61	002028	思源电气	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	66.90	6,500.00	434,850.00
62	002044	美年健康	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	3.78	191,000.00	721,980.00
63	002056	横店东磁	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.47	14,400.00	179,568.00
64	002064	华峰化学	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.17	85,000.00	609,450.00
65	002065	东华软件	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.52	18,500.00	83,620.00
66	002078	太阳纸业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.95	16,400.00	228,780.00
67	002080	中材科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.90	4,900.00	63,210.00
68	002120	韵达股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.74	82,000.00	634,680.00
69	002128	电投能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	21.10	7,400.00	156,140.00
70	002138	顺络电子	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	27.46	6,600.00	181,236.00
71	002152	广电运通	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.46	10,200.00	106,692.00
72	002153	石基信息	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.73	6,700.00	38,391.00
73	002155	湖南黄金	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	18.10	6,900.00	124,890.00
74	002156	通富微电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	22.39	8,700.00	194,793.00
75	002185	华天科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.15	21,100.00	171,965.00
76	002195	岩山科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.51	40,300.00	101,153.00
77	002203	海亮股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.98	9,800.00	78,204.00
78	002223	鱼跃医疗	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	37.60	9,500.00	357,200.00
79	002240	盛新锂能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	13.42	30,300.00	406,626.00
80	002244	滨江集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.26	97,400.00	707,124.00
81	002262	恩华药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	23.74	5,000.00	118,700.00
82	002266	浙富控股	2024 年 7 月 9 日	2.79	21,600.00	60,264.00

			-2024 年 7 月 9 日			
83	002268	电科网安	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	14.23	5,300.00	75,419.00
84	002273	水晶光电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.98	10,000.00	169,800.00
85	002281	光迅科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	37.37	38,800.00	1,449,956.00
86	002294	信立泰	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	26.63	4,600.00	122,498.00
87	002299	圣农发展	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.64	6,100.00	83,204.00
88	002340	格林美	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.37	85,200.00	542,724.00
89	002353	杰瑞股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	35.08	4,500.00	157,860.00
90	002368	太极股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	22.55	6,800.00	153,340.00
91	002372	伟星新材	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.42	6,600.00	101,772.00
92	002373	千方科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.07	8,200.00	74,374.00
93	002384	东山精密	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	20.70	37,000.00	765,900.00
94	002385	大北农	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.85	27,200.00	104,720.00
95	002407	多氟多	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.23	41,900.00	512,437.00
96	002408	齐翔腾达	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.60	11,700.00	65,520.00
97	002409	雅克科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	62.91	2,400.00	150,984.00
98	002414	高德红外	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.89	14,100.00	83,049.00
99	002423	中粮资本	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.49	69,700.00	522,053.00
100	002429	兆驰股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.81	18,600.00	89,466.00
101	002430	杭氧股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	22.25	13,300.00	295,925.00
102	002432	九安医疗	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	40.54	37,500.00	1,520,250.00
103	002436	兴森科技	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	10.32	43,800.00	452,016.00
104	002439	启明星辰	2024 年 7 月 9 日	17.26	5,500.00	94,930.00

			-2024 年 7 月 9 日			
105	002444	巨星科技	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 9 日	24.70	16,900.00	417,430.00
106	002465	海格通信	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.36	14,300.00	148,148.00
107	002472	双环传动	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 11 日	22.02	11,600.00	255,432.00
108	002487	大金重工	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	22.88	37,500.00	858,000.00
109	002497	雅化集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.92	10,800.00	96,336.00
110	002500	山西证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.70	17,700.00	83,190.00
111	002506	协鑫集成	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.94	33,700.00	65,378.00
112	002507	涪陵榨菜	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.25	6,700.00	82,075.00
113	002508	老板电器	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	22.10	4,900.00	108,290.00
114	002517	恺英网络	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.55	19,700.00	188,135.00
115	002518	科士达	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	17.70	11,800.00	208,860.00
116	002531	天顺风能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.94	7,400.00	66,156.00
117	002532	天山铝业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.11	26,800.00	217,348.00
118	002557	洽洽食品	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	28.19	16,500.00	465,135.00
119	002558	巨人网络	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.44	56,200.00	530,528.00
120	002563	森马服饰	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.81	82,000.00	476,420.00
121	002568	百润股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.83	48,800.00	821,304.00
122	002572	索菲亚	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	15.33	58,200.00	892,206.00
123	002595	豪迈科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	38.17	3,300.00	125,961.00
124	002607	中公教育	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.53	35,500.00	54,315.00
125	002608	江苏国信	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.75	6,200.00	48,050.00
126	002624	完美世界	2024 年 7 月 9 日	7.60	11,200.00	85,120.00

			-2024 年 7 月 9 日			
127	002625	光启技术	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 9 日	17.35	15,400.00	267,190.00
128	002653	海思科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	30.70	2,500.00	76,750.00
129	002670	国盛金控	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.47	32,900.00	278,663.00
130	002673	西部证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	6.19	23,000.00	142,370.00
131	002683	广东宏大	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.13	3,700.00	74,481.00
132	002690	美亚光电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.50	2,900.00	47,850.00
133	002738	中矿资源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	26.80	5,300.00	142,040.00
134	002739	万达电影	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.09	12,500.00	151,125.00
135	002756	永兴材料	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	35.78	5,400.00	193,212.00
136	002791	坚朗五金	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	25.87	12,900.00	333,723.00
137	002797	第一创业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.09	209,500.00	1,066,355.00
138	002831	裕同科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	25.59	2,700.00	69,093.00
139	002850	科达利	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	76.38	2,100.00	160,398.00
140	002867	周大生	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.06	40,200.00	525,012.00
141	002926	华西证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.59	13,000.00	85,670.00
142	002936	郑州银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	1.73	188,500.00	326,105.00
143	002939	长城证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.70	13,200.00	88,440.00
144	002945	华林证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.98	2,000.00	19,960.00
145	002958	青农商行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.68	32,100.00	86,028.00
146	002966	苏州银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.50	179,800.00	1,348,500.00
147	003022	联泓新科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.71	3,000.00	41,130.00
148	003031	中瓷电子	2024 年 7 月 9 日	46.24	1,400.00	64,736.00

			-2024 年 7 月 9 日			
149	003035	南网能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.40	11,200.00	49,280.00
150	300001	特锐德	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.12	6,100.00	122,732.00
151	300003	乐普医疗	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.84	10,800.00	160,272.00
152	300009	安科生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.54	22,500.00	192,150.00
153	300012	华测检测	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.06	13,800.00	138,828.00
154	300017	网宿科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.90	17,500.00	138,250.00
155	300024	机器人	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.74	91,600.00	892,184.00
156	300037	新宙邦	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	28.56	9,600.00	274,176.00
157	300058	蓝色光标	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.44	18,400.00	100,096.00
158	300070	碧水源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.19	59,200.00	248,048.00
159	300073	当升科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	34.31	37,800.00	1,296,918.00
160	300088	长信科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.70	117,100.00	550,370.00
161	300114	中航电测	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	45.25	1,000.00	45,250.00
162	300118	东方日升	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	12.10	45,800.00	554,180.00
163	300136	信维通信	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	19.58	84,100.00	1,646,678.00
164	300144	宋城演艺	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.03	17,200.00	138,116.00
165	300146	汤臣倍健	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.55	8,400.00	113,820.00
166	300207	欣旺达	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 9 日	15.17	63,300.00	960,261.00
167	300212	易华录	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.83	3,200.00	53,856.00
168	300251	光线传媒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.41	12,100.00	101,761.00
169	300253	卫宁健康	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	5.90	16,200.00	95,580.00
170	300285	国瓷材料	2024 年 7 月 9 日	17.85	6,600.00	117,810.00

			-2024 年 7 月 9 日			
171	300296	利亚德	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	4.50	200,400.00	901,800.00
172	300357	我武生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.22	2,600.00	52,572.00
173	300373	扬杰科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	38.90	32,300.00	1,256,470.00
174	300383	光环新网	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.45	11,800.00	99,710.00
175	300390	天华新能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	17.18	59,000.00	1,013,620.00
176	300395	菲利华	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	30.75	4,300.00	132,225.00
177	300438	鹏辉能源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	18.34	34,600.00	634,564.00
178	300474	景嘉微	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	63.23	1,000.00	63,230.00
179	300487	蓝晓科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	41.76	24,300.00	1,014,768.00
180	300502	新易盛	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	105.55	5,800.00	612,190.00
181	300529	健帆生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	27.21	5,100.00	138,771.00
182	300558	贝达药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	32.55	16,100.00	524,055.00
183	300567	精测电子	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	56.51	15,300.00	864,603.00
184	300568	星源材质	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.20	18,400.00	150,880.00
185	300595	欧普康视	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	15.68	5,900.00	92,512.00
186	300601	康泰生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	15.61	58,300.00	910,063.00
187	300604	长川科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	27.17	26,500.00	720,005.00
188	300676	华大基因	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	35.01	2,000.00	70,020.00
189	300677	英科医疗	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	26.81	11,500.00	308,315.00
190	300682	朗新集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.51	5,400.00	45,954.00
191	300699	光威复材	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	24.83	4,800.00	119,184.00
192	300724	捷佳伟创	2024 年 7 月 9 日	54.01	5,600.00	302,456.00

