

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	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	6
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	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	11
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	12
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	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	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	35
7.1	期末基金资产组合情况	35
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	36
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	36
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 ..	36
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	73
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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
	75
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
	75
7.11	投资组合报告附注
	76
8	基金份额持有人信息
	77
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构
	77
8.2	期末上市基金前十名持有人
	78
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
	78
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
	78
9	开放式基金份额变动
	78
10	重大事件揭示
	79
10.1	基金份额持有人大会决议
	79
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
	79
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
	79
10.4	基金投资策略的改变
	79
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况
	79
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
	79
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况
	80
10.8	其他重大事件
	82
11	备查文件目录
	83
11.1	备查文件目录
	83
11.2	存放地点
	83
11.3	查阅方式
	83

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）
基金简称	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）
场内简称	标普 500LOF
基金主代码	161125
交易代码	161125
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	302,022,211.59 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	2016 年 12 月 14 日

注：易方达标普 500 指数（QDII-LOF）含人民币份额（份额代码：161125）及美元现汇份额（份额代码：003718），交易代码仅列示人民币份额代码。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、固定收益品种和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	标普 500 指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，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。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资美国证券市场，需承担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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
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)	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

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	State Street Bank and Trust Company
	中文	无	道富银行
注册地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
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	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

2.6 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
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

注：本基金人民币基金份额的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，美元基金份额的登记结算机构为易方达基金管理有限公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,198,300.11
本期利润	48,905,772.40
加权平均基金份额本期利润	0.1946
本期加权平均净值利润率	11.94%
本期基金份额净值增长率	12.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	67,505,810.10
期末可供分配基金份额利润	0.2235
期末基金资产净值	521,147,255.58
期末基金份额净值	1.7255
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	72.55%

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	3.48%	0.59%	3.51%	0.59%	-0.03%	0.00%

过去三个月	6.01%	0.74%	6.03%	0.75%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	12.77%	0.90%	12.61%	0.90%	0.16%	0.00%
过去一年	24.96%	0.95%	25.11%	0.95%	-0.15%	0.00%
过去三年	51.68%	1.45%	51.70%	1.41%	-0.02%	0.04%
自基金合同生效起至今	72.55%	1.24%	79.16%	1.22%	-6.61%	0.02%

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

易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)
 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
 (2016 年 12 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 72.55%，同期业绩比较基准收益率为 79.16%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、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、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
FAN BING (范冰)	本基金的基金经理、易方达恒生科技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、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 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的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2017 年 03 月 25 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2017 年 03 月 25 日至 2021 年 04 月 14 日）、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、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数投资决策委员会委员	2017-03-25	-	16 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员、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，易方达基金管理有限公司易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理。

刘树荣	<p>本基金的基金经理、易方达中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金 (LOF) 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、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 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 800 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、易方达深证 100 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的基金经理、易方达中小企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理</p>	2018-08-11	2021-04-15	14 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、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理。</p>
-----	--	------------	------------	------	--

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

2. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 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 15 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

2021 年一季度, 美国国会正式认证拜登为新一任美国总统, 美国民主党六年来首次赢得参议院控制权, 迎来“蓝色浪潮”。拜登上任后推翻了特朗普在移民等方面的一系列政策, 并公布新的经济纾困方案。美联储维持宽松货币政策不变, 并表示短期内不会收缩购债规模。全球范围内疫情新增

病例放缓, 疫苗开始广泛接种, 市场对于经济复苏和通胀上升的预期升温, 美元指数走强, 长端美债利率明显走高。

2021 年二季度, 美国总统拜登继续推进应对新冠疫情的财政救助计划, 并提出基建计划和税收改革计划。伴随新冠疫苗接种率的提高, 美国线下经济重启, 推动经济复苏, 企业盈利改善, 通胀水平升至近年来的高点。美联储 6 月 FOMC (联邦公开市场委员会) 会议整体偏鹰派, 释放了逐步退出宽松的信号, 引发市场对于流动性收紧的预期, 一度引起市场的回调。但在经济复苏预期的推动之下, 标普 500 指数走强, 继续创出历史新高。

作为追踪标普 500 指数的被动式海外指数基金, 本基金采用完全复制法, 力求追踪误差最小化。

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 1.7255 元, 本报告期份额净值增长率为 12.77%, 同期业绩比较基准收益率为 12.61%, 年化跟踪误差 0.29%, 各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

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 2021 年下半年, 美国经济大概率延续复苏的脚步, 线下经济重启, 带动美股企业盈利走高。但是需要关注通胀继续上升的风险, 以及美联储货币政策收紧的节奏。

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直接的重大利益冲突。

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

4.8 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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:易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日:2021 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	50,118,369.80	25,835,452.46

结算备付金		1,565,182.10	899,601.01
存出保证金		1,313,209.13	378,966.19
交易性金融资产	6.4.7.2	472,552,761.50	300,760,599.43
其中：股票投资		472,552,761.50	300,760,599.43
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,935.01	1,147.72
应收股利		243,107.12	203,080.73
应收申购款		3,163,389.85	2,128,615.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		528,959,954.51	330,207,462.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	-
应付赎回款		6,751,949.05	5,004,709.86
应付管理人报酬		333,220.54	221,374.56
应付托管费		104,131.40	69,179.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		33,105.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	590,292.73	743,533.15
负债合计		7,812,698.93	6,038,797.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	302,022,211.59	211,864,079.23
未分配利润	6.4.7.10	219,125,043.99	112,304,586.29
所有者权益合计		521,147,255.58	324,168,665.52
负债和所有者权益总计		528,959,954.51	330,207,462.62

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7255 元，基金份额总额 302,022,211.59 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		51,377,515.81	-20,643,823.09
1.利息收入		44,085.54	88,664.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,085.54	88,664.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,919,345.09	-9,102,372.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,011,721.90	-3,612,970.16
基金投资收益	6.4.7.13	-	-1,186,354.67
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
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	1,462,969.76	-7,592,183.29
股利收益	6.4.7.16	2,444,653.43	3,289,136.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	46,707,472.29	-12,266,699.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-442,890.04	148,086.24
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	149,502.93	488,498.60
减：二、费用		2,471,743.41	2,399,972.82
1. 管理人报酬		1,619,025.50	1,539,412.36
2. 托管费		505,945.46	481,066.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	13,655.41	57,611.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		5,105.10	543.25
7. 其他费用	6.4.7.20	328,011.94	321,338.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,905,772.40	-23,043,795.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,905,772.40	-23,043,795.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	211,864,079.23	112,304,586.29	324,168,665.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,905,772.40	48,905,772.40
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）	90,158,132.36	57,914,685.30	148,072,817.66
其中：1.基金申购款	168,200,829.04	105,225,036.17	273,425,865.21
2.基金赎回款	-78,042,696.68	-47,310,350.87	-125,353,047.55
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）	302,022,211.59	219,125,043.99	521,147,255.58
项目	上年度可比期间 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）	161,736,153.89	69,461,506.01	231,197,659.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-23,043,795.91	-23,043,795.91
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）	119,900,344.04	60,818,384.16	180,718,728.20
其中：1.基金申购款	411,199,793.80	138,715,795.58	549,915,589.38
2.基金赎回款	-291,299,449.76	-77,897,411.42	-369,196,861.18
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）	281,636,497.93	107,236,094.26	388,872,592.19

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

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)(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[2016]2193 号《关于准予易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，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《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 693,199,312.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,037.35 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金，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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。

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》、《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和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[2014]81 号《财政部国家税务总局证

监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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) 目前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，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款	50,118,369.80
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	50,118,369.80	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	379,504,614.49	472,552,761.50	93,048,147.01
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	379,504,614.49	472,552,761.50	93,048,147.01

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	19,002,651.29	-	-	-
ESU1	19,002,651.29	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,002,651.29	-	-	-

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 2021 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)
ESU1	S&P500 EMINI FUT Sep21	14	19,393,349.40	390,698.11
总额合计				390,698.11
减:可抵销期货暂收款				390,698.11
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 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,935.01
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	-
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	-
合计	3,935.01

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,782.29
预提费用	364,964.21
其他应付款	202,546.23
合计	590,292.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	211,864,079.23	211,864,079.23
本期申购	168,200,829.04	168,200,829.04
本期赎回 (以“-”号填列)	-78,042,696.68	-78,042,696.68
本期末	302,022,211.59	302,022,211.59

