

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容真实、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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12	投资组合报告附注	61
§ 8	基金份额持有人信息	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 9	开放式基金份额变动	63
§ 10	重大事件揭示	64
10.1	基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4	基金投资策略的改变	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8	其他重大事件	67
§ 11	备查文件目录	68
11.1	备查文件目录	68
11.2	存放地点	68
11.3	查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 500 量化增强	
基金主代码	012080	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 15 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	538,209,845.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	012080	012081
报告期末下属分级基金的份额总额	373,822,570.98 份	164,387,274.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。债券投资方面，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，并通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择等方面进行积极主动的债券投资管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资

	风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。
--	--

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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
本期已实现收益	-6,097,546.60	-2,369,627.34
本期利润	-8,407,917.92	-2,398,248.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0216	-0.0158
本期加权平均净值利润率	-2.65%	-1.95%
本期基金份额净值增长率	-2.78%	-2.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
期末可供分配利润	-74,619,715.34	-34,007,216.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1996	-0.2069
期末基金资产净值	299,202,855.64	130,380,057.96
期末基金份额净值	0.8004	0.7931
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金份额累计净值增长率	-19.96%	-20.69%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 量化增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	-4.57%	0.87%	-6.55%	0.91%	1.98%	-0.04%
过去三个月	-2.24%	1.02%	-6.16%	1.09%	3.92%	-0.07%
过去六个月	-2.78%	1.44%	-8.46%	1.53%	5.68%	-0.09%
过去一年	-9.70%	1.16%	-16.71%	1.21%	7.01%	-0.05%
过去三年	-20.09%	1.07%	-26.00%	1.14%	5.91%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-19.96%	1.06%	-25.14%	1.13%	5.18%	-0.07%

易方达中证 500 量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.60%	0.87%	-6.55%	0.91%	1.95%	-0.04%
过去三个月	-2.30%	1.02%	-6.16%	1.09%	3.86%	-0.07%
过去六个月	-2.94%	1.44%	-8.46%	1.53%	5.52%	-0.09%
过去一年	-9.98%	1.16%	-16.71%	1.21%	6.73%	-0.05%
过去三年	-20.81%	1.07%	-26.00%	1.14%	5.19%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-20.69%	1.06%	-25.14%	1.13%	4.45%	-0.07%

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 指数量化增强型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 6 月 15 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达中证 500 量化增强 A



易方达中证 500 量化增强 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-19.96%，同期业绩比较基准收益率为-25.14%；C 类基金份额净值增长率为-20.69%，同期业绩比较基准收益率为-25.14%。

§ 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		
官泽帆	本基金的基金经理，易方达中证 500 增强策略 ETF 的基金经理，量化投资部总经理助理	2021-06-15	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师，摩根士丹利华鑫基金管理有

					限公司数量化研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理，易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达易百智能量化策略混合的基金经理。
刘文贵	本基金的基金经理，投资经理	2023-11-09	-	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任松河资本管理公司量化研究员，上海泓信投资管理有限公司衍生品投资总监，深圳市弘源泰平资产管理有限公司量化投资总监。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
刘文贵	公募基金	1	429,582,913.60	2023-11-09
	私募资产管理计划	1	43,500,188.56	2019-04-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	2	473,083,102.16	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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

回顾本报告期，国内经济整体运行平稳，上半年国内生产总值，按不变价计算，同比增长 5.0%，但国内有效需求不足，经济回升向好基础仍需巩固：社会消费品零售总额上半年同比增长 3.7%，但 6 月份单月同比增长 2.0%，低于市场一致预期，低于前值 3.7%；从房地产投资与商品房销售数据来看，增速仍在下降；外需向好，出口是需求侧的主要向上动力，上半年出口总额同比增长 6.9%，货物和服务净出口对经济增长的贡献率约为 13.9%。

市场表现方面，上半年市场整体先跌后涨，呈现震荡趋势，上证指数、沪深 300 的涨跌幅分别为 -0.25%、0.89%，但中小盘指数普遍跌幅较大，中证 500 指数下跌 8.96%，中证 1000 指数下跌 16.84%，中证 2000 指数下跌 23.28%。行业表现结构分化特征明显，从申万行业指数来看，银行、煤炭、公用事业涨幅均超过两位数，分别为 17.02%、11.96%、11.76%；综合、计算机、商贸零售、社会服务的跌幅较大，均超过 24%，同时超过半数行业指数今年以来录得负收益。从风格表现的角度来看，市场整体风险偏好明显下降，防御类的估值因子、低波因子、红利因子等年初至今的表现明显领先于其他风格，小盘明显弱于大盘。综合来看，大盘价值的表现最好，小盘成长下跌幅度最大。

在此期间，作为指数增强型基金，管理人严格遵照量化指数增强投资模式进行操作，以标的指数的构成为基础，主要利用以基本面选股因子为主的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.8004 元，本报告期份额净值增长率为 -2.78%，同期业绩比较基准收益率为 -8.46%；C 类基金份额净值为 0.7931 元，本报告期份额净值增长率为 -2.94%，

同期业绩比较基准收益率为-8.46%。年化跟踪误差 2.40%，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，下半年出口大概率将保持较高增速，内需可能仍将面临一定的压力，但新一轮设备更新与财政加快基建等政策逐渐发力，或将对冲部分压力，经济基本面继续弱波动。股票市场方面，首先，高行业景气度的投资机会相对稀缺，在当前稳定资本市场预期的政策导向下，存量资金或将继续持有红利低波类标的；其次，部分风险偏好较高的资金仍可能继续追逐热门主题，例如算力、人工智能等，但需要关注企业未来业绩兑现情况；最后，需要注意下半年来自海外的宏观事件冲击，例如美联储降息对市场风格的冲击，美国总统大选对地缘政治风险的影响。

综上，下一阶段基金运作管理仍将迎来诸多方面的挑战，管理人将继续严格遵照多因子量化增强的投资模式进行操作，同时结合采用长期有效的基本面量化模型进行选股，配置稳健的策略模型，以顺应市场风格变换，为投资人创造持续稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 500 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 指数量化增强型证券投资基金

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	28,901,483.32	37,324,719.22
结算备付金		4,078,960.04	2,757,219.91
存出保证金		22,562.65	2,096,902.80
交易性金融资产	6.4.7.2	397,036,623.44	397,545,493.90
其中：股票投资		397,026,571.86	397,369,485.80
基金投资		-	-
债券投资		10,051.58	176,008.10
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		10,840.87	934,572.98
应收股利		-	-
应收申购款		304,713.98	528,264.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		430,355,184.30	441,187,173.79
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		13,172.98	-
应付赎回款		97,293.64	96,855.30
应付管理人报酬		289,265.06	297,289.39
应付托管费		54,237.20	55,741.74
应付销售服务费		31,795.27	29,137.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		40,619.41	0.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	245,887.14	304,221.38
负债合计		772,270.70	783,245.80
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	538,209,845.72	535,988,426.12
未分配利润	6.4.7.8	-108,626,932.12	-95,584,498.13
净资产合计		429,582,913.60	440,403,927.99
负债和净资产总计		430,355,184.30	441,187,173.79

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.8004 元，C 类基金份额净值 0.7931 元；

基金份额总额 538,209,845.72 份, 下属分级基金的份额总额分别为: A 类基金份额总额 373,822,570.98 份, C 类基金份额总额 164,387,274.74 份。

6.2 利润表

会计主体: 易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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		-8,436,486.99	13,092,848.91
1.利息收入		145,427.75	69,532.50
其中: 存款利息收入	6.4.7.9	145,427.75	69,532.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-6,278,097.99	-7,602,261.31
其中: 股票投资收益	6.4.7.10	-14,949,154.15	-13,275,219.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	36,428.54	63.31
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	3,442,282.12	-
股利收益	6.4.7.14	5,192,345.50	5,672,895.31
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	-2,338,992.72	20,525,184.99
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	35,175.97	100,392.73
减: 二、营业总支出		2,369,679.67	2,956,594.78
1. 管理人报酬		1,753,721.74	2,201,952.04
2. 托管费		328,822.76	412,866.02
3. 销售服务费		183,534.04	249,671.62
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		12,398.10	0.21
8. 其他费用	6.4.7.18	91,203.03	92,104.89

