

# 易方达中证浙江新动能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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 4 月 27 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	7
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	41
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	50
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	56
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
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金融衍生品投资明细	57
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	57

7.11	投资组合报告附注 .....	57
8	基金份额持有人信息 .....	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	58
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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 .....	59
9	开放式基金份额变动 .....	59
10	重大事件揭示 .....	60
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4	基金投资策略的改变 .....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8	其他重大事件 .....	63
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
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 .....	64
12	备查文件目录 .....	65
12.1	备查文件目录 .....	65
12.2	存放地点 .....	65
12.3	查阅方式 .....	65

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证浙江新动能 ETF (QDII)
场内简称	浙江 ETF
基金主代码	159803
交易代码	159803
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	25,851,158.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 26 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	<p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含美国存托凭证等）组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>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（含美国存托凭证等）时，基金管理人可采取包括成份股（含美国存托凭证等）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。</p> <p>为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股（含美国存托凭证等）等相关的衍生工具。</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。此外，本基金可根据届时有有效的法律法规和监管机构的有关规定开展融券业务。本基金力争将年化跟踪误差控制在 3% 以内。</p>
业绩比较基准	中证浙江新动能指数收益率
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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798
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55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	无	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		无	香港皇后大道中一号
办公地址		无	香港九龙深旺道1号汇丰中心1座6楼
邮政编码		无	无

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>

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

## 2.6 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 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,956,421.66
本期利润	6,028,014.01
加权平均基金份额本期利润	0.0414
本期加权平均净值利润率	4.12%
本期基金份额净值增长率	8.42%
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	1,687,356.26
期末可供分配基金份额利润	0.0653
期末基金资产净值	28,029,082.05
期末基金份额净值	1.0842
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	8.42%

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 2020 年 4 月 27 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

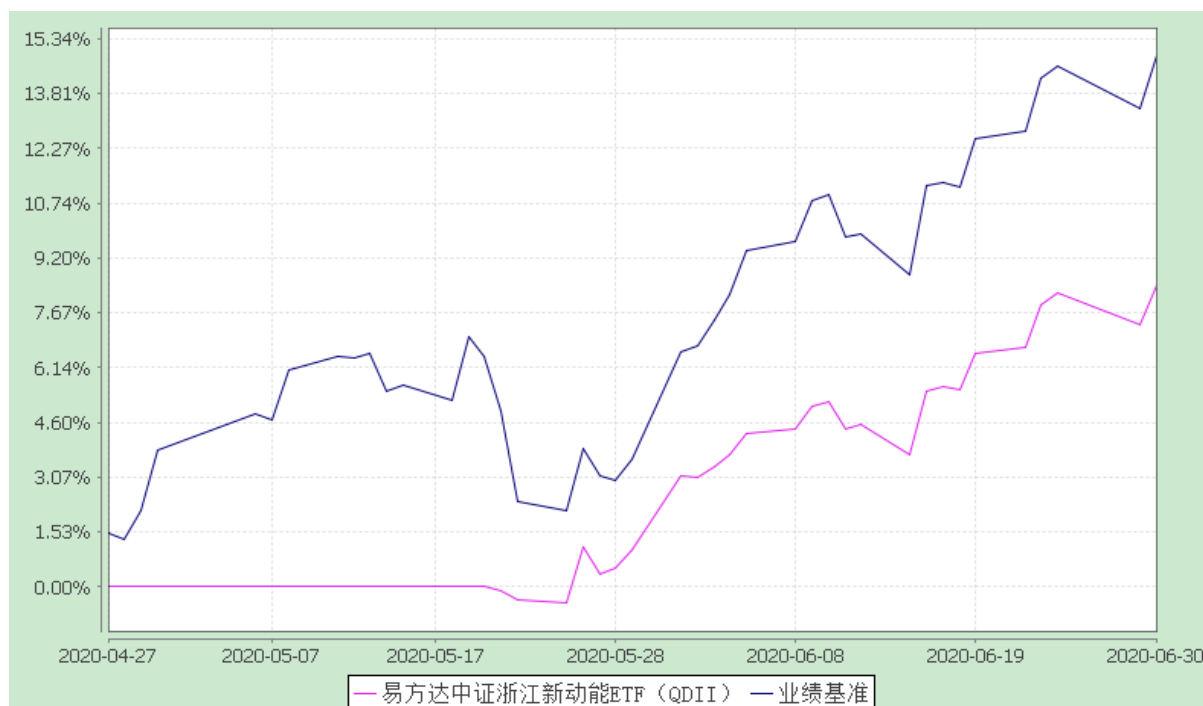
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	7.30%	0.75%	10.90%	1.02%	-3.60%	-0.27%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.42%	0.61%	14.88%	1.05%	-6.46%	-0.44%

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

易方达中证浙江新动能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  
 (2020年4月27日至2020年6月30日)



注：1.本基金合同于2020年4月27日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(第十四部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为8.42%,同期业绩比较基准收益率为14.88%。



## 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		
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2017 年 06 月 23 日至 2020 年 03 月 17 日）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2017 年 06 月 23 日至 2020 年 03 月 17 日）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理（自 2017 年 06 月 23 日至 2020 年 03 月 17 日）、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理（自 2017 年 06 月 23 日至 2020 年 03 月 17 日）、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理（自 2019 年 03 月 20 日至 2020 年 03 月 25 日）、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国企一带一路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、易方达中证浙江新动能交易型开放	2020-04-27	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理、解决方案部总经理助理。

	式指数证券投资基金联接基金的基金经理、指数增强投资部总经理助理				
刘树荣	<p>本基金的基金经理、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、易方达并购重组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、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数证券投资基金 (LOF) 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、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日)、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日)、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF) 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 (自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日)、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 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、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基</p>	2020-04-29	-	13 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、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>

	金的基金经理、易方达中证国企一带一路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、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

##### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 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中证浙江新动能指数。中证浙江新动能指数选取全球主要交易所上市的浙江省企业作为样本股，采用自由流通市值加权，以全面反映浙江省上市企业的表现。目前，浙江新动能指数成份股上市地集中在沪深交易所、香港及美国交易所。报告期内，本基金主要采用组合复制策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2020 年上半年，受新冠疫情的影响，全球股票市场大幅波动，尤其是 3 月份新冠疫情在海外蔓延后，美国标普 500 指数多次触发熔断，上证指数一度跌至 2647 点。二季度，随着各国陆续出台经济刺激政策对冲疫情的影响，投资者的恐慌情绪得到缓解，全球证券市场开始低位大幅反弹，纳斯达克指数更是突破了疫情前的高点创出新高。国内市场上，随着新冠疫情得到有效的控制和缓解，各行业陆续复工、复产，国内经济在系列政策的刺激和支持下逐步走向复苏，A 股市场开始大幅上扬。行业上，医药、TMT、消费等行业表现较好，大幅战胜市场；而金融、采掘等周期行业仍然受疫情影响较大，涨幅靠后。港股市场二季度也跟随全球市场反弹。今年以来南下资金持续流入港股市场，总额合计约 2700 亿人民币，反映出市场对港股的认可。上半年，以阿里巴巴为代表的浙江省企业二级市场表现较好，中证浙江新动能指数上涨 7.2%（人民币计价），沪深 300 指数上涨 1.7%，浙江新动能指数走势优于沪深 300 指数。

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、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，本基金仍处于建仓期，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标仍在调整之中。

### 4.5.2 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 1.0842 元，本报告期份额净值增长率为 8.42%，同期业绩比较基准收益率为 14.88%，受建仓期影响，基金年化跟踪误差为 11.00%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，稳增长、保就业仍是国内各项政策的出发点，宽财政、松货币等经济刺激政策有望延续。随着生产生活逐步恢复正常，前期政策逐步落地将支持下半年经济逐渐修复，预计下半年 GDP 增速将回归正常区间。

下半年证券市场走势可能难以延续 7 月初的快速上涨行情，波动难免。一方面，国内各种经济刺激政策短时间内退出的概率较低，经济持续修复的大背景下有利于股市向好；另一方面，全球疫

情依然严重，疫情爆发以来中美之间的冲突加剧，外部不确定性对证券市场走势仍是一大影响。浙江新动能指数成份股上市地横跨陆、港、美，外部不确定性影响更大。作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

#### 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，本基金托管人在对易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证浙江新动能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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	5,492,868.71
结算备付金		1,855,001.50
存出保证金		69,999.18
交易性金融资产	6.4.7.2	24,040,462.16
其中：股票投资		24,040,462.16
基金投资		-
债券投资		-
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		7,909.47
应收利息	6.4.7.5	1,146.40

应收股利		71,019.96
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>31,538,407.38</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>
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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		15,041.78
应付托管费		4,512.55
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	185,013.16
应交税费		0.20
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	3,304,757.64
负债合计		3,509,325.33
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	25,851,158.00
未分配利润	6.4.7.10	2,177,924.05
所有者权益合计		28,029,082.05
负债和所有者权益总计		31,538,407.38

注：1.本基金合同生效日为2020年4月27日，2020年半年度实际报告期间为2020年4月27日至2020年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日2020年6月30日，基金份额净值1.0842元，基金份额总额25,851,158.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2020 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>6,775,962.31</b>
1.利息收入		220,736.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	67,734.49
债券利息收入		3.63
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		152,998.32
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,685,983.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,204,906.83
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	6,422.15
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	474,654.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,071,592.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-343,664.34
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,141,314.26
<b>减：二、费用</b>		<b>747,948.30</b>
1. 管理人报酬		126,998.64
2. 托管费		38,099.58
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	499,237.90
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.02
7. 其他费用	6.4.7.20	83,612.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>6,028,014.01</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>6,028,014.01</b>

注：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 27 日，2020 年半年度实际报告期间为 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金



本报告期：2020 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 27 日（基金合同生效日）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）	266,851,158.00	-	266,851,158.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,028,014.01	6,028,014.01
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）	-241,000,000.00	-3,850,089.96	-244,850,089.96
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-241,000,000.00	-3,850,089.96	-244,850,089.96
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）	25,851,158.00	2,177,924.05	28,029,082.05

注：本基金合同生效日为 2020 年 4 月 27 日，2020 年半年度实际报告期间为 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

易方达中证浙江新动能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[2019]1358 号《关于准予易方达中证浙江新动能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《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 266,851,158.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,658.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金

管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2020 年 1 月 22 日至 2020 年 4 月 21 日，募集金额总额为人民币 266,851,158.00 元，其中：有效净认购金额为人民币 266,842,500.00 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 8,658.00 元，经安永华明(2020)验字第 60468000\_G16 号验资报告予以审验。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 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。

##### 6.4.4.1 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，惟本会计年度期间为 2020 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

##### (1)金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的基金投资、股票投资、债券投资和衍生工具等于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

#### (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 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。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确

认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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)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收益分配另有规定的,从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,对上述原则进行修改或调整,而无需召开基金份额持有人大会审议。

#### **6.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **6.4.4.13 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 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。

#### **6.4.5.2 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。

#### **6.4.5.3 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[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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	5,492,868.71
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	5,492,868.71

##### 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	21,968,869.81	24,040,462.16	2,071,592.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	21,968,869.81	24,040,462.16	2,071,592.35

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债



本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 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	366.00
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	752.05
应收债券利息	-
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	-
其他	28.35
合计	1,146.40

#### 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	185,013.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	185,013.16

#### 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	-
预提费用	45,590.66

应付替代款	3,223,452.69
其他应付款	35,714.29
合计	3,304,757.64

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	266,851,158.00	266,851,158.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-241,000,000.00	-241,000,000.00
本期末	25,851,158.00	25,851,158.00