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	45,339,372.37	66,965,213.92	112,304,586.29
本期利润	2,198,300.11	46,707,472.29	48,905,772.40
本期基金份额交易产生的变动数	19,968,137.62	37,946,547.68	57,914,685.30
其中：基金申购款	37,064,230.16	68,160,806.01	105,225,036.17
基金赎回款	-17,096,092.54	-30,214,258.33	-47,310,350.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,505,810.10	151,619,233.89	219,125,043.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,721.22
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	-
其他	2,364.32
合计	44,085.54

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	7,708,267.41
减：卖出股票成本总额	6,696,545.51
买卖股票差价收入	1,011,721.90

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
期货投资收益	1,462,969.76
合计	1,462,969.76

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,444,653.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,444,653.43

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	46,438,744.60
——股票投资	46,438,744.60
——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	268,727.69
——权证投资	-
——期货投资	268,727.69
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	46,707,472.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	149,502.93
合计	149,502.93

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	13,655.41
银行间市场交易费用	-
其他	-
合计	13,655.41

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
银行汇划费	501.50
上市费	29,752.78
指数使用费	137,833.30
指数数据费	64,712.93
合计	328,011.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
道富银行	境外资产托管人

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,619,025.50	1,539,412.36
其中：支付销售机构的客户维护费	367,262.05	358,850.25

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	505,945.46	481,066.40

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 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固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

无。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国建设银行-活期存款	49,536,769.06	41,721.22	18,340,725.96	84,233.58
道富银行-活期存款	581,600.74	-	7,470,312.26	1,537.67

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司和道富银行保管，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。

6.4.10.7 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

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，在报告期内投资于托管行道富银行发行的股票 STT US。于 2021 年 6 月 30 日，本

基金持有道富银行的股票 STT US 的估值总额为人民币 372,075.92 元(2020 年 12 月 31 日:246,463.87 元)。

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 (2021 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2021 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 2021 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、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控, 并根据其不同权限实施风险控制; 从岗位职能的分工上看, 基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、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。

本基金属股票指数基金, 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。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪, 具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场, 需承担汇率风险以及境外市场的风险。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险, 本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的

平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指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。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 2021 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%(2020 年 12 月 31 日：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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021 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

本基金投资于海外市场,面临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。

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 2021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	50,118,369.80	-	-	-	50,118,369.80
结算备付金	1,565,182.10	-	-	-	1,565,182.10
存出保证金	1,313,209.13	-	-	-	1,313,209.13
交易性金融资产	-	-	-	472,552,761.50	472,552,761.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,935.01	3,935.01
应收股利	-	-	-	243,107.12	243,107.12
应收申购款	238,267.18	-	-	2,925,122.67	3,163,389.85
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	53,235,028.21	-	-	475,724,926.30	528,959,954.51

					1
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	-	-	-	6,751,949.05	6,751,949.05
应付管理人报酬	-	-	-	333,220.54	333,220.54
应付托管费	-	-	-	104,131.40	104,131.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	33,105.21	33,105.21
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	590,292.73	590,292.73
负债总计	-	-	-	7,812,698.93	7,812,698.93
利率敏感度缺口	53,235,028.21	-	-	467,912,227.37	521,147,255.58
上年度末 2020 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	25,835,452.46	-	-	-	25,835,452.46
结算备付金	899,601.01	-	-	-	899,601.01
存出保证金	378,966.19	-	-	-	378,966.19
交易性金融资产	-	-	-	300,760,599.43	300,760,599.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,147.72	1,147.72
应收股利	-	-	-	203,080.73	203,080.73
应收申购款	161,047.35	-	-	1,967,567.73	2,128,615.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,275,067.01	-	-	302,932,395.61	330,207,462.62
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	-	-	-	5,004,709.86	5,004,709.86
应付管理人报酬	-	-	-	221,374.56	221,374.56
应付托管费	-	-	-	69,179.53	69,179.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	743,533.15	743,533.15
负债总计	-	-	-	6,038,797.10	6,038,797.10
利率敏感度缺口	27,275,067.01	-	-	296,893,598.51	324,168,665.52

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 2021年6月30日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	6,067,829.68	-	-	6,067,829.68
结算备付金	1,565,182.10	-	-	1,565,182.10
存出保证金	1,313,209.13	-	-	1,313,209.13
交易性金融资产	472,552,761.50	-	-	472,552,761.50
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	10.72	-	-	10.72
应收股利	243,107.12	-	-	243,107.12
应收申购款	1,485,330.29	-	-	1,485,330.29
其他资产	-	-	-	-
资产合计	483,227,430.54	-	-	483,227,430.54
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	957,015.24	-	-	957,015.24
其他负债	3,590.85	-	-	3,590.85
负债合计	960,606.09	-	-	960,606.09
资产负债表外汇风险敞口净额	482,266,824.45	-	-	482,266,824.45
项目	上年度末			
	2020年12月31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
以外币计价的资产				
银行存款	16,509,620.01	-	-	16,509,620.01
结算备付金	899,601.01	-	-	899,601.01
存出保证金	378,966.19	-	-	378,966.19
交易性金融资产	300,760,599.43	-	-	300,760,599.43
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	35.82	-	-	35.82
应收股利	203,080.73	-	-	203,080.73
应收申购款	1,219,542.63	-	-	1,219,542.63
其他资产	-	-	-	-
资产合计	319,971,445.82	-	-	319,971,445.82

外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	152,378.53	-	-	152,378.53
其他负债	574.32	-	-	574.32
负债合计	152,952.85	-	-	152,952.85
资产负债表外汇风险敞口净额	319,818,492.97	-	-	319,818,492.97

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-24,113,341.22	-15,990,924.65
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	24,113,341.22	15,990,924.65

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	472,552,761.5 0	90.68	300,760,599.4 3	92.78

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	472,552,761.5 0	90.68	300,760,599.4 3	92.78

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	23,627,637.42	15,038,029.56
	2.业绩比较基准下降 5%	-23,627,637.42	-15,038,029.56

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 2021 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 472,552,761.50 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 300,760,599.43 元，无属于第二层次的余额，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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，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 2021 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(2020 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	472,552,761.50	89.34
	其中：普通股	460,977,621.75	87.15
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	11,575,139.75	2.19
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	51,683,551.90	9.77
8	其他各项资产	4,723,641.11	0.89
9	合计	528,959,954.51	100.00

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（%）
美国	472,552,761.50	90.68
合计	472,552,761.50	90.68

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	13,365,480.82	2.56
材料	12,165,154.07	2.33
工业	40,090,969.62	7.69
非必需消费品	58,091,386.41	11.15
必需消费品	27,664,287.14	5.31
保健	61,288,638.71	11.76
金融	53,329,666.70	10.23
信息技术	130,185,032.72	24.98
电信服务	52,989,289.96	10.17
公用事业	11,437,760.92	2.19
房地产	11,945,094.43	2.29
合计	472,552,761.50	90.68

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达	美国	32,003	28,315,463.80	5.43

				克证券 交易所				
2	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	15,295	26,766,878.47	5.14
3	Amazon.c om Inc	-	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	868	19,290,238.97	3.70
4	Alphabet Inc	-	GOOGL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	609	9,606,492.42	1.84
			GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	584	9,455,589.45	1.81
5	Facebook Inc	-	FB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	4,878	10,957,165.41	2.10
6	Berkshire Hathaway Inc	-	BRK/B US	纽约证 券交易 所	美国	3,866	6,940,981.58	1.33
7	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,557	6,836,677.96	1.31
8	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,257	6,497,088.59	1.25
9	JPMorgan Chase & Co	-	JPM US	纽约证 券交易 所	美国	6,188	6,217,726.87	1.19
10	Johnson & Johnson	-	JNJ US	纽约证 券交易 所	美国	5,330	5,672,382.54	1.09
11	Visa Inc	-	V US	纽约证 券交易 所	美国	3,439	5,194,611.50	1.00
12	UnitedHe alth Group Inc	-	UNH US	纽约证 券交易 所	美国	1,917	4,959,053.65	0.95
13	Home Depot Inc/The	-	HD US	纽约证 券交易 所	美国	2,183	4,497,113.79	0.86
14	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,375	4,472,101.13	0.86