			-2024 年 7 月 9 日			
193	300748	金力永磁	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.96	5,600.00	72,576.00
194	300763	锦浪科技	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	41.64	11,400.00	474,696.00
195	300765	新诺威	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	25.23	17,000.00	428,910.00
196	300776	帝尔激光	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	45.96	13,700.00	629,652.00
197	300803	指南针	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	36.41	11,600.00	422,356.00
198	300861	美畅股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	19.35	16,900.00	327,015.00
199	300866	安克创新	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	71.21	4,310.00	306,915.10
200	300888	稳健医疗	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 12 日	25.30	20,200.00	511,060.00
201	301029	怡合达	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 10 日	19.66	9,100.00	178,906.00
202	301165	锐捷网络	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	29.84	6,600.00	196,944.00
203	301236	软通动力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	35.21	34,700.00	1,221,787.00
204	600004	白云机场	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.48	9,700.00	91,956.00
205	600008	首创环保	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.68	36,300.00	97,284.00
206	600021	上海电力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.89	42,200.00	417,358.00
207	600032	浙江新能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.28	3,600.00	26,208.00
208	600038	中直股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	41.11	3,400.00	139,774.00
209	600056	中国医药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.12	6,200.00	62,744.00
210	600060	海信视像	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	24.74	6,400.00	158,336.00
211	600062	华润双鹤	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	19.58	36,300.00	710,754.00
212	600066	宇通客车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	25.80	13,000.00	335,400.00
213	600079	人福医药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	17.17	11,700.00	200,889.00
214	600095	湘财股份	2024 年 7 月 9 日	5.96	84,500.00	503,620.00

			-2024 年 7 月 10 日			
215	600096	云天化	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	19.42	18,700.00	363,154.00
216	600109	国金证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	7.55	25,500.00	192,525.00
217	600118	中国卫星	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	22.23	3,000.00	66,690.00
218	600126	杭钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.11	9,700.00	39,867.00
219	600129	太极集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	28.92	2,900.00	83,868.00
220	600131	国网信通	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.87	4,900.00	82,663.00
221	600141	兴发集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	19.08	5,700.00	108,756.00
222	600143	金发科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	6.61	56,800.00	375,448.00
223	600153	建发股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.93	54,900.00	490,257.00
224	600155	华创云信	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 11 日	5.91	92,200.00	544,902.00
225	600166	福田汽车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.25	222,800.00	501,300.00
226	600170	上海建工	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.15	55,200.00	118,680.00
227	600177	雅戈尔	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.12	22,800.00	162,336.00
228	600208	新湖中宝	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.58	31,300.00	49,454.00
229	600258	首旅酒店	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.35	5,500.00	67,925.00
230	600271	航天信息	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.36	8,400.00	61,824.00
231	600298	安琪酵母	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	27.93	20,800.00	580,944.00
232	600299	安迪苏	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.70	3,000.00	29,100.00
233	600315	上海家化	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	17.78	29,300.00	520,954.00
234	600316	洪都航空	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.63	3,500.00	58,205.00
235	600325	华发股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	6.50	15,100.00	98,150.00
236	600329	达仁堂	2024 年 7 月 9 日	32.39	2,200.00	71,258.00

			-2024 年 7 月 9 日			
237	600339	中油工程	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	3.12	166,900.00	520,728.00
238	600348	华阳股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	9.96	22,800.00	227,088.00
239	600350	山东高速	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.85	67,400.00	596,490.00
240	600352	浙江龙盛	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.59	21,400.00	183,826.00
241	600369	西南证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.58	32,800.00	117,424.00
242	600373	中文传媒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.84	4,600.00	68,264.00
243	600377	宁沪高速	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	12.60	48,800.00	614,880.00
244	600378	昊华科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	28.90	4,900.00	141,610.00
245	600380	健康元	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	11.17	7,700.00	86,009.00
246	600390	五矿资本	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.05	18,500.00	74,925.00
247	600392	盛和资源	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	8.62	66,000.00	568,920.00
248	600398	海澜之家	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	9.24	75,900.00	701,316.00
249	600399	抚顺特钢	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.63	13,000.00	73,190.00
250	600416	湘电股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.94	35,100.00	348,894.00
251	600418	江淮汽车	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	15.84	42,900.00	679,536.00
252	600435	北方导航	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.62	27,100.00	233,602.00
253	600481	双良节能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	4.67	15,400.00	71,918.00
254	600486	扬农化工	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	56.45	4,400.00	248,380.00
255	600497	驰宏锌锗	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.34	37,100.00	198,114.00
256	600498	烽火通信	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.90	5,800.00	92,220.00
257	600499	科达制造	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.43	101,200.00	853,116.00
258	600500	中化国际	2024 年 7 月 9 日	3.49	14,800.00	51,652.00

			-2024 年 7 月 9 日			
259	600511	国药股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	30.79	18,700.00	575,773.00
260	600516	方大炭素	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.31	20,700.00	89,217.00
261	600517	国网英大	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.33	14,100.00	61,053.00
262	600521	华海药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.05	7,300.00	124,465.00
263	600528	中铁工业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.32	9,200.00	67,344.00
264	600529	山东药玻	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	25.34	6,900.00	174,846.00
265	600535	天士力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.58	7,400.00	93,092.00
266	600536	中国软件	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	29.92	9,000.00	269,280.00
267	600546	山煤国际	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.62	40,800.00	596,496.00
268	600549	厦门钨业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.25	7,000.00	120,750.00
269	600563	法拉电子	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	76.18	8,000.00	609,440.00
270	600566	济川药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	31.71	3,000.00	95,130.00
271	600580	卧龙电驱	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.15	40,700.00	494,505.00
272	600582	天地科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.89	13,600.00	93,704.00
273	600583	海油工程	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.91	18,200.00	107,562.00
274	600598	北大荒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.49	5,800.00	72,442.00
275	600612	老凤祥	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	58.19	8,000.00	465,520.00
276	600637	东方明珠	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.08	16,900.00	102,752.00
277	600642	申能股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.83	20,100.00	177,483.00
278	600655	豫园股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.15	16,000.00	82,400.00
279	600663	陆家嘴	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.82	6,100.00	53,802.00
280	600673	东阳光	2024 年 7 月 9 日	7.04	13,600.00	95,744.00

			-2024 年 7 月 9 日			
281	600699	均胜电子	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	14.82	72,400.00	1,072,968.00
282	600704	物产中大	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.34	25,600.00	111,104.00
283	600707	彩虹股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.81	67,700.00	461,037.00
284	600737	中粮糖业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.59	7,800.00	74,802.00
285	600739	辽宁成大	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.37	10,800.00	90,396.00
286	600755	厦门国贸	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	7.17	66,000.00	473,220.00
287	600763	通策医疗	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	54.05	9,700.00	524,285.00
288	600764	中国海防	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	19.63	11,100.00	217,893.00
289	600765	中航重机	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	20.40	14,200.00	289,680.00
290	600801	华新水泥	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.75	5,500.00	75,625.00
291	600808	马钢股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.02	19,800.00	39,996.00
292	600820	隧道股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.53	23,600.00	154,108.00
293	600827	百联股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.38	6,600.00	48,708.00
294	600839	四川长虹	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.49	120,200.00	539,698.00
295	600848	上海临港	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.11	7,900.00	71,969.00
296	600859	王府井	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	11.74	45,300.00	531,822.00
297	600862	中航高科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	18.78	13,000.00	244,140.00
298	600863	内蒙华电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	4.64	30,900.00	143,376.00
299	600867	通化东宝	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.37	108,300.00	906,471.00
300	600871	石化油服	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.74	283,700.00	493,638.00
301	600873	梅花生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.02	17,000.00	170,340.00
302	600879	航天电子	2024 年 7 月 9 日	7.77	14,600.00	113,442.00