注：本基金合同于2020年4月27日生效，基金合同生效日的基金份额总额为266,851,158.00份基金份额，其中认购资金利息折合8,658.00份基金份额。

## 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,956,421.66	2,071,592.35	6,028,014.01
本期基金份额交易产生的变动数	-2,269,065.40	-1,581,024.56	-3,850,089.96
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,269,065.40	-1,581,024.56	-3,850,089.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,687,356.26	490,567.79	2,177,924.05

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	63,949.75
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	3,696.54
其他	88.20
合计	67,734.49

## 6.4.7.12 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 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	232,640,383.38
减：卖出股票成本总额	229,435,476.55
买卖股票差价收入	3,204,906.83

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 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4月27日（基金合同生效日）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	26,426.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,999.82
减：应收利息总额	4.03
买卖债券差价收入	6,422.15

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	474,654.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	474,654.62

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	2,071,592.35
——股票投资	2,071,592.35
——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	-
——权证投资	-
——期货投资	-

——期权投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	2,071,592.35

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月27日（基金合同生效日）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	1,140,421.74
其他	892.52
合计	1,141,314.26

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。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	499,237.90
银行间市场交易费用	-
其他	-
合计	499,237.90

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	15,662.40
信息披露费	-
银行汇划费	17.00
指数使用费	35,714.29
其他	32,218.47
合计	83,612.16

## 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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司(以下简称“汇丰银行”)	境外资产托管人
易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金	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4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	126,998.64
其中：支付销售机构的客户维护费	290.09

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	38,099.58

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金	5,649,497.00	21.8539%

注：本基金合同生效日为 2020 年 04 月 27 日。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。

#### 6.4.10.5 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 2020年4月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	4,491,545.60	63,939.25
汇丰银行-活期存款	1,001,323.11	10.50

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（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 CH	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 CH	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	601	6,016.01	6,016.01	-
300845 CH	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	235	4,143.05	4,143.05	-
30084	首都	2020-0	2020-0	新股	3.37	3.37	1,131	3,811.	3,811.	-

6 CH	在线	6-22	7-01	流通受限				47	47	
------	----	------	------	------	--	--	--	----	----	--

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。

#### 6.4.13 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、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。

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 0.00%。



## 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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**

本基金投资于国内及海外市场，面临国内及海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因

素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。此外，基金投资的海外证券市场可能对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此对于无涨跌幅上下限的规定证券市场的证券，每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

#### 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	5,492,868.71	-	-	-	5,492,868.71
结算备付金	1,855,001.50	-	-	-	1,855,001.50
存出保证金	69,999.18	-	-	-	69,999.18
交易性金融资产	-	-	-	24,040,462.16	24,040,462.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,909.47	7,909.47
应收利息	-	-	-	1,146.40	1,146.40
应收股利	-	-	-	71,019.96	71,019.96
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,417,869.39	-	-	24,120,537.99	31,538,407.38
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	15,041.78	15,041.78
应付托管费	-	-	-	4,512.55	4,512.55

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	185,013.16	185,013.16
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,304,757.64	3,304,757.64
负债总计	-	-	-	3,509,325.33	3,509,325.33
利率敏感度缺口	7,417,869.39	-	-	20,611,212.66	28,029,082.05

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

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>				
银行存款	876,066.89	125,274.89	-	1,001,341.78
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	2,310,088.99	2,881,665.71	-	5,191,754.70
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	71,019.96	-	71,019.96

应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>3,186,155.88</b>	<b>3,077,960.56</b>	-	<b>6,264,116.44</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	-	-	-	-
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>3,186,155.88</b>	<b>3,077,960.56</b>	-	<b>6,264,116.44</b>

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-313,205.82
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	313,205.82

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,040,462.16	85.77
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	24,040,462.16	85.77

#### 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
	1.业绩比较基准上升 5%	1,202,023.10
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,202,023.10

#### 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 24,019,452.73 元，属于第二层次的余额为 21,009.43 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。

(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	24,040,462.16	76.23
	其中：普通股	21,730,373.17	68.90
	存托凭证	2,310,088.99	7.32
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,347,870.21	23.30
8	其他各项资产	150,075.01	0.48

9	合计	31,538,407.38	100.00
---	----	---------------	--------

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 和 7.3 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国	18,848,707.46	67.25
中国香港	2,881,665.71	10.28
美国	2,310,088.99	8.24
合计	24,040,462.16	85.77

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	6,637.68	0.02
材料	2,846,523.95	10.16
工业	2,188,364.50	7.81
非必需消费品	5,714,518.83	20.39
必需消费品	280,302.00	1.00
保健	3,533,700.70	12.61
金融	2,024,895.00	7.22
信息技术	5,369,782.47	19.16
电信服务	1,536,653.00	5.48
公用事业	161,811.00	0.58
房地产	337,736.00	1.20
其他-GICS 未分类	39,537.03	0.14
合计	24,040,462.16	85.77

注：1.以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2.本基金本报告期末持有的部分股票尚无 GICS 行业分类，因此将其归入“其他-GICS 未分类”。



## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴 集团控股 有限公司	BABA US	纽约证 券交易 所	美国	1,460	2,229,490.30	7.95
2	Hangzhou Hikvision Digital Technolog y Co Ltd	海康威视	002415 CH	深圳证 券交易 所	中国	42,300	1,283,805.00	4.58
3	Hundsun Technolog ies Inc	恒生电子	600570 CH	上海证 券交易 所	中国	9,466	1,019,488.20	3.64
4	Sunny Optical Technolog y (Group) Company Limited	舜宇光学 科技(集团) 有限公司	2382 HK	香港证 券交易 所	中国香港	8,700	985,419.07	3.52
5	Bank of Ningbo Co Ltd	宁波银行	002142 CH	深圳证 券交易 所	中国	34,000	893,180.00	3.19
6	Shenzhou Internatio nal Group Holdings Ltd.	申洲国际 集团控股 有限公司	2313 HK	香港证 券交易 所	中国香港	10,200	870,216.02	3.10
7	Geely Automobi le Holdings Limited	吉利汽车 控股有限 公司	175 HK	香港证 券交易 所	中国香港	66,000	735,501.89	2.62
8	Wingtech Technolog y Co Ltd	闻泰科技	600745 CH	上海证 券交易 所	中国	5,200	654,940.00	2.34
9	Hangzhou Tigermed Consultin g Co Ltd	泰格医药	300347 CH	深圳证 券交易 所	中国	6,000	611,280.00	2.18