15	Procter & Gamble Co/The	-	PG US	纽约证券交易所	美国	4,993	4,352,204.84	0.84
16	Mastercard Inc	-	MA US	纽约证券交易所	美国	1,778	4,193,444.84	0.80
17	Walt Disney Co/The	-	DIS US	纽约证券交易所	美国	3,681	4,179,745.23	0.80
18	Bank of America Corp	-	BAC US	纽约证券交易所	美国	15,407	4,103,653.26	0.79
19	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	972	3,677,360.76	0.71
20	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	8,585	3,498,414.18	0.67
21	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	9,270	3,414,649.94	0.66
22	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	898	3,064,235.90	0.59
23	Verizon Communications Inc	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	8,392	3,037,563.31	0.58
24	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	8,239	2,988,038.25	0.57
25	salesforce.com Inc	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	1,861	2,936,674.05	0.56
26	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	8,561	2,931,160.55	0.56
27	Pfizer Inc	-	PFE US	纽约证券交易所	美国	11,311	2,861,428.68	0.55
28	Coca-Cola Co/The	-	KO US	纽约证券交易所	美国	7,865	2,749,258.03	0.53
29	Abbott	-	ABT US	纽约证	美国	3,592	2,690,118.46	0.52

	Laboratori es			券交易 所				
30	AT&T Inc	-	T US	纽约证 券交易 所	美国	14,463	2,688,985.23	0.52
31	PepsiCo Inc	-	PEP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,797	2,677,268.87	0.51
32	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证 券交易 所	美国	3,916	2,649,686.50	0.51
33	AbbVie Inc	-	ABBV US	纽约证 券交易 所	美国	3,581	2,605,770.74	0.50
34	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证 券交易 所	美国	798	2,600,623.46	0.50
35	Merck & Co Inc	-	MRK US	纽约证 券交易 所	美国	5,131	2,577,824.54	0.49
36	NIKE Inc	-	NKE US	纽约证 券交易 所	美国	2,578	2,572,897.75	0.49
37	Walmart Inc	-	WMT US	纽约证 券交易 所	美国	2,811	2,560,830.28	0.49
38	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	827	2,547,518.99	0.49
39	Wells Fargo & Co	-	WFC US	纽约证 券交易 所	美国	8,383	2,452,680.78	0.47
40	Accenture PLC	-	ACN US	纽约证 券交易 所	美国	1,286	2,449,023.52	0.47
41	Eli Lilly & Co	-	LLY US	纽约证 券交易 所	美国	1,613	2,391,630.83	0.46
42	Texas Instrumen ts Inc	-	TXN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,866	2,318,089.31	0.44
43	Costco Wholesale	-	COST US	纳斯达 克证券	美国	897	2,292,792.79	0.44

	Corp			交易所				
44	McDonald's Corp	-	MCD US	纽约证券交易所	美国	1,512	2,256,234.37	0.43
45	Danaher Corp	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	1,285	2,227,717.68	0.43
46	Medtronic PLC	-	MDT US	纽约证券交易所	美国	2,733	2,191,571.42	0.42
47	QUALCOMM Inc	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,303	2,126,456.84	0.41
48	Philip Morris International Inc	-	PM US	纽约证券交易所	美国	3,158	2,021,942.69	0.39
49	Honeywell International Inc	-	HON US	纽约证券交易所	美国	1,410	1,998,002.34	0.38
50	Linde Public Limited	-	LIN US	纽约证券交易所	美国	1,060	1,979,671.80	0.38
51	Bristol-Myers Squibb Co	-	BMJ US	纽约证券交易所	美国	4,543	1,961,049.02	0.38
52	United Parcel Service Inc	-	UPS US	纽约证券交易所	美国	1,459	1,960,176.71	0.38
53	Citigroup Inc	-	C US	纽约证券交易所	美国	4,233	1,934,701.43	0.37
54	Union Pacific Corp	-	UNP US	纽约证券交易所	美国	1,358	1,929,405.38	0.37
55	Oracle Corp	-	ORCL US	纽约证券交易所	美国	3,761	1,891,234.59	0.36
56	NextEra Energy Inc	-	NEE US	纽约证券交易所	美国	3,974	1,881,276.21	0.36
57	Lowe's	-	LOW US	纽约证	美国	1,482	1,857,043.21	0.36

	Cos Inc			券交易所				
58	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,171	1,843,914.42	0.35
59	Morgan Stanley	-	MS US	纽约证券交易所	美国	3,043	1,802,449.75	0.35
60	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	555	1,757,433.71	0.34
61	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,387	1,724,139.13	0.33
62	Boeing Co/The	-	BA US	纽约证券交易所	美国	1,112	1,720,910.69	0.33
63	International Business Machines Corp	-	IBM US	纽约证券交易所	美国	1,812	1,715,938.74	0.33
64	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,861	1,711,967.84	0.33
65	Goldman Sachs Group Inc/The	-	GS US	纽约证券交易所	美国	697	1,708,905.82	0.33
66	Raytheon Technologies Corp	-	RTX US	纽约证券交易所	美国	3,081	1,697,973.39	0.33
67	BlackRock Inc	-	BLK US	纽约证券交易所	美国	287	1,622,236.99	0.31
68	American Tower Corp	-	AMT US	纽约证券交易所	美国	920	1,605,520.90	0.31
69	Target Corp	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	1,015	1,585,089.54	0.30
70	Caterpillar Inc	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	1,105	1,553,532.28	0.30

71	General Electric Co	-	GE US	纽约证券交易所	美国	17,781	1,546,110.33	0.30
72	3M Co	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	1,174	1,506,441.18	0.29
73	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,413	1,464,201.63	0.28
74	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	2,659	1,433,282.75	0.28
75	Deere & Co	-	DE US	纽约证券交易所	美国	624	1,421,810.13	0.27
76	Charles Schwab Corp/The	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	2,981	1,402,142.81	0.27
77	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	234	1,390,186.13	0.27
78	American Express Co	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	1,299	1,386,555.62	0.27
79	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	390	1,384,557.70	0.27
80	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	281	1,309,639.60	0.25
81	S&P Global Inc	-	SPGI US	纽约证券交易所	美国	479	1,270,091.51	0.24
82	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	2,228	1,223,125.88	0.23
83	Anthem Inc	-	ANTM US	纽约证券交易所	美国	487	1,201,169.03	0.23
84	Lockheed Martin Corp	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	491	1,200,091.81	0.23

85	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	284	1,193,818.73	0.23
86	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	83	1,173,228.26	0.23
87	Altria Group Inc	-	MO US	纽约证券交易所	美国	3,702	1,140,281.04	0.22
88	Zoetis Inc	-	ZTS US	纽约证券交易所	美国	946	1,138,893.41	0.22
89	Prologis Inc	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	1,473	1,137,414.88	0.22
90	Mondelez International Inc	-	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	2,812	1,134,272.63	0.22
91	Fidelity National Information Services Inc	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	1,237	1,132,105.33	0.22
92	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	2,503	1,113,440.74	0.21
93	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	852	1,093,205.51	0.21
94	Stryker Corp	-	SYK US	纽约证券交易所	美国	651	1,092,301.03	0.21
95	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,163	1,088,121.74	0.21
96	Crown Castle International Corp	-	CCI US	纽约证券交易所	美国	859	1,082,653.97	0.21
97	Cigna Corp	-	CI US	纽约证券交易所	美国	700	1,072,047.13	0.21
98	ConocoPh	-	COP US	纽约证	美国	2,698	1,061,447.40	0.20

	illips			券交易 所				
99	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证 券交易 所	美国	2,391	1,041,376.00	0.20
100	PNC Financial Services Group Inc	-	PNC US	纽约证 券交易 所	美国	844	1,040,085.40	0.20
101	US Bancorp	-	USB US	纽约证 券交易 所	美国	2,722	1,001,782.82	0.19
102	CME Group Inc	-	CME US	纳斯达 克证 券交易 所	美国	715	982,362.86	0.19
103	Duke Energy Corp	-	DUK US	纽约证 券交易 所	美国	1,531	976,381.58	0.19
104	General Motors Co	-	GM US	纽约证 券交易 所	美国	2,525	965,166.40	0.19
105	Truist Financial Corp	-	TFC US	纽约证 券交易 所	美国	2,683	961,950.88	0.18
106	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达 克证 券交易 所	美国	1,543	951,339.65	0.18
107	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达 克证 券交易 所	美国	4,554	943,771.00	0.18
108	Estee Lauder Cos Inc	-	EL US	纽约证 券交易 所	美国	457	939,056.67	0.18
109	FedEx Corp	-	FDX US	纽约证 券交易 所	美国	485	934,712.19	0.18
110	Chubb Ltd	-	CB US	纽约证 券交易 所	美国	896	919,984.39	0.18
111	Marsh & McLenna n Cos Inc	-	MMC US	纽约证 券交易 所	美国	1,012	919,712.55	0.18
112	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达 克证 券	美国	177	917,723.10	0.18

