

# 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

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	76
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	76
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	76
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	76
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	76
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	77
8.12	投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>78</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	78
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	79
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>79</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>79</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	79
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	80
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4	基金投资策略的改变 .....	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	80
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8	其他重大事件 .....	83
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>85</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	85
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>85</b>
13.1	备查文件目录 .....	85
13.2	存放地点 .....	86
13.3	查阅方式 .....	86

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 易基、MSCIA 股 ETF 易方达
基金主代码	512090
交易代码	512090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 17 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	325,592,316.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 6 月 1 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律</p>

	法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index)收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特 殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中 心42楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	1,893,385.19	-18,083,001.76	95,495,861.22
本期利润	-41,387,225.37	-109,189,821.31	40,530,437.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1325	-0.3481	0.1152
本期加权平均净值利润率	-8.99%	-22.42%	6.56%
本期基金份额净值增长率	-9.08%	-18.06%	6.43%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	112,948,079.42	151,941,386.47	258,168,575.11
期末可供分配基金份额利润	0.3469	0.4814	0.8078
期末基金资产净值	438,540,395.42	467,533,702.47	577,760,891.11
期末基金份额净值	1.3469	1.4814	1.8078
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	34.69%	48.14%	80.78%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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
过去三个月	-5.87%	0.78%	-6.42%	0.78%	0.55%	0.00%
过去六个月	-8.28%	0.82%	-10.40%	0.83%	2.12%	-0.01%
过去一年	-9.08%	0.81%	-12.83%	0.81%	3.75%	0.00%
过去三年	-20.71%	1.09%	-31.35%	1.10%	10.64%	-0.01%
过去五年	62.14%	1.19%	22.01%	1.20%	40.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	34.69%	1.21%	-5.50%	1.23%	40.19%	-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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 5 月 17 日至 2023 年 12 月 31 日)



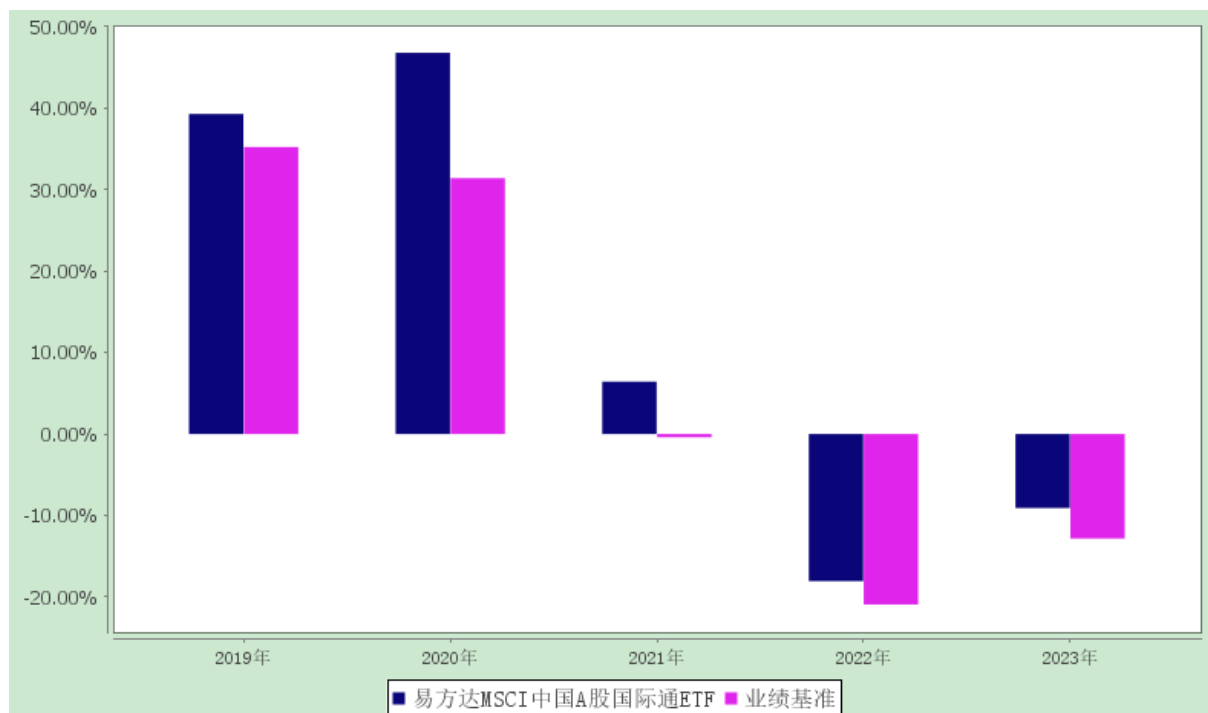
注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 34.69%，同期业绩比较基准收益率为 -5.50%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，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、另类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		
F A	本基金的基金经理，易方达黄金ETF联接（自2017年03月25日至	2018-05-17	2023-08-19	18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

N BI N G ( 范 冰 )	2023 年 08 月 18 日)、易方达黄金 ETF(自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 08 月 18 日)、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) (自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF) (自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达原油 (QDII-LOF-FOF) (自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 03 月 03 日)、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) (自 2017 年 06 月 27 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式(自 2019 年 03 月 13 日至 2023 年 08 月 18 日)、易方达日兴资管日经 225ETF (QDII) (自 2019 年 06 月 12 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达中证香港证券投资主题 ETF(自 2020 年 03 月 13 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达中证龙头企业指数、易方达恒生港股通新经济 ETF(自 2022 年 03 月 03 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理, 指数投资决策委员会委员, 易方达资产管理(香港)有限公司首席投资官(国际指数)、就证券提供意见负责人员 (RO)、提供资产管理负责人员 (RO)、投资决策委员会委员				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师、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管, 贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理, 易方达基金管理有限公司易方达标普消费品指数增强 (QDII)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达恒生科技 ETF (QDII) 的基金经理, 易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、国际指数部部门总监。
宋 钊 贤	本基金的基金经理, 易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证国有企业改革指数 (LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证香港证券投资主题 ETF、易方达中证石化产业 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证现代农业主题	2020-09-05	-	9 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员、投资经理助理、投资经理。

ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达中证装备产业 ETF、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达中证全指建筑材料 ETF、易方达中证装备产业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证沪港深 300ETF、易方达中证龙头企业指数、易方达北证 50 成份指数、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达 MSCI 美国 50ETF (QDII) 的基金经理助理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理				
--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中

交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 47 次，其中 40 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，该指数旨在追踪随着时间推移部分 A 股逐渐被纳入 MSCI 新兴市场指数的过程。目前在每次指数审议时，纳入标的指数的成份股来自 MSCI 中国指数中的中国 A 股成份股。标的指数编制方法基于 MSCI 全球可投资市场指数的编制方法。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2023 年，面对复杂严峻的国际环境和艰巨繁重的国内改革发展稳定任务，我国有序实现疫情防控平稳转段，经济社会全面恢复常态化运行，以稳增长、稳就业、稳物价为导向的宏观经济政策协