10	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	三花智控	002050 CH	深圳证券交易所	中国	20,340	445,446.00	1.59
11	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	世纪华通	002602 CH	深圳证券交易所	中国	28,300	433,273.00	1.55
12	Zhejiang NHU Co Ltd	新和成	002001 CH	深圳证券交易所	中国	14,700	427,770.00	1.53
13	Perfect World Co Ltd/China	完美世界	002624 CH	深圳证券交易所	中国	7,400	426,536.00	1.52
14	Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	大华股份	002236 CH	深圳证券交易所	中国	20,400	391,884.00	1.40
15	Topchoice Medical Corp	通策医疗	600763 CH	上海证券交易所	中国	2,300	383,571.00	1.37
16	Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	浙江龙盛	600352 CH	上海证券交易所	中国	29,500	377,305.00	1.35
17	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	同花顺	300033 CH	深圳证券交易所	中国	2,500	332,700.00	1.19
18	Yunda Holding Co Ltd	韵达股份	002120 CH	深圳证券交易所	中国	13,290	324,940.50	1.16
19	Betta Pharmaceuticals Co Ltd	贝达药业	300558 CH	深圳证券交易所	中国	2,300	321,954.00	1.15
20	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	正泰电器	601877 CH	上海证券交易所	中国	12,200	321,470.00	1.15

21	Songcheng Performance Development Co Ltd	宋城演艺	300144 CH	深圳证券交易所	中国	17,760	307,248.00	1.10
22	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	华友钴业	603799 CH	上海证券交易所	中国	7,800	303,108.00	1.08
23	Leo Group Co Ltd	利欧股份	002131 CH	深圳证券交易所	中国	76,400	294,904.00	1.05
24	Caitong Securities Co Ltd	财通证券	601108 CH	上海证券交易所	中国	28,500	292,125.00	1.04
25	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd	华海药业	600521 CH	上海证券交易所	中国	8,320	282,297.60	1.01
26	Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	荣盛石化	002493 CH	深圳证券交易所	中国	21,400	263,220.00	0.94
27	Huadong Medicine Co Ltd	华东医药	000963 CH	深圳证券交易所	中国	10,000	253,000.00	0.90
28	Bank of Hangzhou Co Ltd	杭州银行	600926 CH	上海证券交易所	中国	26,900	239,948.00	0.86
29	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd	水晶光电	002273 CH	深圳证券交易所	中国	13,800	236,532.00	0.84
30	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	我武生物	300357 CH	深圳证券交易所	中国	3,700	230,325.00	0.82
31	China Jushi Co Ltd	中国巨石	600176 CH	上海证券交易所	中国	23,900	218,685.00	0.78
32	Ningbo	均胜电子	600699 CH	上海证券交易所	中国	8,500	202,385.00	0.72

	Joyson Electronic Corp			券交易所				
33	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	亿帆医药	002019 CH	深圳证券交易所	中国	8,500	195,245.00	0.70
34	Hengyi Petrochemical Co Ltd	恒逸石化	000703 CH	深圳证券交易所	中国	20,880	190,634.40	0.68
35	Youngor Group Co Ltd	雅戈尔	600177 CH	上海证券交易所	中国	31,500	187,740.00	0.67
36	Lianhe Chemical Technology Co Ltd	联化科技	002250 CH	深圳证券交易所	中国	8,500	185,300.00	0.66
37	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	晶盛机电	300316 CH	深圳证券交易所	中国	7,300	180,602.00	0.64
38	Dian Diagnostics Group Co Ltd	迪安诊断	300244 CH	深圳证券交易所	中国	5,008	176,782.40	0.63
39	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	老板电器	002508 CH	深圳证券交易所	中国	5,500	171,105.00	0.61
40	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	浙江鼎力	603338 CH	上海证券交易所	中国	2,220	168,209.40	0.60
41	B-Soft Co Ltd	创业慧康	300451 CH	深圳证券交易所	中国	8,800	162,712.00	0.58
42	Zhejiang Zheneng Electric Power Co Ltd	浙能电力	600023 CH	上海证券交易所	中国	46,100	161,811.00	0.58
43	Minth	敏实集团	425 HK	香港证	中国香港	8,000	161,130.82	0.57

	Group Limited	有限公司		券交易所				
44	Tongkun Group Co Ltd	桐昆股份	601233 CH	上海证券交易所	中国	12,600	160,776.00	0.57
45	Hangzhou Iron & Steel Co	杭钢股份	600126 CH	上海证券交易所	中国	15,400	160,160.00	0.57
46	Ningbo Zhoushan Port Co Ltd	宁波港	601018 CH	上海证券交易所	中国	44,700	159,579.00	0.57
47	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd	普洛药业	000739 CH	深圳证券交易所	中国	6,700	156,043.00	0.56
48	Ningbo Shanshan Co Ltd	杉杉股份	600884 CH	上海证券交易所	中国	12,985	153,093.15	0.55
49	Zheshang Securities Co Ltd	浙商证券	601878 CH	上海证券交易所	中国	15,200	150,632.00	0.54
50	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd	小商品城	600415 CH	上海证券交易所	中国	30,800	149,996.00	0.54
51	Zhejiang Medicine Co Ltd	浙江医药	600216 CH	上海证券交易所	中国	7,700	148,302.00	0.53
52	Proya Cosmetics Co Ltd	珀莱雅	603605 CH	上海证券交易所	中国	800	144,016.00	0.51
53	Zhejiang Supor Co Ltd	苏泊尔	002032 CH	深圳证券交易所	中国	2,000	142,000.00	0.51
54	Ningbo Tuopu Group Co Ltd	拓普集团	601689 CH	上海证券交易所	中国	4,800	133,920.00	0.48
55	Hangzhou Silan Microelectronics Co	士兰微	600460 CH	上海证券交易所	中国	8,900	130,652.00	0.47