			-2024 年 7 月 9 日			
303	600884	杉杉股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	8.12	9,900.00	80,388.00
304	600885	宏发股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	27.68	6,900.00	190,992.00
305	600895	张江高科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	18.48	76,900.00	1,421,112.00
306	600901	江苏金租	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	5.05	172,200.00	869,610.00
307	600906	财达证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.73	10,700.00	61,311.00
308	600909	华安证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.21	23,200.00	97,672.00
309	600928	西安银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.27	10,200.00	33,354.00
310	600956	新天绿能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.17	2,800.00	22,876.00
311	600959	江苏有线	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.64	24,600.00	64,944.00
312	600967	内蒙一机	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	7.20	27,100.00	195,120.00
313	600968	海油发展	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.12	15,300.00	63,036.00
314	600970	中材国际	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	12.06	8,700.00	104,922.00
315	600977	中国电影	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.76	6,100.00	65,636.00
316	600985	淮北矿业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.74	34,700.00	580,878.00
317	600988	赤峰黄金	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.34	14,900.00	243,466.00
318	600995	南网储能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.66	7,900.00	76,314.00
319	600998	九州通	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.88	20,769.00	101,352.72
320	601000	唐山港	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.70	24,400.00	114,680.00
321	601016	节能风电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	2.99	98,300.00	293,917.00
322	601058	赛轮轮胎	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.00	17,900.00	250,600.00
323	601077	渝农商行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.02	51,000.00	256,020.00
324	601098	中南传媒	2024 年 7 月 9 日	12.42	4,900.00	60,858.00

			-2024 年 7 月 9 日			
325	601106	中国一重	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.31	22,600.00	52,206.00
326	601108	财通证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.61	26,700.00	176,487.00
327	601118	海南橡胶	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	4.55	169,900.00	773,045.00
328	601128	常熟银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.57	33,960.00	257,077.20
329	601139	深圳燃气	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 11 日	6.68	19,800.00	132,264.00
330	601156	东航物流	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.35	3,900.00	79,365.00
331	601158	重庆水务	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.80	4,400.00	21,120.00
332	601162	天风证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	2.18	55,000.00	119,900.00
333	601168	西部矿业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	17.95	18,800.00	337,460.00
334	601179	中国西电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	8.04	81,000.00	651,240.00
335	601198	东兴证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.96	16,000.00	127,360.00
336	601212	白银有色	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	2.78	173,000.00	480,940.00
337	601216	君正集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.69	27,700.00	102,213.00
338	601228	广州港	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.05	12,400.00	37,820.00
339	601231	环旭电子	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	16.05	5,500.00	88,275.00
340	601233	桐昆股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.96	13,900.00	221,844.00
341	601298	青岛港	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.56	5,800.00	55,448.00
342	601456	国联证券	2024 年 7 月 3 日 -2024 年 7 月 11 日	9.64	108,100.00	1,042,084.00
343	601555	东吴证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.90	33,000.00	194,700.00
344	601568	北元集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.71	9,800.00	36,358.00
345	601577	长沙银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.18	29,300.00	239,674.00
346	601598	中国外运	2024 年 7 月 9 日	5.63	144,700.00	814,661.00

			-2024 年 7 月 9 日			
347	601611	中国核建	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	8.09	9,900.00	80,091.00
348	601636	旗滨集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	6.45	13,300.00	85,785.00
349	601665	齐鲁银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.91	18,900.00	92,799.00
350	601666	平煤股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	11.20	144,400.00	1,617,280.00
351	601696	中银证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.08	13,700.00	124,396.00
352	601717	郑煤机	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	14.80	8,900.00	131,720.00
353	601828	美凯龙	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	2.55	107,600.00	274,380.00
354	601866	中远海发	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.58	32,600.00	84,108.00
355	601880	辽港股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.23	61,900.00	76,137.00
356	601928	凤凰传媒	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	10.96	19,700.00	215,912.00
357	601933	永辉超市	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	2.48	26,200.00	64,976.00
358	601958	金钼股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.41	11,000.00	114,510.00
359	601965	中国汽研	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	16.89	27,300.00	461,097.00
360	601966	玲珑轮胎	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	18.37	6,100.00	112,057.00
361	601990	南京证券	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	7.68	16,800.00	129,024.00
362	601991	大唐发电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.01	30,500.00	91,805.00
363	601992	金隅集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	1.37	355,400.00	486,898.00
364	601997	贵阳银行	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	5.27	24,000.00	126,480.00
365	603000	人民网	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	19.99	54,600.00	1,091,454.00
366	603056	德邦股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.10	2,500.00	32,750.00
367	603077	和邦生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	1.65	343,100.00	566,115.00
368	603127	昭衍新药	2024 年 7 月 9 日	13.27	3,100.00	41,137.00

			-2024 年 7 月 9 日			
369	603156	养元饮品	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	21.27	3,900.00	82,953.00
370	603160	汇顶科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	68.75	2,300.00	158,125.00
371	603179	新泉股份	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	39.24	11,200.00	439,488.00
372	603185	弘元绿能	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	17.09	25,900.00	442,631.00
373	603218	日月股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	10.27	43,400.00	445,718.00
374	603225	新风鸣	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	15.59	5,500.00	85,745.00
375	603228	景旺电子	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	31.80	4,100.00	130,380.00
376	603233	大参林	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	14.30	40,200.00	574,860.00
377	603305	旭升集团	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.56	34,100.00	360,096.00
378	603317	天味食品	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	11.41	2,600.00	29,666.00
379	603338	浙江鼎力	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	60.42	3,900.00	235,638.00
380	603379	三美股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	39.14	1,800.00	70,452.00
381	603444	吉比特	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	178.0 1	1,000.00	178,010.00
382	603456	九洲药业	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	13.72	47,100.00	646,212.00
383	603486	科沃斯	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	47.18	10,000.00	471,800.00
384	603517	绝味食品	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	15.40	28,500.00	438,900.00
385	603529	爱玛科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	27.33	3,100.00	84,723.00
386	603568	伟明环保	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	20.58	4,200.00	86,436.00
387	603589	口子窖	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	39.19	2,600.00	101,894.00
388	603596	伯特利	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	38.90	17,400.00	676,860.00
389	603606	东方电缆	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	48.81	11,800.00	575,958.00
390	603650	彤程新材	2024 年 7 月 9 日	29.55	17,200.00	508,260.00

			-2024 年 7 月 10 日			
391	603658	安图生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	46.07	1,900.00	87,533.00
392	603688	石英股份	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 12 日	29.61	15,800.00	467,838.00
393	603707	健友股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	11.88	3,600.00	42,768.00
394	603712	七一二	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	18.19	6,500.00	118,235.00
395	603816	顾家家居	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 11 日	32.29	12,000.00	387,480.00
396	603826	坤彩科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	28.97	1,540.00	44,613.80
397	603858	步长制药	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	15.15	37,000.00	560,550.00
398	603868	飞科电器	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	38.40	4,400.00	168,960.00
399	603882	金域医学	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	27.19	2,300.00	62,537.00
400	603883	老百姓	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	18.36	14,690.00	269,708.40
401	603885	吉祥航空	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	10.99	7,300.00	80,227.00
402	603927	中科软	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	18.09	8,160.00	147,614.40
403	603939	益丰药房	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	24.55	5,040.00	123,732.00
404	603979	金诚信	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	50.53	9,900.00	500,247.00
405	605358	立昂微	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	23.14	4,000.00	92,560.00
406	688002	睿创微纳	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	27.97	3,900.00	109,083.00
407	688017	绿的谐波	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	82.10	5,300.00	435,130.00
408	688032	禾迈股份	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	114.78	2,400.00	275,472.00
409	688063	派能科技	2024 年 7 月 5 日 -2024 年 7 月 10 日	39.71	9,900.00	393,129.00
410	688099	晶晨股份	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	59.32	2,700.00	160,164.00
411	688114	华大智造	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	47.41	5,000.00	237,050.00
412	688122	西部超导	2024 年 7 月 9 日	38.32	3,700.00	141,784.00

			-2024 年 7 月 9 日			
413	688153	唯捷创芯	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	37.00	1,600.00	59,200.00
414	688169	石头科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	392.6 0	1,000.00	392,600.00
415	688180	君实生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	29.05	4,800.00	139,440.00
416	688200	华峰测控	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	91.75	6,300.00	578,025.00
417	688220	翱捷科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	37.46	1,700.00	63,682.00
418	688234	天岳先进	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	46.92	1,400.00	65,688.00
419	688276	百克生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	28.37	6,900.00	195,753.00
420	688281	华秦科技	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 10 日	83.32	1,540.00	128,312.80
421	688297	中无人机	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	33.03	6,300.00	208,089.00
422	688301	奕瑞科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	115.2 3	2,900.00	334,167.00
423	688331	荣昌生物	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 12 日	43.20	12,900.00	557,280.00
424	688375	国博电子	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 9 日	70.64	2,500.00	176,600.00
425	688387	信科移动	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	5.04	68,000.00	342,720.00
426	688390	固德威	2024 年 7 月 10 日 -2024 年 7 月 12 日	56.12	6,100.00	342,332.00
427	688425	铁建重工	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	3.68	13,200.00	48,576.00
428	688536	思瑞浦	2024 年 7 月 12 日 -2024 年 7 月 12 日	97.81	2,500.00	244,525.00
429	688538	和辉光电	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	1.98	30,400.00	60,192.00
430	688567	孚能科技	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	9.60	6,000.00	57,600.00
431	688772	珠海冠宇	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 10 日	14.90	39,400.00	587,060.00
432	688778	厦钨新能	2024 年 7 月 2 日 -2024 年 7 月 10 日	31.24	11,100.00	346,764.00
433	688779	长远锂科	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	4.63	72,100.00	333,823.00
434	688819	天能股份	2024 年 7 月 10 日	23.86	12,500.00	298,250.00