同发力取得成效，国民经济总体保持了回升向好、持续修复的趋势，供给和需求两端稳步改善，产业转型升级和新动能的培育持续推进，高技术产业保持较快增长势头。根据国家统计局发布的 2023 年全年经济数据，我国国内生产总值按不变价格计算同比上年增长 5.2%，全国规模以上工业增加值同比增长 4.6%，服务业增加值同比增长 5.8%，社会消费品同比增长 7.2%，货物进出口总额保持正增长。另一方面，世界百年未有之大变局加速演进，我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力以及外部环境风险因素增多的挑战。报告期内 A 股市场整体呈现波动下行趋势，各行业板块上市公司的收益率出现较为显著的分化。行业方面，通信、传媒、计算机等行业表现居前，美容护理、商贸零售、房地产等行业表现相对落后。

MSCI 中国 A 股国际通指数成份股涵盖了互联互通机制下 A 股市场中具有代表性的大盘和中盘上市公司，行业分布较为均衡，本报告期内下跌 12.83%。报告期内，资本市场关键制度建设持续推进，互联互通机制不断发展完善，未来国际投资者投资中国市场的渠道和资产类别将更加丰富。长期视角下，随着我国资本市场高水平双向开放有序推进，A 股上市公司整体结构持续优化，回报股东能力将显著增强，A 股在 MSCI 等国际主流指数体系中的重要性将逐步提升，国际资本对于 A 股的配置比例也有望增加。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3469 元，本报告期份额净值增长率为-9.08%，同期业绩比较基准收益率为-12.83%，年化跟踪误差 0.49%，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

展望 2024 年，我国经济仍将延续恢复态势，高质量发展迈入新的阶段，新旧增长动能转换进程有望加快，宏观政策将坚持稳中求进、以进促稳、先立后破的总基调，着力巩固和增强经济回升向好的基础。随着积极的财政政策适度加力、提质增效，稳健的货币政策保持灵活适度，房地产政策的进一步优化调整，以及各项稳就业、促销费、扩大高水平对外开放和提升关键产业核心竞争力政策举措“组合拳”的落地生效，有助于改善社会预期，提振市场主体信心，疏通制约发展的堵点和难点，从而推动企业利润和居民收入的有效修复。我国拥有齐全完备的产业体系、超大规模国内市场、潜力巨大的外贸市场以及政策空间充足等优势，支撑经济平稳健康发展的有利因素较多，国民经济发展长期向好、前景光明的大趋势没有改变。另一方面，现阶段我国经济持续稳定恢复仍面临着内生需求不足、债务风险有待化解、部分企业经营困难等问题和挑战。此外，全球经济下行压力加大，

各国进入选举年等事件性因素可能引发地缘政治冲突和贸易摩擦风险加剧，严峻复杂的外部环境对我国经济发展的影响亦不容忽视。

资本市场方面，A 股市场大部分行业板块经历了 2023 年的震荡回调，大盘蓝筹指数的整体估值水平已经回落到历史可比较低水平，作为长期资产配置的安全边际得到提升。2024 年 A 股市场有望受益于我国经济企稳复苏，美联储转向宽松后全球流动性拐点来临，以及资本市场深化改革和双向开放持续推进的背景下上市公司质量稳步提升等积极因素，A 股优质权益资产的中长期配置价值将持续显现。

作为被动型投资基金，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，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续督促廉洁从业、执业操守和道德规范等规定贯彻落实，积极开展形式多样的文化宣导，引导员工树立正确的价值观、事业观、职业观，不断推动建设风清气正的公司及行业生态环境。

(2) 持续完善投资合规监控手段，协同投资、研究、交易等业务部门完善相应的内控机制，共同巩固投资合规内控防线。升级风控系统，提升投资合规监控工作效能，有效保障各类资产组合的合规运作。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，提升产品合规审查质效；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，坚持以投资者视角审核基金宣传推介材料，持续加强对网络直播、自媒体账号、对外言论发布、投资者交流等重点领域的合规管理。深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化水平和合规风险控制能力，做好公

司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，探索优化风险评估识别方法，加强客户尽职调查，全面提高反洗钱工作的履职质效。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，聘请律师事务所完成年度合规有效性评估工作，从不同视角更加全面审视公司合规内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 24388 号

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

### 6.1 审计意见

#### (一)我们审计的内容

我们审计了易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

#### (二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。



## 6.2 形成审计意见的基础

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

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

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵珏 成磊

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	10,259,758.59	10,731,413.46
结算备付金		1,646,868.82	2,141,777.67
存出保证金		1,266,328.95	1,478,421.62
交易性金融资产	7.4.7.2	425,798,662.10	453,794,004.89
其中：股票投资		425,798,662.10	453,794,004.89

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		149,146.42	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>439,120,764.88</b>	<b>468,145,617.64</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		21,887.07	263,097.69
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		54,439.56	59,882.33
应付托管费		18,146.53	19,960.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.6	485,896.30	268,974.32
<b>负债合计</b>		<b>580,369.46</b>	<b>611,915.17</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	325,592,316.00	315,592,316.00
未分配利润	7.4.7.8	112,948,079.42	151,941,386.47
<b>净资产合计</b>		<b>438,540,395.42</b>	<b>467,533,702.47</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>439,120,764.88</b>	<b>468,145,617.64</b>

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3469 元，基金份额总额 325,592,316.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-40,045,753.95</b>	<b>-107,762,145.71</b>
1.利息收入		70,085.59	78,116.70
其中：存款利息收入	7.4.7.9	70,085.59	78,116.70
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）		3,218,039.84	-17,324,327.59
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-5,689,521.14	-24,706,280.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	69,007.24	447,893.52
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-1,550,813.95	-2,791,085.07
股利收益	7.4.7.14	10,389,367.69	9,725,144.34

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-43,280,610.56	-91,106,819.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-53,268.82	590,884.73
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,341,471.42</b>	<b>1,427,675.60</b>
1. 管理人报酬		691,354.21	733,066.58
2. 托管费		230,451.53	244,355.55
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.09	0.48
8. 其他费用	7.4.7.18	419,665.59	450,252.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-41,387,225.37</b>	<b>-109,189,821.31</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-41,387,225.37</b>	<b>-109,189,821.31</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-41,387,225.37</b>	<b>-109,189,821.31</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	315,592,316.00	151,941,386.47	467,533,702.47
二、本期期初净资产	315,592,316.00	151,941,386.47	467,533,702.47

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,000,000.00	-38,993,307.05	-28,993,307.05
（一）、综合收益总额	-	-41,387,225.37	-41,387,225.37
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	10,000,000.00	2,393,918.32	12,393,918.32
其中：1.基金申购款	36,000,000.00	16,263,976.43	52,263,976.43
2.基金赎回款	-26,000,000.00	-13,870,058.11	-39,870,058.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	325,592,316.00	112,948,079.42	438,540,395.42
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	319,592,316.00	258,168,575.11	577,760,891.11
二、本期期初净资产	319,592,316.00	258,168,575.11	577,760,891.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-106,227,188.64	-110,227,188.64
（一）、综合收益总额	-	-109,189,821.31	-109,189,821.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	2,962,632.67	-1,037,367.33
其中：1.基金申购款	172,000,000.00	95,304,332.73	267,304,332.73
2.基金赎回款	-176,000,000.00	-92,341,700.06	-268,341,700.06
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	315,592,316.00	151,941,386.47	467,533,702.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]595 号《关于准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,743,592,316.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

##### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

##### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

##### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》

和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。



## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购

和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线

法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金场内份额的收益分配方式采用现金分红；

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的

证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	10,259,758.59	10,731,413.46
等于：本金	10,258,805.17	10,730,442.94
加：应计利息	953.42	970.52
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	10,259,758.59	10,731,413.46

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		515,905,621.83	-	425,798,662.10	-90,106,959.73
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		515,905,621.83	-	425,798,662.10	-90,106,959.73
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		500,160,714.06	-	453,794,004.89	-46,366,709.17
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		500,160,714.06	-	453,794,004.89	-46,366,709.17

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,320,500.00	-	-	-
IC2403	2,146,280.00	-	-	-
IF2403	8,174,220.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,320,500.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,992,620.00	-	-	-
IC2306	2,424,480.00	-	-	-
IF2306	9,568,140.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,992,620.00	-	-	-

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2403	IC2403	2	2,165,840.00	19,560.00
IF2403	IF2403	8	8,293,920.00	119,700.00
合计	-	-	-	139,260.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	139,260.00
净额	-	-	-	-



注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,954.58	38,633.36
其中：交易所市场	3,954.58	38,633.36
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	171,000.00
应付替代款	199,481.94	-
其他应付款	112,459.78	59,340.96
合计	485,896.30	268,974.32

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	315,592,316.00	315,592,316.00
本期申购	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-26,000,000.00	-26,000,000.00
本期末	325,592,316.00	325,592,316.00

#### 7.4.7.8 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	238,782,487.19	-86,841,100.72	151,941,386.47
本期期初	238,782,487.19	-86,841,100.72	151,941,386.47
本期利润	1,893,385.19	-43,280,610.56	-41,387,225.37
本期基金份额交易产生的变动数	7,717,476.36	-5,323,558.04	2,393,918.32
其中：基金申购款	27,519,888.03	-11,255,911.60	16,263,976.43
基金赎回款	-19,802,411.67	5,932,353.56	-13,870,058.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	248,393,348.74	-135,445,269.32	112,948,079.42

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	34,250.62	37,817.70
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	35,553.33	39,677.52
其他	281.64	621.48
合计	70,085.59	78,116.70

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,509,651.78	-13,883,376.40
股票投资收益——赎回差价收入	-1,179,869.36	-10,822,903.98
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-5,689,521.14	-24,706,280.38

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	93,345,468.66	194,313,838.68
减：卖出股票成本总额	97,680,622.87	207,731,498.01
减：交易费用	174,497.57	465,717.07
买卖股票差价收入	-4,509,651.78	-13,883,376.40

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	39,870,058.11	268,341,700.06
减：现金支付赎回款总额	15,761,799.11	107,092,787.06
减：赎回股票成本总额	25,288,128.36	172,071,816.98
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,179,869.36	-10,822,903.98

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	50.77	248.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	68,956.47	447,645.02
债券投资收益——赎回差价收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	69,007.24	447,893.52

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	413,424.60	3,083,341.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	344,398.46	2,635,387.80
减：应计利息总额	53.11	283.46
减：交易费用	16.56	25.33
买卖债券差价收入	68,956.47	447,645.02

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-1,550,813.95	-2,791,085.07

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,389,367.69	9,725,144.34
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	10,389,367.69	9,725,144.34

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-43,740,250.56	-91,142,779.55
——股票投资	-43,740,250.56	-91,142,779.55
——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	459,640.00	35,960.00
——权证投资	-	-
——期货投资	459,640.00	35,960.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-43,280,610.56	-91,106,819.55

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	4,089.47	-
替代损益收入	-57,358.29	590,884.73
合计	-53,268.82	590,884.73

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

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	51,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	244,439.38	270,304.68
银行汇划费	5,226.21	8,948.31
合计	419,665.59	450,252.99

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

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债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

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债券回购交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	691,354.21	733,066.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,773.91	6,433.27
应支付基金管理人的净管理费	685,580.30	726,633.31

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	230,451.53	244,355.55

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达 MSCI 中	77,493,010.00	23.8006%	68,060,760.00	21.5660%



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				
广发证券股份有限公司	1,957,302.00	0.6012%	2,254,513.00	0.7144%

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	10,259,758.59	34,250.62	10,731,413.46	37,817.70

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
中银国际证券股份有限公司	301397	溯联股份	新股网下发行	3,487	185,752.49
中银国际证券股份有限公司	601096	宏盛华源	新股网下发行	37,413	63,602.10
上年度可比期间					
2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02
中银国际证券股份有限公司	600938	中国海油	新股网上发行	3,000	32,400.00
广发证券股份有限公司	600958	东方证券	配股	19,852	167,947.92
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下发行	488	10,677.44
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下发行	12,000	109,920.00
中银国际证券股份有限公司	113055	成银转债	老股东配债	980	98,000.00

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券、托管人关联方中银证券发行的 A 股中银证券和托管人中国银行发行的 A 股中国银行。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 68,300 股（2022 年 12 月 31 日:71,600 股），占本基金净值比例为 0.22%(2022 年 12 月 31 日:0.24%)；持有中银证券发行的 A 股中银证券 32,600 股（2022 年 12 月 31 日:33,700 股），占本基金净值比例为 0.08%(2022 年 12 月 31 日:0.08%)；持有中国银行发行的 A 股中国银行 406,200 股（2022 年 12 月 31 日:424,500 股），占本基金净值比例为 0.37%(2022 年 12 月 31 日:0.29%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6 个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	28.36	642	24,479.46	18,207.12	-
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	256	14,254.08	9,620.48	-
301372	科净	2023-08-03	6 个月	新股	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-

	源			流通受限						
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	67.68	59.37	204	13,806.72	12,111.48	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	47.25	320	18,451.20	15,120.00	-
301487	盟固利	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6 个月	新股流通受限	39.99	38.81	399	15,956.01	15,485.19	-
301499	维科精密	2023-07-13	6 个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-

301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023-08-24	6 个月	新股 流通 受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新股 流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	新股 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	新股 流通 受限	28.00	22.67	739	20,692.00	16,753.13	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	新股 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	133	13,242.81	10,834.18	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	7,451	19,819.66	33,156.95	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新股 流通	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-

				受限						
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新股 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股 流通 受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股 流通 受限	24.22	18.24	556	13,466.32	10,141.44	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股 流通 受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股 流通 受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股 流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股 流通 受限	11.25	11.07	748	8,415.00	8,280.36	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股 流通 受限	1.70	4.06	3,742	6,361.40	15,192.52	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	新股 流通 受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股 流通 受限	58.08	57.81	112	6,504.96	6,474.72	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股 流通 受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海	2023-10-25	6 个月	新股	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-

	汽配			流通受限						
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	210	16,968.00	16,327.50	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,930	19,049.10	24,607.50	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	2,778	14,390.04	22,474.02	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	333	26,303.67	20,143.17	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	38.67	501	13,396.74	19,373.67	-

688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股 流通 受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股 流通 受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股 流通 受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	47.29	37.97	257	12,153.53	9,758.29	-
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股 流通 受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股 流通 受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	385	12,300.75	20,116.25	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	309	13,181.94	14,887.62	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股 流通	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-



				受限						
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新股 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部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、集中交易部门、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。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债

