

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数

证券投资基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 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遵规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§ 5	托管人报告.....	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6	审计报告.....	16
6.1	审计意见.....	16
6.2	形成审计意见的基础.....	16
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任.....	16
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任.....	17
§ 7	年度财务报表.....	18
7.1	资产负债表.....	18
7.2	利润表.....	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4	报表附注.....	23
§ 8	投资组合报告.....	49
8.1	期末基金资产组合情况.....	49
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3	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.....	51
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63

8.6	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	64
8.7	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	64
8.8	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	64
8.9	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	64
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12	投资组合报告附注	65
§ 9	基金份额持有人信息	66
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2	期末上市基金前十名持有人	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.4	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的情况	67
§ 10	开放式基金份额变动	67
§ 11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
11.2	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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8	其他重大事件	71
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1	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	72
§ 13	备查文件目录	72
13.1	备查文件目录	72
13.2	存放地点	73
13.3	查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 易基、MSCIA 股 ETF 易方达
基金主代码	512090
交易代码	512090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 17 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	445,592,316.00 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	2018 年 6 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数（MSCI China A Inclusion RMB Index）收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66594319
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-42891（集中办公 区）	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	刘连舸

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年	2018 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	147,931,758.95	-77,792,826.32

本期利润	290,516,204.29	-172,456,463.35
加权平均基金份额本期利润	0.4014	-0.1481
本期加权平均净值利润率	39.36%	-16.20%
本期基金份额净值增长率	39.29%	-16.93%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	64,479,958.26	-195,956,607.73
期末可供分配基金份额利润	0.1447	-0.1693
期末基金资产净值	515,586,653.22	961,635,708.27
期末基金份额净值	1.1571	0.8307
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	15.71%	-16.93%

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。

4. 本基金合同于 2018 年 5 月 17 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.09%	0.72%	7.83%	0.72%	0.26%	0.00%
过去六个月	9.92%	0.83%	7.76%	0.84%	2.16%	-0.01%
过去一年	39.29%	1.20%	35.24%	1.21%	4.05%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.71%	1.27%	4.75%	1.31%	10.96%	-0.04%

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 MSCI 中国 A 股国际通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

（2018 年 5 月 17 日至 2019 年 12 月 31 日）

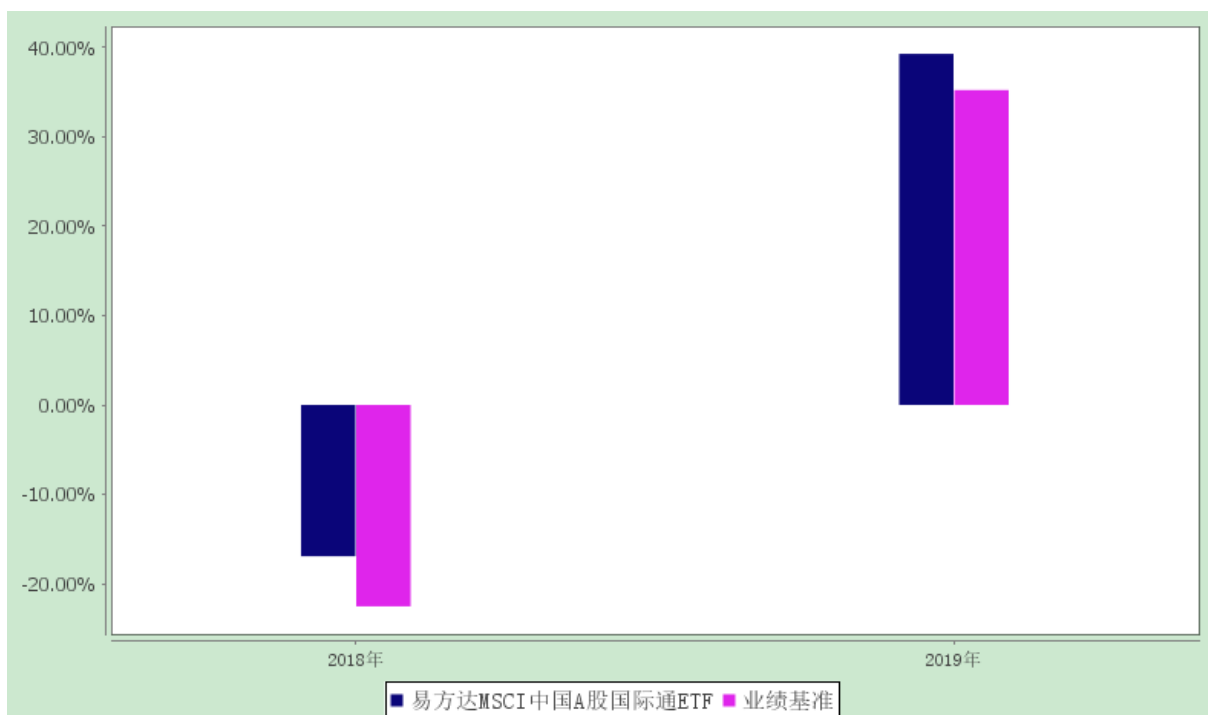


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 15.71%，同期业绩比较基准收益率为 4.75%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续

期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2018 年 5 月 17 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

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		
F A N B I N G (范 冰)	本基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交	2018- 05-17	-	14 年	新加坡籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团 Middle Office 中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析师、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。

<p>易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理</p>				
<p>成曦 本基金的基金经理、易方达中小板指数证券投资基金 (LOF) (原易方达中小板指数分级证券投资基金) 的基金经理、易方达原油证券投资基金 (QDII) 的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理 (自 2017 年 05 月 04 日至 2019 年 08 月 15 日)、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 04 月 27 日至 2019 年 08 月 15 日)、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组</p>	<p>2018-05-17</p>	<p>-</p>	<p>11 年</p>	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。</p>

指数分级证券投资基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理				
--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利

益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 116 次，其中 114 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，2 次为不同基金经理管理的组合间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。

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

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数，该指数代表被纳入 MSCI 全球指数体系的 A 股。一旦个股进入该指数，全球跟踪 MSCI 全球指数体系的资金都将对其进行配置。该指数现阶段主要组成为纳入互联互通范围的大中盘股。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而进行相应调整。

2019 年全年市场表现较好，市场核心指数基本都实现了 20% 以上的涨幅。上半年行情主要由消费股引领，但从 2019 年 7 月份科创板上市以来，电子、医药、生物等科技行业迅速成为全市场的热点，涨幅较大。整体来看，市场已脱离 2018 年以来的估值底部，且行情结构特征明显。

报告期内，国内主要宏观经济数据处在低位温和下滑中，但从 11 月起 PMI 数据开始回升，库存去化加快，采购量和新订单回升较快，经济增速企稳回升迹象明显。从 2018 年以来的落地的财政、货币政策逐渐生效中；从 2019 年 4 季度开始，基建也企稳回升。此外，伴随着中美第一阶段经贸协议的签订，外需及出口也在迅速改善中。

当前，科技成长类股票估值普遍较高，需要高增速的业绩来消化高估值，在此过程中，具备核

心竞争力、现金流改善的优质资产值得重点关注。此外，市场中周期行业龙头普遍估值相对较低，在经济波动逐渐收敛的背景下，该类股票有望迎来估值修复行情。

A 股在 MSCI 指数中的权重因子已经在 2019 年 11 月底提升至 20%。MSCI 指数公司也提出了未来 A 股进一步提升权重因子的四个条件：海外投资人能够获得对冲及衍生品工具、改善结算周期、协调中港股市假期安排、改善“陆股通”综合账户机制。当这四大问题解决后，MSCI 才会就进一步纳入 A 股事件展开公众咨询。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1571 元，本报告期份额净值增长率为 39.29%，同期业绩比较基准收益率为 35.24%。