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,806,166.66	10,136,254.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,806,166.66	10,136,254.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,806,166.66	10,136,254.13

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
二、本期期初净资产	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,221,419.60	-13,042,433.99	-10,821,014.39
（一）、综合收益总额	-	-10,806,166.66	-10,806,166.66
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,221,419.60	-2,236,267.33	-14,847.73
其中：1.基金申购款	71,281,898.17	-15,065,855.86	56,216,042.31
2.基金赎回款	-69,060,478.57	12,829,588.53	-56,230,890.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	538,209,845.72	-108,626,932.12	429,582,913.60
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	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24
二、本期期初净资产	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,770,330.79	16,192,186.68	-17,578,144.11
（一）、综合收益总额	-	10,136,254.13	10,136,254.13
（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）	-33,770,330.79	6,055,932.55	-27,714,398.24
其中：1.基金申购款	204,530,649.95	-16,582,655.99	187,947,993.96
2.基金赎回款	-238,300,980.74	22,638,588.54	-215,662,392.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	556,078,772.96	-63,932,973.83	492,145,799.13

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 指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1043 号《关于准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 指数量化增强型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 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,088,975,598.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 547,709.87 份基金份额。

本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。

本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再

缴纳；已缴纳增值的，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	28,901,483.32
等于：本金	28,899,009.60
加：应计利息	2,473.72
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	28,901,483.32

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		417,327,998.51	-	397,026,571.86	-20,301,426.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,999.98	2.08	10,051.58	5,049.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,999.98	2.08	10,051.58	5,049.52
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		417,332,998.49	2.08	397,036,623.44	-20,296,377.13

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**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	156,379.54
其中：交易所市场	156,379.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	245,887.14

6.4.7.7 实收基金**易方达中证 500 量化增强 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	394,221,116.92	394,221,116.92
本期申购	19,695,199.23	19,695,199.23
本期赎回（以“-”号填列）	-40,093,745.17	-40,093,745.17
本期末	373,822,570.98	373,822,570.98

易方达中证 500 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	141,767,309.20	141,767,309.20
本期申购	51,586,698.94	51,586,698.94
本期赎回（以“-”号填列）	-28,966,733.40	-28,966,733.40
本期末	164,387,274.74	164,387,274.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润**易方达中证 500 量化增强 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-56,633,365.74	-13,017,679.30	-69,651,045.04
本期期初	-56,633,365.74	-13,017,679.30	-69,651,045.04
本期利润	-6,097,546.60	-2,310,371.32	-8,407,917.92
本期基金份额交易产生的变动数	3,190,027.58	249,220.04	3,439,247.62
其中：基金申购款	-3,103,201.51	-821,306.41	-3,924,507.92
基金赎回款	6,293,229.09	1,070,526.45	7,363,755.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,540,884.76	-15,078,830.58	-74,619,715.34

易方达中证 500 量化增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,270,450.43	-4,663,002.66	-25,933,453.09
本期期初	-21,270,450.43	-4,663,002.66	-25,933,453.09
本期利润	-2,369,627.34	-28,621.40	-2,398,248.74
本期基金份额交易产生的变动数	-3,770,217.67	-1,905,297.28	-5,675,514.95
其中：基金申购款	-8,510,183.94	-2,631,164.00	-11,141,347.94
基金赎回款	4,739,966.27	725,866.72	5,465,832.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,410,295.44	-6,596,921.34	-34,007,216.78

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	74,559.97
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	70,695.33
其他	172.45
合计	145,427.75

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	-14,949,154.15
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-14,949,154.15

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	586,209,889.91
减：卖出股票成本总额	600,554,754.81
减：交易费用	604,289.25
买卖股票差价收入	-14,949,154.15

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	41.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	36,387.07
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	36,428.54

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	227,444.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	190,996.46
减：应计利息总额	52.04
减：交易费用	9.07
买卖债券差价收入	36,387.07

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	3,442,282.12

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	5,192,345.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,192,345.50

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	-2,676,472.72
——股票投资	-2,681,522.24
——债券投资	5,049.52
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	337,480.00
——权证投资	-
——期货投资	337,480.00
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	-2,338,992.72

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	35,175.97
合计	35,175.97

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,653.85
存托服务费	41.58
合计	91,203.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

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	1,187,352,286.84	100.00%	2,259,937,959.43	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	227,444.64	100.00%	-	-

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	234,980.08	100.00%	156,379.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	452,001.33	100.00%	220,575.26	100.00%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。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	1,753,721.74
其中：应支付销售机构的客	632,910.91	765,945.28

户维护费		
应支付基金管理人的净管理费	1,120,810.83	1,436,006.76

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	328,822.76	412,866.02

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

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

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	29,391.85	29,391.85

中国工商银行	-	32,454.10	32,454.10
广发证券	-	3,955.69	3,955.69
合计	-	65,801.64	65,801.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证500量化增强A	易方达中证500量化增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	69,468.14	69,468.14
中国工商银行	-	39,681.20	39,681.20
广发证券	-	4,550.43	4,550.43
合计	-	113,699.77	113,699.77

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用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

易方达中证 500 量化增强 A

无。

易方达中证 500 量化增强 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	28,901,483.32	74,559.97	29,714,855.26	56,530.73

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
-	-	-	-	-	-
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

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

易方达中证 500 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通	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	923	65,094.57	173,533.23	-
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	620	10,044.00	9,895.20	-
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	233	6,058.00	8,735.17	-
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	658	14,910.28	10,455.62	-
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	171	14,870.16	29,913.03	-
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	819	12,850.11	15,389.01	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.04%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	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	10,051.58	176,008.10
未评级	0.00	0.00
合计	10,051.58	176,008.10

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额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	28,901,483.32	-	-	-	28,901,483.32
结算备付金	4,078,960.04	-	-	-	4,078,960.04
存出保证金	22,562.65	-	-	-	22,562.65
交易性金融资产	-	-	10,051.58	397,026,571.86	397,036,623.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,840.87	10,840.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	304,713.98	304,713.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	33,003,006.01	-	10,051.58	397,342,126.71	430,355,184.30
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	-	-	-	13,172.98	13,172.98
应付赎回款	-	-	-	97,293.64	97,293.64
应付管理人报酬	-	-	-	289,265.06	289,265.06
应付托管费	-	-	-	54,237.20	54,237.20
应付销售服务费	-	-	-	31,795.27	31,795.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	40,619.41	40,619.41
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	245,887.14	245,887.14
负债总计	-	-	-	772,270.70	772,270.70
利率敏感度缺口	33,003,006.01	-	10,051.58	396,569,856.01	429,582,913.60
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	37,324,719.22	-	-	-	37,324,719.22
结算备付金	2,757,219.91	-	-	-	2,757,219.91
存出保证金	2,096,902.80	-	-	-	2,096,902.80
交易性金融资产	-	176,008.10	-	397,369,485.80	397,545,493.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	934,572.98	934,572.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	528,264.98	528,264.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	42,178,841.93	176,008.10	-	398,832,323.76	441,187,173.79
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	96,855.30	96,855.30
应付管理人报酬	-	-	-	297,289.39	297,289.39
应付托管费	-	-	-	55,741.74	55,741.74
应付销售服务费	-	-	-	29,137.76	29,137.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,221.38	304,221.38
负债总计	-	-	-	783,245.80	783,245.80
利率敏感度缺口	42,178,841.93	176,008.10	-	398,049,077.96	440,403,927.99

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金 资产净 值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	397,026,571.86	92.42	397,369,485.80	90.23
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	397,026,571.86	92.42	397,369,485.80	90.23

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%	20,469,171.99	20,336,306.74
2.业绩比较基准下降 5%	-20,469,171.99	-20,336,306.74	