券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理通过

久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,259,758.59	-	-	-	10,259,758.59
结算备付金	1,646,868.82	-	-	-	1,646,868.82
存出保证金	1,266,328.95	-	-	-	1,266,328.95
交易性金融资产	-	-	-	425,798,662.10	425,798,662.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	149,146.42	149,146.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,172,956.36	-	-	425,947,808.52	439,120,764.88
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	21,887.07	21,887.07
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	54,439.56	54,439.56
应付托管费	-	-	-	18,146.53	18,146.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	485,896.30	485,896.30
负债总计	-	-	-	580,369.46	580,369.46
利率敏感度缺口	13,172,956.36	-	-	425,367,439.06	438,540,395.42
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	10,731,413.46	-	-	-	10,731,413.46
结算备付金	2,141,777.67	-	-	-	2,141,777.67
存出保证金	1,478,421.62	-	-	-	1,478,421.62
交易性金融资产	-	-	-	453,794,004.89	453,794,004.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,351,612.75	-	-	453,794,004.89	468,145,617.64
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	263,097.69	263,097.69
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	59,882.33	59,882.33
应付托管费	-	-	-	19,960.78	19,960.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	268,974.32	268,974.32

负债总计	-	-	-	611,915.17	611,915.17
利率敏感度缺口	14,351,612.75	-	-	453,182,089.72	467,533,702.47

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	425,798,662.10	97.09	453,794,004.89	97.06
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	425,798,662.10	97.09	453,794,004.89	97.06

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	21,253,730.07	22,614,367.19
	2.业绩比较基准下降 5%	-21,253,730.07	-22,614,367.19

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	424,810,868.16	452,420,361.46
第二层次	-	532,662.00
第三层次	987,793.94	840,981.43
合计	425,798,662.10	453,794,004.89

###### 7.4.14.2.2 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和债券，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和债券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，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	840,981.43	840,981.43
当期购买	-	1,645,679.03	1,645,679.03
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,088,084.88	2,088,084.88
当期利得或损失总额	-	589,218.36	589,218.36
其中：计入损益的利得或损失	-	589,218.36	589,218.36
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	987,793.94	987,793.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	171,017.15	171,017.15
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	2,924,599.30	2,924,599.30
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,017,832.80	3,017,832.80
当期利得或损失总额	-	934,214.93	934,214.93
其中：计入损益的利得或损失	-	934,214.93	934,214.93
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	840,981.43	840,981.43
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公	-	-5,726.94	-5,726.94

允价值变动损益			
---------	--	--	--

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	987,793.94	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962—2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	840,981.43	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	425,798,662.10	96.97
	其中：股票	425,798,662.10	96.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,906,627.41	2.71
8	其他各项资产	1,415,475.37	0.32
9	合计	439,120,764.88	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,868,269.52	1.11
B	采矿业	20,572,674.66	4.69
C	制造业	238,003,234.05	54.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,605,757.14	4.01
E	建筑业	8,609,520.40	1.96
F	批发和零售业	4,602,863.16	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	15,381,884.16	3.51
H	住宿和餐饮业	527,676.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,920,788.62	4.31
J	金融业	78,394,469.84	17.88
K	房地产业	5,751,069.88	1.31
L	租赁和商务服务业	3,419,466.02	0.78
M	科学研究和技术服务业	3,131,649.96	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	531,969.29	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	291,720.00	0.07
Q	卫生和社会工作	2,584,731.80	0.59
R	文化、体育和娱乐业	1,986,005.60	0.45
S	综合	614,912.00	0.14

	合计	425,798,662.10	97.09
--	----	----------------	-------

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	14,600	25,199,600.00	5.75
2	300750	宁德时代	51,000	8,326,260.00	1.90
3	600036	招商银行	239,287	6,656,964.34	1.52
4	600900	长江电力	283,921	6,626,716.14	1.51
5	000858	五粮液	45,100	6,327,981.00	1.44
6	601318	中国平安	124,909	5,033,832.70	1.15
7	002594	比亚迪	21,000	4,158,000.00	0.95
8	300760	迈瑞医疗	14,077	4,090,776.20	0.93
9	601166	兴业银行	240,157	3,892,944.97	0.89
10	601288	农业银行	984,500	3,583,580.00	0.82
11	601398	工商银行	727,400	3,476,972.00	0.79
12	600276	恒瑞医药	73,873	3,341,275.79	0.76
13	600809	山西汾酒	14,172	3,269,905.56	0.75
14	000568	泸州老窖	17,100	3,068,082.00	0.70
15	601899	紫金矿业	238,000	2,965,480.00	0.68
16	600030	中信证券	141,565	2,883,679.05	0.66
17	002475	立讯精密	82,586	2,845,087.70	0.65
18	600309	万华化学	36,400	2,796,248.00	0.64
19	601816	京沪高铁	567,800	2,793,576.00	0.64
20	601328	交通银行	453,949	2,605,667.26	0.59
21	002714	牧原股份	63,224	2,603,564.32	0.59
22	300059	东方财富	183,425	2,575,287.00	0.59
23	601088	中国神华	76,300	2,392,005.00	0.55
24	601225	陕西煤业	112,100	2,341,769.00	0.53
25	601668	中国建筑	484,780	2,331,791.80	0.53
26	601138	工业富联	153,200	2,316,384.00	0.53
27	002352	顺丰控股	56,700	2,290,680.00	0.52
28	600000	浦发银行	339,547	2,247,801.14	0.51
29	603259	药明康德	29,675	2,159,153.00	0.49
30	000001	平安银行	224,300	2,106,177.00	0.48
31	600406	国电南瑞	92,937	2,074,353.84	0.47
32	600028	中国石化	366,500	2,045,070.00	0.47
33	603288	海天味业	53,456	2,028,655.20	0.46
34	601012	隆基绿能	87,808	2,010,803.20	0.46
35	600887	伊利股份	73,678	1,970,886.50	0.45
36	002304	洋河股份	17,344	1,906,105.60	0.43

