

**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
2020 年中期报告
2020 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：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十八日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	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.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末上市基金前十名持有人	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9	开放式基金份额变动	55
10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	59
11	影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

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	331,592,316.00 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	姓名	张南	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66594319

负责人	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	45,299,820.23
本期利润	42,230,024.57
加权平均基金份额本期利润	0.1173
本期加权平均净值利润率	10.10%
本期基金份额净值增长率	10.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	89,201,841.47
期末可供分配基金份额利润	0.2690
期末基金资产净值	423,777,874.50
期末基金份额净值	1.2780
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)

基金份额累计净值增长率	27.80%
-------------	--------

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.90%	0.88%	8.40%	0.87%	1.50%	0.01%
过去三个月	17.63%	0.93%	14.49%	0.92%	3.14%	0.01%
过去六个月	10.45%	1.53%	5.80%	1.53%	4.65%	0.00%
过去一年	21.40%	1.21%	14.01%	1.22%	7.39%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	27.80%	1.33%	10.83%	1.36%	16.97%	-0.03%

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 2020 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 27.80%，同期业绩比较基准收益率为 10.83%。

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，总部设在广州，在北京、上海、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募、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，为境内外客户提供包括标准化公募基金与定制化私募产品在内的资产管理解决方案。

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		
FAN	本基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证海外中国	2018-05-17	-	15 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，美国道富集团中台交易支

BING (范冰)	<p>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（自 2017 年 03 月 25 日至 2020 年 03 月 19 日）、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、易方达黄金交易型开放式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、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）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 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、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、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>				<p>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>
成曦	<p>本基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理（自 2016 年 05 月 07 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理（自 2016 年 05 月 07 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理（自 2016 年 05 月 07 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2016 年 05 月 07 日至 2020 年 04 月 22 日）、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、易方达深证 100 交易</p>	2018-05-17	2020-04-23	12 年	<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、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理。</p>

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联接基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日)、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、易方达原油证券投资基金 (QDII) 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 (自 2019 年 03 月 13 日至 2020 年 04 月 22 日)、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、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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。本基金管理人规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 59 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度，新冠肺炎疫情先后在中国国内和海外爆发，国内对人员流动的严格管控给消费和服务带来较大的基本面压力。另一方面全球产业链在疫情超预期蔓延下受到供给和需求两个方面的冲击，国内制造业承受的基本面压力显著增加。2020 年 3 月以来，国内货币和财政稳增长政策陆续出台，复工有序推进，将支持此后的经济恢复。宏观政策对冲力度加大，适当提高财政赤字率来稳经济保就业。美联储连续两次非常规紧急降息至零利率水平附近，并紧急向市场提供流动性和信贷支持，G20 国家共同行动为全球经济注入超过 5 万亿美元以刺激经济。

2020 年二季度，全球经济前景仍然充满不确定性，疫情感染人数继续攀升。全球主要经济体纷纷开启货币及财政政策刺激，提高了市场的风险偏好，MSCI 中国 A 股国际通指数在二季度也一路走高。中国虽然是第一个受到新冠疫情影响的国家，但由于政府采用了多重强力措施来遏制疫情，中国也成为第一个大规模重启经济的大国。国内资本市场改革政策利好不断，在新三板“精选层”首批公开发行落地的同时，创业板注册制也正式进入实操阶段。MSCI 今年以来没有继续增加指数中 A 股的纳入比例，但北向资金在二季度仍然持续流入 A 股市场。

作为追踪 MSCI 中国 A 股国际通指数的 ETF，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，力求追踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2780 元，本报告期份额净值增长率为 10.45%，同期业绩比较基准收益率为 5.80%，年化跟踪误差 0.945%，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 2020 年下半年，中国对新冠疫情的应对得力，中国经济复苏的步伐领先全球其他主要经济体，二季度 GDP 增速 3.2%，较一季度大幅提升。资本市场改革继续深化，长线资金陆续入市。全球范围来看，A 股的估值合理，极具配置价值，也将吸引外资持续流入。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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合规守信、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 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 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,334,738.93	5,527,258.45
结算备付金		1,323,218.91	2,558,634.43
存出保证金		857,265.48	880,910.92
交易性金融资产	6.4.7.2	407,389,249.38	508,403,523.16
其中：股票投资		407,320,249.38	508,309,924.36
基金投资		-	-
债券投资		69,000.00	93,598.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		14,436,876.27	3,905,456.81
应收利息	6.4.7.5	1,419.35	2,304.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		434,342,768.32	521,278,088.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		8,191,848.46	3,846,572.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		48,113.33	68,712.74
应付托管费		16,037.78	22,904.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	125,642.12	236,788.39
应交税费		0.53	4,143.94
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,183,251.60	1,512,313.41
负债合计		10,564,893.82	5,691,435.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	331,592,316.00	445,592,316.00
未分配利润	6.4.7.10	92,185,558.50	69,994,337.22
所有者权益合计		423,777,874.50	515,586,653.22
负债和所有者权益总计		434,342,768.32	521,278,088.56

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2780 元，基金份额总额 331,592,316.00 份。

6.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
一、收入		43,509,761.71	237,505,570.53
1.利息收入		36,123.32	42,866.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,043.16	42,808.41
债券利息收入		80.16	57.59
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,600,788.66	98,062,690.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,950,721.01	89,917,229.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	82,390.84	44,852.89
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-515,690.44	-
股利收益	6.4.7.15	3,083,367.25	8,100,608.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,069,795.66	138,305,786.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-57,354.61	1,094,227.21
减：二、费用		1,279,737.14	3,287,061.63
1. 管理人报酬		313,728.54	1,591,222.22
2. 托管费		104,576.19	347,867.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		602,811.44	1,006,087.81
5. 利息支出	6.4.7.18	-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		567.40	0.19
7. 其他费用	6.4.7.19	258,053.57	341,883.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,230,024.57	234,218,508.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,230,024.57	234,218,508.90

6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	445,592,316.00	69,994,337.22	515,586,653.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,230,024.57	42,230,024.57
三、本期基金份额交易产	-114,000,000.00	-20,038,803.29	-134,038,803.29