			-2024 年 7 月 10 日			
435	689009	九号公司	2024 年 7 月 9 日 -2024 年 7 月 9 日	36.81	3,200.00	117,792.00
合计	-	-	-	-	12,723,809.00	124,505,898.42

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。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 0.01%(2023 年 12 月 31 日：0.01%)。

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	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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	353,021.67	174,905.37
未评级	0.00	0.00
合计	353,021.67	174,905.37

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	上年度末
--------	-----	------

	2024年6月30日	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约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	70,153,228.39	-	-	-	70,153,228.39
结算备付金	21,048,341.49	-	-	-	21,048,341.49
存出保证金	11,781,427.22	-	-	-	11,781,427.22
交易性金融资产	-	-	353,021.67	2,407,880,652.63	2,408,233,674.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,959,262.02	1,959,262.02
应收股利	-	-	-	94,912.23	94,912.23
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	30,071.42	30,071.42
资产总计	102,982,997.10	-	353,021.67	2,409,964,898.30	2,513,300,917.07
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	-	-	-	3,593,275.60	3,593,275.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	322,275.98	322,275.98
应付托管费	-	-	-	107,425.29	107,425.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,602.71	6,602.71
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	618,414.42	618,414.42
负债总计	-	-	-	4,647,994.00	4,647,994.00
利率敏感度缺口	102,982,997.10	-	353,021.67	2,405,316,904.30	2,508,652,923.07
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	77,687,552.30	-	-	-	77,687,552.30
结算备付金	14,539,067.62	-	-	-	14,539,067.62
存出保证金	11,551,359.00	-	-	-	11,551,359.00
交易性金融资产	-	-	174,905.37	2,223,714,833.05	2,223,889,738.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	156,124.70	156,124.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	181,813.93	181,813.93
资产总计	103,777,978.92	-	174,905.37	2,224,052,771.68	2,328,005,655.97

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	-	-	-	3,554.12	3,554.12
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	296,925.06	296,925.06
应付托管费	-	-	-	98,975.05	98,975.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21,908.46	21,908.46
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,479,300.66	2,479,300.66
负债总计	-	-	-	2,900,663.35	2,900,663.35
利率敏感度缺口	103,777,978.92	-	174,905.37	2,221,152,108.33	2,325,104,992.62

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

	2024 年 6 月 30 日		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	2,407,880,652.63	95.98	2,223,714,833.05	95.64
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	2,407,880,652.63	95.98	2,223,714,833.05	95.64

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%	120,411,155.88	111,134,221.42
2.业绩比较基准下降 5%	-120,411,155.88	-111,134,221.42	

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	2,405,460,555.61
第二层次	398,632.78

第三层次	2,374,485.91
合计	2,408,233,674.30

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,407,880,652.63	95.81
	其中：股票	2,407,880,652.63	95.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	353,021.67	0.01
	其中：债券	353,021.67	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	91,201,569.88	3.63
8	其他各项资产	13,865,672.89	0.55
9	合计	2,513,300,917.07	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 124,505,898.42 元，占净值比例 4.96%。

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	15,110,394.22	0.60
B	采矿业	112,533,407.76	4.49
C	制造业	1,523,177,145.66	60.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,214,934.75	3.84
E	建筑业	24,483,078.60	0.98
F	批发和零售业	51,171,568.79	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	48,634,191.72	1.94
H	住宿和餐饮业	7,625,147.10	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	171,130,296.52	6.82
J	金融业	223,777,260.29	8.92
K	房地产业	27,296,782.50	1.09
L	租赁和商务服务业	18,413,806.07	0.73
M	科学研究和技术服务业	19,289,608.66	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	10,962,236.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,674,746.00	0.11
Q	卫生和社会工作	14,908,942.79	0.59
R	文化、体育和娱乐业	36,180,734.00	1.44
S	综合	4,296,371.20	0.17
	合计	2,407,880,652.63	95.98

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	300502	新易盛	287,400	30,335,070.00	1.21
2	002028	思源电气	249,550	16,694,895.00	0.67
3	601058	赛轮轮胎	1,065,027	14,910,378.00	0.59
4	688169	石头科技	38,175	14,864,439.28	0.59
5	600066	宇通客车	537,900	13,877,820.00	0.55
6	002340	格林美	2,079,400	13,245,778.00	0.53
7	000933	神火股份	637,700	12,900,671.00	0.51
8	601077	渝农商行	2,506,800	12,584,136.00	0.50
9	000988	华工科技	407,100	12,184,503.00	0.49
10	601168	西部矿业	675,440	12,124,148.00	0.48
11	300394	天孚通信	134,602	11,901,508.84	0.47
12	002384	东山精密	556,800	11,525,760.00	0.46
13	000423	东阿阿胶	182,500	11,424,500.00	0.46
14	000630	铜陵有色	3,116,900	11,252,009.00	0.45
15	600418	江淮汽车	707,699	11,209,952.16	0.45
16	600988	赤峰黄金	673,700	11,008,258.00	0.44
17	601233	桐昆股份	683,400	10,907,064.00	0.43
18	002625	光启技术	610,800	10,597,380.00	0.42
19	600096	云天化	520,000	10,098,400.00	0.40
20	601567	三星医疗	285,700	9,999,500.00	0.40
21	000400	许继电气	289,780	9,971,329.80	0.40
22	600157	永泰能源	8,262,800	9,750,104.00	0.39
23	688777	中控技术	255,878	9,646,600.60	0.38
24	002156	通富微电	430,100	9,629,939.00	0.38
25	002273	水晶光电	565,347	9,599,592.06	0.38
26	002128	电投能源	454,000	9,579,400.00	0.38
27	601555	东吴证券	1,609,700	9,497,230.00	0.38
28	002078	太阳纸业	678,920	9,470,934.00	0.38
29	600885	宏发股份	337,921	9,353,653.28	0.37
30	601128	常熟银行	1,221,016	9,243,091.12	0.37
31	002532	天山铝业	1,130,300	9,166,733.00	0.37
32	002223	鱼跃医疗	243,600	9,159,360.00	0.37
33	300207	欣旺达	603,400	9,153,578.00	0.36
34	600352	浙江龙盛	1,053,800	9,052,142.00	0.36
35	600398	海澜之家	975,685	9,015,329.40	0.36
36	002138	顺络电子	326,700	8,971,182.00	0.36
37	002966	苏州银行	1,187,780	8,908,350.00	0.36

38	002353	杰瑞股份	248,850	8,729,658.00	0.35
39	601108	财通证券	1,316,137	8,699,665.57	0.35
40	688617	惠泰医疗	18,932	8,634,885.20	0.34
41	600765	中航重机	419,848	8,564,899.20	0.34
42	002185	华天科技	1,038,000	8,459,700.00	0.34
43	002517	恺英网络	871,700	8,324,735.00	0.33
44	600879	航天电子	1,068,640	8,303,332.80	0.33
45	603606	东方电缆	167,800	8,190,318.00	0.33
46	301236	软通动力	231,600	8,154,636.00	0.33
47	600873	梅花生物	808,500	8,101,170.00	0.32
48	688099	晶晨股份	135,837	8,057,850.84	0.32
49	600177	雅戈尔	1,124,700	8,007,864.00	0.32
50	601577	长沙银行	977,200	7,993,496.00	0.32
51	600079	人福医药	462,800	7,946,276.00	0.32
52	600109	国金证券	1,052,300	7,944,865.00	0.32
53	002738	中矿资源	295,460	7,918,328.00	0.32
54	300003	乐普医疗	533,000	7,909,720.00	0.32
55	600060	海信视像	317,400	7,852,476.00	0.31
56	300017	网宿科技	988,400	7,808,360.00	0.31
57	600497	驰宏锌锗	1,443,000	7,705,620.00	0.31
58	300136	信维通信	391,800	7,671,444.00	0.31
59	603160	汇顶科技	111,400	7,658,750.00	0.31
60	603979	金诚信	150,000	7,579,500.00	0.30
61	002202	金风科技	1,118,200	7,514,304.00	0.30
62	002739	万达电影	617,800	7,469,202.00	0.30
63	689009	九号公司	202,748	7,463,153.88	0.30
64	000932	华菱钢铁	1,678,480	7,435,666.40	0.30
65	600985	淮北矿业	437,500	7,323,750.00	0.29
66	688120	华海清科	38,561	7,310,394.38	0.29
67	000683	远兴能源	1,057,400	7,306,634.00	0.29
68	600536	中国软件	243,794	7,294,316.48	0.29
69	002465	海格通信	703,600	7,289,296.00	0.29
70	002409	雅克科技	115,700	7,278,687.00	0.29
71	600348	华阳股份	730,545	7,276,228.20	0.29
72	002444	巨星科技	293,050	7,238,335.00	0.29
73	002281	光迅科技	193,100	7,216,147.00	0.29
74	000009	中国宝安	835,680	7,186,848.00	0.29
75	002008	大族激光	341,000	7,092,800.00	0.28
76	000878	云南铜业	568,440	7,082,762.40	0.28
77	688122	西部超导	184,309	7,062,720.88	0.28
78	002436	兴森科技	684,100	7,059,912.00	0.28
79	300474	景嘉微	111,550	7,053,306.50	0.28
80	600642	申能股份	792,700	6,999,541.00	0.28
81	601615	明阳智能	736,000	6,947,840.00	0.28