本报告期，本基金日跟踪偏离度的均值为 0.02%，年化跟踪误差 0.60%，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

回顾 2019 年，在全球市场降息潮及国内经济政策的对冲下，市场已经从 2018 年的估值底部回到了估值合理区间。在此基础上，展望 2020 年，上市公司的盈利将是后续市场的核心驱动因素。在 2019 年底，以 PPI 为代表的经济数据企稳回升，意味着上市公司大概率有望实现盈利企稳，但是盈利回升幅度的预期差将是决定市场波动的关键因素。此外，也要关注 2020 市场潜在的风险因素：中美贸易协议的后续执行、地缘政治的演变及其可能带来的通胀预期。

在此背景下，建议投资者更多从中长期的维度上去考察公司，以获得上市公司的长期盈利增长的钱，弱化估值的波动。更多从需求总量有增长的行业中，挑选行业竞争格局趋向明晰、市占份额逐步提升并且能够获取超额利润的上市公司。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续完善制度、强化对制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》以及科创板发行交易、转融通交易等方面的最新法规、监管要求以及公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，加强各项政策法规和制度措施的落实执行，适应公司产品

与业务发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 培育合规文化体系、严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，加大力度开展员工合规风控教育培训，进一步树立、强化“诚信、规范、专业、稳健”的基金行业文化理念和“忠实注意、谨慎勤勉”的信义义务意识，促进公司合规文化建设；持续完善制度流程和系统工具，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 有计划、有重点地对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询建议，严格进行合规审查。

(6) 深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《关于进一步规范金融营销宣传行为的通知》等法律法规和监管政策。结合《全国法院民商事审判工作会议纪要》关于金融消费者权益保护的精神，持续优化投资者适当性管理机制流程，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”的职责义务，切实保障投资者合法权益。

(7) 提高认识，主动作为，积极践行“风险为本”的反洗钱工作方法，贯彻落实《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》等最新法规和监管要求，进一步完善洗钱风险管理体系，全面开展洗钱风险评估，深入推进洗钱风险识别与防控能力建设，切实保障资源投入，夯实制度基础，做好队伍建设、系统支持、宣传培训、内部审计、信息报送等各项工作，稳步推动反洗钱工作提质增效。

(8) 全面推动落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套规则，持续健全信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(9) 不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2019 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，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任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回

价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 21350 号

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的

内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈熹 周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2020 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,527,258.45	22,358,614.13
结算备付金		2,558,634.43	711,362.76
存出保证金		880,910.92	661,137.83
交易性金融资产	7.4.7.2	508,403,523.16	938,805,976.15
其中：股票投资		508,309,924.36	938,632,976.91
基金投资		-	-
债券投资		93,598.80	172,999.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,905,456.81	5,384,743.07
应收利息	7.4.7.5	2,304.79	4,917.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		521,278,088.56	967,926,751.48
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,846,572.60	3,971,540.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		68,712.74	406,780.36
应付托管费		22,904.26	81,356.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	236,788.39	205,681.73
应交税费		4,143.94	0.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,512,313.41	1,625,683.79
负债合计		5,691,435.34	6,291,043.21
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	445,592,316.00	1,157,592,316.00
未分配利润	7.4.7.10	69,994,337.22	-195,956,607.73
所有者权益合计		515,586,653.22	961,635,708.27
负债和所有者权益总计		521,278,088.56	967,926,751.48

注：1.本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，2018 年度实际报告期间为 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1571 元，基金份额总额 445,592,316.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 5 月 17 日（基 金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		295,567,329.56	-164,861,704.89
1.利息收入		78,166.23	900,520.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	77,689.29	900,510.96
债券利息收入		200.65	9.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		276.29	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		151,349,749.24	-72,195,957.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	136,122,949.42	-91,382,662.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	154,280.51	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	123,262.14	-
股利收益	7.4.7.15	14,949,257.17	19,186,705.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	142,584,445.34	-94,663,637.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,554,968.75	1,097,369.15
减：二、费用		5,051,125.27	7,594,758.46

1. 管理人报酬		2,071,183.19	3,311,680.81
2. 托管费		507,854.67	662,336.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,820,624.40	2,964,539.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		445.07	0.04
7. 其他费用	7.4.7.19	651,017.94	656,202.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		290,516,204.29	-172,456,463.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		290,516,204.29	-172,456,463.35

注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，2018 年度实际报告期间为 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,157,592,316.00	-195,956,607.73	961,635,708.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	290,516,204.29	290,516,204.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-712,000,000.00	-24,565,259.34	-736,565,259.34

其中：1.基金申购款	1,220,000,000.00	21,091,728.03	1,241,091,728.03
2.基金赎回款	-1,932,000,000.00	-45,656,987.37	-1,977,656,987.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	445,592,316.00	69,994,337.22	515,586,653.22
项目	上年度可比期间		
	2018 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,743,592,316.00	-	1,743,592,316.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-172,456,463.35	-172,456,463.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-586,000,000.00	-23,500,144.38	-609,500,144.38
其中：1.基金申购款	1,570,000,000.00	-165,122,279.65	1,404,877,720.35
2.基金赎回款	-2,156,000,000.00	141,622,135.27	-2,014,377,864.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,157,592,316.00	-195,956,607.73	961,635,708.27

注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，2018 年度实际报告期间为 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达 MSCI 中国 A 股国际通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[2018]595 号《关于准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达 MSCI 中国 A 股国际通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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,743,592,316.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,000.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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。

7.4.3 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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，

但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，

以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入,将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一基金份额享有同等分配权;
- (2) 本基金场内份额的收益分配方式采用现金分红;

(3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
活期存款	5,527,258.45	22,358,614.13
定期存款	-	-
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	-	-
合计	5,527,258.45	22,358,614.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	460,459,736.05	508,309,924.36	47,850,188.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	93,598.80	93,598.80
	银行间市场	-	-
	合计	93,598.80	93,598.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计		460,553,334.85	508,403,523.16	47,850,188.31
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,033,296,613.94	938,632,976.91	-94,663,637.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	172,999.24	172,999.24	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	172,999.24	172,999.24	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,033,469,613.18	938,805,976.15	-94,663,637.03

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	6,086,880.00	-	-	-
IF2001	6,086,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,086,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IF2001	IF2001	5	6,157,500.00	70,620.00
总额合计				70,620.00
减：可抵销期货暂收款				70,620.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有股指期货。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,123.64	4,289.32
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,136.93	320.10
应收债券利息	8.02	10.62
应收资产支持证券利息	-	-

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	36.20	297.50
合计	2,304.79	4,917.54

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	236,788.39	205,681.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	236,788.39	205,681.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 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	-	-
预提费用	258,000.00	176,000.00
应付替代款	552,195.42	1,042,553.21
其他应付款	702,117.99	331,168.08
可退替代款	-	75,962.50
合计	1,512,313.41	1,625,683.79

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,157,592,316.00	1,157,592,316.00
本期申购	1,220,000,000.00	1,220,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,932,000,000.00	-1,932,000,000.00
本期末	445,592,316.00	445,592,316.00