				交易所				
113	Capital One Financial Corp	-	COF US	纽约证券交易所	美国	914	913,371.96	0.18
114	Becton Dickinson and Co	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	578	908,056.33	0.17
115	Colgate-Palmolive Co	-	CL US	纽约证券交易所	美国	1,690	888,144.24	0.17
116	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	290	886,525.34	0.17
117	Norfolk Southern Corp	-	NSC US	纽约证券交易所	美国	501	859,002.15	0.16
118	Intercontinental Exchange Inc	-	ICE US	纽约证券交易所	美国	1,118	857,297.91	0.16
119	Sherwin-Williams Co/The	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	481	846,586.09	0.16
120	Edwards Lifesciences Corp	-	EW US	纽约证券交易所	美国	1,244	832,326.26	0.16
121	Illinois Tool Works Inc	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	574	828,982.25	0.16
122	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	438	825,938.00	0.16
123	Southern Co/The	-	SO US	纽约证券交易所	美国	2,104	822,454.97	0.16
124	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	1,186	818,956.83	0.16
125	Air Products & Chemicals Inc	-	APD US	纽约证券交易所	美国	440	817,714.29	0.16

126	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	734	816,333.38	0.16
127	Boston Scientific Corp	-	BSX US	纽约证券交易所	美国	2,822	779,532.00	0.15
128	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证券交易所	美国	1,604	762,332.37	0.15
129	Eaton Corp PLC	-	ETN US	纽约证券交易所	美国	793	759,105.29	0.15
130	Regeneron Pharmaceuticals Inc	-	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	209	754,118.87	0.14
131	Ford Motor Co	-	F US	纽约证券交易所	美国	7,784	747,241.32	0.14
132	Emerson Electric Co	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	1,195	742,955.43	0.14
133	Moody's Corp	-	MCO US	纽约证券交易所	美国	317	742,080.02	0.14
134	Progressive Corp/The	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	1,166	739,764.53	0.14
135	NXP Semiconductors NV	-	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	551	732,263.45	0.14
136	Humana Inc	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	256	732,163.96	0.14
137	Northrop Grumman Corp	-	NOC US	纽约证券交易所	美国	308	723,120.60	0.14
138	Global Payments Inc	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	588	712,377.97	0.14
139	Twitter Inc	-	TWTR US	纽约证券交易所	美国	1,589	706,341.46	0.14
140	HCA	-	HCA US	纽约证	美国	528	705,176.25	0.14

	Healthcar e Inc			券交易 所				
141	Waste Managem ent Inc	-	WM US	纽约证 券交易 所	美国	775	701,471.57	0.13
142	Freeport- McMoRa n Inc	-	FCX US	纽约证 券交易 所	美国	2,905	696,428.17	0.13
143	Aon PLC	-	AON US	纽约证 券交易 所	美国	450	694,086.06	0.13
144	IDEXX Laboratori es Inc	-	IDXX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	170	693,578.95	0.13
145	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	303	677,792.46	0.13
146	Dollar General Corp	-	DG US	纽约证 券交易 所	美国	483	675,186.20	0.13
147	Vertex Pharmace uticals Inc	-	VRTX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	517	673,418.33	0.13
148	Ecolab Inc	-	ECL US	纽约证 券交易 所	美国	495	658,640.46	0.13
149	Newmont Goldcorp Corp	-	NEM US	纽约证 券交易 所	美国	1,594	652,649.17	0.13
150	KLA-Ten cor Corp	-	KLAC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	306	640,895.28	0.12
151	Roper Technolog ies Inc	-	ROP US	纽约证 券交易 所	美国	209	634,845.66	0.12
152	Johnson Controls Internatio nal plc	-	JCI US	纽约证 券交易 所	美国	1,420	629,566.46	0.12
153	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证 券交易 所	美国	1,162	626,353.72	0.12
154	Dow Inc	-	DOW US	纽约证 券交易	美国	1,484	606,651.97	0.12

				所				
155	IQVIA Holdings Inc	-	IQV US	纽约证券交易所	美国	381	596,421.76	0.11
156	Public Storage	-	PSA US	纽约证券交易所	美国	302	586,631.22	0.11
157	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,287	583,736.38	0.11
158	T Rowe Price Group Inc	-	TROW US	纳斯达克证券交易所	美国	454	580,623.32	0.11
159	Agilent Technologies Inc	-	A US	纽约证券交易所	美国	606	578,649.63	0.11
160	Schlumberger Ltd	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	2,785	575,904.03	0.11
161	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	659	575,616.81	0.11
162	Kimberly-Clark Corp	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	666	575,578.63	0.11
163	MetLife Inc	-	MET US	纽约证券交易所	美国	1,482	572,996.01	0.11
164	L3Harris Technologies Inc	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	405	565,522.00	0.11
165	MSCI Inc	-	MSCI US	纽约证券交易所	美国	164	564,775.02	0.11
166	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	702	562,338.78	0.11
167	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	56	560,859.68	0.11
168	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	142	560,491.20	0.11
169	Trane	-	TT US	纽约证	美国	470	559,094.52	0.11

	Technologies PLC			券交易所				
170	Exelon Corp	-	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,944	556,464.23	0.11
171	General Dynamics Corp	-	GD US	纽约证券交易所	美国	457	555,793.54	0.11
172	Simon Property Group Inc	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	654	551,265.66	0.11
173	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	638	546,022.12	0.10
174	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	1,158	545,574.44	0.10
175	Digital Realty Trust Inc	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	559	543,340.54	0.10
176	Aptiv PLC	-	APTIV US	纽约证券交易所	美国	532	540,707.53	0.10
177	American Electric Power Co Inc	-	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	989	540,448.80	0.10
178	IHS Markit Ltd	-	INFO US	纽约证券交易所	美国	742	540,023.79	0.10
179	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	300	534,489.29	0.10
180	Bank of New York Mellon Corp	-	BK US	纽约证券交易所	美国	1,607	531,838.13	0.10
181	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	572	531,477.34	0.10
182	DuPont De Nemours Inc.	-	DD US	纽约证券交易所	美国	1,061	530,581.00	0.10

183	American International Group Inc	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	1,722	529,516.31	0.10
184	Amphenol Corp	-	APH US	纽约证券交易所	美国	1,193	527,228.98	0.10
185	DexCom Inc	-	DXCM US	纳斯达克证券交易所	美国	191	526,866.38	0.10
186	Baxter International Inc	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	1,006	523,158.28	0.10
187	Prudential Financial Inc	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	790	522,953.49	0.10
188	Microchip Technology Inc	-	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	536	518,491.76	0.10
189	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	471	516,560.38	0.10
190	Alexion Pharmaceuticals Inc	-	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	433	513,877.89	0.10
191	Constellation Brands Inc	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	338	510,702.04	0.10
192	Sysco Corp	-	SYU US	纽约证券交易所	美国	1,016	510,309.14	0.10
193	Parker-Hannifin Corp	-	PH US	纽约证券交易所	美国	257	509,878.06	0.10
194	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	139	508,430.48	0.10
195	Allstate Corp/The	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	603	508,121.23	0.10
196	Marathon Petroleum Corp	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	1,297	506,244.06	0.10

197	Carrier Global Corp	-	CARR US	纽约证券交易所	美国	1,611	505,790.95	0.10
198	HP Inc	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	2,495	486,600.90	0.09
199	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	550	486,128.99	0.09
200	Travelers Cos Inc/The	-	TRV US	纽约证券交易所	美国	502	485,505.07	0.09
201	Walgreens Boots Alliance Inc	-	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,414	480,570.33	0.09
202	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	861	477,343.38	0.09
203	General Mills Inc	-	GIS US	纽约证券交易所	美国	1,205	474,304.74	0.09
204	International Flavors & Fragrances Inc	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	490	472,918.08	0.09
205	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,056	472,482.41	0.09
206	Motorola Solutions Inc	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	333	466,490.60	0.09
207	Cummins Inc	-	CMI US	纽约证券交易所	美国	294	463,060.87	0.09
208	Marriott International Inc/MD	-	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	524	462,132.81	0.09
209	Discover Financial	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	604	461,555.80	0.09

