

# 易方达中小企业 100 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12	投资组合报告附注 .....	44
8	基金份额持有人信息 .....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	46
9	开放式基金份额变动 .....	47
10	重大事件揭示 .....	47
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4	基金投资策略的改变 .....	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	50
11	备查文件目录 .....	51
11.1	备查文件目录 .....	51
11.2	存放地点 .....	51
11.3	查阅方式 .....	51

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）
基金简称	易方达中小企业 100 指数（LOF）
场内简称	中小企业 100LOF
基金主代码	161118
交易代码	161118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 9 月 20 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	173,800,782.40 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	2012 年 10 月 25 日

注：自 2021 年 4 月 6 日起，易方达中小板指数证券投资基金（LOF）名称变更为易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式，以实现对业绩比较基准的紧密跟踪，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资，即按照中小企业 100 指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，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、股指期货投资策略等。
业绩比较基准	中小企业 100 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高预期风险、高预期收益品种。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

### 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	姓名	张南	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102

负责人	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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,096,602.81
本期利润	14,071,908.74
加权平均基金份额本期利润	0.0778
本期加权平均净值利润率	5.03%
本期基金份额净值增长率	5.25%
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	-25,601,643.20
期末可供分配基金份额利润	-0.1473
期末基金资产净值	280,638,398.21
期末基金份额净值	1.6147
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	109.78%
-------------	---------

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	3.58%	1.02%	3.09%	1.03%	0.49%	-0.01%
过去三个月	11.90%	1.09%	10.73%	1.10%	1.17%	-0.01%
过去六个月	5.25%	1.47%	3.55%	1.48%	1.70%	-0.01%
过去一年	27.42%	1.47%	22.35%	1.48%	5.07%	-0.01%
过去三年	57.24%	1.56%	50.33%	1.56%	6.91%	0.00%
自基金合同生效起至今	109.78%	1.64%	124.01%	1.60%	-14.23%	0.04%

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

易方达中小企业 100 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

(2012 年 9 月 20 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 109.78%，同期业绩比较基准收益率为 124.01%。

## 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		
刘树荣	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	2017-07-18	-	14 年	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

<p>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、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、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、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金（LOF）的基金经理</p>				<p>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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、

勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金主要采取完全复制法投资策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2021 年上半年，国内股票市场分化显著。春节前，以大盘蓝筹为代表的机构重仓股涨幅较大，而以中证 1000 为代表的小市值股票却持续走低。春节后，大宗商品价格显著走强，通胀预期带来的名义利率上行对全球股票估值都构成了显著压力，市场风险偏好显著下降，国内股票市场出现大幅回调，前期剧烈的市场分化有所收敛。股票市场的整体下跌趋势直到一季度末才有所缓解，步入震荡区间。二季度，市场风险偏好有所修复，指数震荡上行，但结构分化依然明显。季初流动性宽松推动前期调整幅度较大的机构重仓股走出了一轮估值修复行情。5 月初开始，市场关注点逐步从流动性切换到企业盈利，市场风格从周期向成长切换。整体而言，2021 年上半年，电气设备、钢铁、化工行业表现强势，而家用电器、非银行金融、房地产行业表现较弱。本基金所跟踪的中小企业 100 指数行业权重占比最大的是信息技术行业，受市场风格影响较大，一季度周期类风格占优，指数表

现较弱；二季度科技类成长风格占优，指数表现较好。

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，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.6147 元，本报告期份额净值增长率为 5.25%，同期业绩比较基准收益率为 3.55%，年化跟踪误差 0.51%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对国内经济高位回落的预期已有较长时间，但二季度 GDP 环比增速和复合增速均较一季度明显提升，6 月多数经济指标也偏强，指向当前经济总体仍偏强、总体不差。展望下半年经济增长虽然会放缓，但更多是回到疫情前正常的水平，实质性下行的迹象尚不明显，宏观经济仍将保持平稳运行。近年来，证券市场分化已成为一种常态，但市场上没有不变的热点，不变的只有风格切换和行业轮动。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经济增长的优质指数产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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：易方达中小企业 100 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	17,495,930.46	16,024,679.24