82	002797	第一创业	1,361,400	6,929,526.00	0.28
83	000039	中集集团	746,028	6,908,219.28	0.28
84	300012	华测检测	685,800	6,899,148.00	0.28
85	300054	鼎龙股份	303,900	6,892,452.00	0.27
86	601990	南京证券	895,600	6,878,208.00	0.27
87	600298	安琪酵母	246,250	6,877,762.50	0.27
88	000066	中国长城	783,700	6,857,375.00	0.27
89	600529	山东药玻	268,700	6,808,858.00	0.27
90	601666	平煤股份	604,300	6,768,160.00	0.27
91	688525	佰维存储	104,984	6,734,723.60	0.27
92	002673	西部证券	1,086,100	6,722,959.00	0.27
93	600839	四川长虹	1,495,520	6,714,884.80	0.27
94	603596	伯特利	171,902	6,686,987.80	0.27
95	601179	中国西电	830,400	6,676,416.00	0.27
96	000831	中国稀土	257,900	6,537,765.00	0.26
97	000783	长江证券	1,343,700	6,490,071.00	0.26
98	300395	菲利华	210,600	6,475,950.00	0.26
99	601717	郑煤机	437,106	6,469,168.80	0.26
100	603816	顾家家居	199,900	6,454,771.00	0.26
101	300002	神州泰岳	794,100	6,448,092.00	0.26
102	002432	九安医疗	158,800	6,437,752.00	0.26
103	000728	国元证券	1,060,100	6,424,206.00	0.26
104	000738	航发控制	319,700	6,416,379.00	0.26
105	600862	中航高科	338,620	6,359,283.60	0.25
106	000703	恒逸石化	890,800	6,315,772.00	0.25
107	688180	君实生物	217,317	6,313,058.85	0.25
108	601198	东兴证券	785,300	6,250,988.00	0.25
109	000960	锡业股份	403,140	6,244,638.60	0.25
110	601997	贵阳银行	1,184,320	6,241,366.40	0.25
111	002595	豪迈科技	162,600	6,206,442.00	0.25
112	603338	浙江鼎力	102,600	6,199,092.00	0.25
113	603345	安井食品	83,300	6,190,023.00	0.25
114	601696	中银证券	679,800	6,172,584.00	0.25
115	002155	湖南黄金	340,810	6,168,661.00	0.25
116	688188	柏楚电子	33,232	6,132,965.60	0.24
117	600863	内蒙华电	1,321,410	6,131,342.40	0.24
118	601162	天风证券	2,807,200	6,119,696.00	0.24
119	600038	中直股份	148,600	6,108,946.00	0.24
120	300037	新宙邦	213,780	6,105,556.80	0.24
121	300866	安克创新	85,730	6,104,833.30	0.24
122	300724	捷佳伟创	112,900	6,097,729.00	0.24
123	600521	华海药业	356,500	6,078,325.00	0.24
124	000921	海信家电	187,700	6,051,448.00	0.24
125	300001	特锐德	300,250	6,041,030.00	0.24

126	002472	双环传动	273,900	6,031,278.00	0.24
127	603939	益丰药房	245,637	6,030,388.35	0.24
128	002984	森麒麟	249,800	6,017,682.00	0.24
129	002294	信立泰	225,800	6,013,054.00	0.24
130	600141	兴发集团	314,688	6,004,247.04	0.24
131	600549	厦门钨业	344,700	5,946,075.00	0.24
132	600699	均胜电子	399,260	5,917,033.20	0.24
133	002407	多氟多	483,400	5,911,982.00	0.24
134	600546	山煤国际	401,400	5,868,468.00	0.23
135	002850	科达利	76,700	5,858,346.00	0.23
136	300699	光威复材	235,700	5,852,431.00	0.23
137	600820	隧道股份	891,200	5,819,536.00	0.23
138	600895	张江高科	314,700	5,815,656.00	0.23
139	002262	恩华药业	244,900	5,813,926.00	0.23
140	002064	华峰化学	810,100	5,808,417.00	0.23
141	301358	湖南裕能	183,900	5,785,494.00	0.23
142	600369	西南证券	1,614,600	5,780,268.00	0.23
143	600872	中炬高新	254,500	5,774,605.00	0.23
144	002195	岩山科技	2,300,582	5,774,460.82	0.23
145	300285	国瓷材料	323,200	5,769,120.00	0.23
146	000021	深科技	379,210	5,733,655.20	0.23
147	603589	口子窖	146,249	5,731,498.31	0.23
148	601000	唐山港	1,208,299	5,679,005.30	0.23
149	300073	当升科技	164,800	5,654,288.00	0.23
150	600021	上海电力	570,500	5,642,245.00	0.22
151	603087	甘李药业	121,800	5,641,776.00	0.22
152	300146	汤臣倍健	415,500	5,630,025.00	0.22
153	600486	扬农化工	98,810	5,577,824.50	0.22
154	000513	丽珠集团	149,686	5,569,816.06	0.22
155	601966	玲珑轮胎	299,300	5,498,141.00	0.22
156	002756	永兴材料	153,400	5,488,652.00	0.22
157	300058	蓝色光标	1,007,320	5,479,820.80	0.22
158	600704	物产中大	1,261,800	5,476,212.00	0.22
159	600153	建发股份	608,300	5,432,119.00	0.22
160	603179	新泉股份	138,100	5,419,044.00	0.22
161	300114	中航电测	119,700	5,416,425.00	0.22
162	600155	华创云信	915,648	5,411,479.68	0.22
163	000830	鲁西化工	465,771	5,398,285.89	0.22
164	688065	凯赛生物	118,498	5,378,624.22	0.21
165	300529	健帆生物	196,400	5,344,044.00	0.21
166	600118	中国卫星	239,500	5,324,085.00	0.21
167	002558	巨人网络	561,900	5,304,336.00	0.21
168	600583	海油工程	895,200	5,290,632.00	0.21
169	002152	广电运通	502,830	5,259,601.80	0.21

170	601156	东航物流	257,200	5,234,020.00	0.21
171	000591	太阳能	1,108,200	5,219,622.00	0.21
172	000623	吉林敖东	387,400	5,191,160.00	0.21
173	600970	中材国际	429,200	5,176,152.00	0.21
174	300373	扬杰科技	132,800	5,165,920.00	0.21
175	002025	航天电器	111,100	5,152,818.00	0.21
176	002385	大北农	1,332,300	5,129,355.00	0.20
177	300144	宋城演艺	636,700	5,112,701.00	0.20
178	002439	启明星辰	296,000	5,108,960.00	0.20
179	600380	健康元	453,700	5,067,829.00	0.20
180	601216	君正集团	1,366,800	5,043,492.00	0.20
181	000729	燕京啤酒	570,890	5,040,958.70	0.20
182	605358	立昂微	217,600	5,035,264.00	0.20
183	600998	九州通	1,029,867	5,025,750.96	0.20
184	600143	金发科技	757,000	5,003,770.00	0.20
185	000723	美锦能源	1,051,000	5,002,760.00	0.20
186	300251	光线传媒	594,100	4,996,381.00	0.20
187	600282	南钢股份	998,600	4,973,028.00	0.20
188	600637	东方明珠	816,724	4,965,681.92	0.20
189	000519	中兵红箭	338,450	4,965,061.50	0.20
190	600392	盛和资源	572,883	4,938,251.46	0.20
191	300677	英科医疗	183,600	4,922,316.00	0.20
192	300383	光环新网	582,500	4,922,125.00	0.20
193	600516	方大炭素	1,141,200	4,918,572.00	0.20
194	600763	通策医疗	90,700	4,902,335.00	0.20
195	000636	风华高科	374,816	4,895,096.96	0.20
196	300024	机器人	502,200	4,891,428.00	0.19
197	000818	航锦科技	220,100	4,859,808.00	0.19
198	002958	青农商行	1,799,700	4,823,196.00	0.19
199	601665	齐鲁银行	982,200	4,822,602.00	0.19
200	600909	华安证券	1,141,348	4,805,075.08	0.19
201	000883	湖北能源	799,300	4,803,793.00	0.19
202	002044	美年健康	1,268,000	4,793,040.00	0.19
203	600008	首创环保	1,783,500	4,779,780.00	0.19
204	600566	济川药业	149,800	4,750,158.00	0.19
205	601016	节能风电	1,588,065	4,748,314.35	0.19
206	600867	通化东宝	567,100	4,746,627.00	0.19
207	600511	国药股份	153,290	4,719,799.10	0.19
208	688213	思特威	97,043	4,706,585.50	0.19
209	601456	国联证券	488,100	4,705,284.00	0.19
210	000629	钒钛股份	1,882,000	4,705,000.00	0.19
211	300088	长信科技	994,110	4,672,317.00	0.19
212	600582	天地科技	675,530	4,654,401.70	0.19
213	000997	新大陆	334,510	4,653,034.10	0.19