	Services			所				
210	ResMed Inc	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	289	460,245.17	0.09
211	Xilinx Inc	-	XLNX US	纳斯达克证券交易所	美国	484	452,244.21	0.09
212	Kinder Morgan Inc/DE	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	3,839	452,109.90	0.09
213	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,060	451,126.87	0.09
214	TransDigm Group Inc	-	TDG US	纽约证券交易所	美国	107	447,426.72	0.09
215	SBA Communications Corp	-	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	217	446,766.95	0.09
216	Welltower Inc	-	WELL US	纽约证券交易所	美国	823	441,814.64	0.08
217	Yum! Brands Inc	-	YUM US	纽约证券交易所	美国	591	439,175.23	0.08
218	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	632	438,082.64	0.08
219	Aflac Inc	-	AFL US	纽约证券交易所	美国	1,262	437,471.00	0.08
220	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	1,101	431,021.75	0.08
221	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	729	430,204.87	0.08
222	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	173	426,922.17	0.08
223	Hilton Worldwide	-	HLT US	纽约证券交易所	美国	547	426,231.84	0.08

	Holdings Inc							
224	Pioneer Natural Resources Co	-	PXD US	纽约证券交易所	美国	405	425,207.66	0.08
225	Zimmer Biomet Holdings Inc	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	409	424,915.53	0.08
226	Otis Worldwide Corp	-	OTIS US	纽约证券交易所	美国	803	424,178.63	0.08
227	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	44	424,155.18	0.08
228	Rockwell Automation Inc	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	229	423,127.38	0.08
229	Corteva Inc	-	CTVA US	纽约证券交易所	美国	1,467	420,303.47	0.08
230	Stanley Black & Decker Inc	-	SWK US	纽约证券交易所	美国	317	419,789.12	0.08
231	First Republic Bank/CA	-	FRC US	纽约证券交易所	美国	347	419,570.51	0.08
232	Williams Cos Inc/The	-	WMB US	纽约证券交易所	美国	2,417	414,553.34	0.08
233	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	269	413,918.70	0.08
234	Mettler-Toledo International Inc	-	MTD US	纽约证券交易所	美国	46	411,674.01	0.08
235	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	813	410,080.95	0.08
236	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	325	402,585.36	0.08

237	Corning Inc	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	1,515	400,290.41	0.08
238	Southwest Airlines Co	-	LUV US	纽约证券交易所	美国	1,164	399,213.25	0.08
239	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	684	394,369.72	0.08
240	AMETEK Inc	-	AME US	纽约证券交易所	美国	454	391,540.20	0.08
241	McKesson Corp	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	316	390,395.73	0.07
242	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	172	385,631.28	0.07
243	Public Service Enterprise Group Inc	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	996	384,382.67	0.07
244	SVB Financial Group	-	SIVB US	纳斯达克证券交易所	美国	106	381,026.90	0.07
245	DR Horton Inc	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	652	380,637.10	0.07
246	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,132	380,267.33	0.07
247	Willis Towers Watson PLC	-	WLTW US	纳斯达克证券交易所	美国	254	377,431.86	0.07
248	Kroger Co/The	-	KR US	纽约证券交易所	美国	1,516	375,189.43	0.07
249	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证券交易所	美国	242	374,436.57	0.07
250	AvalonBay Communities Inc	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	277	373,439.84	0.07

251	State Street Corp	-	STT US	纽约证券交易所	美国	700	372,075.92	0.07
252	CBRE Group Inc	-	CBRE US	纽约证券交易所	美国	668	369,954.68	0.07
253	Ameriprise Financial Inc	-	AMP US	纽约证券交易所	美国	230	369,791.63	0.07
254	Arthur J Gallagher & Co	-	AJG US	纽约证券交易所	美国	408	369,211.77	0.07
255	Keysight Technologies Inc	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	370	369,076.50	0.07
256	Nucor Corp	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	593	367,492.41	0.07
257	Maxim Integrated Products Inc	-	MXIM US	纳斯达克证券交易所	美国	533	362,779.06	0.07
258	Zebra Technologies Corp	-	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	106	362,579.18	0.07
259	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达克证券交易所	美国	321	362,315.48	0.07
260	American Water Works Co Inc	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	361	359,445.97	0.07
261	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	622	357,417.31	0.07
262	Delta Air Lines Inc	-	DAL US	纽约证券交易所	美国	1,271	355,198.65	0.07
263	Eversource Energy	-	ES US	纽约证券交易所	美国	683	354,038.80	0.07
264	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	414	352,576.88	0.07

265	Lennar Corp	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	546	350,428.77	0.07
266	Fifth Third Bancorp	-	FITB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,416	349,708.99	0.07
267	Laboratory Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证券交易所	美国	194	345,711.61	0.07
268	Ball Corp	-	BLL US	纽约证券交易所	美国	653	341,778.44	0.07
269	ViacomCBS Inc.	-	VIAC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,170	341,635.93	0.07
270	West Pharmaceutical Services Inc	-	WST US	纽约证券交易所	美国	147	341,013.82	0.07
271	Best Buy Co Inc	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	459	340,937.07	0.07
272	LyondellBasell Industries NV	-	LYB US	纽约证券交易所	美国	512	340,249.85	0.07
273	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,291	340,104.76	0.07
274	VF Corp	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	639	338,661.44	0.06
275	Generac Holdings Inc	-	GNRC US	纽约证券交易所	美国	125	335,238.81	0.06
276	Equity Residential	-	EQR US	纽约证券交易所	美国	669	332,779.13	0.06
277	Synchrony Financial	-	SYF US	纽约证券交易所	美国	1,060	332,250.70	0.06
278	Occidental	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	1,636	330,483.99	0.06

	Petroleum Corp			所				
279	Kansas City Southern	-	KSU US	纽约证券交易所	美国	180	329,507.74	0.06
280	Weyerhaeuser Co	-	WY US	纽约证券交易所	美国	1,474	327,753.69	0.06
281	Etsy Inc	-	ETSY US	纳斯达克证券交易所	美国	246	327,117.76	0.06
282	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	385	322,333.15	0.06
283	Hershey Co/The	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	286	321,812.98	0.06
284	Realty Income Corp	-	O US	纽约证券交易所	美国	743	320,342.28	0.06
285	Consolidated Edison Inc	-	ED US	纽约证券交易所	美国	682	315,983.13	0.06
286	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	280	315,911.81	0.06
287	Old Dominion Freight Line Inc	-	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	191	313,158.52	0.06
288	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	868	311,993.89	0.06
289	International Paper Co	-	IP US	纽约证券交易所	美国	783	310,121.82	0.06
290	Cerner Corp	-	CERN US	纳斯达克证券交易所	美国	610	308,002.06	0.06
291	Hess Corp	-	HES US	纽约证券交易所	美国	544	306,868.19	0.06
292	Enphase Energy	-	ENPH US	纳斯达克证券交易所	美国	257	304,870.92	0.06

	Inc			交易所				
293	Northern Trust Corp	-	NTRS US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	406	303,248.21	0.06
294	Fortive Corp	-	FTV US	纽约证 券交易 所	美国	673	303,204.92	0.06
295	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	468	300,821.02	0.06
296	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证 券交易 所	美国	264	296,870.54	0.06
297	United Rentals Inc	-	URI US	纽约证 券交易 所	美国	142	292,638.78	0.06
298	Alexandria Real Estate Equities Inc	-	ARE US	纽约证 券交易 所	美国	248	291,486.95	0.06
299	Republic Services Inc	-	RSG US	纽约证 券交易 所	美国	410	291,377.00	0.06
300	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	196	288,296.43	0.06
301	Expedia Group Inc	-	EXPE US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	270	285,547.40	0.05
302	Hartford Financial Services Group Inc	-	HIG US	纽约证 券交易 所	美国	712	285,036.67	0.05
303	Clorox Co/The	-	CLX US	纽约证 券交易 所	美国	245	284,747.96	0.05
304	Teradyne Inc	-	TER US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	328	283,849.56	0.05
305	Qorvo Inc	-	QRVO US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	223	281,853.84	0.05
306	Tyson	-	TSN US	纽约证	美国	587	279,703.72	0.05