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	396,576,157.42
第二层次	45,611.11
第三层次	414,854.91
合计	397,036,623.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	397,026,571.86	92.26
	其中:股票	397,026,571.86	92.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,051.58	0.00
	其中:债券	10,051.58	0.00
	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	32,980,443.36	7.66
8	其他各项资产	338,117.50	0.08
9	合计	430,355,184.30	100.00

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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,498,852.00	0.58
B	采矿业	23,623,787.00	5.50
C	制造业	212,816,079.30	49.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,306,239.00	3.56
E	建筑业	4,785,387.00	1.11
F	批发和零售业	4,029,094.40	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	7,243,093.00	1.69
H	住宿和餐饮业	2,579,835.00	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,189,515.70	5.63
J	金融业	29,451,405.72	6.86
K	房地产业	4,084,887.00	0.95
L	租赁和商务服务业	1,170,546.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	60,720.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,672,701.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,365,690.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	4,598,436.00	1.07
S	综合	209,088.00	0.05
	合计	340,685,356.12	79.31

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	101,880.00	0.02

B	采矿业	1,207,209.00	0.28
C	制造业	36,640,323.41	8.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	690,441.00	0.16
E	建筑业	1,920,689.00	0.45
F	批发和零售业	1,845,357.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,123,182.00	0.26
H	住宿和餐饮业	54,060.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,675,627.59	1.79
J	金融业	2,497,970.00	0.58
K	房地产业	63,558.00	0.01
L	租赁和商务服务业	525,013.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	1,775,216.54	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	87,671.20	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	133,018.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	56,341,215.74	13.12

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

7.3.1 期末指数投资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	52,200	5,509,710.00	1.28
2	601058	赛轮轮胎	281,900	3,946,600.00	0.92
3	002028	思源电气	50,700	3,391,830.00	0.79
4	002340	格林美	521,700	3,323,229.00	0.77
5	002532	天山铝业	398,800	3,234,268.00	0.75
6	600066	宇通客车	119,800	3,090,840.00	0.72
7	688169	石头科技	7,575	2,973,945.00	0.69

8	002273	水晶光电	168,500	2,861,130.00	0.67
9	688099	晶晨股份	47,530	2,819,479.60	0.66
10	000738	航发控制	139,800	2,805,786.00	0.65
11	000703	恒逸石化	392,400	2,782,116.00	0.65
12	300394	天孚通信	31,400	2,776,388.00	0.65
13	002384	东山精密	133,600	2,765,520.00	0.64
14	000400	许继电气	80,200	2,759,682.00	0.64
15	300054	鼎龙股份	121,500	2,755,620.00	0.64
16	601717	郑煤机	185,100	2,739,480.00	0.64
17	300207	欣旺达	179,600	2,724,532.00	0.63
18	002128	电投能源	128,100	2,702,910.00	0.63
19	600988	赤峰黄金	163,300	2,668,322.00	0.62
20	000830	鲁西化工	227,900	2,641,361.00	0.61
21	002465	海格通信	250,600	2,596,216.00	0.60
22	000683	远兴能源	368,400	2,545,644.00	0.59
23	600529	山东药玻	98,700	2,501,058.00	0.58
24	603160	汇顶科技	36,200	2,488,750.00	0.58
25	600642	申能股份	279,600	2,468,868.00	0.57
26	600521	华海药业	143,900	2,453,495.00	0.57
27	600885	宏发股份	87,900	2,433,072.00	0.57
28	601168	西部矿业	135,500	2,432,225.00	0.57
29	002203	海亮股份	300,900	2,401,182.00	0.56
30	000887	中鼎股份	191,800	2,347,632.00	0.55
31	002019	亿帆医药	189,500	2,342,220.00	0.55
32	688002	睿创微纳	83,204	2,327,215.88	0.54
33	600970	中材国际	192,900	2,326,374.00	0.54
34	002138	顺络电子	84,300	2,314,878.00	0.54
35	002008	大族激光	111,200	2,312,960.00	0.54
36	000598	兴蓉环境	305,200	2,295,104.00	0.53
37	601666	平煤股份	204,600	2,291,520.00	0.53
38	002595	豪迈科技	59,800	2,282,566.00	0.53
39	002517	恺英网络	238,100	2,273,855.00	0.53
40	300251	光线传媒	269,000	2,262,290.00	0.53
41	300677	英科医疗	84,200	2,257,402.00	0.53
42	000883	湖北能源	375,500	2,256,755.00	0.53
43	601555	东吴证券	376,140	2,219,226.00	0.52
44	300529	健帆生物	81,100	2,206,731.00	0.51
45	600872	中炬高新	96,200	2,182,778.00	0.51
46	002939	长城证券	320,900	2,150,030.00	0.50
47	601577	长沙银行	259,388	2,121,793.84	0.49
48	600959	江苏有线	803,400	2,120,976.00	0.49
49	601128	常熟银行	277,010	2,096,965.70	0.49
50	300866	安克创新	29,390	2,092,861.90	0.49
51	002025	航天电器	44,500	2,063,910.00	0.48

52	000728	国元证券	338,900	2,053,734.00	0.48
53	002153	石基信息	352,700	2,020,971.00	0.47
54	601233	桐昆股份	126,000	2,010,960.00	0.47
55	000709	河钢股份	1,031,600	2,001,304.00	0.47
56	603893	瑞芯微	33,600	1,988,112.00	0.46
57	603568	伟明环保	95,800	1,971,564.00	0.46
58	600096	云天化	100,500	1,951,710.00	0.45
59	688188	柏楚电子	10,564	1,949,586.20	0.45
60	600399	抚顺特钢	339,800	1,913,074.00	0.45
61	300724	捷佳伟创	35,400	1,911,954.00	0.45
62	601108	财通证券	288,638	1,907,897.18	0.44
63	300285	国瓷材料	106,300	1,897,455.00	0.44
64	600038	中直股份	45,700	1,878,727.00	0.44
65	002557	洽洽食品	65,600	1,849,264.00	0.43
66	603826	坤彩科技	62,300	1,804,831.00	0.42
67	600315	上海家化	101,300	1,801,114.00	0.42
68	002373	千方科技	196,800	1,784,976.00	0.42
69	600499	科达制造	210,400	1,773,672.00	0.41
70	300558	贝达药业	54,000	1,757,700.00	0.41
71	601636	旗滨集团	271,800	1,753,110.00	0.41
72	002155	湖南黄金	96,600	1,748,460.00	0.41
73	600141	兴发集团	90,200	1,721,016.00	0.40
74	601615	明阳智能	181,500	1,713,360.00	0.40
75	300001	特锐德	84,500	1,700,140.00	0.40
76	600820	隧道股份	259,100	1,691,923.00	0.39
77	603786	科博达	26,300	1,687,145.00	0.39
78	002563	森马服饰	288,400	1,675,604.00	0.39
79	600637	东方明珠	268,800	1,634,304.00	0.38
80	300383	光环新网	192,900	1,630,005.00	0.38
81	600985	淮北矿业	97,100	1,625,454.00	0.38
82	688029	南微医学	26,379	1,623,891.24	0.38
83	601098	中南传媒	130,000	1,614,600.00	0.38
84	600801	华新水泥	117,100	1,610,125.00	0.37
85	600109	国金证券	209,100	1,578,705.00	0.37
86	603979	金诚信	30,700	1,551,271.00	0.36
87	600663	陆家嘴	174,600	1,539,972.00	0.36
88	600968	海油发展	373,600	1,539,232.00	0.36
89	688180	君实生物	52,958	1,538,429.90	0.36
90	600258	首旅酒店	123,300	1,522,755.00	0.35
91	600021	上海电力	149,600	1,479,544.00	0.34
92	003031	中瓷电子	31,600	1,461,184.00	0.34
93	002078	太阳纸业	104,600	1,459,170.00	0.34
94	688065	凯赛生物	31,974	1,451,299.86	0.34
95	603317	天味食品	126,730	1,445,989.30	0.34