7.4.7.10 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	-80,725,362.37	-115,231,245.36	-195,956,607.73
本期利润	147,931,758.95	142,584,445.34	290,516,204.29
本期基金份额交易产生的变动数	-2,726,438.32	-21,838,821.02	-24,565,259.34
其中：基金申购款	22,169,503.64	-1,077,775.61	21,091,728.03
基金赎回款	-24,895,941.96	-20,761,045.41	-45,656,987.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,479,958.26	5,514,378.96	69,994,337.22

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
活期存款利息收入	63,004.49	687,533.72
定期存款利息收入	-	175,194.44
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	12,449.93	26,882.09
其他	2,234.87	10,900.71
合计	77,689.29	900,510.96

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	56,313,094.21	-42,431,499.93
股票投资收益——赎回差价收入	79,809,855.21	-48,951,162.92
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	136,122,949.42	-91,382,662.85

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
卖出股票成交总额	785,270,575.03	596,674,049.68
减：卖出股票成本总额	728,957,480.82	639,105,549.61
买卖股票差价收入	56,313,094.21	-42,431,499.93

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月 31日
赎回基金份额对价总额	1,977,656,987.37	2,014,377,864.73
减：现金支付赎回款总额	575,812,745.37	573,676,951.73
减：赎回股票成本总额	1,322,034,386.79	1,489,652,075.92
赎回差价收入	79,809,855.21	-48,951,162.92

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交 总额	1,964,586.93	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	1,810,090.82	-

成本总额		
减：应收利息总额	215.60	-
买卖债券差价收入	154,280.51	-

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
股指期货投资收益	123,262.14	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,949,257.17	19,186,705.28
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	14,949,257.17	19,186,705.28

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
1.交易性金融资产	142,513,825.34	-94,663,637.03
——股票投资	142,513,825.34	-94,663,637.03
——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	70,620.00	-

——权证投资	-	-
——期货投资	70,620.00	-
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	142,584,445.34	-94,663,637.03

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日）至 2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	1,554,968.75	635,462.73
其他	-	461,906.42
基金申购费收入	-	-
合计	1,554,968.75	1,097,369.15

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日）至 2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,820,624.40	2,964,539.40
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,820,624.40	2,964,539.40

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日）
----	--------------------------	--------------------------------

	31日	至2018年12月31日
审计费用	80,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	183,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	20,068.03	16,633.93
上市费	60,000.00	65,000.00
指数使用费	370,949.91	331,168.08
其他	-	400.00
合计	651,017.94	656,202.01

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9关联方关系

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
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申赎代办券商
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
盈峰控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
易方达 MSCI 中国 A 股国际通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
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,071,183.19	3,311,680.81
其中：支付销售机构的客户维护费	36,570.66	43,221.99

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

2.自 2019 年 4 月 22 日起，本基金的基金管理费由“按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提”调整为本基金的基金管理费“按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提”。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	507,854.67	662,336.20

注：1.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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

2.自 2019 年 4 月 22 日起，本基金的基金托管费由“按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提”调整为本基金的基金托管费“按前一日基金资产净值的 0.05%年费率计提”。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发	106,919,260.00	23.9949%	-	-

起式联接基金				
广发证券	4,400,178.00	0.9875%	7,435,600.00	0.6423%

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。

7.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日） 至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	5,527,258.45	63,004.49	22,358,614.13	687,533.72

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票中国银行。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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

002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股 流通 受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
003816	中国广核	2019-08-14	2020-02-27	新股 流通 受限	2.49	3.53	562,958	1,401,765.42	1,987,241.74	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新股 流通 受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002466	天齐锂业	2019-12-26	2020-01-03	配股 流通 受限	8.75	30.18	6,450	56,437.50	194,661.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
110063	鹰 19 转债	2019-12-16	2020-01-03	新发 流通 受限	100.00	100.00	360	35,999.29	35,999.29	-
113030	东风转债	2019-12-26	2020-01-20	新发 流通 受限	100.00	100.00	280	27,999.51	27,999.51	-
128088	深南转债	2019-12-24	2020-01-16	新发 流通 受限	100.00	100.00	296	29,600.00	29,600.00	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019-12-31	重大事项停牌	39.39	2020-01-02	40.43	18,642	507,274.32	734,308.38	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、监察与合规管理总部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理;从投资管理的流程看,已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人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。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 2019 年 12 月 31 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 0.02%(2018 年 12 月 31 日: 0.02%)。

7.4.13.2.1 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 2019年12月31日	上年度末 2018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。

7.4.13.2.2 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 2019年12月31日	上年度末 2018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

7.4.13.2.3 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 2019年12月31日	上年度末 2018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

7.4.13.2.4 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	173,009.86
AAA 以下	93,606.82	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	93,606.82	173,009.86
----	-----------	------------

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。

7.4.13.2.5 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 2019年12月31日	上年度末 2018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

7.4.13.2.6 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 2019年12月31日	上年度末 2018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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

于 2019 年 12 月 31 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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 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。

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，期末除本报告“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。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,527,258.45	-	-	-	5,527,258.45
结算备付金	2,558,634.43	-	-	-	2,558,634.43
存出保证金	880,910.92	-	-	-	880,910.92
交易性金融资产	-	-	93,598.80	508,309,924.36	508,403,523.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,905,456.81	3,905,456.81
应收利息	-	-	-	2,304.79	2,304.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,966,803.80	-	93,598.80	512,217,685.96	521,278,088.56

					6
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,846,572.60	3,846,572.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	68,712.74	68,712.74
应付托管费	-	-	-	22,904.26	22,904.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	236,788.39	236,788.39
应交税费	-	-	-	4,143.94	4,143.94
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,512,313.41	1,512,313.41
负债总计	-	-	-	5,691,435.34	5,691,435.3
					4
利率敏感度缺口	8,966,803.80	-	93,598.80	506,526,250.62	515,586,653.2
					2
上年度末					
2018 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
日					
资产					
银行存款	22,358,614.13	-	-	-	22,358,614.13
结算备付金	711,362.76	-	-	-	711,362.76
存出保证金	661,137.83	-	-	-	661,137.83
交易性金融资产	-	-	172,999.24	938,632,976.91	938,805,976.1
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,384,743.07	5,384,743.07
应收利息	-	-	-	4,917.54	4,917.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,731,114.72	-	172,999.24	944,022,637.52	967,926,751.48
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,971,540.95	3,971,540.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	406,780.36	406,780.36
应付托管费	-	-	-	81,356.08	81,356.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	205,681.73	205,681.73
应交税费	-	-	-	0.30	0.30
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,625,683.79	1,625,683.79
负债总计	-	-	-	6,291,043.21	6,291,043.21
利率敏感度缺口	23,731,114.72	-	172,999.24	937,731,594.31	961,635,708.27

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	508,309,924.36	98.59	938,632,976.91	97.61
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	508,309,924.36	98.59	938,632,976.91	97.61