	Ltd							
56	Haitian International Holdings Limited	海天国际控股有限公司	1882 HK	香港证券交易所	中国香港	9,000	129,397.91	0.46
57	Hangzhou First Applied Material Co Ltd	福斯特	603806 CH	上海证券交易所	中国	2,520	125,773.20	0.45
58	Hangzhou Shunwang Technology Co Ltd	顺网科技	300113 CH	深圳证券交易所	中国	4,800	121,920.00	0.43
59	Wuchan Zhongda Group Co Ltd	物产中大	600704 CH	上海证券交易所	中国	28,600	120,406.00	0.43
60	Tech-Bank Food Co Ltd	天邦股份	002124 CH	深圳证券交易所	中国	9,200	118,220.00	0.42
61	Zhejiang Conba Pharmaceutical Co Ltd	康恩贝	600572 CH	上海证券交易所	中国	21,200	116,600.00	0.42
62	STO Express Co Ltd	申通快递	002468 CH	深圳证券交易所	中国	7,000	114,870.00	0.41
63	Gansu Shangfeng Cement Co Ltd	上峰水泥	000672 CH	深圳证券交易所	中国	4,700	110,967.00	0.40
64	Zhejiang Merit Interactive Network Technology Co	每日互动	300766 CH	深圳证券交易所	中国	2,800	106,568.00	0.38
65	Zhejiang Weiming Environment Protection	伟明环保	603568 CH	上海证券交易所	中国	4,580	106,256.00	0.38

	Co Ltd							
66	Zhejiang Juhua Co Ltd	巨化股份	600160 CH	上海证券交易所	中国	15,400	106,106.00	0.38
67	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	横店东磁	002056 CH	深圳证券交易所	中国	9,400	105,750.00	0.38
68	Hangzhou Onechance Tech Corp	壹网壹创	300792 CH	深圳证券交易所	中国	600	104,496.00	0.37
69	Zhejiang Huace Film & TV Co Ltd	华策影视	300133 CH	深圳证券交易所	中国	14,000	101,500.00	0.36
70	Wolong Electric Group Co Ltd	卧龙电驱	600580 CH	上海证券交易所	中国	8,900	100,036.00	0.36
71	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd	嘉化能源	600273 CH	上海证券交易所	中国	11,400	99,636.00	0.36
72	Zhejiang Satellite Petrochemical Co Ltd	卫星石化	002648 CH	深圳证券交易所	中国	6,100	99,247.00	0.35
73	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd	顾家家居	603816 CH	上海证券交易所	中国	2,200	99,022.00	0.35
74	Zhejiang Hailiang Co Ltd	海亮股份	002203 CH	深圳证券交易所	中国	11,100	97,125.00	0.35
75	China Zheshang Bank Co Ltd	浙商银行	601916 CH	上海证券交易所	中国	24,600	96,924.00	0.35
76	Zhejiang	万丰奥威	002085 CH	深圳证	中国	14,900	96,552.00	0.34

	Wanfeng Auto Wheel Co Ltd			券交易所				
77	Inforenment Technology Group Co Ltd	盈峰环境	000967 CH	深圳证券交易所	中国	10,900	89,925.00	0.32
78	Zhejiang Orient Financial Holdings Group Co Ltd	浙江东方	600120 CH	上海证券交易所	中国	12,740	87,523.80	0.31
79	Zhejiang Daily Digital Culture Group Co Ltd	浙数文化	600633 CH	上海证券交易所	中国	8,900	87,042.00	0.31
80	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	伟星新材	002372 CH	深圳证券交易所	中国	7,200	83,736.00	0.30
81	Eastern Communications Co Ltd	东方通信	600776 CH	上海证券交易所	中国	5,500	82,995.00	0.30
82	BEST Inc	-	BEST US	纽约证券交易所	美国	2,660	80,598.69	0.29
83	Transfar Zhilian Co Ltd	传化智联	002010 CH	深圳证券交易所	中国	14,800	80,512.00	0.29
84	Zhejiang Huafeng Spandex Co Ltd	华峰氨纶	002064 CH	深圳证券交易所	中国	15,800	80,106.00	0.29
85	Wanxiang Qianchao Co Ltd	万向钱潮	000559 CH	深圳证券交易所	中国	15,600	75,504.00	0.27



86	Zhejiang Runtu Co Ltd	闰土股份	002440 CH	深圳证券交易所	中国	7,900	72,206.00	0.26
87	Wasu Media Holding Co Ltd	华数传媒	000156 CH	深圳证券交易所	中国	6,600	71,478.00	0.26
88	Kuang-Chi Technologies Co Ltd	光启技术	002625 CH	深圳证券交易所	中国	9,800	71,050.00	0.25
89	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	森马服饰	002563 CH	深圳证券交易所	中国	9,200	64,860.00	0.23
90	Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd	杭氧股份	002430 CH	深圳证券交易所	中国	4,500	63,900.00	0.23
91	Chimin Health Management Co Ltd	济民制药	603222 CH	上海证券交易所	中国	1,600	54,880.00	0.20
92	Hoshine Silicon Industry Co Ltd	合盛硅业	603260 CH	上海证券交易所	中国	1,700	46,478.00	0.17
93	Ningbo Xusheng Auto Technology Co Ltd	旭升股份	603305 CH	上海证券交易所	中国	1,100	42,108.00	0.15
94	Flat Glass Group Co Ltd	福莱特	601865 CH	上海证券交易所	中国	2,000	37,600.00	0.13
95	Hangzhou Dptech Technologies Co Ltd	迪普科技	300768 CH	深圳证券交易所	中国	600	27,774.00	0.10
96	Zhejiang Sanmei Chemical Industry	三美股份	603379 CH	上海证券交易所	中国	1,020	21,899.40	0.08