96	600008	首创环保	536,800	1,438,624.00	0.33
97	600516	方大炭素	333,200	1,436,092.00	0.33
98	002120	韵达股份	183,300	1,418,742.00	0.33
99	002294	信立泰	52,900	1,408,727.00	0.33
100	600737	中粮糖业	146,500	1,404,935.00	0.33
101	688516	奥特维	33,480	1,399,798.80	0.33
102	002683	广东宏大	68,100	1,370,853.00	0.32
103	600177	雅戈尔	188,600	1,342,832.00	0.31
104	002653	海思科	43,600	1,338,520.00	0.31
105	603486	科沃斯	27,900	1,316,322.00	0.31
106	000998	隆平高科	132,600	1,303,458.00	0.30
107	002064	华峰化学	178,700	1,281,279.00	0.30
108	603885	吉祥航空	114,200	1,255,058.00	0.29
109	603056	德邦股份	95,300	1,248,430.00	0.29
110	002152	广电运通	116,300	1,216,498.00	0.28
111	603444	吉比特	6,800	1,210,468.00	0.28
112	600208	新湖中宝	754,800	1,192,584.00	0.28
113	000630	铜陵有色	329,900	1,190,939.00	0.28
114	001203	大中矿业	123,100	1,182,991.00	0.28
115	000027	深圳能源	160,100	1,168,730.00	0.27
116	002414	高德红外	193,700	1,140,893.00	0.27
117	603517	绝味食品	73,100	1,125,740.00	0.26
118	002945	华林证券	112,100	1,118,758.00	0.26
119	002353	杰瑞股份	31,000	1,087,480.00	0.25
120	601966	玲珑轮胎	59,100	1,085,667.00	0.25
121	000563	陕国投 A	392,300	1,078,825.00	0.25
122	000921	海信家电	33,300	1,073,592.00	0.25
123	600582	天地科技	155,100	1,068,639.00	0.25
124	600517	国网英大	245,200	1,061,716.00	0.25
125	600754	锦江酒店	46,000	1,057,080.00	0.25
126	601598	中国外运	186,200	1,048,306.00	0.24
127	002958	青农商行	389,200	1,043,056.00	0.24
128	300682	朗新集团	122,500	1,042,475.00	0.24
129	002185	华天科技	126,400	1,030,160.00	0.24
130	002926	华西证券	155,100	1,022,109.00	0.24
131	600497	驰宏锌锗	189,800	1,013,532.00	0.24
132	002500	山西证券	215,500	1,012,850.00	0.24
133	000513	丽珠集团	26,800	997,228.00	0.23
134	600546	山煤国际	67,300	983,926.00	0.23
135	600390	五矿资本	242,300	981,315.00	0.23
136	600535	天士力	77,200	971,176.00	0.23
137	600848	上海临港	105,900	964,749.00	0.22
138	601991	大唐发电	319,100	960,491.00	0.22
139	600808	马钢股份	472,200	953,844.00	0.22

140	600859	王府井	80,700	947,418.00	0.22
141	000997	新大陆	68,000	945,880.00	0.22
142	600299	安迪苏	95,800	929,260.00	0.22
143	688567	孚能科技	92,271	885,801.60	0.21
144	688778	厦钨新能	27,846	869,909.04	0.20
145	000423	东阿阿胶	13,800	863,880.00	0.20
146	600763	通策医疗	15,500	837,775.00	0.20
147	601198	东兴证券	104,800	834,208.00	0.19
148	300595	欧普康视	53,100	832,608.00	0.19
149	300776	帝尔激光	17,000	781,320.00	0.18
150	688301	奕瑞科技	6,622	763,053.06	0.18
151	300002	神州泰岳	92,500	751,100.00	0.17
152	000039	中集集团	80,400	744,504.00	0.17
153	002558	巨人网络	74,700	705,168.00	0.16
154	601665	齐鲁银行	142,900	701,639.00	0.16
155	689009	九号公司	18,635	685,954.35	0.16
156	688120	华海清科	3,527	668,648.66	0.16
157	002984	森麒麟	27,700	667,293.00	0.16
158	603225	新凤鸣	42,600	664,134.00	0.15
159	603379	三美股份	16,800	657,552.00	0.15
160	600598	北大荒	52,200	651,978.00	0.15
161	300017	网宿科技	81,900	647,010.00	0.15
162	600416	湘电股份	62,800	624,232.00	0.15
163	300296	利亚德	137,300	617,850.00	0.14
164	000825	太钢不锈	182,400	616,512.00	0.14
165	601216	君正集团	163,200	602,208.00	0.14
166	300088	长信科技	127,100	597,370.00	0.14
167	002065	东华软件	130,400	589,408.00	0.14
168	601997	贵阳银行	110,700	583,389.00	0.14
169	688772	珠海冠宇	39,006	581,189.40	0.14
170	600369	西南证券	161,700	578,886.00	0.13
171	600352	浙江龙盛	67,300	578,107.00	0.13
172	600350	山东高速	65,100	576,135.00	0.13
173	002266	浙富控股	206,400	575,856.00	0.13
174	002831	裕同科技	22,500	575,775.00	0.13
175	600282	南钢股份	115,000	572,700.00	0.13
176	688234	天岳先进	12,184	571,673.28	0.13
177	688276	百克生物	20,023	568,052.51	0.13
178	300253	卫宁健康	96,100	566,990.00	0.13
179	603707	健友股份	47,700	566,676.00	0.13
180	300144	宋城演艺	70,200	563,706.00	0.13
181	600901	江苏金租	111,500	563,075.00	0.13
182	600348	华阳股份	55,800	555,768.00	0.13
183	002423	中粮资本	74,000	554,260.00	0.13

184	600126	杭钢股份	132,300	543,753.00	0.13
185	601139	深圳燃气	81,000	541,080.00	0.13
186	001872	招商港口	28,000	539,000.00	0.13
187	603338	浙江鼎力	8,800	531,696.00	0.12
188	600967	内蒙一机	73,800	531,360.00	0.12
189	600998	九州通	108,200	528,016.00	0.12
190	000987	越秀资本	105,500	523,280.00	0.12
191	002429	兆驰股份	107,500	517,075.00	0.12
192	600380	健康元	46,200	516,054.00	0.12
193	601567	三星医疗	14,600	511,000.00	0.12
194	601608	中信重工	133,900	510,159.00	0.12
195	000156	华数传媒	80,200	503,656.00	0.12
196	600827	百联股份	67,300	496,674.00	0.12
197	003022	联泓新科	36,200	496,302.00	0.12
198	600498	烽火通信	31,200	496,080.00	0.12
199	000750	国海证券	170,300	495,573.00	0.12
200	600707	彩虹股份	72,700	495,087.00	0.12
201	002056	横店东磁	39,700	495,059.00	0.12
202	002936	郑州银行	285,700	494,261.00	0.12
203	600566	济川药业	15,500	491,505.00	0.11
204	600755	厦门国贸	67,300	482,541.00	0.11
205	600699	均胜电子	32,300	478,686.00	0.11
206	000401	冀东水泥	117,200	475,832.00	0.11
207	000959	首钢股份	174,900	475,728.00	0.11
208	600528	中铁工业	64,900	475,068.00	0.11
209	002531	天顺风能	52,700	471,138.00	0.11
210	600361	创新新材	116,800	470,704.00	0.11
211	000739	普洛药业	34,500	468,165.00	0.11
212	600511	国药股份	15,200	468,008.00	0.11
213	300803	指南针	12,800	466,048.00	0.11
214	603233	大参林	32,568	465,722.40	0.11
215	000559	万向钱潮	104,300	465,178.00	0.11
216	600927	永安期货	41,400	461,610.00	0.11
217	600079	人福医药	26,800	460,156.00	0.11
218	600578	京能电力	141,400	458,136.00	0.11
219	601828	美凯龙	178,800	455,940.00	0.11
220	000937	冀中能源	68,000	455,600.00	0.11
221	600143	金发科技	68,800	454,768.00	0.11
222	600098	广州发展	70,800	453,120.00	0.11
223	002044	美年健康	118,800	449,064.00	0.10
224	603156	养元饮品	21,000	446,670.00	0.10
225	688520	神州细胞	11,290	444,261.50	0.10
226	600500	中化国际	126,800	442,532.00	0.10
227	600925	苏能股份	87,400	441,370.00	0.10