结算备付金		15,590.21	49,003.74
存出保证金		17,869.45	17,562.14
交易性金融资产	6.4.7.2	264,875,089.12	259,072,230.40
其中：股票投资		264,652,476.16	258,942,231.54
基金投资		-	-
债券投资		222,612.96	129,998.86
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		703,551.52	1,956,237.89
应收利息	6.4.7.5	1,481.58	1,617.97
应收股利		-	-
应收申购款		591,143.31	717,465.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		283,700,655.65	277,838,796.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31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		2,509,935.28	2,972,430.96
应付管理人报酬		226,720.29	227,198.09
应付托管费		49,878.44	49,983.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	48,201.76	42,932.53
应交税费		0.58	0.39
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,521.09	289,192.65
负债合计		3,062,257.44	3,581,738.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	133,778,579.50	137,610,246.96
未分配利润	6.4.7.10	146,859,818.71	136,646,811.38
所有者权益合计		280,638,398.21	274,257,058.34
负债和所有者权益总计		283,700,655.65	277,838,796.56

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6147 元，基金份额总额 173,800,782.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中小企业 100 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
<b>一、收入</b>		<b>16,133,353.69</b>	<b>42,397,352.78</b>
1.利息收入		31,102.72	61,415.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,998.60	61,283.81
债券利息收入		104.12	131.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,966,500.01	15,376,557.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,513,823.75	13,714,055.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,274.27	207,145.92
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,440,401.99	1,455,356.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,024,694.07	26,773,726.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	160,445.03	185,653.17
<b>减：二、费用</b>		<b>2,061,444.95</b>	<b>1,952,138.96</b>
1. 管理人报酬		1,391,041.44	1,214,937.13
2. 托管费		306,029.10	267,286.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	143,870.77	238,349.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.11	0.51
7. 其他费用	6.4.7.19	220,503.53	231,565.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>14,071,908.74</b>	<b>40,445,213.82</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>14,071,908.74</b>	<b>40,445,213.82</b>

## 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 易方达中小企业 100 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)	137,610,246.96	136,646,811.38	274,257,058.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	14,071,908.74	14,071,908.74
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)	-3,831,667.46	-3,858,901.41	-7,690,568.87
其中: 1.基金申购款	53,461,643.04	55,800,444.28	109,262,087.32
2.基金赎回款	-57,293,310.50	-59,659,345.69	-116,952,656.19
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)	133,778,579.50	146,859,818.71	280,638,398.21
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)	176,706,749.38	65,571,778.80	242,278,528.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	40,445,213.82	40,445,213.82
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)	-31,586,867.65	-12,233,654.19	-43,820,521.84
其中: 1.基金申购款	96,138,957.64	44,598,910.78	140,737,868.42
2.基金赎回款	-127,725,825.29	-56,832,564.97	-184,558,390.26
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)	145,119,881.73	93,783,338.43	238,903,220.16

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

易方达中小板指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]680 号《关于核准易方达中小板指数分级证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 401,094,727.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 69,225.16 份基金份额。根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金为契约型开放式基金，自基金合同生效日起的 7 年内（含 7 年）为本基金的分级运作期，本基金采取分级运作方式，7 年届满后自动转换为上市开放式基金（LOF）。此外，若本基金在分级运作期内发生分级运作期提前结束的情形，本基金将提前转换为上市开放式基金（LOF）。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定，分级运作期届满，易方达中小板指数分级证券投资基金于 2019 年 9 月 20 日自动转换为上市开放式基金（LOF），其中易基中小板基础份额转换为易基中小板份额，易基中小板 A 类份额及易基中小板 B 类份额折算为易基中小板份额，基金名称变更为“易方达中小板指数证券投资基金（LOF）”，转换后场内易基中小板份额在深圳证券交易所上市交易。

自 2021 年 4 月 6 日起，易方达中小板指数证券投资基金（LOF）名称变更为易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）。