	Co Ltd							
97	Xinfengming Group Co Ltd	新凤鸣	603225 CH	上海证券交易所	中国	2,000	19,960.00	0.07
98	Nanhua Futures Co Ltd	南华期货	603093 CH	上海证券交易所	中国	900	19,386.00	0.07
99	Wuxi DK Electronic Materials Co Ltd	帝科股份	300842 CH	深圳证券交易所	中国	455	18,527.60	0.07
100	Xiangpiaopiao Food Co Ltd	香飘飘	603711 CH	上海证券交易所	中国	600	18,066.00	0.06
101	Gan & Lee Pharmaceuticals Co Ltd	甘李药业	603087 CH	上海证券交易所	中国	129	12,938.70	0.05
102	Qingdao Kutesmart Co Ltd	酷特智能	300840 CH	深圳证券交易所	中国	1,185	7,038.90	0.03
103	China Suntien Green Energy Corp Ltd	新天绿能	600956 CH	上海证券交易所	中国	1,317	6,637.68	0.02
104	Shenglan Technology Co Ltd	胜蓝股份	300843 CH	深圳证券交易所	中国	601	6,016.01	0.02
105	Zhengzhou J&T Hi-Tech Co Ltd	捷安高科	300845 CH	深圳证券交易所	中国	235	4,143.05	0.01
106	Capitalonline Data Service Co Ltd	首都在线	300846 CH	深圳证券交易所	中国	1,131	3,811.47	0.01

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	25,573,023.24	91.24
2	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	002415 CH	14,970,857.00	53.41
3	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	10,831,149.23	38.64
4	Bank of Ningbo Co Ltd	002142 CH	10,646,161.00	37.98
5	Hundsun Technologies Inc	600570 CH	9,369,200.22	33.43
6	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	8,831,016.43	31.51
7	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	8,784,156.35	31.34
8	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	300347 CH	5,945,072.93	21.21
9	Wingtech Technology Co Ltd	600745 CH	4,831,810.24	17.24
10	Zhejiang NHU Co Ltd	002001 CH	4,708,340.00	16.80
11	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	002602 CH	4,590,061.00	16.38
12	Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	600352 CH	4,424,594.00	15.79
13	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	002050 CH	4,275,408.00	15.25
14	Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	002236 CH	3,994,466.15	14.25
15	Songcheng Performance Development Co Ltd	300144 CH	3,800,865.00	13.56
16	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	601877 CH	3,744,900.30	13.36
17	Topchoice Medical Corp	600763 CH	3,682,896.00	13.14
18	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	300033 CH	3,356,618.00	11.98
19	Caitong Securities Co Ltd	601108 CH	3,277,025.00	11.69
20	Perfect World Co Ltd/China	002624 CH	3,193,557.00	11.39
21	Yunda Holding Co Ltd	002120 CH	3,185,066.86	11.36
22	Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	002493 CH	3,122,386.00	11.14
23	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	603799 CH	3,108,351.00	11.09
24	Bank of Hangzhou Co Ltd	600926 CH	2,940,372.00	10.49

25	Betta Pharmaceuticals Co Ltd	300558 CH	2,896,087.24	10.33
26	Huadong Medicine Co Ltd	000963 CH	2,827,514.00	10.09
27	Leo Group Co Ltd	002131 CH	2,720,714.82	9.71
28	China Jushi Co Ltd	600176 CH	2,687,486.82	9.59
29	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd	600521 CH	2,529,684.00	9.03
30	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	300357 CH	2,500,398.60	8.92
31	Youngor Group Co Ltd	600177 CH	2,487,540.60	8.87
32	Minth Group Limited	425 HK	2,356,071.30	8.41
33	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd	002273 CH	2,349,084.00	8.38
34	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	002019 CH	2,156,537.00	7.69
35	Ningbo Joyson Electronic Corp	600699 CH	2,120,403.00	7.57
36	Zhejiang Zheneng Electric Power Co Ltd	600023 CH	2,041,200.00	7.28
37	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	002508 CH	2,017,769.00	7.20
38	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	300316 CH	2,012,261.00	7.18
39	Hengyi Petrochemical Co Ltd	000703 CH	1,914,203.00	6.83
40	Ningbo Zhoushan Port Co Ltd	601018 CH	1,872,595.00	6.68
41	Tongkun Group Co Ltd	601233 CH	1,813,279.80	6.47
42	Zheshang Securities Co Ltd	601878 CH	1,773,938.00	6.33
43	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	603338 CH	1,771,971.00	6.32
44	Haitian International Holdings Limited	1882 HK	1,674,754.86	5.98
45	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	600460 CH	1,588,452.00	5.67
46	Wuchan Zhongda Group Co Ltd	600704 CH	1,585,748.00	5.66
47	Zhejiang Supor Co Ltd	002032 CH	1,535,969.00	5.48
48	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd	000739 CH	1,501,624.76	5.36
49	Zhejiang Conba Pharmaceutical Co Ltd	600572 CH	1,372,632.00	4.90
50	Proya Cosmetics Co Ltd	603605 CH	1,297,953.00	4.63