228	600339	中油工程	140,400	438,048.00	0.10
229	688281	华秦科技	5,231	435,846.92	0.10
230	601077	渝农商行	86,500	434,230.00	0.10
231	300765	新诺威	17,100	431,433.00	0.10
232	601568	北元集团	116,200	431,102.00	0.10
233	603218	日月股份	41,700	428,259.00	0.10
234	300390	天华新能	24,600	422,628.00	0.10
235	002299	圣农发展	30,900	421,476.00	0.10
236	688779	长远锂科	90,673	419,815.99	0.10
237	688387	信科移动	81,950	413,028.00	0.10
238	688153	唯捷创芯	10,978	406,186.00	0.09
239	600863	内蒙华电	87,200	404,608.00	0.09
240	601231	环旭电子	24,600	394,830.00	0.09
241	603883	老百姓	21,450	393,822.00	0.09
242	688348	昱能科技	6,672	393,648.00	0.09
243	600316	洪都航空	23,400	389,142.00	0.09
244	600060	海信视像	15,000	371,100.00	0.09
245	002223	鱼跃医疗	9,500	357,200.00	0.08
246	601958	金铝股份	34,200	356,022.00	0.08
247	688006	杭可科技	20,338	354,898.10	0.08
248	600398	海澜之家	38,400	354,816.00	0.08
249	603858	步长制药	23,400	354,510.00	0.08
250	600871	石化油服	201,200	350,088.00	0.08
251	603305	旭升集团	33,100	349,536.00	0.08
252	688172	燕东微	21,527	348,306.86	0.08
253	600704	物产中大	80,100	347,634.00	0.08
254	000958	电投产融	89,700	328,302.00	0.08
255	000960	锡业股份	20,600	319,094.00	0.07
256	603456	九洲药业	23,200	318,304.00	0.07
257	600928	西安银行	96,800	316,536.00	0.07
258	688375	国博电子	4,317	304,952.88	0.07
259	603298	杭叉集团	15,200	298,528.00	0.07
260	601298	青岛港	31,200	298,272.00	0.07
261	601228	广州港	97,600	297,680.00	0.07
262	688777	中控技术	7,757	292,438.90	0.07
263	300146	汤臣倍健	21,300	288,615.00	0.07
264	600873	梅花生物	27,500	275,550.00	0.06
265	600879	航天电子	35,000	271,950.00	0.06
266	600271	航天信息	36,900	271,584.00	0.06
267	600377	宁沪高速	21,500	270,900.00	0.06
268	002202	金风科技	39,800	267,456.00	0.06
269	300136	信维通信	13,600	266,288.00	0.06
270	002966	苏州银行	35,500	266,250.00	0.06
271	688063	派能科技	6,584	261,450.64	0.06

272	000932	华菱钢铁	57,800	256,054.00	0.06
273	601155	新城控股	28,600	253,682.00	0.06
274	600862	中航高科	13,500	253,530.00	0.06
275	002506	协鑫集成	130,500	253,170.00	0.06
276	002436	兴森科技	24,000	247,680.00	0.06
277	603345	安井食品	3,300	245,223.00	0.06
278	000066	中国长城	27,900	244,125.00	0.06
279	000933	神火股份	11,900	240,737.00	0.06
280	002797	第一创业	46,300	235,667.00	0.05
281	601000	唐山港	49,700	233,590.00	0.05
282	688819	天能股份	9,746	232,539.56	0.05
283	000785	居然之家	95,500	232,065.00	0.05
284	000778	新兴铸管	65,085	226,495.80	0.05
285	600583	海油工程	37,300	220,443.00	0.05
286	600483	福能股份	18,900	220,374.00	0.05
287	002385	大北农	55,400	213,290.00	0.05
288	601158	重庆水务	44,400	213,120.00	0.05
289	600765	中航重机	10,400	212,160.00	0.05
290	600170	上海建工	98,000	210,700.00	0.05
291	002487	大金重工	9,200	210,496.00	0.05
292	600673	东阳光	29,700	209,088.00	0.05
293	600155	华创云信	35,100	207,441.00	0.05
294	603927	中科软	11,100	200,799.00	0.05
295	300009	安科生物	23,300	198,982.00	0.05
296	603658	安图生物	4,300	198,101.00	0.05
297	603939	益丰药房	8,000	196,400.00	0.05
298	002608	江苏国信	25,000	193,750.00	0.05
299	600062	华润双鹤	9,800	191,884.00	0.04
300	603228	景旺电子	5,900	187,620.00	0.04
301	600655	豫园股份	36,000	185,400.00	0.04
302	601399	国机重装	71,700	184,986.00	0.04
303	688538	和辉光电	92,738	183,621.24	0.04
304	688425	铁建重工	48,049	176,820.32	0.04
305	603606	东方电缆	3,600	175,716.00	0.04
306	600909	华安证券	38,800	163,348.00	0.04
307	000878	云南铜业	12,600	156,996.00	0.04
308	002262	恩华药业	6,500	154,310.00	0.04
309	002472	双环传动	7,000	154,140.00	0.04
310	300114	中航电测	3,400	153,850.00	0.04
311	688475	萤石网络	4,323	147,457.53	0.03
312	002439	启明星辰	8,400	144,984.00	0.03
313	301358	湖南裕能	4,600	144,716.00	0.03
314	688122	西部超导	3,680	141,017.60	0.03
315	600481	双良节能	29,200	136,364.00	0.03

316	600166	福田汽车	60,500	136,125.00	0.03
317	300037	新宙邦	4,700	134,232.00	0.03
318	300888	稳健医疗	5,300	134,090.00	0.03
319	600325	华发股份	20,600	133,900.00	0.03
320	002497	雅化集团	15,000	133,800.00	0.03
321	300601	康泰生物	8,500	132,685.00	0.03
322	603077	和邦生物	80,300	132,495.00	0.03
323	002507	涪陵榨菜	10,800	132,300.00	0.03
324	002690	美亚光电	8,000	132,000.00	0.03
325	300861	美畅股份	6,700	129,645.00	0.03
326	600563	法拉电子	1,700	129,506.00	0.03
327	688385	复旦微电	4,069	127,685.22	0.03
328	300748	金力永磁	9,800	127,008.00	0.03
329	002572	索菲亚	8,200	125,706.00	0.03
330	300070	碧水源	29,900	125,281.00	0.03
331	601118	海南橡胶	26,800	121,940.00	0.03
332	688349	三一重能	4,904	121,815.36	0.03
333	000032	深桑达 A	7,900	118,342.00	0.03
334	600956	新天绿能	14,200	116,014.00	0.03
335	601106	中国一重	49,900	115,269.00	0.03
336	300357	我武生物	5,700	115,254.00	0.03
337	601992	金隅集团	81,800	112,066.00	0.03
338	300373	扬杰科技	2,700	105,030.00	0.02
339	600764	中国海防	4,800	94,224.00	0.02
340	000155	川能动力	8,300	89,391.00	0.02
341	300438	鹏辉能源	4,600	84,364.00	0.02
342	301029	怡合达	4,200	82,572.00	0.02
343	002865	钧达股份	2,100	80,598.00	0.02
344	002240	盛新锂能	6,000	80,520.00	0.02
345	603882	金域医学	2,900	78,851.00	0.02
346	002430	杭氧股份	3,500	77,875.00	0.02
347	600549	厦门钨业	4,500	77,625.00	0.02
348	600995	南网储能	8,000	77,280.00	0.02
349	600032	浙江新能	10,600	77,168.00	0.02
350	000729	燕京啤酒	8,300	73,289.00	0.02
351	600977	中国电影	6,700	72,092.00	0.02
352	601696	中银证券	7,900	71,732.00	0.02
353	603688	石英股份	2,400	71,064.00	0.02
354	300568	星源材质	8,600	70,520.00	0.02
355	300699	光威复材	2,800	69,524.00	0.02
356	002372	伟星新材	4,400	67,848.00	0.02
357	600486	扬农化工	1,200	67,740.00	0.02
358	603185	弘元绿能	3,900	66,651.00	0.02
359	600378	昊华科技	2,300	66,470.00	0.02