	Foods Inc			券交易所				
307	Xylem Inc/NY	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	359	278,208.34	0.05
308	Garmin Ltd	-	GRMN US	纳斯达克证券交易所	美国	297	277,513.49	0.05
309	Caesars Entertainment Inc	-	CZR US	纳斯达克证券交易所	美国	414	277,477.45	0.05
310	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	122	277,272.79	0.05
311	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	603	277,238.49	0.05
312	McCormick & Co Inc/MD	-	MKC US	纽约证券交易所	美国	485	276,719.68	0.05
313	Edison International	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	740	276,407.01	0.05
314	Huntington Bancshares Inc/OH	-	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,992	275,819.40	0.05
315	Expeditors International of Washington Inc	-	EXPD US	纳斯达克证券交易所	美国	337	275,615.00	0.05
316	Gartner Inc	-	IT US	纽约证券交易所	美国	176	275,375.97	0.05
317	Dover Corp	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	283	275,328.17	0.05
318	Tractor Supply Co	-	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	229	275,250.26	0.05
319	FleetCor Technology	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	166	274,592.75	0.05

	ies Inc			所				
320	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证 券交易 所	美国	738	272,227.32	0.05
321	Extra Space Storage Inc	-	EXR US	纽约证 券交易 所	美国	257	271,981.45	0.05
322	PPL Corp	-	PPL US	纽约证 券交易 所	美国	1,500	271,033.50	0.05
323	Waters Corp	-	WAT US	纽约证 券交易 所	美国	121	270,153.69	0.05
324	Carnival Corp	-	CCL US	纽约证 券交易 所	美国	1,573	267,863.40	0.05
325	CarMax Inc	-	KMX US	纽约证 券交易 所	美国	320	266,983.01	0.05
326	Halliburto n Co	-	HAL US	纽约证 券交易 所	美国	1,770	264,362.80	0.05
327	STERIS PLC	-	STE US	纽约证 券交易 所	美国	198	263,878.29	0.05
328	Trimble Inc	-	TRMB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	499	263,786.36	0.05
329	Church & Dwight Co Inc	-	CHD US	纽约证 券交易 所	美国	478	263,153.21	0.05
330	Take-Two Interactiv e Software Inc	-	TTWO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	229	261,876.82	0.05
331	FirstEnergy Corp	-	FE US	纽约证 券交易 所	美国	1,082	260,091.51	0.05
332	Nasdaq Inc	-	NDAQ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	229	260,072.00	0.05
333	Ameren	-	AEE US	纽约证	美国	499	258,016.14	0.05

	Corp			券交易 所				
334	KeyCorp	-	KEY US	纽约证 券交易 所	美国	1,910	254,796.03	0.05
335	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证 券交易 所	美国	391	251,832.14	0.05
336	Citizens Financial Group Inc	-	CFG US	纽约证 券交易 所	美国	846	250,690.77	0.05
337	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证 券交易 所	美国	107	250,439.79	0.05
338	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证 券交易 所	美国	1,913	249,387.90	0.05
339	Teledyne Technolog ies Inc	-	TDY US	纽约证 券交易 所	美国	92	248,922.90	0.05
340	Cooper Cos Inc/The	-	COO US	纽约证 券交易 所	美国	97	248,314.55	0.05
341	Albemarle Corp	-	ALB US	纽约证 券交易 所	美国	227	247,036.94	0.05
342	Akamai Technolog ies Inc	-	AKAM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	325	244,805.49	0.05
343	Darden Restauran ts Inc	-	DRI US	纽约证 券交易 所	美国	259	244,265.49	0.05
344	Essex Property Trust Inc	-	ESS US	纽约证 券交易 所	美国	126	244,199.92	0.05
345	Ulta Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	109	243,474.26	0.05
346	Mid-Ame rica Apartmen t Communi ties Inc	-	MAA US	纽约证 券交易 所	美国	223	242,626.24	0.05

347	Hewlett Packard Enterprise Co	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	2,565	241,592.88	0.05
348	WW Grainger Inc	-	GWW US	纽约证券交易所	美国	85	240,509.52	0.05
349	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	256	240,311.59	0.05
350	Royal Caribbean Cruises Ltd	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	436	240,199.96	0.05
351	Broadridge Financial Solutions Inc	-	BR US	纽约证券交易所	美国	230	240,004.99	0.05
352	Charles River Laboratories International Inc	-	CRL US	纽约证券交易所	美国	100	238,972.02	0.05
353	Teleflex Inc	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	91	236,199.93	0.05
354	Genuine Parts Co	-	GPC US	纽约证券交易所	美国	287	234,481.54	0.04
355	Ingersoll-Rand Inc.	-	IR US	纽约证券交易所	美国	742	233,965.57	0.04
356	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	80	233,788.43	0.04
357	Catalent Inc	-	CTLT US	纽约证券交易所	美国	332	231,890.72	0.04
358	Pool Corp	-	POOL US	纳斯达克证券交易所	美国	78	231,113.18	0.04
359	Amcor PLC	-	AMCR US	纽约证券交易所	美国	3,111	230,315.87	0.04

				所				
360	NetApp Inc	-	NTAP US	纳斯达克 证券交易 所	美国	434	229,397.38	0.04
361	Fox Corp	-	FOXA US	纳斯达克 证券交易 所	美国	666	159,749.10	0.03
			FOX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	306	69,583.03	0.01
362	Domino's Pizza Inc	-	DPZ US	纽约证 券交易 所	美国	76	229,031.48	0.04
363	Conagra Brands Inc	-	CAG US	纽约证 券交易 所	美国	973	228,672.94	0.04
364	Paycom Software Inc	-	PAYC US	纽约证 券交易 所	美国	97	227,761.10	0.04
365	Healthpea k Properties Inc	-	PEAK US	纽约证 券交易 所	美国	1,051	226,024.62	0.04
366	Quest Diagnosti cs Inc	-	DGX US	纽约证 券交易 所	美国	265	225,922.94	0.04
367	AES Corp/VA	-	AES US	纽约证 券交易 所	美国	1,330	223,991.69	0.04
368	Jacobs Engineeri ng Group Inc	-	J US	纽约证 券交易 所	美国	259	223,233.79	0.04
369	Duke Realty Corp	-	DRE US	纽约证 券交易 所	美国	729	222,990.70	0.04
370	MGM Resorts Internatio nal	-	MGM US	纽约证 券交易 所	美国	809	222,898.32	0.04
371	Seagate Technolog y PLC	-	STX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	392	222,670.34	0.04
372	Las Vegas	-	LVS US	纽约证	美国	654	222,610.27	0.04

	Sands Corp			券交易所				
373	Celanese Corp	-	CE US	纽约证券交易所	美国	227	222,312.71	0.04
374	MarketAxess Holdings Inc	-	MKTX US	纳斯达克证券交易所	美国	74	221,617.99	0.04
375	Hologic Inc	-	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	513	221,112.17	0.04
376	Devon Energy Corp	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	1,168	220,250.13	0.04
377	Avery Dennison Corp	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	162	220,023.77	0.04
378	Cincinnati Financial Corp	-	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	292	219,986.04	0.04
379	PerkinElmer Inc	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	220	219,450.89	0.04
380	Viatis Inc	-	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,355	217,401.42	0.04
381	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	419	216,515.48	0.04
382	Diamondback Energy Inc	-	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	356	215,927.81	0.04
383	Cardinal Health Inc	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	584	215,383.35	0.04
384	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	563	214,876.10	0.04
385	United Airlines Holdings Inc	-	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	634	214,164.33	0.04

386	L Brands Inc	-	LB US	纽约证券交易所	美国	460	214,136.81	0.04
387	AmerisourceBergen Corp	-	ABC US	纽约证券交易所	美国	287	212,270.04	0.04
388	IDEX Corp	-	IEX US	纽约证券交易所	美国	148	210,388.66	0.04
389	Baker Hughes Company	-	BKR US	纽约证券交易所	美国	1,422	210,089.82	0.04
390	Boston Properties Inc	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	279	206,533.34	0.04
391	Kellogg Co	-	K US	纽约证券交易所	美国	496	206,126.80	0.04
392	Monolithic Power Systems Inc	-	MPWR US	纳斯达克证券交易所	美国	85	205,064.57	0.04
393	NortonLifeLock Inc	-	NLOK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,159	203,803.11	0.04
394	Principal Financial Group Inc	-	PFJ US	纳斯达克证券交易所	美国	494	201,657.58	0.04
395	Textron Inc	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	452	200,806.01	0.04
396	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	239	200,560.91	0.04
397	Incyte Corp	-	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	368	200,003.66	0.04
398	Eastman Chemical Co	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	265	199,867.42	0.04
399	NVR Inc	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	6	192,768.09	0.04