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	340,000,000.00	52,225,827.56	392,225,827.56
2.基金赎回款	-454,000,000.00	-72,264,630.85	-526,264,630.85
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）	331,592,316.00	92,185,558.50	423,777,874.50
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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）	-	234,218,508.90	234,218,508.90
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）	-410,000,000.00	1,144,461.38	-408,855,538.62
其中：1.基金申购款	946,000,000.00	3,206,085.85	949,206,085.85
2.基金赎回款	-1,356,000,000.00	-2,061,624.47	-1,358,061,624.47
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）	747,592,316.00	39,406,362.55	786,998,678.55

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：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 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。

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相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基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	10,334,738.93
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	10,334,738.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	362,774,841.73	407,320,249.38	44,545,407.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	69,000.00	69,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	69,000.00	69,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	362,843,841.73	407,389,249.38	44,545,407.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,708,395.00	-	-	-
IC2009	1,063,600.00	-	-	-
IF2009	4,644,795.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,708,395.00	-	-	-

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 2020 年 6 月 30 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）
IC2009	IC2009	1	1,132,880.00	69,280.00
IF2009	IF2009	4	4,881,120.00	236,325.00
总额合计				305,605.00
减：可抵销期货暂收款				305,605.00
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。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	862.76
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	528.77
应收债券利息	6.49
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	21.33
合计	1,419.35

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	125,642.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	125,642.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-
预提费用	157,453.90

应付替代款	1,168,525.26
可退替代款	679,835.20
其他应付款	177,437.24
合计	2,183,251.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	445,592,316.00	445,592,316.00
本期申购	340,000,000.00	340,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-454,000,000.00	-454,000,000.00
本期末	331,592,316.00	331,592,316.00

6.4.7.10 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	64,479,958.26	5,514,378.96	69,994,337.22
本期利润	45,299,820.23	-3,069,795.66	42,230,024.57
本期基金份额交易产生的变动数	-20,577,937.02	539,133.73	-20,038,803.29
其中：基金申购款	72,719,575.82	-20,493,748.26	52,225,827.56
基金赎回款	-93,297,512.84	21,032,881.99	-72,264,630.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	89,201,841.47	2,983,717.03	92,185,558.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	20,600.28
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	14,867.65	
其他	575.23	
合计	36,043.16	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	37,391,537.15

股票投资收益——赎回差价收入	6,559,183.86
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	43,950,721.01

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	246,690,785.88
减：卖出股票成本总额	209,299,248.73
买卖股票差价收入	37,391,537.15

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	526,264,630.85
减：现金支付赎回款总额	208,187,781.85
减：赎回股票成本总额	311,517,665.14
赎回差价收入	6,559,183.86

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	541,974.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	459,498.25
减：应收利息总额	85.07
买卖债券差价收入	82,390.84

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	-515,690.44

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,083,367.25
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	3,083,367.25

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-3,304,780.66
——股票投资	-3,304,780.66
——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	234,985.00
——权证投资	-
——期货投资	234,985.00
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	-3,069,795.66

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	-57,354.61
其他	-
合计	-57,354.61

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

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	602,811.44
银行间市场交易费用	-

合计	602,811.44
----	------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,391.06
指数使用费	150,208.61
其他	-
合计	258,053.57

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
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、申购赎回代办证券公司
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	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

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 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。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	313,728.54	1,591,222.22
其中：支付销售机构的客户维护费	4,165.13	27,113.68

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	104,576.19	347,867.70

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

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自有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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起式联接基金	64,759,260.00	19.5298%	106,919,260.00	23.9949%
广发证券	3,802,833.00	1.1468%	4,400,178.00	0.9875%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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
中国银行-活期存款	10,334,738.93	20,600.28	10,949,069.77	36,231.26

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。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2020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	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
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688080	映翰通	2020-02-03	2020-08-12	新股流通	27.63	86.78	2,233	61,697.79	193,779.74	-

				受限						
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新股流通受限	15.48	41.36	17,880	276,782.40	739,516.80	-
688200	华峰测控	2020-02-11	2020-08-18	新股流通受限	107.41	270.02	3,780	406,009.80	1,020,675.60	-
688277	天智航	2020-06-24	2021-01-07	新股流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688360	德马科技	2020-05-25	2020-12-02	新股流通受限	25.12	46.03	6,109	153,458.08	281,197.27	-
688365	光云科技	2020-04-22	2020-10-29	新股流通受限	10.80	43.22	8,249	89,089.20	356,521.78	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股流通受限	5.00	6.54	10,890	54,450.00	71,220.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	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
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	新发流通受限	100.00	100.00	502	50,200.00	50,200.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	新发流通受限	100.00	100.00	188	18,800.00	18,800.00	-

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。

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 2020 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 2020 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、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。

6.4.13.2 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。

于 2020 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 0.02%(2019 年 12 月 31 日: 0.02%)。

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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	69,006.49	93,606.82
未评级	0.00	0.00
合计	69,006.49	93,606.82

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020 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(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。

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。

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。

6.4.13.4 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。

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 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,334,738.93	-	-	-	10,334,738.93
结算备付金	1,323,218.91	-	-	-	1,323,218.91
存出保证金	857,265.48	-	-	-	857,265.48
交易性金融资产	-	-	69,000.00	407,320,249.38	407,389,249.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	14,436,876.27	14,436,876.27
应收利息	-	-	-	1,419.35	1,419.35
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,515,223.32	-	69,000.00	421,758,545.00	434,342,768.32
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	-	-	-	8,191,848.46	8,191,848.46
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	48,113.33	48,113.33
应付托管费	-	-	-	16,037.78	16,037.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	125,642.12	125,642.12
应交税费	-	-	-	0.53	0.53
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	2,183,251.60	2,183,251.60
负债总计	-	-	-	10,564,893.82	10,564,893.82
利率敏感度缺口	12,515,223.32	-	69,000.00	411,193,651.18	423,777,874.50
上年度末 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
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	5,691,435.34
利率敏感度缺口	8,966,803.80	-	93,598.80	506,526,250.62	515,586,653.2 2

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	407,320,249.38	96.12	508,309,924.36	98.59
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	407,320,249.38	96.12	508,309,924.36	98.59

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	20,337,449.76	25,335,235.30
	2.业绩比较基准下降5%	-20,337,449.76	-25,335,235.30