360	601016	节能风电	22,000	65,780.00	0.02
361	600580	卧龙电驱	5,400	65,610.00	0.02
362	601019	山东出版	5,400	63,828.00	0.01
363	003035	南网能源	13,800	60,720.00	0.01
364	601179	中国西电	7,500	60,300.00	0.01
365	600536	中国软件	2,000	59,840.00	0.01
366	603529	爱玛科技	2,100	57,393.00	0.01
367	601156	东航物流	2,800	56,980.00	0.01
368	300073	当升科技	1,600	54,896.00	0.01
369	601990	南京证券	6,900	52,992.00	0.01
370	603737	三棵树	1,200	43,524.00	0.01
371	002625	光启技术	2,300	39,905.00	0.01
372	603596	伯特利	800	31,120.00	0.01
373	300212	易华录	1,400	23,562.00	0.01
374	601928	凤凰传媒	2,000	21,920.00	0.01
375	600839	四川长虹	1,200	5,388.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	688018	乐鑫科技	19,832	1,957,021.76	0.46
2	300783	三只松鼠	68,600	1,500,282.00	0.35
3	688076	诺泰生物	18,182	1,423,286.96	0.33
4	688222	成都先导	120,998	1,373,327.30	0.32
5	688408	中信博	14,051	1,293,816.08	0.30
6	688368	晶丰明源	21,070	1,167,278.00	0.27
7	688123	聚辰股份	18,631	1,133,323.73	0.26
8	688578	艾力斯	17,753	1,131,576.22	0.26
9	300679	电连技术	27,600	1,110,348.00	0.26
10	688595	芯海科技	36,111	1,083,330.00	0.25
11	603267	鸿远电子	30,500	1,040,050.00	0.24
12	601601	中国太保	36,900	1,028,034.00	0.24
13	688139	海尔生物	26,780	996,216.00	0.23
14	601800	中国交建	111,100	993,234.00	0.23
15	688095	福昕软件	21,573	988,259.13	0.23
16	603348	文灿股份	35,300	977,457.00	0.23
17	688533	上声电子	37,579	972,168.73	0.23
18	688050	爱博医疗	13,235	970,390.20	0.23
19	002928	华夏航空	150,800	956,072.00	0.22
20	605305	中际联合	36,960	953,198.40	0.22
21	300596	利安隆	35,000	949,550.00	0.22
22	300841	康华生物	18,600	941,904.00	0.22

23	601137	博威合金	60,100	915,924.00	0.21
24	601886	江河集团	183,100	893,528.00	0.21
25	688111	金山办公	3,907	888,842.50	0.21
26	601336	新华保险	28,500	855,855.00	0.20
27	300820	英杰电气	21,600	849,744.00	0.20
28	600882	妙可蓝多	66,900	834,243.00	0.19
29	003038	鑫铂股份	50,180	741,158.60	0.17
30	688088	虹软科技	24,403	704,270.58	0.16
31	603983	丸美股份	24,100	663,473.00	0.15
32	688766	普冉股份	5,964	579,521.88	0.13
33	688510	航亚科技	29,950	551,379.50	0.13
34	300896	爱美客	3,200	550,720.00	0.13
35	688016	心脉医疗	5,605	549,570.25	0.13
36	603501	韦尔股份	5,400	536,598.00	0.12
37	300835	龙磁科技	16,500	479,325.00	0.11
38	605333	沪光股份	16,100	448,385.00	0.10
39	688253	英诺特	11,445	436,168.95	0.10
40	603995	甬金股份	24,500	429,240.00	0.10
41	688798	艾为电子	7,546	427,254.52	0.10
42	688336	三生国健	20,945	426,230.75	0.10
43	000975	银泰黄金	26,000	423,540.00	0.10
44	688023	安恒信息	10,524	421,065.24	0.10
45	600000	浦发银行	50,000	411,500.00	0.10
46	000600	建投能源	64,700	407,610.00	0.09
47	300428	立中集团	21,700	403,403.00	0.09
48	300662	科锐国际	24,600	396,798.00	0.09
49	002215	诺普信	50,700	377,715.00	0.09
50	002315	焦点科技	13,900	374,744.00	0.09
51	688365	光云科技	60,138	362,030.76	0.08
52	688136	科兴制药	21,005	352,043.80	0.08
53	300492	华图山鼎	3,700	348,540.00	0.08
54	300673	佩蒂股份	22,100	289,952.00	0.07
55	601808	中海油服	14,100	242,520.00	0.06
56	601001	晋控煤业	14,600	241,192.00	0.06
57	300769	德方纳米	7,600	214,320.00	0.05
58	002371	北方华创	600	191,934.00	0.04
59	002463	沪电股份	5,200	189,800.00	0.04
60	301589	诺瓦星云	923	173,533.23	0.04
61	600183	生益科技	8,200	172,692.00	0.04
62	603605	珀莱雅	1,500	166,485.00	0.04
63	600161	天坛生物	6,520	159,088.00	0.04
64	002906	华阳集团	5,800	155,208.00	0.04
65	603239	浙江仙通	11,100	152,181.00	0.04
66	002922	伊戈尔	6,900	150,834.00	0.04

67	002322	理工能科	8,200	131,364.00	0.03
68	688352	硕中科技	10,530	120,147.30	0.03
69	002925	盈趣科技	9,300	117,831.00	0.03
70	002130	沃尔核材	8,300	117,196.00	0.03
71	603992	松霖科技	6,200	114,018.00	0.03
72	300181	佐力药业	7,500	113,400.00	0.03
73	300881	盛德鑫泰	4,300	110,467.00	0.03
74	000990	诚志股份	14,800	110,112.00	0.03
75	002245	蔚蓝锂芯	14,000	108,500.00	0.03
76	688469	芯联集成	27,067	107,185.32	0.02
77	300926	博俊科技	5,335	106,806.70	0.02
78	000403	派林生物	4,000	106,640.00	0.02
79	300102	乾照光电	16,600	106,572.00	0.02
80	300236	上海新阳	3,400	105,876.00	0.02
81	688575	亚辉龙	4,519	105,383.08	0.02
82	603355	莱克电气	4,800	103,680.00	0.02
83	002521	齐峰新材	8,700	102,225.00	0.02
84	300761	立华股份	4,500	101,880.00	0.02
85	300547	川环科技	6,200	101,370.00	0.02
86	300387	富邦股份	16,900	101,231.00	0.02
87	300254	仟源医药	12,800	100,608.00	0.02
88	002722	物产金轮	8,800	99,440.00	0.02
89	002847	盐津铺子	2,320	99,226.40	0.02
90	688080	映翰通	3,271	99,209.43	0.02
91	603877	太平鸟	7,200	98,856.00	0.02
92	688416	恒烁股份	2,587	98,228.39	0.02
93	688696	极米科技	1,264	97,631.36	0.02
94	002600	领益智造	13,700	97,544.00	0.02
95	603579	荣泰健康	6,240	96,470.40	0.02
96	603966	法兰泰克	13,700	94,119.00	0.02
97	603908	牧高笛	4,620	92,677.20	0.02
98	002536	飞龙股份	9,700	92,344.00	0.02
99	603365	水星家纺	5,900	92,335.00	0.02
100	002959	小熊电器	1,900	91,409.00	0.02
101	002192	融捷股份	2,800	84,056.00	0.02
102	300850	新强联	5,500	82,610.00	0.02
103	300363	博腾股份	6,800	81,260.00	0.02
104	002326	永太科技	9,900	77,418.00	0.02
105	688486	龙迅股份	1,323	75,807.90	0.02
106	600415	小商品城	10,200	75,684.00	0.02
107	301498	乖宝宠物	1,400	75,320.00	0.02
108	300294	博雅生物	2,200	72,600.00	0.02
109	000547	航天发展	12,000	70,320.00	0.02
110	601778	晶科科技	30,700	69,996.00	0.02