51	Ningbo Tuopu Group Co Ltd	601689 CH	1,294,802.80	4.62
52	Dian Diagnostics Group Co Ltd	300244 CH	1,292,988.92	4.61
53	Zhejiang Juhua Co Ltd	600160 CH	1,284,557.00	4.58
54	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd	600415 CH	1,283,912.00	4.58
55	Tech-Bank Food Co Ltd	002124 CH	1,248,101.00	4.45
56	Hangzhou Iron & Steel Co	600126 CH	1,231,940.00	4.40
57	Ningbo Shanshan Co Ltd	600884 CH	1,220,982.00	4.36
58	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd	600273 CH	1,188,025.90	4.24
59	BEST Inc	BEST US	1,183,395.19	4.22
60	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd	002085 CH	1,181,897.00	4.22
61	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	002056 CH	1,175,093.00	4.19
62	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	002563 CH	1,146,005.00	4.09
63	Hangzhou First Applied Material Co Ltd	603806 CH	1,133,907.80	4.05
64	Huayi Brothers Media Corp	300027 CH	1,116,462.00	3.98
65	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	002372 CH	1,115,687.00	3.98
66	Long Yuan Construction Group Co Ltd	600491 CH	1,097,525.00	3.92
67	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd	603816 CH	1,092,950.00	3.90
68	Hangzhou Shunwang Technology Co Ltd	300113 CH	1,083,552.00	3.87
69	Zhejiang Huace Film & TV Co Ltd	300133 CH	1,068,233.00	3.81
70	Eastern Communications Co Ltd	600776 CH	1,066,765.00	3.81
71	Transfar Zhilian Co Ltd	002010 CH	1,056,264.00	3.77
72	Infore Environment Technology Group Co Ltd	000967 CH	1,031,419.82	3.68
73	Zhejiang Daily Digital Culture Group Co Ltd	600633 CH	1,016,454.00	3.63
74	Aerospace CH UAV Co Ltd	002389 CH	994,550.00	3.55
75	Zhejiang Satellite Petrochemical Co Ltd	002648 CH	982,970.00	3.51
76	Zhejiang Orient Financial	600120 CH	975,730.80	3.48

	Holdings Group Co Ltd			
77	Wanxiang Qianchao Co Ltd	000559 CH	963,885.80	3.44
78	Zhejiang Narada Power Source Co Ltd	300068 CH	886,794.00	3.16
79	Zhejiang Runtu Co Ltd	002440 CH	865,215.00	3.09
80	Zhejiang Hisoar Pharmaceutical Co Ltd	002099 CH	865,041.23	3.09
81	STO Express Co Ltd	002468 CH	829,063.00	2.96
82	Zhejiang Weiming Environment Protection Co Ltd	603568 CH	821,814.00	2.93
83	Wasu Media Holding Co Ltd	000156 CH	818,679.46	2.92
84	Zhejiang Hailiang Co Ltd	002203 CH	803,306.08	2.87
85	Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd	002444 CH	726,297.00	2.59
86	Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd	002430 CH	644,276.00	2.30
87	Focused Photonics Hangzhou Inc	300203 CH	616,857.00	2.20

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	23,804,990.34	84.93
2	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	002415 CH	13,824,174.73	49.32
3	Bank of Ningbo Co Ltd	002142 CH	9,948,870.66	35.49
4	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	9,856,259.04	35.16
5	Hundsun Technologies Inc	600570 CH	8,829,378.11	31.50
6	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	8,265,112.72	29.49
7	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	7,877,437.14	28.10
8	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	300347 CH	5,582,073.08	19.92
9	Wingtech Technology Co Ltd	600745 CH	4,307,737.00	15.37
10	Zhejiang NHU Co Ltd	002001 CH	4,299,736.40	15.34
11	Zhejiang Longsheng Group Co Ltd	600352 CH	4,171,998.00	14.88
12	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	002602 CH	4,054,752.27	14.47
13	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	002050 CH	4,015,440.00	14.33
14	Songcheng Performance Development Co Ltd	300144 CH	3,663,270.05	13.07
15	Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	002236 CH	3,633,302.94	12.96

16	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	601877 CH	3,531,805.03	12.60
17	Topchoice Medical Corp	600763 CH	3,416,733.00	12.19
18	Caitong Securities Co Ltd	601108 CH	3,103,230.00	11.07
19	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	300033 CH	3,070,509.91	10.95
20	Perfect World Co Ltd/China	002624 CH	2,917,231.16	10.41
21	Yunda Holding Co Ltd	002120 CH	2,910,104.73	10.38
22	Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	002493 CH	2,860,340.66	10.20
23	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	603799 CH	2,848,818.00	10.16
24	Bank of Hangzhou Co Ltd	600926 CH	2,764,849.80	9.86
25	Betta Pharmaceuticals Co Ltd	300558 CH	2,615,074.26	9.33
26	Huadong Medicine Co Ltd	000963 CH	2,588,872.00	9.24
27	China Jushi Co Ltd	600176 CH	2,425,111.19	8.65
28	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd	002273 CH	2,424,907.57	8.65
29	Leo Group Co Ltd	002131 CH	2,402,449.00	8.57
30	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd	600521 CH	2,274,543.00	8.11
31	Youngor Group Co Ltd	600177 CH	2,264,628.00	8.08
32	Mint Group Limited	425 HK	2,261,782.44	8.07
33	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	300357 CH	2,248,023.61	8.02
34	Ningbo Joyson Electronic Corp	600699 CH	2,127,483.84	7.59
35	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	002508 CH	2,095,712.79	7.48
36	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	002019 CH	1,940,273.00	6.92
37	Zhejiang Zheneng Electric Power Co Ltd	600023 CH	1,870,916.00	6.67
38	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	300316 CH	1,803,975.00	6.44
39	Tongkun Group Co Ltd	601233 CH	1,758,179.62	6.27
40	Ningbo Zhoushan Port Co Ltd	601018 CH	1,734,543.00	6.19
41	Hengyi Petrochemical Co Ltd	000703 CH	1,722,299.70	6.14
42	Zheshang Securities Co Ltd	601878 CH	1,672,012.00	5.97
43	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	603338 CH	1,634,211.00	5.83
44	Haitian International Holdings Limited	1882 HK	1,577,704.69	5.63
45	Wuchan Zhongda Group Co Ltd	600704 CH	1,470,324.21	5.25
46	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	600460 CH	1,467,028.00	5.23
47	Zhejiang Supor Co Ltd	002032 CH	1,417,414.00	5.06
48	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd	000739 CH	1,374,121.00	4.90
49	Ningbo Tuopu Group Co Ltd	601689 CH	1,321,274.00	4.71
50	Zhejiang Conba Pharmaceutical Co Ltd	600572 CH	1,294,528.00	4.62
51	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd	600415 CH	1,252,794.00	4.47
52	Dian Diagnostics Group Co Ltd	300244 CH	1,243,730.80	4.44
53	Proya Cosmetics Co Ltd	603605 CH	1,215,798.00	4.34
54	Hangzhou Iron & Steel Co	600126 CH	1,208,864.00	4.31
55	Zhejiang Juhua Co Ltd	600160 CH	1,179,379.00	4.21
56	Ningbo Shanshan Co Ltd	600884 CH	1,149,623.00	4.10
57	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	002056 CH	1,123,317.00	4.01
58	Tech-Bank Food Co Ltd	002124 CH	1,120,000.00	4.00
59	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd	600273 CH	1,109,503.00	3.96