214	600170	上海建工	2,158,900	4,641,635.00	0.19
215	600498	烽火通信	288,800	4,591,920.00	0.18
216	600129	太极集团	158,500	4,583,820.00	0.18
217	600499	科达制造	543,600	4,582,548.00	0.18
218	000750	国海证券	1,569,430	4,567,041.30	0.18
219	600535	天士力	363,018	4,566,766.44	0.18
220	601933	永辉超市	1,837,500	4,557,000.00	0.18
221	000598	兴蓉环境	604,510	4,545,915.20	0.18
222	002120	韵达股份	587,100	4,544,154.00	0.18
223	600004	白云机场	479,300	4,543,764.00	0.18
224	601991	大唐发电	1,505,900	4,532,759.00	0.18
225	000060	中金岭南	1,068,700	4,531,288.00	0.18
226	600580	卧龙电驱	371,780	4,517,127.00	0.18
227	002261	拓维信息	406,000	4,494,420.00	0.18
228	603000	人民网	223,950	4,476,760.50	0.18
229	300118	东方日升	369,400	4,469,740.00	0.18
230	300568	星源材质	544,600	4,465,720.00	0.18
231	300567	精测电子	79,000	4,464,290.00	0.18
232	002429	兆驰股份	925,400	4,451,174.00	0.18
233	002430	杭氧股份	199,400	4,436,650.00	0.18
234	600166	福田汽车	1,966,190	4,423,927.50	0.18
235	002939	长城证券	659,900	4,421,330.00	0.18
236	603486	科沃斯	93,500	4,411,330.00	0.18
237	603658	安图生物	95,110	4,381,717.70	0.17
238	600325	华发股份	673,979	4,380,863.50	0.17
239	603228	景旺电子	137,300	4,366,140.00	0.17
240	603156	养元饮品	205,100	4,362,477.00	0.17
241	601231	环旭电子	270,500	4,341,525.00	0.17
242	600816	建元信托	1,594,700	4,321,637.00	0.17
243	300765	新诺威	170,600	4,304,238.00	0.17
244	600673	东阳光	610,280	4,296,371.20	0.17
245	000893	亚钾国际	265,800	4,295,328.00	0.17
246	300487	蓝晓科技	102,350	4,274,136.00	0.17
247	300601	康泰生物	273,260	4,265,588.60	0.17
248	603568	伟明环保	207,229	4,264,772.82	0.17
249	603927	中科软	235,684	4,263,523.56	0.17
250	600754	锦江酒店	185,000	4,251,300.00	0.17
251	002508	老板电器	192,300	4,249,830.00	0.17
252	601636	旗滨集团	658,700	4,248,615.00	0.17
253	000027	深圳能源	578,096	4,220,100.80	0.17
254	000998	隆平高科	428,000	4,207,240.00	0.17
255	002624	完美世界	553,050	4,203,180.00	0.17
256	002926	华西证券	637,800	4,203,102.00	0.17
257	002653	海思科	136,300	4,184,410.00	0.17

258	603298	杭叉集团	212,300	4,169,572.00	0.17
259	603290	斯达半导	48,384	4,166,346.24	0.17
260	002497	雅化集团	466,893	4,164,685.56	0.17
261	600737	中粮糖业	434,271	4,164,658.89	0.17
262	600563	法拉电子	54,642	4,162,627.56	0.17
263	002065	东华软件	918,500	4,151,620.00	0.17
264	688052	纳芯微	40,324	4,144,500.72	0.17
265	300604	长川科技	152,300	4,137,991.00	0.16
266	601866	中远海发	1,603,654	4,137,427.32	0.16
267	002299	圣农发展	303,113	4,134,461.32	0.16
268	603077	和邦生物	2,503,290	4,130,428.50	0.16
269	300253	卫宁健康	699,900	4,129,410.00	0.16
270	601958	金铂股份	395,900	4,121,319.00	0.16
271	002056	横店东磁	329,540	4,109,363.80	0.16
272	600131	国网信通	243,400	4,106,158.00	0.16
273	600655	豫园股份	796,000	4,099,400.00	0.16
274	002500	山西证券	872,190	4,099,293.00	0.16
275	600373	中文传媒	276,000	4,095,840.00	0.16
276	002414	高德红外	695,300	4,095,317.00	0.16
277	688385	复旦微电	130,259	4,087,527.42	0.16
278	688772	珠海冠宇	274,303	4,087,114.70	0.16
279	300390	天华新能	237,510	4,080,421.80	0.16
280	688002	睿创微纳	145,557	4,071,229.29	0.16
281	300763	锦浪科技	97,500	4,059,900.00	0.16
282	300009	安科生物	475,240	4,058,549.60	0.16
283	603893	瑞芯微	67,900	4,017,643.00	0.16
284	002507	涪陵榨菜	327,220	4,008,445.00	0.16
285	002368	太极股份	177,483	4,002,241.65	0.16
286	688114	华大智造	84,036	3,984,146.76	0.16
287	002372	伟星新材	257,880	3,976,509.60	0.16
288	600707	彩虹股份	581,400	3,959,334.00	0.16
289	601611	中国核建	489,000	3,956,010.00	0.16
290	603885	吉祥航空	358,700	3,942,113.00	0.16
291	000887	中鼎股份	320,010	3,916,922.40	0.16
292	002203	海亮股份	485,600	3,875,088.00	0.15
293	603379	三美股份	99,000	3,874,860.00	0.15
294	002831	裕同科技	151,240	3,870,231.60	0.15
295	600755	厦门国贸	539,731	3,869,871.27	0.15
296	603225	新凤鸣	246,982	3,850,449.38	0.15
297	688390	固德威	68,501	3,844,276.12	0.15
298	688521	芯原股份	142,001	3,798,526.75	0.15
299	600995	南网储能	392,700	3,793,482.00	0.15
300	600859	王府井	321,951	3,779,704.74	0.15
301	600801	华新水泥	273,968	3,767,060.00	0.15

302	601880	辽港股份	3,049,670	3,751,094.10	0.15
303	600329	达仁堂	115,490	3,740,721.10	0.15
304	600416	湘电股份	375,700	3,734,458.00	0.15
305	600390	五矿资本	920,000	3,726,000.00	0.15
306	600884	杉杉股份	457,400	3,714,088.00	0.15
307	002683	广东宏大	184,500	3,713,985.00	0.15
308	300296	利亚德	822,900	3,703,050.00	0.15
309	002019	亿帆医药	298,780	3,692,920.80	0.15
310	300070	碧水源	880,600	3,689,714.00	0.15
311	002506	协鑫集成	1,895,200	3,676,688.00	0.15
312	600435	北方导航	426,160	3,673,499.20	0.15
313	002244	滨江集团	504,020	3,659,185.20	0.15
314	600399	抚顺特钢	647,400	3,644,862.00	0.15
315	601598	中国外运	647,100	3,643,173.00	0.15
316	600739	辽宁成大	434,800	3,639,276.00	0.15
317	600483	福能股份	311,000	3,626,260.00	0.14
318	000050	深天马 A	497,700	3,623,256.00	0.14
319	601098	中南传媒	291,700	3,622,914.00	0.14
320	300803	指南针	99,300	3,615,513.00	0.14
321	300748	金力永磁	278,860	3,614,025.60	0.14
322	600598	北大荒	288,710	3,605,987.90	0.14
323	002572	索菲亚	234,100	3,588,753.00	0.14
324	000155	川能动力	333,000	3,586,410.00	0.14
325	002568	百润股份	212,700	3,579,741.00	0.14
326	600901	江苏金租	707,980	3,575,299.00	0.14
327	600848	上海临港	392,300	3,573,853.00	0.14
328	002487	大金重工	155,500	3,557,840.00	0.14
329	002240	盛新锂能	263,900	3,541,538.00	0.14
330	300676	华大基因	101,100	3,539,511.00	0.14
331	002080	中材科技	273,700	3,530,730.00	0.14
332	001286	陕西能源	304,700	3,513,191.00	0.14
333	002373	千方科技	383,980	3,482,698.60	0.14
334	002557	洽洽食品	123,200	3,473,008.00	0.14
335	002936	郑州银行	2,004,543	3,467,859.39	0.14
336	688301	奕瑞科技	30,061	3,463,929.03	0.14
337	600968	海油发展	835,500	3,442,260.00	0.14
338	603712	七一二	188,600	3,430,634.00	0.14
339	300595	欧普康视	218,100	3,419,808.00	0.14
340	000563	陕国投 A	1,242,606	3,417,166.50	0.14
341	002268	电科网安	239,820	3,412,638.60	0.14
342	601928	凤凰传媒	310,200	3,399,792.00	0.14
343	603858	步长制药	224,100	3,395,115.00	0.14
344	603883	老百姓	184,581	3,388,907.16	0.14
345	000778	新兴铸管	969,540	3,373,999.20	0.13