### 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 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

##### （1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### （2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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。

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	17,495,930.46
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	17,495,930.46

#### 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	178,610,690.84	264,652,476.16	86,041,785.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	188,400.00	222,612.96
	银行间市场	-	-
	合计	188,400.00	222,612.96
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	178,799,090.84	264,875,089.12	86,075,998.28

#### 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,446.38
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	6.30
应收债券利息	21.70
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	7.20
合计	1,481.58

#### 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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	48,201.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	48,201.76

#### 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	8,508.16
应付证券出借违约金	-
预提费用	119,012.93
其他应付款	100,000.00
合计	227,521.09

#### 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	178,778,759.69	137,610,246.96
本期申购	69,455,724.65	53,461,643.04
本期赎回 (以“-”号填列)	-74,433,701.94	-57,293,310.50
本期末	173,800,782.40	133,778,579.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 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
上年度末	-45,335,742.00	181,982,553.38	136,646,811.38
本期利润	19,096,602.81	-5,024,694.07	14,071,908.74
本期基金份额交易产生的变动数	637,495.99	-4,496,397.40	-3,858,901.41
其中：基金申购款	-15,358,161.35	71,158,605.63	55,800,444.28
基金赎回款	15,995,657.34	-75,655,003.03	-59,659,345.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,601,643.20	172,461,461.91	146,859,818.71

## 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	30,009.03
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	512.11
其他	477.46
合计	30,998.60

## 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	55,204,394.10
减：卖出股票成本总额	35,690,570.35
买卖股票差价收入	19,513,823.75

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	650,066.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	637,694.70
减：应收利息总额	97.65
买卖债券差价收入	12,274.27

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 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	1,440,401.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,440,401.99

#### 6.4.7.16 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	-5,024,694.07
——股票投资	-5,058,907.03
——债券投资	34,212.96
——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	-
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	-5,024,694.07

#### 6.4.7.17 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	160,445.03
其他	-
合计	160,445.03

#### 6.4.7.18 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	143,870.77
银行间市场交易费用	-

合计	143,870.77
----	------------

#### 6.4.7.19 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,490.60
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	220,503.53

#### 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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,391,041.44	1,214,937.13
其中：支付销售机构的客户维护费	299,890.41	226,182.62

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 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，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 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
当期发生的基金应支付的托管费	306,029.10	267,286.16

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 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，支付日期顺延。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	17,495,930.46	30,009.03	14,593,913.11	57,991.21

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保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

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（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**

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

300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	336	8,265.60	54,768.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

				受限						
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984. 80	9,207. 20	-
30095 3	震裕 科技	2021-0 3-11	2021-0 9-22	新股 流通 受限	28.77	99.85	240	6,904. 80	23,964 .00	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834. 96	10,688 .24	-
30095 6	英力 股份	2021-0 3-16	2021-0 9-27	新股 流通 受限	12.85	25.80	371	4,767. 35	9,571. 80	-
30095 7	贝泰 妮	2021-0 3-18	2021-0 9-27	新股 流通 受限	47.33	251.96	237	11,217 .21	59,714 .52	-
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826. 72	5,396. 04	-
30096 1	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	新股 流通 受限	8.48	22.07	394	3,341. 12	8,695. 58	-
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958. 40	9,429. 12	-
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432. 79	6,364. 67	-
30096 6	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	新股 流通 受限	8.24	31.54	286	2,356. 64	9,020. 44	-
30096 8	格林 精密	2021-0 4-06	2021-1 0-15	新股 流通 受限	6.87	12.07	1,162	7,982. 94	14,025 .34	-
30097 2	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 流通 受限	7.19	12.65	430	3,091. 70	5,439. 50	-
30097 3	立高 食品	2021-0 4-08	2021-1 0-15	新股 流通 受限	28.28	115.71	273	7,720. 44	31,588 .83	-
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696. 16	6,410. 76	-
30097	东箭	2021-0	2021-1	新股	8.42	13.60	593	4,993.	8,064.	-