37	601888	中国中免	22,658	1,896,248.02	0.43
38	601601	中国太保	79,157	1,882,353.46	0.43
39	601857	中国石油	249,651	1,762,536.06	0.40
40	600436	片仔癀	7,153	1,730,954.47	0.39
41	300015	爱尔眼科	107,897	1,706,930.54	0.39
42	300122	智飞生物	27,850	1,701,913.50	0.39
43	000725	京东方 A	433,300	1,689,870.00	0.39
44	688111	金山办公	5,285	1,671,117.00	0.38
45	601985	中国核电	218,400	1,638,000.00	0.37
46	601988	中国银行	406,200	1,620,738.00	0.37
47	000625	长安汽车	95,688	1,610,429.04	0.37
48	600050	中国联通	367,600	1,610,088.00	0.37
49	688041	海光信息	22,652	1,607,838.96	0.37
50	601818	光大银行	536,600	1,556,140.00	0.35
51	002371	北方华创	6,300	1,547,973.00	0.35
52	300498	温氏股份	77,120	1,547,027.20	0.35
53	002142	宁波银行	76,420	1,536,806.20	0.35
54	600690	海尔智家	73,053	1,534,113.00	0.35
55	600016	民生银行	410,080	1,533,699.20	0.35
56	600019	宝钢股份	257,300	1,525,789.00	0.35
57	600150	中国船舶	51,600	1,519,104.00	0.35
58	300274	阳光电源	17,100	1,497,789.00	0.34
59	601766	中国中车	281,300	1,479,638.00	0.34
60	601658	邮储银行	336,100	1,462,035.00	0.33
61	603501	韦尔股份	13,700	1,461,927.00	0.33
62	600905	三峡能源	331,000	1,446,470.00	0.33
63	601919	中远海控	148,120	1,418,989.60	0.32
64	600919	江苏银行	207,766	1,389,954.54	0.32
65	600048	保利发展	138,500	1,371,150.00	0.31
66	600031	三一重工	98,100	1,350,837.00	0.31
67	601390	中国中铁	237,500	1,349,000.00	0.31
68	601127	赛力斯	17,400	1,325,880.00	0.30
69	688271	联影医疗	9,560	1,309,815.60	0.30
70	600438	通威股份	52,000	1,301,560.00	0.30
71	688036	传音控股	9,356	1,294,870.40	0.30
72	601211	国泰君安	87,000	1,294,560.00	0.30
73	601006	大秦铁路	177,700	1,281,217.00	0.29
74	600989	宝丰能源	84,700	1,251,019.00	0.29
75	002230	科大讯飞	26,900	1,247,622.00	0.28
76	000063	中兴通讯	46,600	1,233,968.00	0.28
77	600104	上汽集团	90,100	1,219,053.00	0.28
78	002493	荣盛石化	116,950	1,210,432.50	0.28
79	601688	华泰证券	84,900	1,184,355.00	0.27
80	601066	中信建投	50,000	1,183,000.00	0.27

81	000002	万科 A	112,400	1,175,704.00	0.27
82	600999	招商证券	85,647	1,168,225.08	0.27
83	000166	申万宏源	260,700	1,157,508.00	0.26
84	600893	航发动力	30,836	1,152,649.68	0.26
85	600886	国投电力	86,300	1,137,434.00	0.26
86	601169	北京银行	244,600	1,108,038.00	0.25
87	688012	中微公司	7,203	1,106,380.80	0.25
88	000596	古井贡酒	4,700	1,094,160.00	0.25
89	000895	双汇发展	40,200	1,073,742.00	0.24
90	601995	中金公司	28,200	1,073,010.00	0.24
91	600346	恒力石化	81,300	1,070,721.00	0.24
92	000338	潍柴动力	78,400	1,070,160.00	0.24
93	603993	洛阳钼业	204,300	1,062,360.00	0.24
94	300308	中际旭创	9,400	1,061,354.00	0.24
95	002027	分众传媒	167,100	1,056,072.00	0.24
96	600837	海通证券	111,600	1,045,692.00	0.24
97	000651	格力电器	32,500	1,045,525.00	0.24
98	600585	海螺水泥	46,300	1,044,528.00	0.24
99	000538	云南白药	20,680	1,016,422.00	0.23
100	600845	宝信软件	20,661	1,008,256.80	0.23
101	300014	亿纬锂能	23,791	1,003,980.20	0.23
102	300033	同花顺	6,400	1,003,968.00	0.23
103	000792	盐湖股份	62,800	1,001,660.00	0.23
104	001979	招商蛇口	104,900	999,697.00	0.23
105	601111	中国国航	134,700	988,698.00	0.23
106	601229	上海银行	164,142	979,927.74	0.22
107	000776	广发证券	68,300	976,007.00	0.22
108	601669	中国电建	199,300	974,577.00	0.22
109	300124	汇川技术	15,400	972,356.00	0.22
110	600547	山东黄金	41,884	957,887.08	0.22
111	002466	天齐锂业	17,100	954,009.00	0.22
112	601689	拓普集团	12,800	940,800.00	0.21
113	000100	TCL 科技	217,220	934,046.00	0.21
114	601628	中国人寿	32,079	909,439.65	0.21
115	300782	卓胜微	6,316	890,556.00	0.20
116	601009	南京银行	119,700	883,386.00	0.20
117	600188	兖矿能源	44,300	877,583.00	0.20
118	002311	海大集团	19,300	866,763.00	0.20
119	601600	中国铝业	152,900	862,356.00	0.20
120	600015	华夏银行	153,382	862,006.84	0.20
121	600660	福耀玻璃	23,035	861,278.65	0.20
122	600795	国电电力	206,200	857,792.00	0.20
123	002920	德赛西威	6,600	854,766.00	0.19
124	600085	同仁堂	15,900	853,830.00	0.19

125	601100	恒立液压	15,532	849,289.76	0.19
126	000963	华东医药	20,340	843,296.40	0.19
127	002241	歌尔股份	39,700	834,097.00	0.19
128	600011	华能国际	106,100	816,970.00	0.19
129	600111	北方稀土	41,900	810,346.00	0.18
130	600089	特变电工	58,535	807,783.00	0.18
131	600703	三安光电	57,800	800,530.00	0.18
132	002460	赣锋锂业	18,560	794,368.00	0.18
133	002459	晶澳科技	38,116	789,763.52	0.18
134	601868	中国能建	375,000	787,500.00	0.18
135	600674	川投能源	51,500	778,680.00	0.18
136	688008	澜起科技	13,201	775,690.76	0.18
137	600115	中国东航	198,000	768,240.00	0.18
138	601901	方正证券	95,200	767,312.00	0.17
139	600010	宝钢股份	525,100	766,646.00	0.17
140	300433	蓝思科技	57,600	760,320.00	0.17
141	601336	新华保险	24,300	756,459.00	0.17
142	601699	潞安环能	34,500	755,895.00	0.17
143	600958	东方证券	86,552	753,002.40	0.17
144	600029	南方航空	129,800	747,648.00	0.17
145	000425	徐工机械	136,700	746,382.00	0.17
146	601360	三六零	82,589	744,126.89	0.17
147	603392	万泰生物	9,850	740,030.50	0.17
148	300896	爱美客	2,500	735,825.00	0.17
149	000301	东方盛虹	76,500	734,400.00	0.17
150	002129	TCL 中环	46,775	731,561.00	0.17
151	603986	兆易创新	7,840	724,337.60	0.17
152	601939	建设银行	110,900	721,959.00	0.16
153	601633	长城汽车	28,600	721,292.00	0.16
154	688599	天合光能	25,254	720,496.62	0.16
155	300832	新产业	9,200	719,440.00	0.16
156	600588	用友网络	39,822	708,433.38	0.16
157	603369	今世缘	14,500	706,875.00	0.16
158	002236	大华股份	38,000	701,100.00	0.16
159	601788	光大证券	45,240	697,600.80	0.16
160	600926	杭州银行	68,460	685,284.60	0.16
161	600221	海航控股	499,800	684,726.00	0.16
162	688223	晶科能源	77,117	683,256.62	0.16
163	600426	华鲁恒升	24,686	681,086.74	0.16
164	002049	紫光国微	9,980	673,151.00	0.15
165	688396	华润微	15,009	670,752.21	0.15
166	000661	长春高新	4,600	670,680.00	0.15
167	300316	晶盛机电	15,100	665,759.00	0.15
168	000983	山西焦煤	65,640	648,523.20	0.15