7.4.13.4.3.2 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	25,335,235.30	46,940,314.65
2.业绩比较基准下降 5%	-25,335,235.30	-46,940,314.65	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 505,391,787.87 元, 属于第二层次的余额为 3,011,735.29 元, 无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日: 第一层次 929,276,824.15 元, 第二层次 9,529,152.00 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 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, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	508,309,924.36	97.51
	其中: 股票	508,309,924.36	97.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	93,598.80	0.02
	其中: 债券	93,598.80	0.02
	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	8,085,892.88	1.55
8	其他各项资产	4,788,672.52	0.92
9	合计	521,278,088.56	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	6,982,079.00	1.35
B	采矿业	14,085,942.33	2.73
C	制造业	235,934,971.91	45.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,738,348.72	3.05
E	建筑业	12,746,675.12	2.47
F	批发和零售业	8,745,029.38	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	14,883,808.00	2.89
H	住宿和餐饮业	658,377.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,108,975.90	4.29
J	金融业	132,153,805.30	25.63
K	房地产业	23,934,127.10	4.64
L	租赁和商务服务业	5,813,839.10	1.13
M	科学研究和技术服务业	3,364,595.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	648,314.04	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,016,987.24	0.97
R	文化、体育和娱乐业	4,299,543.94	0.83
S	综合	1,194,505.28	0.23

	合计	508,309,924.36	98.59
--	----	----------------	-------

8.3 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	600519	贵州茅台	22,000	26,026,000.00	5.05
2	601318	中国平安	188,400	16,100,664.00	3.12
3	600036	招商银行	359,000	13,491,220.00	2.62
4	000858	五粮液	67,700	9,004,777.00	1.75
5	601166	兴业银行	361,833	7,164,293.40	1.39
6	600900	长江电力	381,421	7,010,517.98	1.36
7	600276	恒瑞医药	76,318	6,679,351.36	1.30
8	600000	浦发银行	511,147	6,322,888.39	1.23
9	601398	工商银行	941,400	5,535,432.00	1.07
10	000002	万科 A	168,500	5,422,330.00	1.05
11	002415	海康威视	163,900	5,366,086.00	1.04
12	000001	平安银行	297,800	4,898,810.00	0.95
13	601288	农业银行	1,299,200	4,794,048.00	0.93
14	600030	中信证券	170,700	4,318,710.00	0.84
15	603288	海天味业	38,960	4,188,589.60	0.81
16	601601	中国太保	109,857	4,156,988.88	0.81
17	601668	中国建筑	731,780	4,112,603.60	0.80
18	300750	宁德时代	37,700	4,011,280.00	0.78
19	600016	民生银行	619,680	3,910,180.80	0.76
20	601328	交通银行	685,849	3,861,329.87	0.75
21	600585	海螺水泥	70,300	3,852,440.00	0.75
22	000651	格力电器	53,400	3,501,972.00	0.68
23	000333	美的集团	59,900	3,489,175.00	0.68
24	002475	立讯精密	93,860	3,425,890.00	0.66
25	600048	保利地产	204,700	3,312,046.00	0.64
26	600887	伊利股份	105,178	3,254,207.32	0.63
27	600104	上汽集团	136,400	3,253,140.00	0.63
28	600050	中国联通	541,500	3,189,435.00	0.62
29	300498	温氏股份	93,100	3,128,160.00	0.61
30	601818	光大银行	694,500	3,062,745.00	0.59
31	601766	中国中车	425,600	3,038,784.00	0.59
32	600309	万华化学	53,600	3,010,712.00	0.58
33	601888	中国国旅	33,258	2,958,299.10	0.57
34	002304	洋河股份	26,744	2,955,212.00	0.57
35	002714	牧原股份	31,300	2,779,127.00	0.54
36	001979	招商蛇口	138,600	2,753,982.00	0.53

37	002142	宁波银行	97,200	2,736,180.00	0.53
38	000725	京东方 A	588,700	2,672,698.00	0.52
39	601688	华泰证券	128,200	2,603,742.00	0.51
40	600031	三一重工	145,500	2,480,775.00	0.48
41	601211	国泰君安	131,300	2,427,737.00	0.47
42	603259	药明康德	25,900	2,385,908.00	0.46
43	601229	上海银行	248,705	2,360,210.45	0.46
44	600028	中国石化	445,500	2,276,505.00	0.44
45	601988	中国银行	613,300	2,263,077.00	0.44
46	000568	泸州老窖	25,900	2,245,012.00	0.44
47	600837	海通证券	142,200	2,198,412.00	0.43
48	300015	爱尔眼科	55,160	2,182,129.60	0.42
49	601006	大秦铁路	259,300	2,128,853.00	0.41
50	601989	中国重工	400,000	2,096,000.00	0.41
51	601169	北京银行	368,900	2,095,352.00	0.41
52	000063	中兴通讯	59,200	2,095,088.00	0.41
53	600690	海尔智家	105,700	2,061,150.00	0.40
54	601186	中国铁建	201,260	2,040,776.40	0.40
55	000166	申万宏源	391,900	2,006,528.00	0.39
56	000538	云南白药	22,300	1,994,289.00	0.39
57	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.39
58	601390	中国中铁	325,100	1,931,094.00	0.37
59	300059	东方财富	117,700	1,856,129.00	0.36
60	600019	宝钢股份	322,200	1,849,428.00	0.36
61	600999	招商证券	98,536	1,802,223.44	0.35
62	601336	新华保险	35,800	1,759,570.00	0.34
63	600015	华夏银行	224,382	1,721,009.94	0.33
64	601628	中国人寿	48,979	1,707,897.73	0.33
65	600406	国电南瑞	80,100	1,696,518.00	0.33
66	002024	苏宁易购	163,100	1,648,941.00	0.32
67	601857	中国石油	282,551	1,647,272.33	0.32
68	000338	潍柴动力	103,700	1,646,756.00	0.32
69	600346	恒力石化	101,800	1,636,944.00	0.32
70	603501	韦尔股份	11,300	1,620,420.00	0.31
71	002027	分众传媒	254,500	1,593,170.00	0.31
72	601899	紫金矿业	342,000	1,569,780.00	0.30
73	601012	隆基股份	63,088	1,566,475.04	0.30
74	002594	比亚迪	32,700	1,558,809.00	0.30
75	000776	广发证券	102,300	1,551,891.00	0.30
76	600340	华夏幸福	53,240	1,527,988.00	0.30
77	603160	汇顶科技	7,400	1,526,620.00	0.30
78	601155	新城控股	38,830	1,503,497.60	0.29
79	600547	山东黄金	45,560	1,486,167.20	0.29
80	000876	新希望	74,400	1,484,280.00	0.29