400	PTC Inc	-	PTC US	纳斯达克 证券交易所	美国	209	190,723.73	0.04
401	Masco Corp	-	MAS US	纽约证 券交易 所	美国	501	190,662.81	0.04
402	UDR Inc	-	UDR US	纽约证 券交易 所	美国	591	187,001.68	0.04
403	Westingho use Air Brake Technolog ies Corp	-	WAB US	纽约证 券交易 所	美国	350	186,083.18	0.04
404	PulteGrou p Inc	-	PHM US	纽约证 券交易 所	美国	524	184,724.49	0.04
405	Citrix Systems Inc	-	CTXS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	242	183,333.37	0.04
406	ABIOME D Inc	-	ABMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	90	181,463.56	0.03
407	JM Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证 券交易 所	美国	216	180,799.59	0.03
408	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	497	179,026.94	0.03
409	WestRock Co	-	WRK US	纽约证 券交易 所	美国	519	178,435.58	0.03
410	FMC Corp	-	FMC US	纽约证 券交易 所	美国	255	178,240.62	0.03
411	Fortune Brands Home & Security Inc	-	FBHS US	纽约证 券交易 所	美国	276	177,603.39	0.03
412	LKQ Corp	-	LKQ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	555	176,471.20	0.03
413	Evergy Inc	-	EVRG US	纽约证 券交易	美国	452	176,453.50	0.03

				所				
414	DENTSP LY SIRONA Inc	-	XRAY US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	431	176,135.01	0.03
415	Brown-Fo rman Corp	-	BF/B US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	363	175,735.52	0.03
416	Bio-Rad Laboratori es Inc	-	BIO US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	42	174,811.47	0.03
417	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	166	174,743.77	0.03
418	American Airlines Group Inc	-	AAL US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,274	174,561.85	0.03
419	CenterPoi nt Energy Inc	-	CNP US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,098	173,925.01	0.03
420	Whirlpool Corp	-	WHR US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	123	173,237.01	0.03
421	Howmet Aerospace Inc	-	HWM US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	777	173,022.09	0.03
422	Lumen Technolog ies Inc	-	LUMN US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,966	172,600.56	0.03
423	Hormel Foods Corp	-	HRL US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	559	172,434.60	0.03
424	Advance Auto Parts Inc	-	AAP US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	130	172,279.24	0.03
425	Leidos Holdings Inc	-	LDOS US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	263	171,769.54	0.03
426	Discovery Inc	-	DISCK US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	565	105,775.74	0.02
			DISCA US	纳斯 达克 证 券	美国	323	64,017.27	0.01

				交易所				
427	Wynn Resorts Ltd	-	WYNN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	209	165,124.68	0.03
428	Packaging Corp of America	-	PKG US	纽约证 券交易 所	美国	187	163,592.60	0.03
429	CH Robinson Worldwide Inc	-	CHRW US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	266	160,961.27	0.03
430	Quanta Services Inc	-	PWR US	纽约证 券交易 所	美国	275	160,900.10	0.03
431	News Corp	-	NWSA US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	763	127,021.78	0.02
			NWS US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	211	33,191.02	0.01
432	Loews Corp	-	L US	纽约证 券交易 所	美国	452	159,576.10	0.03
433	Jack Henry & Associates Inc	-	JKHY US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	151	159,499.93	0.03
434	Cboe Global Markets Inc	-	CBOE US	巴兹全 球市场	美国	207	159,198.51	0.03
435	Interpublic Group of Cos Inc	-	IPG US	纽约证 券交易 所	美国	755	158,465.93	0.03
436	Live Nation Entertainment Inc	-	LYV US	纽约证 券交易 所	美国	280	158,435.24	0.03
437	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证 券交易 所	美国	255	158,324.45	0.03
438	Allegion PLC	-	ALLE US	纽约证 券交易 所	美国	173	155,681.30	0.03

439	Snap-on Inc	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	107	154,441.68	0.03
440	Iron Mountain Inc	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	557	152,279.03	0.03
441	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证券交易所	美国	531	149,150.01	0.03
442	Hasbro Inc	-	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	244	148,988.51	0.03
443	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,348	148,823.39	0.03
444	Lamb Weston Holdings Inc	-	LW US	纽约证券交易所	美国	283	147,463.28	0.03
445	F5 Networks Inc	-	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	122	147,112.76	0.03
446	Penn National Gaming Inc	-	PENN US	纳斯达克证券交易所	美国	296	146,263.38	0.03
447	BorgWarner Inc	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	462	144,870.84	0.03
448	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	150	141,892.87	0.03
449	Mohawk Industries Inc	-	MHK US	纽约证券交易所	美国	114	141,538.59	0.03
450	Lincoln National Corp	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	348	141,271.53	0.03
451	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	321	139,953.48	0.03
452	CF Industries	-	CF US	纽约证券交易所	美国	417	138,599.18	0.03

	Holdings Inc			所				
453	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	667	137,496.57	0.03
454	Marathon Oil Corp	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	1,556	136,907.09	0.03
455	Norwegian Cruise Line Holdings	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	708	134,514.01	0.03
456	Henry Schein Inc	-	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	275	131,800.58	0.03
457	Newell Brands Inc	-	NWL US	纳斯达克证券交易所	美国	737	130,787.24	0.03
458	WR Berkley Corp	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	271	130,303.64	0.03
459	DISH Network Corp	-	DISH US	纳斯达克证券交易所	美国	478	129,075.38	0.02
460	Regency Centers Corp	-	REG US	纳斯达克证券交易所	美国	308	127,480.77	0.02
461	Everest Re Group Ltd	-	RE US	纽约证券交易所	美国	78	126,984.76	0.02
462	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证券交易所	美国	487	126,786.57	0.02
463	Invesco Ltd	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	734	126,746.00	0.02
464	Robert Half International Inc	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	220	126,446.12	0.02
465	DXC Technology Co	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	502	126,281.26	0.02
466	Molson	-	TAP US	纽约证	美国	364	126,250.77	0.02

	Coors Beverage Co			券交易所				
467	Comerica Inc	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	269	123,972.29	0.02
468	AO Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	264	122,895.91	0.02
469	NiSource Inc	-	NI US	纽约证券交易所	美国	764	120,920.15	0.02
470	Western Union Co/The	-	WU US	纽约证券交易所	美国	802	119,007.57	0.02
471	Sealed Air Corp	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	305	116,742.08	0.02
472	Campbell Soup Co	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	396	116,628.32	0.02
473	Pinnacle West Capital Corp	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	219	115,968.03	0.02
474	Assurant Inc	-	AIZ US	纽约证券交易所	美国	114	115,018.98	0.02
475	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	852	114,758.51	0.02
476	Juniper Networks Inc	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	647	114,314.38	0.02
477	Globe Life Inc	-	GL US	纽约证券交易所	美国	185	113,835.04	0.02
478	Nielsen Holdings PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	698	111,240.73	0.02
479	Franklin Resources Inc	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	538	111,182.33	0.02
480	DaVita	-	DVA US	纽约证	美国	142	110,474.56	0.02

	Inc			券交易所				
481	Zions Bancorp NA	-	ZION US	纳斯达克证券交易所	美国	320	109,273.88	0.02
482	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	79	107,555.82	0.02
483	Federal Realty Investment Trust	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	139	105,213.26	0.02
484	Apa Corp	-	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	752	105,078.44	0.02
485	Organon & Co	-	OGN US	纽约证券交易所	美国	504	98,523.24	0.02
486	PVH Corp	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	141	98,000.94	0.02
487	Under Armour Inc	-	UAA US	纽约证券交易所	美国	375	51,236.67	0.01
			UA US	纽约证券交易所	美国	388	46,546.05	0.01
488	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证券交易所	美国	441	97,432.52	0.02
489	IPG Photonics Corp	-	IPGP US	纳斯达克证券交易所	美国	71	96,673.26	0.02
490	Alaska Air Group Inc	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	247	96,233.33	0.02
491	Vornado Realty Trust	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	312	94,065.77	0.02
492	People's United Financial Inc	-	PBCT US	纳斯达克证券交易所	美国	847	93,785.02	0.02

493	Cabot Oil & Gas Corp	-	COG US	纽约证券交易所	美国	795	89,670.71	0.02
494	Gap Inc/The	-	GPS US	纽约证券交易所	美国	409	88,909.39	0.02
495	Leggett & Platt Inc	-	LEG US	纽约证券交易所	美国	264	88,360.21	0.02
496	Hanesbrands Inc	-	HBI US	纽约证券交易所	美国	694	83,703.39	0.02
497	Perrigo Co PLC	-	PRGO US	纽约证券交易所	美国	265	78,491.83	0.02
498	National Oilwell Varco Inc	-	NOV US	纽约证券交易所	美国	773	76,502.83	0.01
499	Unum Group	-	UNM US	纽约证券交易所	美国	405	74,304.07	0.01
500	Ralph Lauren Corp	-	RL US	纽约证券交易所	美国	96	73,062.18	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL US	7,658,941.84	2.36
2	Microsoft Corp	MSFT US	7,279,068.42	2.25
3	Amazon.com Inc	AMZN US	5,473,549.00	1.69
4	Alphabet Inc	GOOGL US	2,562,136.74	0.79
		GOOG US	2,434,809.74	0.75
5	Facebook Inc	FB US	2,842,763.40	0.88
6	Tesla Inc	TSLA US	2,075,822.31	0.64
7	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	1,915,033.92	0.59
8	JPMorgan Chase & Co	JPM US	1,856,583.09	0.57