111	600938	中国海油	2,000	66,000.00	0.02
112	002032	苏泊尔	1,300	65,130.00	0.02
113	601187	厦门银行	12,100	64,493.00	0.02
114	688208	道通科技	2,669	64,429.66	0.01
115	301004	嘉益股份	700	63,700.00	0.01
116	605198	安德利	2,400	63,360.00	0.01
117	002329	皇氏集团	22,800	61,788.00	0.01
118	688033	天宜上佳	10,246	61,476.00	0.01
119	688388	嘉元科技	6,296	61,386.00	0.01
120	600167	联美控股	11,700	60,957.00	0.01
121	001301	尚太科技	1,400	60,508.00	0.01
122	300115	长盈精密	5,000	59,950.00	0.01
123	000695	滨海能源	7,300	59,349.00	0.01
124	301079	邵阳液压	4,600	58,696.00	0.01
125	688166	博瑞医药	1,656	57,960.00	0.01
126	605058	澳弘电子	2,900	57,072.00	0.01
127	003006	百亚股份	2,400	56,880.00	0.01
128	301162	国能日新	1,300	56,628.00	0.01
129	002399	海普瑞	6,500	56,355.00	0.01
130	301126	达嘉维康	6,200	55,986.00	0.01
131	000528	柳工	5,000	55,950.00	0.01
132	601963	重庆银行	7,200	55,800.00	0.01
133	600011	华能国际	5,800	55,796.00	0.01
134	300257	开山股份	5,500	55,550.00	0.01
134	600756	浪潮软件	5,500	55,550.00	0.01
136	600717	天津港	13,000	55,510.00	0.01
137	002876	三利谱	2,300	55,476.00	0.01
138	000553	安道麦 A	12,200	55,388.00	0.01
139	603855	华荣股份	2,500	55,275.00	0.01
140	603235	天新药业	2,300	55,269.00	0.01
141	603511	爱慕股份	4,500	55,260.00	0.01
142	002139	拓邦股份	5,200	55,224.00	0.01
143	600206	有研新材	6,200	55,180.00	0.01
144	002112	三变科技	6,200	55,056.00	0.01
145	002287	奇正藏药	2,800	54,824.00	0.01
146	601018	宁波港	16,100	54,740.00	0.01
147	300772	运达股份	5,700	54,720.00	0.01
148	300022	吉峰科技	15,400	54,670.00	0.01
149	300140	节能环境	9,100	54,327.00	0.01
150	603416	信捷电气	1,900	54,302.00	0.01
151	000708	中信特钢	4,000	54,280.00	0.01
152	600272	开开实业	6,300	54,180.00	0.01
153	603100	川仪股份	2,300	54,073.00	0.01
154	603277	银都股份	1,800	54,072.00	0.01

155	601007	金陵饭店	8,500	54,060.00	0.01
156	603103	横店影视	3,900	53,976.00	0.01
157	603866	桃李面包	10,600	53,742.00	0.01
158	002533	金杯电工	5,400	53,730.00	0.01
159	301200	大族数控	1,700	53,652.00	0.01
160	300741	华宝股份	3,500	53,340.00	0.01
161	000800	一汽解放	6,800	53,244.00	0.01
162	300650	太龙股份	5,000	53,150.00	0.01
163	603053	成都燃气	5,500	53,130.00	0.01
164	600015	华夏银行	8,300	53,120.00	0.01
165	605099	共创草坪	2,800	52,948.00	0.01
166	601311	骆驼股份	6,600	52,932.00	0.01
167	002727	一心堂	3,500	52,815.00	0.01
168	600660	福耀玻璃	1,100	52,690.00	0.01
169	688350	富森科技	4,617	52,679.97	0.01
170	002265	建设工业	6,100	52,643.00	0.01
171	300388	节能国祯	9,500	52,630.00	0.01
172	601512	中新集团	6,900	52,578.00	0.01
173	600662	外服控股	13,100	52,531.00	0.01
174	300129	泰胜风能	7,700	52,514.00	0.01
175	600551	时代出版	7,400	52,392.00	0.01
176	603332	苏州龙杰	7,100	52,327.00	0.01
177	300274	阳光电源	840	52,105.20	0.01
178	605077	华康股份	3,400	51,850.00	0.01
179	000930	中粮科技	10,300	51,809.00	0.01
180	300441	鲍斯股份	8,700	51,591.00	0.01
181	300857	协创数据	900	51,300.00	0.01
182	688432	有研硅	5,259	50,959.71	0.01
183	600742	一汽富维	6,800	50,660.00	0.01
184	601633	长城汽车	2,000	50,600.00	0.01
185	688055	龙腾光电	15,925	50,482.25	0.01
186	002978	安宁股份	1,800	50,148.00	0.01
187	002249	大洋电机	10,600	50,138.00	0.01
188	603408	建霖家居	3,800	50,122.00	0.01
189	002171	楚江新材	7,600	50,084.00	0.01
190	600547	山东黄金	1,800	49,284.00	0.01
191	002705	新宝股份	3,500	49,245.00	0.01
192	600386	北巴传媒	17,600	49,104.00	0.01
193	300979	华利集团	800	48,680.00	0.01
194	300109	新开源	4,200	48,636.00	0.01
195	688059	华锐精密	1,049	47,603.62	0.01
196	603727	博迈科	3,600	47,376.00	0.01
197	688071	华依科技	2,178	47,197.26	0.01
198	603811	诚意药业	7,500	46,875.00	0.01

199	000860	顺鑫农业	2,800	46,872.00	0.01
200	601279	英利汽车	12,500	46,625.00	0.01
201	002919	名臣健康	4,000	46,440.00	0.01
202	603198	迎驾贡酒	800	46,000.00	0.01
203	002957	科瑞技术	3,300	44,748.00	0.01
204	601500	通用股份	8,200	43,788.00	0.01
205	002475	立讯精密	1,100	43,241.00	0.01
206	600236	桂冠电力	5,600	42,952.00	0.01
207	600557	康缘药业	2,700	42,390.00	0.01
208	002035	华帝股份	6,700	41,741.00	0.01
209	603583	捷昌驱动	2,000	40,760.00	0.01
210	600219	南山铝业	10,300	39,243.00	0.01
211	301291	明阳电气	1,300	39,065.00	0.01
212	300842	帝科股份	1,000	38,800.00	0.01
213	601702	华峰铝业	2,100	38,346.00	0.01
214	603711	香飘飘	2,600	36,010.00	0.01
215	000725	京东方 A	8,600	35,174.00	0.01
216	600039	四川路桥	4,300	33,927.00	0.01
217	688325	赛微微电	1,070	33,565.90	0.01
218	301129	瑞纳智能	1,300	32,812.00	0.01
219	000920	沃顿科技	4,400	32,252.00	0.01
220	300404	博济医药	3,900	31,239.00	0.01
221	301367	怡和嘉业	500	31,100.00	0.01
222	603037	凯众股份	2,380	30,916.20	0.01
223	600033	福建高速	9,200	30,820.00	0.01
224	003043	华亚智能	800	30,528.00	0.01
225	688531	日联科技	654	30,188.64	0.01
226	688692	达梦数据	171	29,913.03	0.01
227	688078	龙软科技	1,298	29,892.94	0.01
228	603220	中贝通信	1,100	29,876.00	0.01
229	688671	碧兴物联	1,441	29,871.93	0.01
230	605555	德昌股份	1,600	29,776.00	0.01
231	301299	卓创资讯	700	29,400.00	0.01
232	600030	中信证券	1,600	29,168.00	0.01
233	300418	昆仑万维	900	29,016.00	0.01
234	688371	菲沃泰	2,871	28,824.84	0.01
235	002970	锐明技术	800	28,824.00	0.01
236	688173	希荻微	2,584	28,501.52	0.01
237	000045	深纺织 A	3,500	28,070.00	0.01
238	688210	统联精密	1,256	27,820.40	0.01
239	688607	康众医疗	2,235	27,758.70	0.01
240	301059	金三江	3,100	27,621.00	0.01
241	688158	优刻得	2,694	27,559.62	0.01
242	688489	三未信安	1,033	27,519.12	0.01