81	000661	长春高新	3,300	1,475,100.00	0.29
82	601066	中信建投	48,500	1,474,400.00	0.29
83	600919	江苏银行	202,043	1,462,791.32	0.28
84	300760	迈瑞医疗	7,877	1,432,826.30	0.28
85	600741	华域汽车	54,100	1,406,059.00	0.27
86	000895	双汇发展	48,300	1,402,149.00	0.27
87	601088	中国神华	75,800	1,383,350.00	0.27
88	600436	片仔癀	12,547	1,378,538.89	0.27
89	603993	洛阳钼业	308,600	1,345,496.00	0.26
90	600703	三安光电	71,800	1,318,248.00	0.26
91	600809	山西汾酒	14,594	1,309,081.80	0.25
92	002230	科大讯飞	37,800	1,303,344.00	0.25
93	601225	陕西煤业	144,800	1,301,752.00	0.25
94	601009	南京银行	147,700	1,295,329.00	0.25
95	603986	兆易创新	6,300	1,290,807.00	0.25
96	600009	上海机场	16,300	1,283,625.00	0.25
97	601138	工业富联	69,700	1,273,419.00	0.25
98	601933	永辉超市	166,400	1,254,656.00	0.24
99	600588	用友网络	43,440	1,233,696.00	0.24
100	300033	同花顺	11,300	1,232,943.00	0.24
101	601901	方正证券	141,500	1,226,805.00	0.24
102	601939	建设银行	166,000	1,200,180.00	0.23
103	300122	智飞生物	23,400	1,162,044.00	0.23
104	601985	中国核电	227,200	1,136,000.00	0.22
105	600383	金地集团	78,023	1,131,333.50	0.22
106	600958	东方证券	103,700	1,115,812.00	0.22
107	002241	歌尔股份	55,600	1,107,552.00	0.21
108	000069	华侨城 A	141,600	1,103,064.00	0.21
109	600886	国投电力	119,300	1,095,174.00	0.21
110	600029	南方航空	149,900	1,076,282.00	0.21
111	002352	顺丰控股	28,900	1,074,791.00	0.21
112	002600	领益智造	98,300	1,066,555.00	0.21
113	300003	乐普医疗	32,100	1,061,868.00	0.21
114	002236	大华股份	53,200	1,057,616.00	0.21
115	000100	TCL 集团	235,100	1,050,897.00	0.20
116	600010	包钢股份	794,500	1,048,740.00	0.20
117	600570	恒生电子	13,400	1,041,582.00	0.20
118	000596	古井贡酒	7,500	1,019,400.00	0.20
119	002311	海大集团	28,200	1,015,200.00	0.20
120	002624	完美世界	22,600	997,564.00	0.19
121	601877	正泰电器	37,000	991,600.00	0.19
122	600606	绿地控股	139,900	972,305.00	0.19
123	002555	三七互娱	36,100	972,173.00	0.19
124	002044	美年健康	65,126	969,726.14	0.19

125	601669	中国电建	223,000	967,820.00	0.19
126	000938	紫光股份	30,584	966,454.40	0.19
127	600115	东方航空	163,900	952,259.00	0.18
128	002916	深南电路	6,600	937,860.00	0.18
129	600061	国投资本	61,200	926,568.00	0.18
130	300413	芒果超媒	26,210	916,301.60	0.18
131	002493	荣盛石化	73,900	915,621.00	0.18
132	600196	复星医药	34,400	915,040.00	0.18
133	300124	汇川技术	29,800	913,072.00	0.18
134	002736	国信证券	72,000	903,600.00	0.18
135	601788	光大证券	68,440	896,564.00	0.17
136	300601	康泰生物	10,200	895,458.00	0.17
137	600438	通威股份	68,000	892,840.00	0.17
138	300142	沃森生物	27,300	885,612.00	0.17
139	600332	白云山	24,800	883,128.00	0.17
140	002120	韵达股份	26,300	875,790.00	0.17
141	601618	中国中冶	312,200	874,160.00	0.17
142	601872	招商轮船	105,600	872,256.00	0.17
143	002007	华兰生物	24,700	868,205.00	0.17
144	002001	新和成	36,800	855,968.00	0.17
145	600018	上港集团	147,900	853,383.00	0.17
146	600893	航发动力	38,936	844,132.48	0.16
147	002050	三花智控	48,500	840,505.00	0.16
148	601377	兴业证券	117,600	832,608.00	0.16
149	002371	北方华创	9,400	827,200.00	0.16
150	600183	生益科技	39,400	824,248.00	0.16
151	600926	杭州银行	89,760	822,201.60	0.16
152	002032	苏泊尔	10,700	821,546.00	0.16
153	600660	福耀玻璃	34,235	821,297.65	0.16
154	002466	天齐锂业	27,150	819,387.00	0.16
155	300014	亿纬锂能	16,200	812,592.00	0.16
156	601600	中国铝业	229,200	811,368.00	0.16
157	600352	浙江龙盛	56,000	810,320.00	0.16
158	000066	中国长城	51,900	807,564.00	0.16
159	600795	国电电力	342,400	801,216.00	0.16
160	000768	中航飞机	48,700	797,706.00	0.15
161	300144	宋城演艺	25,700	794,387.00	0.15
162	600271	航天信息	33,600	778,512.00	0.15
163	300433	蓝思科技	56,100	775,302.00	0.15
164	300347	泰格医药	12,250	773,587.50	0.15
165	000786	北新建材	30,300	771,135.00	0.15
166	000963	华东医药	31,540	768,945.20	0.15
167	600705	中航资本	157,100	761,935.00	0.15
168	603899	晨光文具	15,600	760,344.00	0.15

169	002146	荣盛发展	77,000	756,910.00	0.15
170	000425	徐工机械	136,900	748,843.00	0.15
171	600674	川投能源	75,900	747,615.00	0.15
172	000157	中联重科	111,900	747,492.00	0.14
173	300136	信维通信	16,400	744,232.00	0.14
174	300454	深信服	6,500	743,535.00	0.14
175	002456	欧菲光	47,600	742,560.00	0.14
176	601100	恒立液压	14,900	741,275.00	0.14
177	603799	华友钴业	18,642	734,308.38	0.14
178	601990	南京证券	55,800	720,378.00	0.14
179	603369	今世缘	22,000	719,840.00	0.14
180	000656	金科股份	93,600	718,848.00	0.14
181	002202	金风科技	59,546	711,574.70	0.14
182	601108	财通证券	62,400	707,616.00	0.14
183	300628	亿联网络	9,700	702,377.00	0.14
184	601727	上海电气	140,700	700,686.00	0.14
185	300408	三环集团	31,400	699,592.00	0.14
186	002179	中航光电	17,900	699,174.00	0.14
187	000703	恒逸石化	50,100	697,392.00	0.14
188	000783	长江证券	97,400	695,436.00	0.13
189	600536	中国软件	9,700	695,393.00	0.13
190	002271	东方雨虹	26,400	694,584.00	0.13
191	002463	沪电股份	31,000	688,510.00	0.13
192	002157	正邦科技	42,400	686,880.00	0.13
193	000625	长安汽车	68,100	683,043.00	0.13
194	600111	北方稀土	63,000	682,920.00	0.13
195	600085	同仁堂	24,200	681,956.00	0.13
196	000961	中南建设	64,500	680,475.00	0.13
197	601021	春秋航空	15,500	680,295.00	0.13
198	000723	美锦能源	72,100	679,903.00	0.13
199	601111	中国国航	70,000	678,300.00	0.13
200	000977	浪潮信息	22,500	677,250.00	0.13
201	002384	东山精密	28,700	664,405.00	0.13
202	600176	中国巨石	60,800	662,720.00	0.13
203	300450	先导智能	14,700	660,618.00	0.13
204	002410	广联达	19,400	659,212.00	0.13
205	002460	赣锋锂业	18,800	654,804.00	0.13
206	603833	欧派家居	5,574	652,158.00	0.13
207	002739	万达电影	35,400	642,510.00	0.12
208	603589	口子窖	11,700	642,447.00	0.12
209	601198	东兴证券	48,600	638,604.00	0.12
210	000860	顺鑫农业	12,100	637,428.00	0.12
211	600763	通策医疗	6,200	635,686.00	0.12
212	600801	华新水泥	24,000	634,320.00	0.12