169	300408	三环集团	22,000	647,900.00	0.15
170	002812	恩捷股份	11,400	647,748.00	0.15
171	688256	寒武纪	4,771	643,894.16	0.15
172	601825	沪农商行	111,500	640,010.00	0.15
173	000938	紫光股份	33,038	639,285.30	0.15
174	601881	中国银河	52,800	636,240.00	0.15
175	002736	国信证券	74,200	633,668.00	0.14
176	600570	恒生电子	21,987	632,346.12	0.14
177	002050	三花智控	21,500	632,100.00	0.14
178	601618	中国中冶	206,400	631,584.00	0.14
179	600039	四川路桥	83,840	627,961.60	0.14
180	601916	浙商银行	249,180	627,933.60	0.14
181	300999	金龙鱼	18,708	624,473.04	0.14
182	002252	上海莱士	78,000	624,000.00	0.14
183	600600	青岛啤酒	8,327	622,443.25	0.14
184	600196	复星医药	24,700	618,241.00	0.14
185	600584	长电科技	20,700	618,102.00	0.14
186	688303	大全能源	20,874	617,244.18	0.14
187	603799	华友钴业	18,637	613,716.41	0.14
188	601727	上海电气	146,200	609,654.00	0.14
189	600745	闻泰科技	14,400	609,264.00	0.14
190	002001	新和成	35,676	605,064.96	0.14
191	600023	浙能电力	129,100	595,151.00	0.14
192	600741	华域汽车	36,400	592,592.00	0.14
193	600161	天坛生物	19,000	587,860.00	0.13
194	601377	兴业证券	99,730	585,415.10	0.13
195	601021	春秋航空	11,400	572,280.00	0.13
196	000999	华润三九	11,500	571,895.00	0.13
197	002648	卫星化学	38,769	571,842.75	0.13
198	003816	中国广核	182,100	566,331.00	0.13
199	605499	东鹏饮料	3,100	565,781.00	0.13
200	000977	浪潮信息	17,028	565,329.60	0.13
201	600489	中金黄金	56,200	559,752.00	0.13
202	688126	沪硅产业	32,086	555,729.52	0.13
203	002709	天赐材料	22,100	554,268.00	0.13
204	601872	招商轮船	94,200	553,896.00	0.13
205	600918	中泰证券	80,500	552,230.00	0.13
206	002600	领益智造	81,000	547,560.00	0.12
207	300413	芒果超媒	21,610	544,572.00	0.12
208	600256	广汇能源	75,988	542,554.32	0.12
209	601607	上海医药	32,200	538,706.00	0.12
210	601877	正泰电器	25,000	537,750.00	0.12
211	000157	中联重科	82,000	535,460.00	0.12
212	300418	昆仑万维	14,200	531,080.00	0.12



213	601319	中国人保	109,500	529,980.00	0.12
214	000617	中油资本	97,400	525,960.00	0.12
215	603198	迎驾贡酒	7,900	523,691.00	0.12
216	603806	福斯特	21,408	519,572.16	0.12
217	603659	璞泰来	24,812	519,315.16	0.12
218	301236	软通动力	11,150	515,130.00	0.12
219	600160	巨化股份	31,200	514,488.00	0.12
220	600027	华电国际	98,300	505,262.00	0.12
221	600803	新奥股份	29,900	502,918.00	0.11
222	600061	国投资本	74,408	501,509.92	0.11
223	600183	生益科技	27,300	499,863.00	0.11
224	002422	科伦药业	17,200	499,660.00	0.11
225	601238	广汽集团	57,100	499,625.00	0.11
226	300765	新诺威	13,600	498,032.00	0.11
227	002938	鹏鼎控股	22,300	497,736.00	0.11
228	601838	成都银行	44,200	497,692.00	0.11
229	300759	康龙化成	17,150	497,007.00	0.11
230	600522	中天科技	39,600	494,604.00	0.11
231	000876	新希望	53,000	493,960.00	0.11
232	601865	福莱特	18,500	493,950.00	0.11
233	600026	中远海能	40,300	493,272.00	0.11
234	000807	云铝股份	40,200	491,244.00	0.11
235	600233	圆通速递	39,900	490,371.00	0.11
236	600515	海南机场	132,000	488,400.00	0.11
237	603195	公牛集团	5,100	487,815.00	0.11
238	002555	三七互娱	25,800	485,298.00	0.11
239	002463	沪电股份	21,910	484,649.20	0.11
240	000975	银泰黄金	32,140	482,100.00	0.11
241	000630	铜陵有色	146,400	480,192.00	0.11
242	688072	拓荆科技	2,075	479,947.50	0.11
243	600985	淮北矿业	28,700	477,281.00	0.11
244	300661	圣邦股份	5,335	474,868.35	0.11
245	002601	龙佰集团	27,700	474,501.00	0.11
246	600079	人福医药	19,000	472,340.00	0.11
247	600009	上海机场	14,400	472,032.00	0.11
248	603939	益丰药房	11,737	469,949.48	0.11
249	600875	东方电气	32,100	469,302.00	0.11
250	603260	合盛硅业	9,200	469,200.00	0.11
251	002028	思源电气	9,000	468,360.00	0.11
252	601878	浙商证券	44,900	468,307.00	0.11
253	002007	华兰生物	21,090	466,721.70	0.11
254	000408	藏格矿业	18,400	466,256.00	0.11
255	600332	白云山	16,232	464,235.20	0.11
256	600415	小商品城	63,400	464,088.00	0.11

257	000786	北新建材	19,600	457,856.00	0.10
258	002821	凯莱英	3,920	455,112.00	0.10
259	600176	中国巨石	46,279	454,922.57	0.10
260	601117	中国化学	70,800	450,288.00	0.10
261	002603	以岭药业	19,440	448,480.80	0.10
262	002602	世纪华通	86,360	445,617.60	0.10
263	002074	国轩高科	20,600	442,900.00	0.10
264	300142	沃森生物	18,700	439,637.00	0.10
265	000933	神火股份	26,100	438,480.00	0.10
266	600460	士兰微	19,200	438,336.00	0.10
267	002916	深南电路	6,120	434,458.80	0.10
268	301269	华大九天	4,100	433,985.00	0.10
269	300628	亿联网络	14,660	433,203.00	0.10
270	600362	江西铜业	24,100	430,426.00	0.10
271	688188	柏楚电子	1,677	424,465.47	0.10
272	601555	东吴证券	57,959	423,680.29	0.10
273	601233	桐昆股份	27,900	422,127.00	0.10
274	002294	信立泰	12,900	421,314.00	0.10
275	601058	赛轮轮胎	35,800	420,650.00	0.10
276	601108	财通证券	54,150	420,204.00	0.10
277	601799	星宇股份	3,200	419,552.00	0.10
278	300442	润泽科技	16,500	418,605.00	0.10
279	601077	渝农商行	102,400	417,792.00	0.10
280	688728	格科微	20,366	416,892.02	0.10
281	300496	中科创达	5,200	416,312.00	0.09
282	300037	新宙邦	8,780	415,294.00	0.09
283	300502	新易盛	8,400	414,288.00	0.09
284	605117	德业股份	4,920	412,788.00	0.09
285	300394	天孚通信	4,500	411,840.00	0.09
286	000932	华菱钢铁	79,900	411,485.00	0.09
287	600418	江淮汽车	25,400	410,210.00	0.09
288	002156	通富微电	17,700	409,224.00	0.09
289	688169	石头科技	1,446	409,145.70	0.09
290	600348	华阳股份	41,850	408,456.00	0.09
291	300866	安克创新	4,600	407,560.00	0.09
292	603899	晨光股份	10,800	405,540.00	0.09
293	300751	迈为股份	3,128	405,107.28	0.09
294	002223	鱼跃医疗	11,700	404,586.00	0.09
295	688777	中控技术	8,914	404,249.90	0.09
296	603833	欧派家居	5,764	401,232.04	0.09
297	600546	山煤国际	22,900	400,979.00	0.09
298	002078	太阳纸业	32,800	399,176.00	0.09
299	600219	南山铝业	135,500	398,370.00	0.09
300	600018	上港集团	80,700	395,430.00	0.09