346	600258	首旅酒店	273,186	3,373,847.10	0.13
347	688538	和辉光电	1,702,251	3,370,456.98	0.13
348	688017	绿的谐波	40,894	3,357,397.40	0.13
349	601212	白银有色	1,199,600	3,334,888.00	0.13
350	600271	航天信息	450,300	3,314,208.00	0.13
351	300558	贝达药业	101,800	3,313,590.00	0.13
352	600062	华润双鹤	169,124	3,311,447.92	0.13
353	688234	天岳先进	70,510	3,308,329.20	0.13
354	600528	中铁工业	449,976	3,293,824.32	0.13
355	000709	河钢股份	1,694,600	3,287,524.00	0.13
356	600977	中国电影	303,400	3,264,584.00	0.13
357	002531	天顺风能	363,900	3,253,266.00	0.13
358	603688	石英股份	109,800	3,251,178.00	0.13
359	601155	新城控股	366,200	3,248,194.00	0.13
360	002408	齐翔腾达	575,763	3,224,272.80	0.13
361	688220	翱捷科技	85,797	3,213,955.62	0.13
362	000739	普洛药业	236,800	3,213,376.00	0.13
363	600959	江苏有线	1,215,150	3,207,996.00	0.13
364	688005	容百科技	137,570	3,202,629.60	0.13
365	600378	昊华科技	110,800	3,202,120.00	0.13
366	688536	思瑞浦	32,600	3,188,606.00	0.13
367	603444	吉比特	17,822	3,172,494.22	0.13
368	601118	海南橡胶	695,100	3,162,705.00	0.13
369	000825	太钢不锈	934,400	3,158,272.00	0.13
370	688331	荣昌生物	72,748	3,142,713.60	0.13
371	603737	三棵树	85,520	3,101,810.40	0.12
372	603882	金域医学	113,941	3,098,055.79	0.12
373	600056	中国医药	303,910	3,075,569.20	0.12
374	688200	华峰测控	33,340	3,058,945.00	0.12
375	600906	财达证券	530,600	3,040,338.00	0.12
376	000987	越秀资本	609,585	3,023,541.60	0.12
377	600517	国网英大	696,500	3,015,845.00	0.12
378	601399	国机重装	1,168,400	3,014,472.00	0.12
379	603456	九洲药业	218,700	3,000,564.00	0.12
380	601019	山东出版	253,600	2,997,552.00	0.12
381	002266	浙富控股	1,070,850	2,987,671.50	0.12
382	600612	老凤祥	51,300	2,985,147.00	0.12
383	300212	易华录	176,520	2,970,831.60	0.12
384	600316	洪都航空	175,020	2,910,582.60	0.12
385	600871	石化油服	1,672,300	2,909,802.00	0.12
386	000937	冀中能源	433,200	2,902,440.00	0.12
387	603650	彤程新材	97,300	2,875,215.00	0.11
388	603529	爱玛科技	104,800	2,864,184.00	0.11
389	688567	孚能科技	296,852	2,849,779.20	0.11

390	002423	中粮资本	379,800	2,844,702.00	0.11
391	600925	苏能股份	557,800	2,816,890.00	0.11
392	001227	兰州银行	1,168,000	2,779,840.00	0.11
393	688063	派能科技	69,503	2,759,964.13	0.11
394	000032	深桑达 A	184,200	2,759,316.00	0.11
395	601965	中国汽研	162,500	2,744,625.00	0.11
396	603728	鸣志电器	68,200	2,743,686.00	0.11
397	601298	青岛港	286,600	2,739,896.00	0.11
398	600098	广州发展	425,900	2,725,760.00	0.11
399	600208	新潮中宝	1,722,900	2,722,182.00	0.11
400	688297	中无人机	81,910	2,705,487.30	0.11
401	688516	奥特维	64,555	2,699,044.55	0.11
402	601608	中信重工	703,000	2,678,430.00	0.11
403	002607	中公教育	1,748,200	2,674,746.00	0.11
404	600663	陆家嘴	301,600	2,660,112.00	0.11
405	002670	国盛金控	313,295	2,653,608.65	0.11
406	603233	大参林	185,408	2,651,334.40	0.11
407	600578	京能电力	813,200	2,634,768.00	0.11
408	688561	奇安信	111,388	2,630,984.56	0.10
409	300438	鹏辉能源	143,100	2,624,454.00	0.10
410	601106	中国一重	1,131,200	2,613,072.00	0.10
411	300357	我武生物	129,050	2,609,391.00	0.10
412	600500	中化国际	741,047	2,586,254.03	0.10
413	300776	帝尔激光	56,020	2,574,679.20	0.10
414	600377	宁沪高速	201,000	2,532,600.00	0.10
415	003031	中瓷电子	54,700	2,529,328.00	0.10
416	000785	居然之家	1,032,500	2,508,975.00	0.10
417	600022	山东钢铁	2,040,806	2,489,783.32	0.10
418	002865	钧达股份	64,700	2,483,186.00	0.10
419	600967	内蒙一机	344,844	2,482,876.80	0.10
420	600350	山东高速	277,600	2,456,760.00	0.10
421	600315	上海家化	137,820	2,450,439.60	0.10
422	688349	三一重能	97,495	2,421,775.80	0.10
423	000958	电投产融	660,400	2,417,064.00	0.10
424	000537	中绿电	253,500	2,415,855.00	0.10
425	300888	稳健医疗	95,420	2,414,126.00	0.10
426	688425	铁建重工	655,130	2,410,878.40	0.10
427	000559	万向钱潮	539,400	2,405,724.00	0.10
428	600827	百联股份	324,976	2,398,322.88	0.10
429	000156	华数传媒	381,400	2,395,192.00	0.10
430	601568	北元集团	643,420	2,387,088.20	0.10
431	002690	美亚光电	144,238	2,379,927.00	0.09
432	002608	江苏国信	307,000	2,379,250.00	0.09
433	688029	南微医学	38,529	2,371,845.24	0.09