213	600004	白云机场	35,500	619,475.00	0.12
214	300251	光线传媒	52,000	613,600.00	0.12
215	601998	中信银行	98,200	605,894.00	0.12
216	002049	紫光国微	11,900	604,996.00	0.12
217	300308	中际旭创	11,600	604,940.00	0.12
218	000671	阳光城	71,100	604,350.00	0.12
219	000627	天茂集团	85,800	604,032.00	0.12
220	600362	江西铜业	35,600	602,708.00	0.12
221	601607	上海医药	32,700	600,699.00	0.12
222	002180	纳思达	18,200	599,144.00	0.12
223	002353	杰瑞股份	16,200	598,752.00	0.12
224	002422	科伦药业	25,400	596,646.00	0.12
225	601919	中远海控	113,000	595,510.00	0.12
226	002673	西部证券	60,500	592,900.00	0.11
227	300529	健帆生物	8,200	589,088.00	0.11
228	601018	宁波港	153,400	582,920.00	0.11
229	002821	凯莱英	4,500	582,750.00	0.11
230	600516	方大炭素	47,847	581,819.52	0.11
231	002153	石基信息	14,900	581,100.00	0.11
232	002129	中环股份	49,100	579,871.00	0.11
233	600426	华鲁恒升	29,100	578,217.00	0.11
234	600600	青岛啤酒	11,300	576,300.00	0.11
235	601838	成都银行	62,900	570,503.00	0.11
236	000050	深天马 A	34,900	568,521.00	0.11
237	600208	新湖中宝	149,900	566,622.00	0.11
238	600583	海油工程	76,300	563,094.00	0.11
239	600498	烽火通信	20,400	559,980.00	0.11
240	601360	三六零	23,800	559,538.00	0.11
241	600637	东方明珠	59,480	556,732.80	0.11
242	601117	中国化学	86,000	553,840.00	0.11
243	600170	上海建工	155,700	551,178.00	0.11
244	002065	东华软件	53,400	551,088.00	0.11
245	600038	中直股份	11,500	548,665.00	0.11
246	300383	光环新网	27,300	547,911.00	0.11
247	600673	东阳光	53,500	547,840.00	0.11
248	600066	宇通客车	38,201	544,364.25	0.11
249	601878	浙商证券	48,800	543,144.00	0.11
250	603939	益丰药房	7,400	541,828.00	0.11
251	002508	老板电器	16,000	540,960.00	0.10
252	601992	金隅集团	144,900	540,477.00	0.10
253	002812	恩捷股份	10,700	540,350.00	0.10
254	300207	欣旺达	27,500	536,800.00	0.10
255	000728	国元证券	57,900	536,733.00	0.10
256	300676	华大基因	7,800	535,860.00	0.10

257	002405	四维图新	33,200	534,520.00	0.10
258	600068	葛洲坝	79,784	532,957.12	0.10
259	002601	龙麟佰利	34,600	532,494.00	0.10
260	601555	东吴证券	53,200	531,468.00	0.10
261	603517	绝味食品	11,400	529,530.00	0.10
262	601997	贵阳银行	55,380	529,432.80	0.10
263	000999	华润三九	16,600	525,888.00	0.10
264	600487	亨通光电	32,320	525,523.20	0.10
265	002506	协鑫集成	88,600	523,626.00	0.10
266	603019	中科曙光	15,100	522,158.00	0.10
267	603658	安图生物	5,400	520,452.00	0.10
268	600872	中炬高新	13,200	519,420.00	0.10
269	601799	星宇股份	5,400	512,892.00	0.10
270	300558	贝达药业	7,800	512,460.00	0.10
271	002439	启明星辰	15,000	507,000.00	0.10
272	600489	中金黄金	59,785	506,976.80	0.10
273	002926	华西证券	45,900	505,359.00	0.10
274	600369	西南证券	97,100	503,949.00	0.10
275	002797	第一创业	60,500	500,940.00	0.10
276	601233	桐昆股份	33,400	500,666.00	0.10
277	600161	天坛生物	17,900	500,126.00	0.10
278	600109	国金证券	53,700	499,410.00	0.10
279	600760	中航沈飞	15,792	499,027.20	0.10
280	600642	申能股份	85,600	497,336.00	0.10
281	600779	水井坊	9,500	491,625.00	0.10
282	601231	环旭电子	25,500	490,365.00	0.10
283	600132	重庆啤酒	9,400	488,424.00	0.09
284	603338	浙江鼎力	6,800	486,200.00	0.09
285	603707	健友股份	11,700	485,316.00	0.09
286	601238	广汽集团	41,380	483,732.20	0.09
287	601966	玲珑轮胎	20,800	476,944.00	0.09
288	002373	千方科技	26,300	474,452.00	0.09
289	000709	河钢股份	183,800	474,204.00	0.09
290	600219	南山铝业	207,700	465,248.00	0.09
291	002127	南极电商	42,600	464,766.00	0.09
292	600704	物产中大	88,500	464,625.00	0.09
293	600845	宝信软件	14,100	463,890.00	0.09
294	600011	华能国际	82,800	462,024.00	0.09
295	600297	广汇汽车	141,504	461,303.04	0.09
296	300699	光威复材	10,100	459,550.00	0.09
297	601216	君正集团	146,800	459,484.00	0.09
298	300146	汤臣倍健	28,200	459,378.00	0.09
299	600909	华安证券	62,700	457,710.00	0.09
300	000975	银泰黄金	33,600	457,296.00	0.09

301	603882	金域医学	8,900	455,858.00	0.09
302	601099	太平洋	119,900	454,421.00	0.09
303	603866	桃李面包	10,700	454,108.00	0.09
304	600188	兖州煤业	43,000	454,080.00	0.09
305	600522	中天科技	54,500	452,350.00	0.09
306	600153	建发股份	50,100	450,399.00	0.09
307	300357	我武生物	10,200	450,330.00	0.09
308	600998	九州通	31,800	449,970.00	0.09
309	002078	太阳纸业	45,300	445,752.00	0.09
310	600875	东方电气	48,500	445,715.00	0.09
311	300012	华测检测	29,700	442,827.00	0.09
312	601800	中国交建	48,300	442,428.00	0.09
313	600528	中铁工业	38,400	441,600.00	0.09
314	600118	中国卫星	20,600	440,222.00	0.09
315	600867	通化东宝	34,800	440,220.00	0.09
316	601128	常熟银行	48,300	440,013.00	0.09
317	002773	康弘药业	11,900	439,943.00	0.09
318	603885	吉祥航空	29,300	439,500.00	0.09
319	300017	网宿科技	46,000	438,380.00	0.09
320	600027	华电国际	119,400	438,198.00	0.08
321	600655	豫园股份	55,700	436,688.00	0.08
322	300253	卫宁健康	29,100	435,918.00	0.08
323	000629	攀钢钒钛	149,000	435,080.00	0.08
324	002013	中航机电	62,500	433,750.00	0.08
325	600089	特变电工	64,850	431,252.50	0.08
326	002465	海格通信	39,800	431,034.00	0.08
327	000402	金融街	53,000	430,360.00	0.08
328	000630	铜陵有色	184,200	429,186.00	0.08
329	002558	巨人网络	23,643	426,992.58	0.08
330	600816	安信信托	95,872	425,671.68	0.08
331	002299	圣农发展	17,600	423,808.00	0.08
332	600298	安琪酵母	13,800	423,246.00	0.08
333	600895	张江高科	27,600	422,556.00	0.08
334	002690	美亚光电	10,800	422,280.00	0.08
335	600977	中国电影	27,697	421,548.34	0.08
336	600885	宏发股份	12,200	420,290.00	0.08
337	603444	吉比特	1,400	417,886.00	0.08
338	600535	天士力	26,900	414,798.00	0.08
339	600739	辽宁成大	27,218	414,530.14	0.08
340	002500	山西证券	49,900	413,671.00	0.08
341	002081	金螳螂	46,900	413,658.00	0.08
342	600486	扬农化工	6,000	411,780.00	0.08
343	600688	上海石化	106,400	411,768.00	0.08
344	300070	碧水源	54,000	410,400.00	0.08