6.4.14 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 2020 年 6 月 30 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 404,088,352.39 元，属于第二层次的余额为 3,300,896.99 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 505,391,787.87 元，第二层次 3,011,735.29 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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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。

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	407,320,249.38	93.78
	其中：股票	407,320,249.38	93.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,000.00	0.02
	其中：债券	69,000.00	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	11,657,957.84	2.68
8	其他各项资产	15,295,561.10	3.52
9	合计	434,342,768.32	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,757,676.00	1.59
B	采矿业	9,652,405.79	2.28
C	制造业	212,268,805.55	50.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,758,007.26	2.30
E	建筑业	8,054,881.20	1.90
F	批发和零售业	6,444,053.74	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	10,759,230.50	2.54
H	住宿和餐饮业	463,776.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,997,385.49	5.43
J	金融业	85,891,874.02	20.27
K	房地产业	14,787,697.90	3.49
L	租赁和商务服务业	5,778,056.74	1.36
M	科学研究和技术服务业	3,487,214.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	336,168.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	579,975.00	0.14
Q	卫生和社会工作	5,179,138.76	1.22
R	文化、体育和娱乐业	3,597,085.61	0.85
S	综合	495,621.60	0.12
	合计	407,289,053.16	96.11

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	16,000	23,406,080.00	5.52
2	601318	中国平安	132,600	9,467,640.00	2.23
3	600036	招商银行	253,087	8,534,093.64	2.01
4	000858	五粮液	49,000	8,384,880.00	1.98

5	600276	恒瑞医药	65,804	6,073,709.20	1.43
6	600900	长江电力	271,321	5,138,819.74	1.21
7	300750	宁德时代	28,200	4,916,952.00	1.16
8	002475	立讯精密	88,886	4,564,296.10	1.08
9	603288	海天味业	33,372	4,151,476.80	0.98
10	601166	兴业银行	255,357	4,029,533.46	0.95
11	300760	迈瑞医疗	13,077	3,997,638.90	0.94
12	002714	牧原股份	47,460	3,891,720.00	0.92
13	600000	浦发银行	359,447	3,802,949.26	0.90
14	601888	中国中免	23,258	3,582,429.74	0.85
15	002415	海康威视	117,900	3,578,265.00	0.84
16	601398	工商银行	662,800	3,300,744.00	0.78
17	000002	万科 A	123,200	3,220,448.00	0.76
18	000001	平安银行	244,800	3,133,440.00	0.74
19	601288	农业银行	914,800	3,092,024.00	0.73
20	600030	中信证券	121,100	2,919,721.00	0.69
21	600585	海螺水泥	50,400	2,666,664.00	0.63
22	603259	药明康德	25,800	2,492,280.00	0.59
23	600016	民生银行	435,480	2,469,171.60	0.58
24	601328	交通银行	478,949	2,457,008.37	0.58
25	601668	中国建筑	512,080	2,442,621.60	0.58
26	600887	伊利股份	75,478	2,349,630.14	0.55
27	300015	爱尔眼科	51,678	2,245,409.10	0.53
28	000661	长春高新	5,000	2,176,500.00	0.51
29	600048	保利地产	147,100	2,174,138.00	0.51
30	000651	格力电器	38,000	2,149,660.00	0.51
31	601601	中国太保	76,757	2,091,628.25	0.49
32	300059	东方财富	101,620	2,052,724.00	0.48
33	002352	顺丰控股	37,300	2,040,310.00	0.48
34	300122	智飞生物	20,300	2,033,045.00	0.48
35	002304	洋河股份	19,044	2,002,286.16	0.47
36	002142	宁波银行	76,200	2,001,774.00	0.47
37	000725	京东方 A	427,900	1,998,293.00	0.47
38	600309	万华化学	39,400	1,969,606.00	0.46
39	000063	中兴通讯	48,700	1,954,331.00	0.46
40	600031	三一重工	103,700	1,945,412.00	0.46
41	601012	隆基股份	46,388	1,889,383.24	0.45
42	600588	用友网络	39,922	1,760,560.20	0.42
43	300498	温氏股份	80,620	1,757,516.00	0.41
44	601818	光大银行	490,700	1,756,706.00	0.41
45	601688	华泰证券	89,900	1,690,120.00	0.40
46	000568	泸州老窖	18,500	1,685,720.00	0.40
47	601766	中国中车	298,700	1,663,759.00	0.39
48	600809	山西汾酒	11,394	1,652,130.00	0.39

49	002594	比亚迪	23,000	1,651,400.00	0.39
50	600104	上汽集团	96,500	1,639,535.00	0.39
51	000895	双汇发展	35,000	1,613,150.00	0.38
52	601211	国泰君安	93,100	1,606,906.00	0.38
53	000876	新希望	53,300	1,588,340.00	0.37
54	000538	云南白药	16,600	1,557,246.00	0.37
55	600050	中国联通	317,600	1,537,184.00	0.36
56	600999	招商证券	69,936	1,535,095.20	0.36
57	603501	韦尔股份	7,500	1,514,625.00	0.36
58	601988	中国银行	429,500	1,494,660.00	0.35
59	600745	闻泰科技	11,700	1,473,615.00	0.35
60	000166	申万宏源	291,700	1,473,085.00	0.35
61	300413	芒果超媒	22,510	1,467,652.00	0.35
62	601229	上海银行	174,442	1,447,868.60	0.34
63	300601	康泰生物	8,700	1,410,792.00	0.33
64	600570	恒生电子	12,830	1,381,791.00	0.33
65	001979	招商蛇口	83,700	1,376,028.00	0.32
66	600690	海尔智家	77,253	1,367,378.10	0.32
67	603986	兆易创新	5,700	1,344,687.00	0.32
68	601066	中信建投	33,900	1,334,982.00	0.32
69	600436	片仔癀	7,747	1,318,926.75	0.31
70	600703	三安光电	52,300	1,307,500.00	0.31
71	603160	汇顶科技	5,800	1,292,820.00	0.31
72	601169	北京银行	263,000	1,288,700.00	0.30
73	601006	大秦铁路	182,700	1,286,208.00	0.30
74	002555	三七互娱	27,100	1,268,280.00	0.30
75	600028	中国石化	320,900	1,254,719.00	0.30
76	601390	中国中铁	249,800	1,253,996.00	0.30
77	600837	海通证券	99,500	1,251,710.00	0.30
78	002241	歌尔股份	41,600	1,221,376.00	0.29
79	601186	中国铁建	144,160	1,208,060.80	0.29
80	600547	山东黄金	32,460	1,188,685.20	0.28
81	002007	华兰生物	23,090	1,157,039.90	0.27
82	600406	国电南瑞	56,600	1,146,150.00	0.27
83	601336	新华保险	25,700	1,137,996.00	0.27
84	601989	中国重工	282,800	1,131,200.00	0.27
85	000938	紫光股份	26,184	1,125,388.32	0.27
86	601857	中国石油	266,451	1,116,429.69	0.26
87	300014	亿纬锂能	23,291	1,114,474.35	0.26
88	601138	工业富联	72,800	1,102,920.00	0.26
89	601933	永辉超市	116,900	1,096,522.00	0.26
90	000100	TCL 科技	174,900	1,084,380.00	0.26
91	000776	广发证券	76,300	1,077,356.00	0.25
92	000338	潍柴动力	77,300	1,060,556.00	0.25