243	300235	方直科技	3,400	27,268.00	0.01
244	688227	品高股份	2,251	27,259.61	0.01
245	300752	隆利科技	2,000	27,160.00	0.01
246	688058	宝兰德	1,291	26,891.53	0.01
247	300631	久吾高科	1,400	26,810.00	0.01
248	603538	美诺华	2,400	26,808.00	0.01
249	301052	果麦文化	1,300	26,650.00	0.01
250	002516	旷达科技	7,300	26,572.00	0.01
251	301270	汉仪股份	1,100	26,543.00	0.01
252	688211	中科微至	1,040	26,364.00	0.01
253	603700	宁水集团	2,800	26,264.00	0.01
254	603162	海通发展	2,800	26,040.00	0.01
255	301261	恒工精密	700	25,949.00	0.01
256	688550	瑞联新材	1,118	25,926.42	0.01
257	301229	纽泰格	1,100	25,883.00	0.01
258	301319	唯特偶	860	25,825.80	0.01
259	688162	巨一科技	1,321	25,733.08	0.01
260	002837	英维克	1,200	25,668.00	0.01
261	601177	杭齿前进	3,700	25,604.00	0.01
262	002661	克明食品	3,400	25,398.00	0.01
263	002237	恒邦股份	2,200	25,322.00	0.01
264	301558	三态股份	3,000	25,170.00	0.01
265	603686	福龙马	3,300	25,146.00	0.01
266	300556	丝路视觉	1,500	25,095.00	0.01
267	300463	迈克生物	2,200	25,036.00	0.01
268	002664	信质集团	2,100	24,990.00	0.01
269	300539	横河精密	3,100	24,955.00	0.01
270	300922	天秦装备	1,900	24,681.00	0.01
271	003030	祖名股份	1,700	24,429.00	0.01
272	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
273	002773	康弘药业	1,100	23,815.00	0.01
274	688682	霍莱沃	805	23,618.70	0.01
275	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
276	301221	光庭信息	600	21,408.00	0.00
277	688109	品茗科技	636	17,394.60	0.00
278	688582	芯动联科	553	15,572.48	0.00
279	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
280	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00
281	688709	成都华微	819	15,389.01	0.00
282	688728	格科微	1,261	15,270.71	0.00
283	603496	恒为科技	600	14,670.00	0.00
284	300442	润泽科技	600	14,370.00	0.00
285	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
286	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00

287	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
288	600007	中国国贸	500	10,980.00	0.00
289	688456	有研粉材	402	10,721.34	0.00
290	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
291	688584	上海合晶	658	10,455.62	0.00
292	601033	永兴股份	620	9,895.20	0.00
293	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
294	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
295	300910	瑞丰新材	200	8,744.00	0.00
296	603341	龙旗科技	233	8,735.17	0.00
297	001282	三联锻造	300	8,313.00	0.00
298	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
299	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
300	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
301	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
302	300668	杰恩设计	400	6,624.00	0.00
303	300083	创世纪	1,000	6,130.00	0.00
304	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
305	688429	时创能源	346	5,861.24	0.00
306	603193	润本股份	303	5,572.17	0.00
307	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
308	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
309	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
310	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
311	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
312	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
313	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
314	603090	宏盛股份	200	3,564.00	0.00
315	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
316	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
317	000983	山西焦煤	300	3,093.00	0.00
318	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
319	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 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	4,207,013.00	0.96
2	002340	格林美	4,107,330.00	0.93

3	600521	华海药业	3,887,052.25	0.88
4	000975	银泰黄金	3,772,911.00	0.86
5	002463	沪电股份	3,641,905.00	0.83
6	000703	恒逸石化	3,541,573.00	0.80
7	000683	远兴能源	3,453,718.00	0.78
8	002517	恺英网络	3,442,643.00	0.78
9	601666	平煤股份	3,432,483.00	0.78
10	002532	天山铝业	3,363,742.00	0.76
11	000400	许继电气	3,356,115.44	0.76
12	002465	海格通信	3,327,943.00	0.76
13	601598	中国外运	3,306,715.00	0.75
14	000830	鲁西化工	3,290,820.00	0.75
15	600885	宏发股份	3,246,569.34	0.74
16	300395	菲利华	3,082,884.00	0.70
17	300207	欣旺达	2,935,697.00	0.67
18	300529	健帆生物	2,918,090.00	0.66
19	600499	科达制造	2,910,708.00	0.66
20	300054	鼎龙股份	2,880,789.00	0.65

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002463	沪电股份	5,130,906.00	1.17
2	600161	天坛生物	4,074,512.00	0.93
3	000932	华菱钢铁	3,752,110.63	0.85
4	601958	金钼股份	3,516,735.00	0.80
5	000975	银泰黄金	3,471,622.99	0.79
6	002223	鱼跃医疗	3,463,203.00	0.79
7	002032	苏泊尔	3,293,240.00	0.75
8	000630	铜陵有色	3,285,705.00	0.75
9	000997	新大陆	3,181,961.00	0.72
10	000783	长江证券	3,173,868.00	0.72
11	600369	西南证券	3,113,816.00	0.71
12	002756	永兴材料	3,065,081.23	0.70
13	601168	西部矿业	3,041,634.34	0.69
14	002739	万达电影	3,036,741.00	0.69
15	300395	菲利华	2,992,613.00	0.68
16	002244	滨江集团	2,986,939.00	0.68
17	300017	网宿科技	2,957,895.72	0.67
18	600066	宇通客车	2,945,769.00	0.67
19	600867	通化东宝	2,897,043.00	0.66

20	601966	玲珑轮胎	2,842,249.00	0.65
----	--------	------	--------------	------

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	602,893,363.11
卖出股票收入（成交）总额	586,209,889.91

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）	10,051.58	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,051.58	0.00

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	113683	伟 24 转债	50	10,051.58	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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，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。

本基金对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	22,562.65
2	应收清算款	10,840.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	304,713.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	338,117.50

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达中证 500	8,973	41,660.82	3,893,690.96	1.04%	369,928,880.02	98.96%

量化增强 A						
易方达中证 500 量化增强 C	7,417	22,163.58	30,825,537.74	18.75%	133,561,737.00	81.25%
合计	16,390	32,837.70	34,719,228.70	6.45%	503,490,617.02	93.55%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达中证 500 量化增强 A	1,718,590.62	0.4597%
	易方达中证 500 量化增强 C	7,282.97	0.0044%
	合计	1,725,873.59	0.3207%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	0
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	50~100
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 15 日）基金份额总额	777,613,734.55	311,361,864.27
本报告期初基金份额总额	394,221,116.92	141,767,309.20
本报告期基金总申购份额	19,695,199.23	51,586,698.94
减：本报告期基金总赎回份额	40,093,745.17	28,966,733.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	373,822,570.98	164,387,274.74

§ 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	1,187,352,286.84	100.00%	234,980.08	100.00%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中信建投证券股份有限公司，无新增交易单元。

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、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 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
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	227,444.64	100.00%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-13
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
3	关于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2024 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-23
4	关于旗下部分基金 2024 年 3 月 29 日至 2024 年 4 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-26
5	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	中国证券报	2024-03-29
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	中国证券报	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23
8	关于旗下部分基金 2024 年 5 月 15 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-10

	公告		
9	关于旗下部分基金 2024 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-26

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日