345	000415	渤海租赁	107,400	408,120.00	0.08
345	600699	均胜电子	22,800	408,120.00	0.08
347	603858	步长制药	19,757	407,389.34	0.08
348	000513	丽珠集团	12,000	404,400.00	0.08
349	000031	大悦城	56,100	402,798.00	0.08
350	000401	冀东水泥	23,600	401,436.00	0.08
351	000825	太钢不锈	98,100	401,229.00	0.08
352	600398	海澜之家	52,200	400,896.00	0.08
353	002152	广电运通	41,700	400,737.00	0.08
354	600521	华海药业	23,200	400,432.00	0.08
355	002110	三钢闽光	42,600	398,736.00	0.08
356	000750	国海证券	74,400	397,296.00	0.08
357	600256	广汇能源	119,488	395,505.28	0.08
358	600466	蓝光发展	53,400	393,558.00	0.08
359	002010	传化智联	55,800	389,484.00	0.08
360	300024	机器人	27,800	389,200.00	0.08
361	601098	中南传媒	32,300	385,662.00	0.07
362	601699	潞安环能	53,100	385,506.00	0.07
363	002387	维信诺	24,000	381,600.00	0.07
364	601958	金钼股份	47,300	378,873.00	0.07
365	000686	东北证券	40,400	375,720.00	0.07
366	300595	欧普康视	7,900	373,907.00	0.07
367	002385	大北农	74,900	373,002.00	0.07
368	300285	国瓷材料	16,300	372,455.00	0.07
369	600372	中航电子	26,000	370,240.00	0.07
370	002372	伟星新材	28,000	368,760.00	0.07
371	600021	上海电力	45,700	367,885.00	0.07
372	000423	东阿阿胶	10,400	367,848.00	0.07
373	600201	生物股份	19,500	365,040.00	0.07
374	601866	中远海发	139,200	360,528.00	0.07
375	600376	首开股份	45,200	360,244.00	0.07
376	603883	老百姓	5,600	358,848.00	0.07
377	002268	卫士通	13,900	358,481.00	0.07
378	000932	华菱钢铁	74,500	356,110.00	0.07
379	002340	格林美	73,100	355,997.00	0.07
380	600460	士兰微	22,900	354,263.00	0.07
381	600160	巨化股份	48,400	352,352.00	0.07
382	600733	北汽蓝谷	60,300	352,152.00	0.07
383	000027	深圳能源	56,700	352,107.00	0.07
384	600258	首旅酒店	16,900	348,309.00	0.07
385	002019	亿帆医药	21,400	347,750.00	0.07
386	002507	涪陵榨菜	13,000	347,490.00	0.07
387	002399	海普瑞	17,800	347,278.00	0.07
388	002174	游族网络	14,900	346,723.00	0.07

389	002223	鱼跃医疗	17,000	345,440.00	0.07
390	600380	健康元	33,000	341,550.00	0.07
391	000089	深圳机场	34,900	340,973.00	0.07
392	300296	利亚德	44,327	339,988.09	0.07
393	600511	国药股份	12,400	338,396.00	0.07
394	000998	隆平高科	23,000	338,330.00	0.07
395	600315	上海家化	10,800	334,152.00	0.06
396	600675	中华企业	71,500	332,475.00	0.06
397	000623	吉林敖东	20,100	332,253.00	0.06
398	002414	高德红外	15,800	331,800.00	0.06
399	000028	国药一致	7,300	331,128.00	0.06
400	600373	中文传媒	24,300	330,723.00	0.06
401	000983	西山煤电	53,800	329,794.00	0.06
402	600566	济川药业	13,600	328,848.00	0.06
403	600820	隧道股份	54,000	326,160.00	0.06
404	000729	燕京啤酒	49,700	324,044.00	0.06
405	600549	厦门钨业	24,800	323,392.00	0.06
406	600967	内蒙一机	30,300	322,089.00	0.06
407	002281	光迅科技	10,800	321,624.00	0.06
408	002195	二三四五	99,524	321,462.52	0.06
409	601598	中国外运	75,400	321,204.00	0.06
410	002563	森马服饰	32,500	320,775.00	0.06
411	002572	索菲亚	15,300	320,535.00	0.06
412	000883	湖北能源	76,800	320,256.00	0.06
413	600808	马钢股份	103,800	318,666.00	0.06
414	000413	东旭光电	93,300	313,488.00	0.06
415	000898	鞍钢股份	93,400	312,890.00	0.06
416	600598	北大荒	32,100	312,654.00	0.06
417	000960	锡业股份	29,900	312,156.00	0.06
418	600754	锦江酒店	10,800	310,068.00	0.06
419	600026	中远海能	48,000	306,240.00	0.06
420	600567	山鹰纸业	79,400	299,338.00	0.06
421	601333	广深铁路	97,700	298,962.00	0.06
422	002217	合力泰	53,500	296,925.00	0.06
423	600446	金证股份	14,400	296,352.00	0.06
424	000778	新兴铸管	70,000	291,900.00	0.06
425	002294	信立泰	14,600	291,124.00	0.06
426	600572	康恩贝	46,900	288,435.00	0.06
427	600879	航天电子	47,900	286,442.00	0.06
428	600392	盛和资源	31,500	285,705.00	0.06
429	002074	国轩高科	19,600	285,180.00	0.06
430	600273	嘉化能源	25,300	284,625.00	0.06
431	000997	新大陆	17,800	282,664.00	0.05
432	600782	新钢股份	54,800	281,124.00	0.05

433	002583	海能达	33,300	280,053.00	0.05
434	600643	爱建集团	28,900	277,440.00	0.05
435	600863	内蒙华电	100,700	276,925.00	0.05
436	601880	大连港	135,400	274,862.00	0.05
437	000830	鲁西化工	25,900	272,209.00	0.05
438	000046	泛海控股	59,800	272,090.00	0.05
439	601000	唐山港	103,000	267,800.00	0.05
440	000732	泰禾集团	43,300	266,295.00	0.05
441	000060	中金岭南	61,715	265,374.50	0.05
442	000039	中集集团	27,000	265,140.00	0.05
443	000581	威孚高科	13,900	264,795.00	0.05
444	600282	南钢股份	76,400	263,580.00	0.05
445	002085	万丰奥威	37,500	262,500.00	0.05
446	000559	万向钱潮	48,400	259,908.00	0.05
447	002603	以岭药业	20,900	259,787.00	0.05
448	000738	航发控制	19,800	258,786.00	0.05
449	300072	三聚环保	40,600	256,592.00	0.05
450	600500	中化国际	47,600	252,280.00	0.05
451	600777	新潮能源	119,600	251,160.00	0.05
452	002124	天邦股份	20,000	251,000.00	0.05
453	002092	中泰化学	36,700	249,193.00	0.05
454	000598	兴蓉环境	53,100	245,853.00	0.05
455	000839	中信国安	68,500	242,490.00	0.05
456	600056	中国医药	18,400	240,120.00	0.05
457	600062	华润双鹤	17,900	233,595.00	0.05
458	600582	天地科技	72,900	232,551.00	0.05
459	600260	凯乐科技	17,100	232,047.00	0.05
460	000826	启迪环境	25,200	231,336.00	0.04
461	002038	双鹭药业	17,500	230,125.00	0.04
462	603077	和邦生物	154,300	228,364.00	0.04
463	600648	外高桥	12,900	224,073.00	0.04
464	600835	上海机电	13,400	222,038.00	0.04
465	002424	贵州百灵	24,800	216,008.00	0.04
466	000681	视觉中国	11,300	194,812.00	0.04
467	002970	锐明技术	787	96,478.33	0.02
468	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
469	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
470	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
471	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000858	五粮液	25,317,266.34	2.63
2	600036	招商银行	20,335,890.70	2.11
3	002415	海康威视	19,355,787.68	2.01
4	000002	万科 A	18,477,366.17	1.92
5	002304	洋河股份	14,919,108.21	1.55
6	000001	平安银行	14,778,453.40	1.54
7	000333	美的集团	13,282,990.02	1.38
8	300498	温氏股份	11,692,315.09	1.22
9	001979	招商蛇口	9,497,354.95	0.99
10	000651	格力电器	9,474,314.52	0.99
11	000725	京东方 A	8,235,360.00	0.86
12	002142	宁波银行	7,799,746.33	0.81
13	002714	牧原股份	7,551,268.24	0.79
14	000568	泸州老窖	7,523,491.11	0.78
15	002024	苏宁易购	7,318,389.00	0.76
16	000063	中兴通讯	7,040,001.02	0.73
17	000166	申万宏源	6,859,056.20	0.71
18	002594	比亚迪	6,821,547.62	0.71
19	300760	迈瑞医疗	6,697,855.49	0.70
20	002475	立讯精密	6,170,528.65	0.64