93	002371	北方华创	6,200	1,059,642.00	0.25
94	002027	分众传媒	189,700	1,056,629.00	0.25
95	002024	苏宁易购	120,400	1,055,908.00	0.25
96	002230	科大讯飞	28,200	1,055,526.00	0.25
97	601899	紫金矿业	239,800	1,055,120.00	0.25
98	600019	宝钢股份	229,000	1,044,240.00	0.25
99	300142	沃森生物	19,500	1,021,020.00	0.24
100	688200	华峰测控	3,780	1,020,675.60	0.24
101	300347	泰格医药	9,950	1,013,706.00	0.24
102	600346	恒力石化	72,300	1,012,200.00	0.24
103	002410	广联达	14,500	1,010,650.00	0.24
104	002916	深南电路	6,020	1,008,470.40	0.24
105	300433	蓝思科技	35,800	1,003,832.00	0.24
106	002050	三花智控	45,600	998,640.00	0.24
107	600015	华夏银行	159,882	978,477.84	0.23
108	002624	完美世界	16,900	974,116.00	0.23
109	601088	中国神华	67,500	969,300.00	0.23
110	601628	中国人寿	35,379	962,662.59	0.23
111	002311	海大集团	20,000	951,800.00	0.22
112	601009	南京银行	124,800	914,784.00	0.22
113	300033	同花顺	6,800	904,944.00	0.21
114	002841	视源股份	8,800	875,776.00	0.21
115	601100	恒立液压	10,900	874,180.00	0.21
116	601155	新城控股	27,660	864,098.40	0.20
117	600009	上海机场	11,900	857,633.00	0.20
118	600340	华夏幸福	37,440	855,878.40	0.20
119	300124	汇川技术	22,500	854,775.00	0.20
120	600438	通威股份	48,200	837,716.00	0.20
121	002493	荣盛石化	68,100	837,630.00	0.20
122	600196	复星医药	24,700	836,095.00	0.20
123	300003	乐普医疗	22,600	825,352.00	0.19
124	600183	生益科技	28,000	819,560.00	0.19
125	002271	东方雨虹	20,100	816,663.00	0.19
126	600741	华域汽车	39,000	810,810.00	0.19
127	600919	江苏银行	142,643	808,785.81	0.19
128	002602	世纪华通	52,800	808,368.00	0.19
129	603993	洛阳钼业	218,300	801,161.00	0.19
130	002001	新和成	27,500	800,250.00	0.19
131	002600	领益智造	74,400	790,872.00	0.19
132	002129	中环股份	35,200	790,592.00	0.19
133	300676	华大基因	5,000	779,550.00	0.18
134	601939	建设银行	121,200	764,772.00	0.18
135	002120	韵达股份	30,970	757,216.50	0.18
136	600383	金地集团	55,223	756,555.10	0.18

137	002236	大华股份	39,300	754,953.00	0.18
138	601788	光大证券	46,940	753,856.40	0.18
139	002460	赣锋锂业	14,000	749,980.00	0.18
140	601225	陕西煤业	103,200	744,072.00	0.18
141	688106	金宏气体	17,880	739,516.80	0.17
142	000977	浪潮信息	18,828	737,681.04	0.17
143	002044	美年健康	50,926	733,843.66	0.17
144	300529	健帆生物	10,450	726,275.00	0.17
145	601901	方正证券	102,000	722,160.00	0.17
146	000596	古井贡酒	4,800	721,152.00	0.17
147	601877	正泰电器	27,200	716,720.00	0.17
148	600600	青岛啤酒	9,327	713,515.50	0.17
149	002821	凯莱英	2,900	704,700.00	0.17
150	300454	深信服	3,400	700,264.00	0.17
151	300558	贝达药业	5,000	699,900.00	0.17
152	600958	东方证券	73,500	697,515.00	0.16
153	002812	恩捷股份	10,600	697,480.00	0.16
154	300628	亿联网络	9,900	675,774.00	0.16
155	002127	南极电商	31,800	673,206.00	0.16
156	600763	通策医疗	4,000	667,080.00	0.16
157	601985	中国核电	161,000	658,490.00	0.16
158	002456	欧菲光	35,600	654,684.00	0.15
159	600886	国投电力	83,200	653,952.00	0.15
160	601669	中国电建	187,900	650,134.00	0.15
161	600893	航发动力	27,536	646,545.28	0.15
162	600926	杭州银行	72,460	646,343.20	0.15
163	000768	中航飞机	36,300	643,962.00	0.15
164	000069	华侨城 A	106,200	643,572.00	0.15
165	603369	今世缘	16,100	640,619.00	0.15
166	300408	三环集团	22,700	628,790.00	0.15
167	300253	卫宁健康	27,390	628,326.60	0.15
168	603899	晨光文具	11,500	627,900.00	0.15
169	600010	包钢股份	574,900	620,892.00	0.15
170	300136	信维通信	11,700	620,334.00	0.15
171	600845	宝信软件	10,400	614,432.00	0.14
172	600521	华海药业	18,070	613,115.10	0.14
173	600606	绿地控股	98,600	609,348.00	0.14
174	002384	东山精密	20,300	607,985.00	0.14
175	002736	国信证券	53,800	607,940.00	0.14
176	603939	益丰药房	6,660	606,060.00	0.14
177	000425	徐工机械	102,200	604,002.00	0.14
178	601881	中国银河	52,400	601,028.00	0.14
179	300308	中际旭创	9,500	598,500.00	0.14
180	002049	紫光国微	8,200	596,550.00	0.14