8	科技	4-15	0-26	流通受限				06	80	
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	366	12,158.52	32,025.00	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2021-0 7-05	新股 流通 受限	8.86	8.86	4,995	44,255 .70	44,255 .70	-
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,917. 30	4,917. 30	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,609	24,681 .14	24,681 .14	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	290	2,743. 40	2,743. 40	-

**6.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
12703 8	国微 转债	2021-0 6-10	2021-0 7-14	新发 流通 受限	100.00	100.00	780	78,000 .00	78,000 .00	-

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

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00202 4	苏宁易 购	2021-06 -16	重大事 项停牌	5.59	2021-0 7-06	6.15	280,994	2,969,537.31	1,570,756.46	-

**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。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 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 0.08%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

##### 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	上年度末
--------	-----	------

	2021年6月30日	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	130,009.12
AAA 以下	222,634.66	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	222,634.66	130,009.12

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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	17,495,930.46	-	-	-	17,495,930.46
结算备付金	15,590.21	-	-	-	15,590.21
存出保证金	17,869.45	-	-	-	17,869.45

交易性金融资产	-	-	222,612.96	264,652,476.16	264,875,089.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	703,551.52	703,551.52
应收利息	-	-	-	1,481.58	1,481.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	29,468.21	-	-	561,675.10	591,143.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,558,858.33	-	222,612.96	265,919,184.36	283,700,655.65
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	-	-	-	2,509,935.28	2,509,935.28
应付管理人报酬	-	-	-	226,720.29	226,720.29
应付托管费	-	-	-	49,878.44	49,878.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	48,201.76	48,201.76
应交税费	-	-	-	0.58	0.58
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	227,521.09	227,521.09
负债总计	-	-	-	3,062,257.44	3,062,257.44
利率敏感度缺口	17,558,858.33	-	222,612.96	262,856,926.92	280,638,398.21
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	16,024,679.24	-	-	-	16,024,679.24
结算备付金	49,003.74	-	-	-	49,003.74
存出保证金	17,562.14	-	-	-	17,562.14
交易性金融资产	-	-	129,998.86	258,942,231.54	259,072,230.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,956,237.89	1,956,237.89
应收利息	-	-	-	1,617.97	1,617.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	83,567.49	-	-	633,897.69	717,465.18
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,174,812.61	-	129,998.86	261,533,985.09	277,838,796.56
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,972,430.96	2,972,430.96
应付管理人报酬	-	-	-	227,198.09	227,198.09
应付托管费	-	-	-	49,983.60	49,983.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	42,932.53	42,932.53
应交税费	-	-	-	0.39	0.39
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	289,192.65	289,192.65
负债总计	-	-	-	3,581,738.22	3,581,738.22
利率敏感度缺口	16,174,812.61	-	129,998.86	257,952,246.87	274,257,058.34

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净

值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	264,652,476.16	94.30	258,942,231.54	94.42
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	264,652,476.16	94.30	258,942,231.54	94.42

#### 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%	13,910,301.55	13,581,045.35
	2.业绩比较基准下降 5%	-13,910,301.55	-13,581,045.35

#### 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 262,676,280.16 元，属于第二层次的余额为 2,198,808.96 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 257,886,400.81 元，第二层次 1,185,829.59 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

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	264,652,476.16	93.29
	其中：股票	264,652,476.16	93.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	222,612.96	0.08
	其中：债券	222,612.96	0.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,511,520.67	6.17
8	其他各项资产	1,314,045.86	0.46
9	合计	283,700,655.65	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,723,299.46	3.82
B	采矿业	869,201.00	0.31
C	制造业	186,600,826.25	66.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,192,422.00	0.42
E	建筑业	752,297.04	0.27
F	批发和零售业	1,653,228.80	0.59

G	交通运输、仓储和邮政业	8,491,038.04	3.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,537,410.58	8.74
J	金融业	17,830,097.38	6.35
K	房地产业	628,459.56	0.22
L	租赁和商务服务业	7,788,806.68	2.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,840,409.00	0.66
Q	卫生和社会工作	1,708,708.04	0.61
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	264,652,476.16	94.30