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。

8.4.2 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	000858	五粮液	41,834,338.70	4.35
2	002415	海康威视	32,201,638.56	3.35
3	000002	万科 A	29,938,771.64	3.11
4	000333	美的集团	29,587,148.17	3.08
5	000001	平安银行	24,788,249.97	2.58
6	002304	洋河股份	21,978,140.04	2.29
7	600519	贵州茅台	19,712,444.86	2.05
8	000651	格力电器	15,961,691.03	1.66
9	001979	招商蛇口	14,733,758.54	1.53
10	000725	京东方 A	13,826,079.00	1.44

11	002142	宁波银行	12,310,501.15	1.28
12	002714	牧原股份	11,921,657.87	1.24
13	002024	苏宁易购	11,741,255.17	1.22
14	000568	泸州老窖	11,724,487.38	1.22
15	000063	中兴通讯	11,544,930.02	1.20
16	002475	立讯精密	11,028,017.16	1.15
17	002594	比亚迪	10,693,904.72	1.11
18	000166	申万宏源	10,649,942.86	1.11
19	000776	广发证券	9,755,643.77	1.01
20	002027	分众传媒	8,491,641.84	0.88

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。

8.4.3 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	654,344,420.99
卖出股票收入（成交）总额	785,270,575.03

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。

8.5 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）	93,598.80	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	93,598.80	0.02

8.6 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	110063	鹰 19 转债	360	35,999.29	0.01
2	128088	深南转债	296	29,600.00	0.01
3	113030	东风转债	280	27,999.51	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2001	IF2001	5	6,157,500.00	70,620.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					70,620.00
股指期货投资本期收益（元）					123,262.14
股指期货投资本期公允价值变动（元）					70,620.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2019 年 6 月 24 日，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司关于以下违法违规事实：（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力，处以罚款 130 万元人民币。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心 2015 年至 2018 年 6 月在为部分客户办理信用卡业务时，对申请人收入核定严重不审慎的违法违规事实，责令改正，并处罚款 30 万元。

2019 年 12 月 3 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心 2019 年 1 月信用卡催收外包管理严重违反审慎经营规则的违法违规事实，责令改正，并处罚款 50 万元。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心 1、2016 年 1 月至 2018 年 1 月在为部分客户办理信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度；2、2016 年至 2018 年 8 月对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职的违法违规行为，责令改正，并处罚款 40 万元。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行股份有限公司信用卡中心 2016 年 9 月至 2018 年 6 月在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度的违法违规事实，责令改正，并处罚款 20 万元。

2019 年 6 月 26 日，国家外汇管理局深圳市分局对万科企业股份有限公司违反外汇登记管理规定的行为，作出警告并罚款 5 万元的处罚决定。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除浦发银行，兴业银行，招商银行、万科 A 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	880,910.92

2	应收证券清算款	3,905,456.81
3	应收股利	-
4	应收利息	2,304.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,788,672.52

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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		中国银行股份有限公司一易方达MSCI中国A股国际通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
6,523	68,310.95	155,596,80 3.00	34.92%	289,995,513 .00	65.08%	106,919,26 0.00	23.99%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国银行股份有限公司一易方达MSCI中国A股国际通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。

9.2 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	陈建敏	12,000,000.00	2.69%
2	申万宏源证券有限公司	11,314,966.00	2.54%
3	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	2.24%
4	陈菲	8,468,800.00	1.90%
5	谢昊	8,250,700.00	1.85%
6	杨镇泉	6,109,900.00	1.37%
7	邹志慧	4,872,900.00	1.09%
8	华泰证券股份有限公司	4,573,500.00	1.03%
9	中信证券股份有限公司	4,479,412.00	1.01%
10	广发证券股份有限公司	4,400,178.00	0.99%
11	中国银行股份有限公司一易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	106,919,260.00	23.99%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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%

9.4 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的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年5月17日)基金份额总额	1,743,592,316.00
本报告期期初基金份额总额	1,157,592,316.00
本报告期基金总申购份额	1,220,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,932,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	445,592,316.00
-------------	----------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 2 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 80,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、托管人、基金托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对我司采取责令改正措施的决定，对公司提出整改要求。公司已及时完成了整改。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中金财富	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	45,848,890.56	3.21%	42,691.49	4.86%	-
中金公司	1	127,679,177.25	8.94%	102,143.50	11.63%	-
国信证券	1	90,362,762.21	6.33%	72,288.28	8.23%	-
中信建投	2	43,735,849.22	3.06%	39,418.57	4.49%	-
国联证券	1	86,378,925.71	6.05%	69,104.16	7.87%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	43,134,016.92	3.02%	21,567.36	2.46%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	49,250,274.74	3.45%	45,867.38	5.22%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	17,955,041.23	1.26%	16,679.68	1.90%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	1,802,022.54	0.13%	1,678.28	0.19%	-
华菁证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	309,007.27	0.02%	247.18	0.03%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	904,302,856.34	63.31%	452,205.72	51.50%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	17,617,906.22	1.23%	14,094.46	1.61%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增光大证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华菁证券有限公司各一个交易单元,中国中投证券有限责任公司更名为中国中金财富证券有限公司。

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。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。

11.7.2 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
中金财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,406,933.40	71.61%	-	-	-	-
国信证券	46,203.62	2.35%	-	-	-	-
中信建投	177,154.80	9.02%	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	217,921.90	11.09%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	116,373.21	5.92%	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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增加兴业证券为易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-03-12
2	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-13
3	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、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-19
4	易方达基金管理有限公司关于调低旗下易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金相关基金费率并修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-04-20
5	易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-05-28
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-22
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 增加联讯证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-08-01
8	易方达基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019-10-24
9	易方达基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及	2019-12-31

		中国证监会基金电子披露网站	
10	易方达基金管理有限公司关于易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议部分条款的公告	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	2019-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2019 年 04 月 02 日~2019 年 12 月 31 日	-	259,000,000.00	152,080,740.00	106,919,260.00	23.99%
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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二〇年三月三十一日