181	300144	宋城演艺	34,380	594,774.00	0.14
182	603019	中科曙光	15,380	590,592.00	0.14
183	600161	天坛生物	13,000	589,290.00	0.14
184	603658	安图生物	3,600	584,784.00	0.14
185	002414	高德红外	19,930	583,550.40	0.14
186	002607	中公教育	20,900	579,975.00	0.14
187	300661	圣邦股份	1,900	579,595.00	0.14
188	600029	南方航空	112,100	579,557.00	0.14
189	600872	中炬高新	9,900	579,447.00	0.14
190	600332	白云山	17,900	578,707.00	0.14
191	002179	中航光电	14,100	578,241.00	0.14
192	601990	南京证券	40,400	576,508.00	0.14
193	601377	兴业证券	83,800	574,030.00	0.14
194	300595	欧普康视	8,250	572,055.00	0.13
195	000656	金科股份	70,100	572,016.00	0.13
196	603659	璞泰来	5,500	566,610.00	0.13
197	601618	中国中冶	223,800	561,738.00	0.13
198	000963	华东医药	22,140	560,142.00	0.13
199	000625	长安汽车	50,900	559,900.00	0.13
200	000860	顺鑫农业	9,800	558,404.00	0.13
201	002157	正邦科技	31,700	554,116.00	0.13
202	603517	绝味食品	7,800	551,772.00	0.13
203	600061	国投资本	43,100	548,663.00	0.13
204	002252	上海莱士	64,400	544,824.00	0.13
205	002463	沪电股份	21,800	544,564.00	0.13
206	000157	中联重科	84,100	540,763.00	0.13
207	601111	中国国航	81,000	535,410.00	0.13
208	300450	先导智能	11,500	531,415.00	0.13
209	603799	华友钴业	13,642	530,128.12	0.13
210	300383	光环新网	20,200	526,614.00	0.12
211	603882	金域医学	5,800	519,100.00	0.12
212	601727	上海电气	102,700	517,608.00	0.12
213	600660	福耀玻璃	24,635	514,132.45	0.12
214	600352	浙江龙盛	39,900	510,321.00	0.12
215	601360	三六零	27,800	509,018.00	0.12
216	000066	中国长城	38,300	505,560.00	0.12
217	600298	安琪酵母	10,200	504,696.00	0.12
218	600674	川投能源	54,200	502,434.00	0.12
219	002385	大北农	55,000	501,050.00	0.12
220	002065	东华软件	39,800	498,296.00	0.12
221	601162	天风证券	82,000	496,920.00	0.12
222	603444	吉比特	900	494,109.00	0.12
223	002439	启明星辰	11,700	492,219.00	0.12
224	600536	中国软件	6,200	491,040.00	0.12

225	603707	健友股份	7,600	490,732.00	0.12
226	002032	苏泊尔	6,900	489,900.00	0.12
227	000783	长江证券	72,200	486,628.00	0.11
228	002603	以岭药业	15,600	486,564.00	0.11
229	601872	招商轮船	82,900	483,307.00	0.11
230	600115	东方航空	114,400	482,768.00	0.11
231	002773	康弘药业	9,700	481,120.00	0.11
232	002690	美亚光电	9,100	478,660.00	0.11
233	600018	上港集团	113,800	477,960.00	0.11
234	600085	同仁堂	17,600	477,312.00	0.11
235	601319	中国人保	74,100	477,204.00	0.11
236	002185	华天科技	34,800	470,844.00	0.11
237	002223	鱼跃医疗	12,900	469,560.00	0.11
238	600760	中航沈飞	14,292	469,063.44	0.11
239	002373	千方科技	19,500	467,805.00	0.11
240	603338	浙江鼎力	6,100	462,197.00	0.11
241	600795	国电电力	248,900	460,465.00	0.11
242	002299	圣农发展	15,800	458,200.00	0.11
243	000786	北新建材	21,400	456,462.00	0.11
244	601600	中国铝业	164,500	454,020.00	0.11
245	002153	石基信息	11,600	452,748.00	0.11
246	002146	荣盛发展	55,700	451,170.00	0.11
247	600118	中国卫星	14,600	450,118.00	0.11
248	603605	珀莱雅	2,500	450,050.00	0.11
249	601108	财通证券	43,900	449,975.00	0.11
250	002180	纳思达	13,600	447,576.00	0.11
251	300482	万孚生物	4,300	447,200.00	0.11
252	600132	重庆啤酒	6,100	445,300.00	0.11
253	601799	星宇股份	3,500	444,500.00	0.10
254	000703	恒逸石化	48,680	444,448.40	0.10
255	002466	天齐锂业	19,350	444,082.50	0.10
256	002202	金风科技	44,446	443,126.62	0.10
257	600705	中航资本	111,600	441,936.00	0.10
258	600109	国金证券	38,500	439,285.00	0.10
259	601607	上海医药	23,700	435,606.00	0.10
260	600998	九州通	23,300	433,846.00	0.10
261	600522	中天科技	37,700	431,665.00	0.10
262	000961	中南建设	48,000	427,200.00	0.10
263	601800	中国交建	57,900	424,986.00	0.10
264	600867	通化东宝	24,200	421,806.00	0.10
265	601919	中远海控	121,300	420,911.00	0.10
266	300251	光线传媒	38,400	418,944.00	0.10
267	300285	国瓷材料	12,500	418,875.00	0.10
268	001914	招商积余	13,600	417,928.00	0.10