9	Johnson & Johnson	JNJ US	1,696,868.58	0.52
10	Visa Inc	V US	1,457,103.20	0.45
11	UnitedHealth Group Inc	UNH US	1,414,629.00	0.44
12	NVIDIA Corp	NVDA US	1,382,930.25	0.43
13	Walt Disney Co/The	DIS US	1,341,553.89	0.41
14	Home Depot Inc/The	HD US	1,300,566.89	0.40
15	Procter & Gamble Co/The	PG US	1,288,280.40	0.40
16	Mastercard Inc	MA US	1,259,247.43	0.39
17	PayPal Holdings Inc	PYPL US	1,163,588.43	0.36
18	Bank of America Corp	BAC US	1,153,649.26	0.36
19	Comcast Corp	CMCSA US	1,012,082.18	0.31
20	Intel Corp	INTC US	973,623.08	0.30

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初基金资产净值 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	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	Apple Inc	AAPL US	459,526.25	0.14
2	Microsoft Corp	MSFT US	374,081.36	0.12
3	Amazon.com Inc	AMZN US	292,565.81	0.09
4	Alphabet Inc	GOOGL US	121,989.85	0.04
		GOOG US	111,462.38	0.03
5	Varian Medical Systems Inc	VAR US	186,602.50	0.06
6	DuPont De Nemours Inc.	DD US	151,685.43	0.05
7	Facebook Inc	FB US	138,610.95	0.04
8	Tiffany & Co	TIF US	135,085.64	0.04
9	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	128,767.44	0.04
10	Tesla Inc	TSLA US	124,503.52	0.04
11	Johnson & Johnson	JNJ US	92,513.07	0.03
12	FLIR Systems Inc	FLIR US	92,241.12	0.03
13	JPMorgan Chase & Co	JPM US	89,744.38	0.03
14	Visa Inc	V US	77,665.01	0.02
15	Procter & Gamble Co/The	PG US	72,208.10	0.02
16	NVIDIA Corp	NVDA US	71,440.17	0.02
17	UnitedHealth Group Inc	UNH US	71,177.59	0.02
18	Walt Disney Co/The	DIS US	70,804.06	0.02
19	Home Depot Inc/The	HD US	65,267.27	0.02
20	Mastercard Inc	MA US	64,506.74	0.02

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	132,124,545.67
卖出收入（成交）总额	7,708,267.41

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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Sep21	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则,根据《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-期货投资”与“证券清算款-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-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。期货投资的公允价值变动金额为 390,698.11 元,已包含在结算备付金中。

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 2020 年 12 月 10 日, 谷歌因违反隐私保护规定被法国国家信息与自由委员会 (CNIL) 处以 1 亿欧元的罚款。

2020 年 12 月 10 日, 谷歌因未经用户同意的情况下安装 cookie 被法国数据隐私监管机构 CNIL 处以 6000 万欧元的罚款。

2021 年 1 月 8 日, 谷歌因谷歌浏览器网页隐私问题被英国竞争与市场管理局 (CMA) 开展调查。

2021 年 5 月 13 日, 谷歌因滥用支配地位行为被意大利反垄断监管机构处以 1 亿欧元的罚款。

2021 年 6 月 3 日, 谷歌因在线广告技术领域可能的垄断行为被法国反垄断监管机构进行调查。

2021 年 6 月 4 日, 谷歌因新闻服务领域可能的垄断行为被德国的 Bundeskartellamt 国家竞争监管机构进行调查。

2021 年 6 月 22 日, 谷歌因在线广告技术领域可能的垄断行为被欧盟反垄断监管机构进行调查。

2021 年 6 月 25 日, 谷歌因虚假评论打击力度不足被英国 CMA 进行调查。

2020 年 7 月 8 日, 亚马逊涉嫌违反多项制裁令的要求, 向美制裁地区及个人售卖商品和服务, 将支付罚款 134,523 美元。

2020 年 12 月 10 日, 亚马逊因违反隐私保护规定被法国国家信息与自由委员会 (CNIL) 处以 3500 万欧元的罚款。

2021 年 2 月 2 日, 亚马逊集团因歪曲扣留司机消费的指控被迫向联邦贸易委员会 FTC 支付 6170 万美元。

2021 年 6 月 25 日, 亚马逊集团因虚假评论打击力度不足被英国 CMA 进行调查。

2020 年 9 月 29 日, 摩根大通因操纵贵金属和国债市场有关的不当行为被美国司法部、商品期货交易委员会和证券交易委员会处以 9.2 亿美元罚款。

2020 年 11 月 24 日, 摩根大通因未能对其信托业务维持足够的内部控制和内部审计被美国货币监理署(OCC)罚款 2.5 亿美元。

2021 年 1 月 6 日, NVIDIA 因收购 ARM 被英国竞争与市场管理局 (CMA) 开展反垄断调查。

2021 年 3 月 4 日, 苹果因涉嫌违反竞争法的行为被英国竞争与市场管理局 (CMA) 开展调查。

2021 年 3 月 20 日, 苹果因侵犯专利被美国得克萨斯州一联邦陪审团作出裁决, 判罚 3.085 亿美元。

2021 年 4 月 30 日, 苹果集团因垄断支付行为被欧盟反垄断委员会提出指控。

2021 年 4 月 1 日, Facebook 集团因对 Giphy 的收购被英国 CMA 进行调查。

2021 年 6 月 4 日, Facebook 集团因垄断数据行为被欧盟反垄断委员会进行调查。

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。除谷歌、Facebook、苹果、亚马逊、摩根大通、英伟达外, 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。

7.11.2 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	1,313,209.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	243,107.12
4	应收利息	3,935.01
5	应收申购款	3,163,389.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,723,641.11

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
69,901	4,320.71	75,299,163.43	24.93%	226,723,048.16	75.07%

注: 持有人户数及结构包含人民币份额及美元现汇份额。

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	马国芳	2,223,400.00	7.90%
2	任钢	1,706,415.00	6.06%
3	彭建军	1,058,000.00	3.76%
4	许可	1,000,000.00	3.55%
5	徐文芳	1,000,000.00	3.55%
6	安洁	986,555.00	3.50%
7	夏斌	729,160.00	2.59%
8	袁达能	676,400.00	2.40%
9	黄昱成	427,370.00	1.52%
10	凌震	374,918.00	1.33%

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	40,119.73	0.0133%

注：基金管理人的从业人员持有的本基金份额含易方达标普 500 指数（QDII-LOF）人民币份额及美元现汇份额。

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	0~10
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（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	693,199,312.42
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	211,864,079.23
本报告期基金总申购份额	168,200,829.04
减：本报告期基金总赎回份额	78,042,696.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	302,022,211.59

注：本基金份额变动含易方达标普 500 指数（QDII-LOF）人民币份额及美元现汇份额。

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 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟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，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。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

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	
Citigroup Global Markets Limited	1	138,540,798.61	99.34%	11,640.02	95.97%	-
Goldman Sachs	1	663,311.36	0.48%	410.76	3.39%	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	260,368.59	0.19%	78.14	0.64%	-
Everbright Securities (International) Limited	1	-	-	-	-	-
GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd.	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，无新增交易账户。

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
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Everbright Securities (International) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Futur	-	-	-	-	-	-	-	-

es (Hon g Kong) Co. Ltd.								
--	--	--	--	--	--	--	--	--

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	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）恢复大额申购业务的公告	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	2021-01-05
2	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2021 年 1 月 18 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2021-01-13
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2021-01-21
4	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	2021-01-23
5	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中欧财富为销售机构的公告	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	2021-03-16
6	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2021 年 4 月 2 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2021-03-30
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	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	2021-03-30
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报	2021-03-30
9	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	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	2021-04-02
10	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）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	2021-04-15
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-19
12	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）	证券时报、基金管理人网	2021-05-26

	2021 年 5 月 31 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	站及中国证监会基金电 子披露网站	
13	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）暂停大额申购业务的公告	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	2021-05-27
14	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）恢复大额申购业务的公告	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	2021-06-04
15	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2021 年 7 月 5 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	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	2021-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日