434	603517	绝味食品	153,900	2,370,060.00	0.09
435	603826	坤彩科技	80,940	2,344,831.80	0.09
436	601992	金隅集团	1,706,600	2,338,042.00	0.09
437	603707	健友股份	196,566	2,335,204.08	0.09
438	002867	周大生	178,400	2,329,904.00	0.09
439	688032	禾迈股份	20,081	2,304,897.18	0.09
440	300682	朗新集团	268,700	2,286,637.00	0.09
441	600126	杭钢股份	550,400	2,262,144.00	0.09
442	003022	联泓新科	162,900	2,233,359.00	0.09
443	000967	盈峰环境	521,300	2,205,099.00	0.09
444	688475	萤石网络	63,756	2,174,717.16	0.09
445	688778	厦钨新能	69,043	2,156,903.32	0.09
446	688520	神州细胞	54,806	2,156,616.10	0.09
447	603218	日月股份	208,900	2,145,403.00	0.09
448	600339	中油工程	682,830	2,130,429.60	0.08
449	603786	科博达	33,200	2,129,780.00	0.08
450	600032	浙江新能	292,100	2,126,488.00	0.08
451	600481	双良节能	454,700	2,123,449.00	0.08
452	600361	创新新材	526,700	2,122,601.00	0.08
453	600095	湘财股份	355,300	2,117,588.00	0.08
454	301267	华夏眼科	102,100	2,115,512.00	0.08
455	000898	鞍钢股份	989,400	2,097,528.00	0.08
456	603127	昭衍新药	154,456	2,049,631.12	0.08
457	688248	南网科技	68,558	2,031,373.54	0.08
458	003035	南网能源	460,300	2,025,320.00	0.08
459	600808	马钢股份	992,940	2,005,738.80	0.08
460	688281	华秦科技	24,027	2,001,929.64	0.08
461	002563	森马服饰	335,900	1,951,579.00	0.08
462	002153	石基信息	339,956	1,947,947.88	0.08
463	601228	广州港	622,700	1,899,235.00	0.08
464	603185	弘元绿能	110,100	1,881,609.00	0.08
465	000539	粤电力 A	367,900	1,868,932.00	0.07
466	001872	招商港口	97,000	1,867,250.00	0.07
467	688779	长远锂科	394,747	1,827,678.61	0.07
468	600928	西安银行	546,800	1,788,036.00	0.07
469	001203	大中矿业	184,100	1,769,201.00	0.07
470	000401	冀东水泥	431,770	1,752,986.20	0.07
471	000959	首钢股份	640,900	1,743,248.00	0.07
472	688006	杭可科技	97,643	1,703,870.35	0.07
473	600764	中国海防	86,500	1,697,995.00	0.07
474	002518	科士达	95,200	1,685,040.00	0.07
475	603056	德邦股份	127,000	1,663,700.00	0.07
476	603305	旭升集团	151,700	1,601,952.00	0.06
477	601139	深圳燃气	238,200	1,591,176.00	0.06

478	600299	安迪苏	163,600	1,586,920.00	0.06
479	688172	燕东微	96,969	1,568,958.42	0.06
480	300861	美畅股份	80,400	1,555,740.00	0.06
481	603317	天味食品	131,410	1,499,388.10	0.06
482	688276	百克生物	50,807	1,441,394.59	0.06
483	301029	怡合达	72,600	1,427,316.00	0.06
484	688387	信科移动	278,293	1,402,596.72	0.06
485	688375	国博电子	19,406	1,370,839.84	0.05
486	002791	坚朗五金	52,800	1,365,936.00	0.05
487	600927	永安期货	120,500	1,343,575.00	0.05
488	688819	天能股份	55,828	1,332,056.08	0.05
489	688153	唯捷创芯	33,926	1,255,262.00	0.05
490	000031	大悦城	528,520	1,236,736.80	0.05
491	688107	安路科技	48,628	1,236,123.76	0.05
492	601858	中国科传	63,900	1,221,768.00	0.05
493	601158	重庆水务	238,500	1,144,800.00	0.05
494	601828	美凯龙	440,400	1,123,020.00	0.04
495	002945	华林证券	112,300	1,120,754.00	0.04
496	688348	昱能科技	18,461	1,089,199.00	0.04
497	600956	新天绿能	124,600	1,017,982.00	0.04
498	301165	锐捷网络	27,600	823,584.00	0.03
499	688295	中复神鹰	40,033	812,669.90	0.03
500	603868	飞科电器	19,667	755,212.80	0.03
501	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
502	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
503	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
504	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
505	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
506	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
507	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
508	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
509	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
510	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
511	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
512	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
513	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
514	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
515	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
516	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
517	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
518	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
519	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
520	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
521	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00

522	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
523	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
524	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
525	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
526	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
527	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
528	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
529	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
530	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
531	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	688777	中控技术	11,024,407.25	0.47
2	601567	三星医疗	9,695,223.00	0.42
3	688617	惠泰医疗	8,438,228.49	0.36
4	002202	金风科技	8,337,345.00	0.36
5	002436	兴森科技	7,766,662.00	0.33
6	603979	金诚信	7,726,635.18	0.33
7	601615	明阳智能	7,697,631.00	0.33
8	301358	湖南裕能	7,564,618.00	0.33
9	300002	神州泰岳	7,316,186.00	0.31
10	000921	海信家电	7,171,772.32	0.31
11	300054	鼎龙股份	7,058,263.00	0.30
12	603345	安井食品	6,751,560.00	0.29
13	600872	中炬高新	6,700,239.00	0.29
14	002984	森麒麟	6,266,662.20	0.27
15	688525	佰维存储	5,998,149.72	0.26
16	603179	新泉股份	5,864,173.00	0.25
17	603087	甘李药业	5,773,433.00	0.25
18	000818	航锦科技	5,571,004.00	0.24
19	002422	科伦药业	5,497,482.00	0.24
20	688065	凯赛生物	5,458,837.00	0.23

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	21,364,703.60	0.92
2	002422	科伦药业	19,038,826.89	0.82
3	000975	银泰黄金	15,331,795.56	0.66
4	300418	昆仑万维	14,462,543.00	0.62
5	600160	巨化股份	12,383,168.20	0.53
6	600161	天坛生物	10,942,864.25	0.47
7	600415	小商品城	9,489,874.50	0.41
8	600482	中国动力	8,376,462.14	0.36
9	688072	拓荆科技	8,352,051.37	0.36
10	002600	领益智造	6,832,819.00	0.29
11	002032	苏泊尔	5,256,945.00	0.23
12	300394	天孚通信	5,208,042.40	0.22
13	002131	利欧股份	4,755,376.10	0.20
14	000581	威孚高科	4,398,661.00	0.19
15	688728	格科微	4,270,982.59	0.18
16	002966	苏州银行	3,975,522.40	0.17
17	002092	ST 中泰	3,963,142.40	0.17
18	300866	安克创新	3,931,268.30	0.17
19	000547	航天发展	3,924,711.66	0.17
20	300026	红日药业	3,841,535.80	0.17

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	713,932,419.98
卖出股票收入（成交）总额	491,526,101.19

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）	353,021.67	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	353,021.67	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	113685	升 24 转债	3,530	353,021.67	0.01

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。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆

作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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，河南神火煤电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局河南局、永城市水利局的处罚。思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。西部矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海西蒙古族藏族自治州水利局、海西蒙古族藏族自治州应急管理局的处罚。重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆市江北区市场监督管理局的处罚。

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

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,781,427.22
2	应收清算款	1,959,262.02
3	应收股利	94,912.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	30,071.42

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,865,672.89

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	688169	石头科技	1,878,409.08	0.07	询价转让流通受限
2	688169	石头科技	392,600.00	0.02	转融通流通受限
3	000988	华工科技	688,390.00	0.03	转融通流通受限
4	300502	新易盛	612,190.00	0.02	转融通流通受限
5	002340	格林美	542,724.00	0.02	转融通流通受限
6	002028	思源电气	434,850.00	0.02	转融通流通受限
7	601168	西部矿业	337,460.00	0.01	转融通流通受限
8	600066	宇通客车	335,400.00	0.01	转融通流通受限
9	000933	神火股份	311,542.00	0.01	转融通流通受限
10	601077	渝农商行	256,020.00	0.01	转融通流通受限
11	601058	赛轮轮胎	250,600.00	0.01	转融通流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有限 公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基 金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例

22,797	180,504.6 8	3,347,137.5 47.00	81.34%	767,827,60 3.00	18.66%	2,706,533.3 22.00	65.77%
--------	----------------	----------------------	--------	--------------------	--------	----------------------	--------

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	308,082,700.00	7.49%
2	中国人寿保险股份有限公司	172,047,200.00	4.18%
3	中信建投证券股份有限公司	52,895,222.00	1.29%
4	江苏张家港农村商业银行股份有限公司—金港湾瑞享 6 号净值型人民币理财产品	14,560,000.00	0.35%
5	佛山市中科睿盈科技研究有限责任公司	13,497,400.00	0.33%
6	香港中央结算有限公司	9,416,076.00	0.23%
7	中信证券股份有限公司	8,938,930.00	0.22%
8	杜蕾	8,536,200.00	0.21%
9	方正证券股份有限公司	8,446,463.00	0.21%
10	招商证券股份有限公司	7,770,050.00	0.19%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,706,533,322.00	65.77%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%
------------------	------	---------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 8 月 27 日）基金份额总额	295,259,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,517,965,150.00
本报告期基金总申购份额	1,182,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	585,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,114,965,150.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	128,362.00	0.01%	77.02	0.06%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	572,123,555.03	47.62%	57,221.24	47.60%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	285,183,449.37	23.74%	28,518.66	23.72%	-
中信建投	3	344,040,208.88	28.63%	34,404.03	28.62%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为华金证券股份有限公司。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	193,442.26	28.86%	-	-	-	-
中信建投	476,944.16	71.14%	-	-	-	-
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
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-11
3	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
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
6	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
7	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 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

中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2024 年 01 月 01 日 ~2024 年 06 月 30 日	2,549,03 2,277.00	1,226,73 9,324.00	1,069,23 8,279.00	2,706,53 3,322.00	65.77 %
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如场外个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；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。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日