269	603589	口子窖	8,200	417,380.00	0.10
270	002405	四维图新	25,300	417,197.00	0.10
271	600498	烽火通信	14,400	416,304.00	0.10
272	600111	北方稀土	44,400	413,808.00	0.10
273	600895	张江高科	20,200	411,474.00	0.10
274	300357	我武生物	6,600	410,850.00	0.10
275	600801	华新水泥	17,300	410,183.00	0.10
276	603858	步长制药	14,157	408,429.45	0.10
277	000021	深科技	18,700	408,221.00	0.10
278	300699	光威复材	6,500	407,745.00	0.10
279	002739	万达电影	26,700	407,709.00	0.10
280	300146	汤臣倍健	20,700	407,583.00	0.10
281	600315	上海家化	8,500	407,150.00	0.10
282	300316	晶盛机电	16,400	405,736.00	0.10
283	601555	东吴证券	49,530	404,164.80	0.10
284	000050	深天马 A	26,300	403,968.00	0.10
285	600637	东方明珠	41,830	403,659.50	0.10
286	603833	欧派家居	3,474	402,636.60	0.10
287	002152	广电运通	31,100	402,434.00	0.09
288	601231	环旭电子	18,400	401,856.00	0.09
289	000975	银泰黄金	25,500	399,840.00	0.09
290	000513	丽珠集团	8,300	398,483.00	0.09
291	601021	春秋航空	11,300	398,212.00	0.09
292	002294	信立泰	13,400	397,444.00	0.09
293	600176	中国巨石	43,400	397,110.00	0.09
294	002422	科伦药业	18,900	396,900.00	0.09
295	300496	中科创达	5,100	396,270.00	0.09
296	600511	国药股份	9,700	394,499.00	0.09
297	002601	龙蟠佰利	21,300	394,050.00	0.09
298	002212	南洋股份	14,800	393,384.00	0.09
299	600004	白云机场	25,500	388,620.00	0.09
300	600011	华能国际	92,000	388,240.00	0.09
301	600380	健康元	23,900	388,136.00	0.09
302	600487	亨通光电	23,620	387,604.20	0.09
303	300207	欣旺达	20,500	387,450.00	0.09
304	600779	水井坊	6,200	387,004.00	0.09
305	600201	生物股份	13,900	386,976.00	0.09
306	601018	宁波港	108,300	386,631.00	0.09
307	002074	国轩高科	14,400	386,496.00	0.09
308	600489	中金黄金	42,285	386,484.90	0.09
309	002353	杰瑞股份	12,400	384,400.00	0.09
310	002465	海格通信	29,700	384,318.00	0.09
311	601198	东兴证券	35,200	383,680.00	0.09
312	002508	老板电器	12,300	382,653.00	0.09

313	300212	易华录	6,800	380,800.00	0.09
314	002242	九阳股份	10,100	376,427.00	0.09
315	600699	均胜电子	15,800	376,198.00	0.09
316	002507	涪陵榨菜	10,400	374,504.00	0.09
317	600885	宏发股份	9,316	373,757.92	0.09
318	002511	中顺洁柔	16,700	372,410.00	0.09
319	002558	巨人网络	21,343	371,368.20	0.09
320	600739	辽宁成大	19,518	369,475.74	0.09
321	600271	航天信息	22,700	368,648.00	0.09
322	603712	七一二	9,600	368,448.00	0.09
323	002156	通富微电	14,700	368,235.00	0.09
324	002013	中航机电	46,600	368,140.00	0.09
325	002673	西部证券	45,100	368,016.00	0.09
326	000999	华润三九	12,600	367,794.00	0.09
327	002019	亿帆医药	16,000	367,520.00	0.09
328	600177	雅戈尔	61,600	367,136.00	0.09
329	600426	华鲁恒升	20,728	366,471.04	0.09
330	601998	中信银行	71,100	366,165.00	0.09
331	002926	华西证券	34,300	364,609.00	0.09
332	300418	昆仑万维	14,600	364,416.00	0.09
333	600598	北大荒	22,600	363,860.00	0.09
334	000728	国元证券	43,300	363,720.00	0.09
335	601689	拓普集团	13,000	362,700.00	0.09
336	603883	老百姓	3,600	360,144.00	0.08
337	600655	豫园股份	40,300	357,058.00	0.08
338	688365	光云科技	8,249	356,521.78	0.08
339	600642	申能股份	60,300	356,373.00	0.08
340	002075	沙钢股份	28,200	352,500.00	0.08
341	601838	成都银行	44,200	351,832.00	0.08
342	603866	桃李面包	6,900	351,141.00	0.08
343	600170	上海建工	113,800	349,366.00	0.08
344	000739	普洛药业	15,000	349,350.00	0.08
345	601878	浙商证券	35,200	348,832.00	0.08
346	300088	长信科技	31,000	347,200.00	0.08
347	002557	洽洽食品	6,400	346,816.00	0.08
348	600362	江西铜业	25,700	345,922.00	0.08
349	000671	阳光城	53,200	337,288.00	0.08
350	000723	美锦能源	53,800	336,788.00	0.08
351	300070	碧水源	41,400	336,168.00	0.08
352	002925	盈趣科技	5,800	336,052.00	0.08
353	002399	海普瑞	13,400	335,536.00	0.08
354	600068	葛洲坝	56,384	335,484.80	0.08
355	601117	中国化学	60,900	333,732.00	0.08
356	000627	天茂集团	63,900	332,919.00	0.08