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	273,811	17,660,809.50	6.29
2	002475	立讯精密	301,827	13,884,042.00	4.95
3	002594	比亚迪	55,048	13,817,048.00	4.92
4	002714	牧原股份	160,478	9,760,271.96	3.48
5	002142	宁波银行	218,863	8,529,091.11	3.04
6	002304	洋河股份	38,337	7,943,426.40	2.83
7	002230	科大讯飞	117,085	7,912,604.30	2.82
8	002352	顺丰控股	109,100	7,386,070.00	2.63
9	002812	恩捷股份	30,300	7,093,230.00	2.53
10	002241	歌尔股份	158,964	6,794,121.36	2.42
11	002027	分众传媒	703,748	6,622,268.68	2.36
12	002460	赣锋锂业	54,100	6,550,969.00	2.33
13	002271	东方雨虹	112,503	6,223,665.96	2.22
14	002129	中环股份	144,433	5,575,113.80	1.99
15	002410	广联达	66,751	4,552,418.20	1.62
16	002049	紫光国微	29,045	4,478,448.55	1.60
17	002311	海大集团	52,894	4,316,150.40	1.54
18	002371	北方华创	15,200	4,216,176.00	1.50

19	002709	天赐材料	38,900	4,145,962.00	1.48
20	002821	凯莱英	10,059	3,747,983.40	1.34
21	002493	荣盛石化	208,400	3,599,068.00	1.28
22	002179	中航光电	36,971	2,921,448.42	1.04
23	002050	三花智控	120,770	2,896,064.60	1.03
24	002074	国轩高科	65,130	2,837,062.80	1.01
25	002340	格林美	300,965	2,814,022.75	1.00
26	002841	视源股份	22,500	2,796,525.00	1.00
27	002001	新和成	91,338	2,619,573.84	0.93
28	002601	龙蟠佰利	75,480	2,610,098.40	0.93
29	002568	百润股份	25,829	2,448,330.91	0.87
30	002236	大华股份	115,997	2,447,536.70	0.87
31	002008	大族激光	57,092	2,305,945.88	0.82
32	002185	华天科技	144,500	2,223,855.00	0.79
33	002007	华兰生物	60,374	2,214,518.32	0.79
34	002202	金风科技	172,380	2,096,140.80	0.75
35	002736	国信证券	193,905	2,084,478.75	0.74
36	002624	完美世界	86,032	2,057,025.12	0.73
37	002555	三七互娱	83,100	1,996,062.00	0.71
38	002607	中公教育	88,100	1,840,409.00	0.66
39	002384	东山精密	86,700	1,806,828.00	0.64
40	002044	美年健康	187,564	1,708,708.04	0.61
41	002459	晶澳科技	34,800	1,705,200.00	0.61
42	002405	四维图新	114,976	1,690,147.20	0.60
43	002797	第一创业	236,460	1,688,324.40	0.60
44	002024	苏宁易购	280,994	1,570,756.46	0.56
45	002353	杰瑞股份	35,000	1,564,500.00	0.56
46	002920	德赛西威	14,200	1,563,136.00	0.56
47	002223	鱼跃医疗	40,794	1,555,475.22	0.55
48	002252	上海莱士	206,492	1,546,625.08	0.55
49	002600	领益智造	162,500	1,493,375.00	0.53
50	002508	老板电器	31,260	1,453,590.00	0.52
51	002414	高德红外	52,128	1,437,690.24	0.51
52	002791	坚朗五金	7,400	1,435,970.00	0.51
53	002602	世纪华通	221,096	1,419,436.32	0.51
54	002013	中航机电	135,512	1,364,605.84	0.49
55	002439	启明星辰	46,007	1,334,663.07	0.48
56	002064	华峰化学	93,100	1,322,020.00	0.47
57	002180	纳思达	40,900	1,316,980.00	0.47
58	002078	太阳纸业	97,500	1,301,625.00	0.46
59	002385	大北农	187,743	1,276,652.40	0.45
60	002938	鹏鼎控股	35,566	1,276,108.08	0.45
61	002422	科伦药业	63,230	1,261,438.50	0.45
62	002507	涪陵榨菜	33,053	1,244,775.98	0.44