60	BEST Inc	BEST US	1,100,643.75	3.93
61	Long Yuan Construction Group Co Ltd	600491 CH	1,100,387.00	3.93
62	Huayi Brothers Media Corp	300027 CH	1,095,260.00	3.91
63	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd	002085 CH	1,087,686.00	3.88
64	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd	603816 CH	1,062,426.80	3.79
65	Hangzhou First Applied Material Co Ltd	603806 CH	1,060,880.71	3.78
66	Hangzhou Shunwang Technology Co Ltd	300113 CH	1,038,971.00	3.71
67	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	002372 CH	1,020,186.50	3.64
68	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	002563 CH	1,016,510.00	3.63
69	Infore Environment Technology Group Co Ltd	000967 CH	1,005,527.20	3.59
70	Aerospace CH UAV Co Ltd	002389 CH	982,925.00	3.51
71	Transfar Zhilian Co Ltd	002010 CH	960,948.00	3.43
72	Eastern Communications Co Ltd	600776 CH	958,765.73	3.42
73	Zhejiang Daily Digital Culture Group Co Ltd	600633 CH	943,697.00	3.37
74	Zhejiang Huace Film & TV Co Ltd	300133 CH	940,305.00	3.35
75	Zhejiang Satellite Petrochemical Co Ltd	002648 CH	915,702.00	3.27
76	Zhejiang Hisoar Pharmaceutical Co Ltd	002099 CH	910,509.00	3.25
77	Zhejiang Orient Financial Holdings Group Co Ltd	600120 CH	899,874.80	3.21
78	Zhejiang Narada Power Source Co Ltd	300068 CH	887,013.00	3.16
79	Wanxiang Qianchao Co Ltd	000559 CH	882,621.00	3.15
80	Zhejiang Runtu Co Ltd	002440 CH	804,569.01	2.87
81	Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd	002444 CH	782,690.00	2.79
82	Wasu Media Holding Co Ltd	000156 CH	769,502.00	2.75
83	STO Express Co Ltd	002468 CH	731,392.00	2.61
84	Zhejiang Weiming Environment Protection Co Ltd	603568 CH	713,336.46	2.54
85	Zhejiang Hailiang Co Ltd	002203 CH	672,101.00	2.40
86	Focused Photonics Hangzhou Inc	300203 CH	669,603.00	2.39
87	Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd	002430 CH	604,493.00	2.16

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	251,404,346.36
卖出收入（成交）总额	232,640,383.38

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.11 投资组合报告附注**

7.11.1 2019 年 12 月 5 日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币 40 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规。

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。除宁波银行外，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。

7.11.2 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。

**7.11.3 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	69,999.18
2	应收证券清算款	7,909.47
3	应收股利	71,019.96
4	应收利息	1,146.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	150,075.01
---	----	------------

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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		中国工商银行股份有限 公司—易方达中证浙江 新动能交易型开放式指 数证券投资基金联接基 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
845	30,593.09	6,640,455.00	25.69%	19,210,703. 00	74.31%	5,649,497.0 0	21.85%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金”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	楼振兴	1,000,019.00	3.87%

2	宋洪洲	1,000,019.00	3.87%
3	华泰证券股份有限公司	695,418.00	2.69%
4	吴胜强	500,019.00	1.93%
5	高启梅	500,019.00	1.93%
6	钟小英	430,022.00	1.66%
7	林荣雄	300,008.00	1.16%
8	代乔茂	300,005.00	1.16%
9	北京天演资本管理有限公司一天演春晓八期私募证券投资基金	295,263.00	1.14%
10	李瑞华	280,008.00	1.08%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金	5,649,497.00	21.85%

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（2020年4月27日）基金份额总额	266,851,158.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	241,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,851,158.00

注：本基金合同生效日为2020年04月27日。

## 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	

华泰证券	2	220,832,329.70	45.63%	110,422.00	50.01%	-
国信证券	1	149,181,632.23	30.82%	74,591.16	33.78%	-
Goldman Sachs	1	2,518,115.39	0.52%	2,014.29	0.91%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	111,472,024.89	23.03%	33,757.79	15.29%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，新增国信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司各一个交易单元；新增华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、国融证券股份有限公司各两个交易单元；于如下证券经营机构 Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs 各新增一个交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。
- 2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	26,420.96	100.00%	240,000.00	100.00%	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-28
2	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-29
3	易方达基金管理有限公司关于易方达中证浙江新动能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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-15
4	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-21
5	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-21
6	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券时报	2020-05-21
7	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-25
8	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
9	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
10	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
11	易方达基金管理有限公司关于易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-29
12	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金增加恒泰证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-04
13	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金增加兴业证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-04

14	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金增加东海证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-10
15	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金增加东北证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-15
16	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-22
17	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 7 月 1 日暂停申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
18	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 7 月 3 日暂停申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国工商银行股份有限公司—易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020年06月30日	-	7,649,497.00	2,000,000.00	5,649,497.00	21.85%
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中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证浙江新动能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