357	002131	利欧股份	85,800	331,188.00	0.08
358	002500	山西证券	50,490	330,204.60	0.08
359	300168	万达信息	14,900	328,843.00	0.08
360	600066	宇通客车	26,901	328,192.20	0.08
361	002683	宏大爆破	9,400	328,060.00	0.08
362	002939	长城证券	26,500	326,480.00	0.08
363	002078	太阳纸业	33,800	321,776.00	0.08
364	600486	扬农化工	3,900	321,750.00	0.08
365	002468	申通快递	19,500	319,995.00	0.08
366	600875	东方电气	36,000	318,600.00	0.08
367	600369	西南证券	69,200	317,628.00	0.07
368	000988	华工科技	13,000	317,590.00	0.07
369	000423	东阿阿胶	8,800	315,128.00	0.07
370	600208	新湖中宝	105,700	314,986.00	0.07
371	601992	金隅集团	102,600	313,956.00	0.07
372	002958	青农商行	70,600	312,758.00	0.07
373	600221	海航控股	208,400	312,600.00	0.07
374	002797	第一创业	45,100	312,092.00	0.07
375	002030	达安基因	11,410	311,264.80	0.07
376	000750	国海证券	71,410	309,919.40	0.07
377	600089	特变电工	45,350	307,019.50	0.07
378	600667	太极实业	25,800	304,956.00	0.07
379	600038	中直股份	7,400	303,918.00	0.07
380	600516	方大炭素	48,206	302,733.68	0.07
381	600909	华安证券	44,300	302,569.00	0.07
382	002174	游族网络	11,600	302,528.00	0.07
383	002340	格林美	60,700	301,679.00	0.07
384	600219	南山铝业	147,800	300,034.00	0.07
385	600153	建发股份	37,000	299,700.00	0.07
386	002281	光迅科技	9,100	299,026.00	0.07
386	300271	华宇软件	10,600	299,026.00	0.07
388	601966	玲珑轮胎	14,700	296,940.00	0.07
389	000932	华菱钢铁	77,600	292,552.00	0.07
390	600027	华电国际	85,300	291,726.00	0.07
391	601233	桐昆股份	22,800	290,928.00	0.07
392	002572	索菲亚	11,900	287,623.00	0.07
393	000540	中天金融	89,100	286,902.00	0.07
394	000998	隆平高科	17,200	286,380.00	0.07
395	000401	冀东水泥	17,700	283,908.00	0.07
396	002396	星网锐捷	8,000	282,640.00	0.07
397	688360	德马科技	6,109	281,197.27	0.07
398	000709	河钢股份	136,900	279,276.00	0.07
399	000547	航天发展	20,400	278,868.00	0.07
399	300024	机器人	20,400	278,868.00	0.07

401	002081	金螳螂	35,200	276,672.00	0.07
402	601099	太平洋	87,200	276,424.00	0.07
403	600754	锦江酒店	9,900	274,725.00	0.06
404	600026	中远海能	42,400	273,904.00	0.06
405	600188	兖州煤业	31,000	271,560.00	0.06
406	601216	君正集团	105,900	268,986.00	0.06
407	000688	国城矿业	14,500	268,685.00	0.06
408	600167	联美控股	18,700	268,158.00	0.06
409	300017	网宿科技	31,500	267,435.00	0.06
410	600673	东阳光	38,400	265,344.00	0.06
411	000630	铜陵有色	136,800	264,024.00	0.06
412	600704	物产中大	62,600	263,546.00	0.06
413	600688	上海石化	75,600	263,088.00	0.06
414	601128	常熟银行	35,000	262,850.00	0.06
415	600566	济川药业	10,300	262,238.00	0.06
416	600977	中国电影	19,797	259,934.61	0.06
417	000402	金融街	39,100	259,624.00	0.06
418	002387	维信诺	18,000	257,040.00	0.06
419	000686	东北证券	30,200	255,190.00	0.06
420	000729	燕京啤酒	37,000	253,450.00	0.06
421	600372	中航电子	18,700	249,084.00	0.06
422	600583	海油工程	54,400	247,520.00	0.06
423	000825	太钢不锈	74,200	246,344.00	0.06
424	601098	中南传媒	23,200	245,456.00	0.06
425	600160	巨化股份	34,900	240,461.00	0.06
426	600021	上海电力	32,400	239,760.00	0.06
427	002372	伟星新材	20,600	239,578.00	0.06
428	600460	士兰微	16,300	239,284.00	0.06
429	000415	渤海租赁	80,000	238,400.00	0.06
430	000623	吉林敖东	15,000	235,950.00	0.06
431	002268	卫士通	11,000	234,740.00	0.06
432	000027	深圳能源	50,580	234,691.20	0.06
433	600733	北汽蓝谷	36,000	231,480.00	0.05
434	600256	广汇能源	85,288	230,277.60	0.05
435	000581	威孚高科	11,000	227,480.00	0.05
436	002010	传化智联	41,800	227,392.00	0.05
437	600967	内蒙一机	21,600	224,424.00	0.05
438	000629	攀钢钒钛	111,100	223,311.00	0.05
439	600879	航天电子	34,400	221,536.00	0.05
440	600820	隧道股份	38,600	218,090.00	0.05
441	600675	中华企业	53,400	217,338.00	0.05
442	600549	厦门钨业	18,300	216,672.00	0.05
443	000997	新大陆	13,500	215,730.00	0.05
444	300012	华测检测	10,900	215,384.00	0.05

445	601699	潞安环能	38,400	213,888.00	0.05
446	000028	国药一致	4,700	211,547.00	0.05
447	601958	金钼股份	34,200	211,356.00	0.05
448	002110	三钢闽光	31,700	211,122.00	0.05
449	300026	红日药业	38,200	210,864.00	0.05
450	600466	蓝光发展	38,800	209,132.00	0.05
451	002195	二三四五	74,324	208,850.44	0.05
452	600446	金证股份	10,600	205,640.00	0.05
453	000046	泛海控股	54,300	204,711.00	0.05
454	002217	合力泰	38,900	204,225.00	0.05
455	600373	中文传媒	17,200	202,616.00	0.05
456	002563	森马服饰	28,700	202,335.00	0.05
457	000738	航发控制	14,800	202,020.00	0.05
458	000089	深圳机场	26,300	201,458.00	0.05
459	300296	利亚德	33,027	200,473.89	0.05
460	000883	湖北能源	56,000	197,120.00	0.05
461	000983	西山煤电	52,140	195,525.00	0.05
462	688080	映翰通	2,233	193,779.74	0.05
463	600808	马钢股份	74,600	192,468.00	0.05
464	600376	首开股份	32,800	192,208.00	0.05
465	000413	东旭光电	71,900	191,973.00	0.05
466	000031	大悦城	37,400	190,366.00	0.04
467	603885	吉祥航空	20,900	190,190.00	0.04
468	601866	中远海发	102,900	189,336.00	0.04
469	600258	首旅酒店	12,300	189,051.00	0.04
470	600572	康恩贝	34,300	188,650.00	0.04
471	600056	中国医药	13,100	185,365.00	0.04
472	002085	万丰奥威	28,100	182,088.00	0.04
473	000598	兴蓉环境	39,100	179,860.00	0.04
474	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.04
475	601598	中国外运	54,800	177,004.00	0.04
476	600863	内蒙华电	71,200	175,152.00	0.04
477	002506	协鑫集成	66,000	172,260.00	0.04
478	000898	鞍钢股份	70,000	171,500.00	0.04
479	600260	凯乐科技	12,300	166,296.00	0.04
480	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
481	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
482	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
483	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
484	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
485	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
486	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
487	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
488	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00