63	002463	沪电股份	79,800	1,234,506.00	0.44
64	002080	中材科技	47,100	1,232,607.00	0.44
65	002916	深南电路	11,056	1,228,653.28	0.44
66	003816	中国广核	446,600	1,192,422.00	0.42
67	002456	欧菲光	132,887	1,180,036.56	0.42
68	002127	南极电商	119,400	1,166,538.00	0.42
69	002075	沙钢股份	106,700	1,164,097.00	0.41
70	002373	千方科技	66,300	1,107,210.00	0.39
71	002120	韵达股份	81,668	1,104,968.04	0.39
72	002157	正邦科技	92,200	1,101,790.00	0.39
73	002603	以岭药业	37,700	1,099,332.00	0.39
74	002152	广电运通	79,029	1,029,747.87	0.37
75	002673	西部证券	122,776	1,012,902.00	0.36
76	002065	东华软件	127,048	1,007,490.64	0.36
77	002926	华西证券	99,900	962,037.00	0.34
78	002299	圣农发展	40,100	957,588.00	0.34
79	002572	索菲亚	39,000	943,800.00	0.34
80	002500	山西证券	135,272	907,675.12	0.32
81	002690	美亚光电	16,100	897,736.00	0.32
82	002683	宏大爆破	31,300	869,201.00	0.31
83	002019	亿帆医药	49,700	857,325.00	0.31
84	002966	苏州银行	115,900	851,865.00	0.30
85	002958	青农商行	192,300	823,044.00	0.29
86	002294	信立泰	23,856	784,862.40	0.28
87	002372	伟星新材	37,100	766,857.00	0.27
88	002081	金螳螂	94,987	752,297.04	0.27
89	002558	巨人网络	56,200	747,460.00	0.27
90	002153	石基信息	30,323	712,893.73	0.25
91	002939	长城证券	63,000	701,190.00	0.25
92	002032	苏泊尔	10,514	670,688.06	0.24
93	002925	盈趣科技	16,420	638,902.20	0.23
94	002146	荣盛发展	111,429	628,459.56	0.22
95	002563	森马服饰	48,300	577,185.00	0.21
96	002773	康弘药业	21,500	497,295.00	0.18
97	002705	新宝股份	18,900	496,125.00	0.18
98	002945	华林证券	19,500	269,490.00	0.10
99	002532	天山铝业	30,900	259,251.00	0.09
100	002901	大博医疗	3,000	218,670.00	0.08
101	300957	贝泰妮	237	59,714.52	0.02
102	300919	中伟股份	336	54,768.00	0.02
103	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
104	300979	华利集团	366	32,025.00	0.01
105	300973	立高食品	273	31,588.83	0.01
106	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01

107	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
108	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
109	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
110	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
111	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
112	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
113	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
114	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
115	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
116	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
117	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
118	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
119	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
120	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
121	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
122	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
123	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
124	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
125	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
126	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
127	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
128	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
129	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
130	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
131	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
132	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
133	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
134	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
135	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
136	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
137	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
138	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
139	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
140	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
141	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
142	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
143	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
144	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
145	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
146	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
147	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	3,971,788.00	1.45
2	002415	海康威视	2,733,726.00	1.00
3	002568	百润股份	2,080,481.22	0.76
4	002475	立讯精密	1,834,886.00	0.67
5	002594	比亚迪	1,513,632.00	0.55
6	002714	牧原股份	1,508,356.00	0.55
7	002352	顺丰控股	1,218,640.00	0.44
8	002142	宁波银行	1,203,917.00	0.44
9	002812	恩捷股份	1,196,252.00	0.44
10	002607	中公教育	1,110,132.00	0.40
11	002493	荣盛石化	1,043,214.50	0.38
12	002241	歌尔股份	1,021,879.00	0.37
13	002027	分众传媒	1,015,046.00	0.37
14	002129	中环股份	975,302.00	0.36
15	002304	洋河股份	974,128.00	0.36
16	002460	赣锋锂业	887,415.00	0.32
17	002271	东方雨虹	756,629.00	0.28
18	002230	科大讯飞	719,679.00	0.26
19	002459	晶澳科技	686,908.00	0.25
20	002920	德赛西威	646,632.00	0.24