301	600733	北汽蓝谷	64,400	394,772.00	0.09
302	688122	西部超导	7,415	394,700.45	0.09
303	601168	西部矿业	27,600	393,852.00	0.09
304	603658	安图生物	6,900	393,369.00	0.09
305	600109	国金证券	43,100	391,348.00	0.09
306	688301	奕瑞科技	1,197	389,336.22	0.09
307	000733	振华科技	6,600	388,344.00	0.09
308	300919	中伟股份	7,900	388,127.00	0.09
309	002064	华峰化学	57,500	385,825.00	0.09
310	000066	中国长城	37,600	380,512.00	0.09
311	002841	视源股份	8,300	379,808.00	0.09
312	002180	纳思达	16,600	375,658.00	0.09
313	000423	东阿阿胶	7,600	374,832.00	0.09
314	600732	爱旭股份	21,200	373,968.00	0.09
315	002939	长城证券	46,700	373,600.00	0.09
316	002128	电投能源	26,000	371,020.00	0.08
317	601216	君正集团	99,000	370,260.00	0.08
318	600398	海澜之家	49,900	370,258.00	0.08
319	002465	海格通信	28,800	370,080.00	0.08
320	002625	光启技术	25,000	369,500.00	0.08
321	688009	中国通号	84,202	368,804.76	0.08
322	688363	华熙生物	5,504	368,382.72	0.08
323	600702	舍得酒业	3,800	367,460.00	0.08
324	600536	中国软件	10,090	365,863.40	0.08
325	600132	重庆啤酒	5,500	365,475.00	0.08
326	600642	申能股份	56,900	365,298.00	0.08
327	002414	高德红外	50,003	365,021.90	0.08
328	688065	凯赛生物	6,617	363,802.66	0.08
329	688180	君实生物	8,661	362,289.63	0.08
330	603290	斯达半导	2,000	362,000.00	0.08
331	002384	东山精密	19,900	361,782.00	0.08
332	603160	汇顶科技	5,200	359,320.00	0.08
333	600298	安琪酵母	10,200	358,836.00	0.08
334	603000	人民网	12,800	358,144.00	0.08
335	688187	时代电气	9,856	358,068.48	0.08
336	000009	中国宝安	30,400	356,896.00	0.08
337	600884	杉杉股份	26,200	356,844.00	0.08
338	603688	石英股份	4,100	356,208.00	0.08
339	000027	深圳能源	55,180	355,911.00	0.08
340	300223	北京君正	5,500	355,575.00	0.08
341	601958	金铂股份	37,600	355,320.00	0.08
342	600177	雅戈尔	54,000	353,700.00	0.08
343	002152	广电运通	28,800	353,088.00	0.08
344	000629	钒钛股份	107,500	352,600.00	0.08

345	600157	永泰能源	256,800	351,816.00	0.08
346	300601	康泰生物	12,920	350,778.00	0.08
347	300003	乐普医疗	21,700	350,672.00	0.08
348	000728	国元证券	51,100	349,013.00	0.08
349	000988	华工科技	11,700	348,192.00	0.08
350	603606	东方电缆	8,100	346,275.00	0.08
351	600487	亨通光电	29,000	346,260.00	0.08
352	600895	张江高科	17,900	345,470.00	0.08
353	603345	安井食品	3,300	345,213.00	0.08
354	688082	盛美上海	3,295	344,030.95	0.08
355	000783	长江证券	63,900	343,782.00	0.08
356	688220	翱捷科技	4,852	341,774.88	0.08
357	601990	南京证券	42,700	340,746.00	0.08
358	600066	宇通客车	25,700	340,525.00	0.08
359	300454	深信服	4,700	339,763.00	0.08
360	600566	济川药业	10,800	339,444.00	0.08
361	002032	苏泊尔	6,400	339,264.00	0.08
362	688120	华海清科	1,803	338,423.10	0.08
363	600153	建发股份	35,100	338,013.00	0.08
364	000723	美锦能源	50,700	337,662.00	0.08
365	603816	顾家家居	9,630	337,050.00	0.08
366	002430	杭氧股份	11,500	335,915.00	0.08
367	300146	汤臣倍健	19,700	335,491.00	0.08
368	601696	中银证券	32,600	335,454.00	0.08
369	002353	杰瑞股份	11,900	334,509.00	0.08
370	002673	西部证券	52,300	333,151.00	0.08
371	002756	永兴材料	6,370	332,577.70	0.08
372	000831	中国稀土	12,000	332,040.00	0.08
373	601615	明阳智能	26,400	331,056.00	0.08
374	600096	云天化	21,200	330,720.00	0.08
375	002739	万达电影	25,300	329,406.00	0.08
376	603233	大参林	13,220	329,178.00	0.08
377	600873	梅花生物	34,400	328,520.00	0.07
378	002532	天山铝业	54,600	328,146.00	0.07
379	002456	欧菲光	37,600	327,496.00	0.07
380	300957	贝泰妮	4,800	327,216.00	0.07
381	601966	玲珑轮胎	16,975	326,429.25	0.07
382	603596	伯特利	4,700	325,710.00	0.07
383	603882	金域医学	5,200	325,364.00	0.07
384	002340	格林美	59,500	324,870.00	0.07
385	688538	和辉光电	133,677	324,835.11	0.07
386	600779	水井坊	5,500	323,235.00	0.07
387	600998	九州通	46,029	322,663.29	0.07
388	600072	中船科技	17,400	322,596.00	0.07