489	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
490	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
491	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
492	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	000858	五粮液	6,728,133.18	1.30
2	300760	迈瑞医疗	5,598,975.31	1.09
3	300750	宁德时代	5,063,259.52	0.98
4	002415	海康威视	4,265,084.00	0.83
5	002714	牧原股份	4,251,438.00	0.82
6	000001	平安银行	4,154,413.74	0.81
7	000002	万科 A	3,865,645.00	0.75
8	002475	立讯精密	3,139,602.69	0.61
9	300601	康泰生物	2,544,215.93	0.49
10	000063	中兴通讯	2,491,778.94	0.48
11	002142	宁波银行	2,354,399.00	0.46
12	600745	闻泰科技	2,342,800.00	0.45
13	300498	温氏股份	2,136,008.00	0.41
14	601318	中国平安	2,124,881.00	0.41
15	000725	京东方 A	2,043,330.00	0.40
16	000651	格力电器	2,029,947.00	0.39
17	600036	招商银行	2,010,671.51	0.39
18	300015	爱尔眼科	1,820,331.90	0.35
19	001979	招商蛇口	1,703,889.38	0.33
20	002304	洋河股份	1,634,882.22	0.32

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	000858	五粮液	9,183,794.00	1.78
2	300750	宁德时代	6,461,053.32	1.25
3	002415	海康威视	5,911,314.00	1.15
4	000002	万科 A	5,193,841.00	1.01
5	000001	平安银行	4,965,034.47	0.96

6	002714	牧原股份	4,589,006.10	0.89
7	300760	迈瑞医疗	4,330,554.84	0.84
8	002475	立讯精密	4,294,710.91	0.83
9	000333	美的集团	3,490,363.00	0.68
10	000063	中兴通讯	3,021,683.00	0.59
11	300498	温氏股份	3,012,244.74	0.58
12	000651	格力电器	3,004,706.00	0.58
13	002142	宁波银行	2,921,165.04	0.57
14	000725	京东方 A	2,833,852.00	0.55
15	300601	康泰生物	2,715,851.00	0.53
16	001979	招商蛇口	2,643,451.00	0.51
17	300015	爱尔眼科	2,487,737.24	0.48
18	002304	洋河股份	2,437,298.90	0.47
19	300059	东方财富	2,090,163.00	0.41
20	000568	泸州老窖	1,975,524.18	0.38

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	230,947,236.17
卖出股票收入（成交）总额	246,690,785.88

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）	69,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,000.00	0.02

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	128112	歌尔转 2	502	50,200.00	0.01
2	128114	正邦转债	188	18,800.00	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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
IC2009	IC2009	1	1,132,880.00	69,280.00	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，降低现金拖累，减少交易成本，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

IF2009	IF2009	4	4,881,120.00	236,325.00	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，降低现金拖累，减少交易成本，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）					305,605.00
股指期货投资本期收益（元）					-515,690.44
股指期货投资本期公允价值变动（元）					234,985.00

7.10.2 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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的如下违法违规行为作出责令改正、并处罚款 40 万元的行政处罚决定：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。

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招商银行股份有限公司信用卡中心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行为，对招商银行股份有限公司处以责令改正，并处罚款 20 万元。

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。除兴业银行、招商银行外，本基金投资的其他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。

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	857,265.48
2	应收证券清算款	14,436,876.27
3	应收股利	-
4	应收利息	1,419.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,295,561.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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	
		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

4,674	70,944.01	140,538,840 .00	42.38%	191,053,47 6.00	57.62%	64,759,260. 00	19.53%
-------	-----------	--------------------	--------	--------------------	--------	-------------------	--------

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。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	友邦保险有限公司江苏分公司—传统—普通保险产品	15,671,100.00	4.73%
2	陈建敏	12,000,000.00	3.62%
3	竞技世界（北京）网络技术有限公司	10,634,900.00	3.21%
4	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	3.02%
5	友邦保险有限公司上海分公司—传统—普通保险产品	7,957,800.00	2.40%
6	交银康联人寿保险有限公司—传统 2	6,600,000.00	1.99%
7	杨镇泉	6,109,900.00	1.84%
8	华泰证券股份有限公司	5,973,425.00	1.80%
9	罗雄强	4,310,000.00	1.30%
10	张长义	4,076,400.00	1.23%
11	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	64,759,260.00	19.53%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 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	445,592,316.00
本报告期基金总申购份额	340,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	454,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	331,592,316.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 6 月 22 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起聘任张坤先生、陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金财富	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	53,105,141.20	11.38%	42,484.06	16.16%	-
中信建投	2	248,130.06	0.05%	231.09	0.09%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	35,343,294.61	7.58%	17,672.71	6.72%	-
国信证券	1	41,944,672.45	8.99%	33,555.93	12.77%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

高华证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	3,087,857.38	0.66%	2,470.26	0.94%	-
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	-	-	-	-	-
华菁证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	332,799,909.42	71.34%	166,427.43	63.32%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司各一个交易单元，新增国盛证券有限责任公司一个交易单元。

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。基金交易单元的选择标准如下：

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	177,270.80	32.71%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	364,703.36	67.29%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中金公司为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-01-13
2	易方达基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式相关业务规则并修订部分基金基金合同的公告	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	2020-01-18
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2020-01-18
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 1 月 31 日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告	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	2020-01-30
5	易方达基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	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	2020-02-04
6	易方达基金管理有限公司关于部分沪市上市基金增加扩位证券简称的公告	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	2020-03-13
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证券报	2020-03-31
8	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	2020-04-10
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加浙商证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-04-15
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2020-04-21
11	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经理变更公告	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	2020-04-23
12	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加湘财证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-04-28
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中信证券华南为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-04-28
14	易方达基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	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	2020-05-20

15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东吴证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-06-01
16	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2020-06-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国银行股份有限公司—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	2020 年 01 月 01 日~2020 年 02 月 19 日,2020 年 02 月 21 日~2020 年 06 月 29 日	106,919,260.00	3,570,000.00	45,730,000.00	64,759,260.00	19.53%
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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达 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。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日