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

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	2,542,448.44	0.93
2	002415	海康威视	2,266,056.00	0.83
3	002475	立讯精密	2,264,964.90	0.83
4	002714	牧原股份	2,226,541.00	0.81
5	002142	宁波银行	2,123,404.40	0.77
6	002352	顺丰控股	1,719,474.00	0.63
7	002304	洋河股份	1,651,707.00	0.60
8	002027	分众传媒	1,579,019.00	0.58
9	002465	海格通信	1,420,266.14	0.52
10	002230	科大讯飞	1,237,870.10	0.45

11	002241	歌尔股份	1,145,870.00	0.42
12	002271	东方雨虹	1,118,009.00	0.41
13	002460	赣锋锂业	965,855.00	0.35
14	002007	华兰生物	926,861.00	0.34
15	002049	紫光国微	771,871.00	0.28
16	002281	光迅科技	746,568.00	0.27
17	002410	广联达	726,871.00	0.27
18	002841	视源股份	700,090.00	0.26
19	002601	龙麟佰利	620,853.00	0.23
20	002001	新和成	616,912.00	0.22

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	46,459,722.00
卖出股票收入（成交）总额	55,204,394.10

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	222,612.96	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	222,612.96	0.08

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127036	三花转债	1,104	144,612.96	0.05
2	127038	国微转债	780	78,000.00	0.03

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。

2021 年 6 月 10 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款人民币 25 万元的行政处罚决定：代理销售保险不规范。

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。

**7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。**

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,869.45
2	应收证券清算款	703,551.52
3	应收股利	-
4	应收利息	1,481.58
5	应收申购款	591,143.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,314,045.86

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例

22,615	7,685.20	26,705,888.56	15.37%	147,094,893.84	84.63%
--------	----------	---------------	--------	----------------	--------

## 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	杨翠凤	13,481,978.00	36.10%
2	蒋时秀	4,637,644.00	12.42%
3	陈能春	532,103.00	1.42%
4	张永宏	368,912.00	0.99%
5	陈俊英	328,008.00	0.88%
6	唐顺尧	290,105.00	0.78%
7	赵建雄	281,141.00	0.75%
8	钱君	280,153.00	0.75%
9	窦晓鸣	250,000.00	0.67%
10	程玉恩	245,513.00	0.66%

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	1,272.41	0.0007%

## 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（2012 年 9 月 20 日）基金份额总额	401,094,727.69
本报告期期初基金份额总额	178,778,759.69
本报告期基金总申购份额	69,455,724.65
减：本报告期基金总赎回份额	74,433,701.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	173,800,782.40

## 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	
招商证券	1	3,473,991.00	3.48%	2,779.14	3.48%	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	20,049,665.41	20.10%	16,039.78	20.10%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	76,237,747.83	76.42%	60,989.74	76.42%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-

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

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华西证券	316,171.70	48.64%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	131,170.00	20.18%	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	202,724.92	31.19%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-01-21
2	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
3	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加万得基金为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-01
4	易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数证券投资基金（LOF）变更基金名称及修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12

5	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	中国证券报	2021-03-30
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
7	易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数证券投资基金（LOF）变更基金名称、基金简称的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证券报	2021-04-19

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达中小板指数分级证券投资基金募集的文件；
2. 易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数证券投资基金（LOF）变更基金名称、基金简称的公告；
3. 《易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
4. 《易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
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