389	601577	长沙银行	47,300	322,586.00	0.07
390	601231	环旭电子	21,300	321,843.00	0.07
391	603589	口子窖	7,100	321,630.00	0.07
392	601880	辽港股份	221,600	321,320.00	0.07
393	002202	金风科技	40,046	320,368.00	0.07
394	600369	西南证券	78,300	320,247.00	0.07
395	600754	锦江酒店	10,700	319,930.00	0.07
396	600352	浙江龙盛	37,900	318,360.00	0.07
397	600705	中航产融	102,200	317,842.00	0.07
398	002185	华天科技	37,300	317,796.00	0.07
399	002262	恩华药业	11,700	317,304.00	0.07
400	603728	鸣志电器	4,800	316,080.00	0.07
401	300207	欣旺达	21,400	315,864.00	0.07
402	600060	海信视像	15,100	315,590.00	0.07
403	603568	伟明环保	19,720	315,520.00	0.07
404	002738	中矿资源	8,436	314,747.16	0.07
405	002444	巨星科技	13,900	313,028.00	0.07
406	603156	养元饮品	14,700	312,522.00	0.07
407	600606	绿地控股	135,500	311,650.00	0.07
408	002080	中材科技	19,500	310,440.00	0.07
409	688561	奇安信	7,721	309,534.89	0.07
410	601198	东兴证券	37,600	309,448.00	0.07
411	601162	天风证券	100,100	309,309.00	0.07
412	603885	吉祥航空	25,700	308,400.00	0.07
413	000800	一汽解放	36,200	307,700.00	0.07
414	300763	锦浪科技	4,400	307,560.00	0.07
415	600583	海油工程	51,700	307,098.00	0.07
416	600129	太极集团	6,600	306,636.00	0.07
417	300487	蓝晓科技	5,750	305,095.00	0.07
418	300144	宋城演艺	30,780	303,798.60	0.07
419	000050	深天马 A	28,500	303,525.00	0.07
420	600497	驰宏锌锗	60,000	303,000.00	0.07
421	000738	航发控制	15,200	302,480.00	0.07
422	002409	雅克科技	5,400	300,942.00	0.07
423	002568	百润股份	12,228	300,931.08	0.07
424	601456	国联证券	27,700	300,268.00	0.07
425	002831	裕同科技	10,900	299,859.00	0.07
426	000069	华侨城 A	96,400	299,804.00	0.07
427	601155	新城控股	26,160	298,485.60	0.07
428	603737	三棵树	6,268	298,419.48	0.07
429	600637	东方明珠	39,600	297,792.00	0.07
430	601179	中国西电	60,400	297,772.00	0.07
431	601933	永辉超市	105,000	296,100.00	0.07
432	000987	越秀资本	49,093	295,539.86	0.07

433	000021	深科技	18,200	295,022.00	0.07
434	601991	大唐发电	121,700	294,514.00	0.07
435	000937	冀中能源	41,000	292,740.00	0.07
436	002607	中公教育	71,500	291,720.00	0.07
437	603338	浙江鼎力	5,700	291,669.00	0.07
438	600486	扬农化工	4,620	291,614.40	0.07
439	600970	中材国际	31,100	290,474.00	0.07
440	002385	大北农	48,600	289,656.00	0.07
441	600699	均胜电子	16,100	289,156.00	0.07
442	300724	捷佳伟创	3,900	288,639.00	0.07
443	603712	七一二	9,100	286,741.00	0.07
444	688099	晶晨股份	4,578	286,720.14	0.07
445	002797	第一创业	49,300	286,433.00	0.07
446	000032	深桑达 A	13,500	285,930.00	0.07
447	600655	豫园股份	46,000	285,660.00	0.07
448	000729	燕京啤酒	33,100	285,653.00	0.07
449	000703	恒逸石化	42,480	285,465.60	0.07
450	600549	厦门钨业	16,600	285,188.00	0.07
451	688521	芯原股份	5,696	284,572.16	0.06
452	600100	同方股份	38,600	283,710.00	0.06
453	000893	亚钾国际	10,800	283,392.00	0.06
454	600839	四川长虹	53,300	281,957.00	0.06
455	603486	科沃斯	6,800	281,792.00	0.06
456	603707	健友股份	18,785	281,775.00	0.06
457	300604	长川科技	7,400	281,126.00	0.06
458	002966	苏州银行	43,400	280,364.00	0.06
459	002271	东方雨虹	14,600	280,320.00	0.06
460	600021	上海电力	33,100	280,026.00	0.06
461	002595	豪迈科技	9,400	279,838.00	0.06
462	300251	光线传媒	34,300	279,545.00	0.06
463	002517	恺英网络	25,000	279,250.00	0.06
464	600848	上海临港	27,720	278,586.00	0.06
465	002044	美年健康	46,126	277,217.26	0.06
466	600380	健康元	22,200	275,946.00	0.06
467	600763	通策医疗	3,600	275,220.00	0.06
468	000960	锡业股份	19,100	273,512.00	0.06
469	600704	物产中大	61,300	271,559.00	0.06
470	601866	中远海发	116,000	271,440.00	0.06
471	600378	昊华科技	8,900	271,272.00	0.06
472	000799	酒鬼酒	3,700	270,655.00	0.06
473	600988	赤峰黄金	19,300	270,393.00	0.06
474	600038	中直股份	7,000	269,710.00	0.06
475	002372	伟星新材	18,600	269,142.00	0.06
476	600004	白云机场	27,400	267,972.00	0.06

477	002176	江特电机	19,800	267,300.00	0.06
478	002281	光迅科技	9,300	265,050.00	0.06
479	002624	完美世界	22,350	264,624.00	0.06
480	600977	中国电影	21,600	264,384.00	0.06
481	601928	凤凰传媒	30,000	264,300.00	0.06
482	002244	滨江集团	36,300	263,901.00	0.06
483	300212	易华录	8,300	261,035.00	0.06
484	000709	河钢股份	122,000	259,860.00	0.06
485	300699	光威复材	9,720	259,232.40	0.06
486	000513	丽珠集团	7,400	259,074.00	0.06
487	600872	中炬高新	9,200	258,520.00	0.06
488	600673	东阳光	35,200	258,016.00	0.06
489	000591	太阳能	46,100	257,238.00	0.06
490	600166	福田汽车	94,100	256,893.00	0.06
491	002153	石基信息	26,356	256,707.44	0.06
492	002558	巨人网络	23,000	256,220.00	0.06
493	002056	横店东磁	18,900	255,906.00	0.06
494	688390	固德威	1,953	255,022.74	0.06
495	600521	华海药业	17,370	254,817.90	0.06
496	600511	国药股份	8,900	254,718.00	0.06
497	603456	九洲药业	10,500	254,205.00	0.06
498	002138	顺络电子	9,400	253,894.00	0.06
499	603893	瑞芯微	4,000	253,600.00	0.06
500	002120	韵达股份	33,970	253,416.20	0.06
501	002850	科达利	3,000	253,380.00	0.06
502	603529	爱玛科技	10,100	252,904.00	0.06
503	002299	圣农发展	14,700	252,546.00	0.06
504	000683	远兴能源	42,900	251,823.00	0.06
505	002405	四维图新	28,200	250,980.00	0.06
506	000825	太钢不锈	67,200	250,656.00	0.06
507	688032	禾迈股份	919	248,130.00	0.06
508	300390	天华新能	9,780	247,923.00	0.06
509	600516	方大炭素	47,306	247,883.44	0.06
510	600688	上海石化	86,300	246,818.00	0.06
511	600598	北大荒	20,600	246,582.00	0.06
512	603077	和邦生物	104,400	246,384.00	0.06
513	600170	上海建工	105,200	246,168.00	0.06
514	002240	盛新锂能	10,800	245,700.00	0.06
515	002531	天顺风能	20,900	242,440.00	0.06
516	002508	老板电器	11,100	241,758.00	0.06
517	600559	老白干酒	10,700	241,285.00	0.06
518	002926	华西证券	30,900	239,784.00	0.05
519	688536	思瑞浦	1,633	238,907.90	0.05
520	688516	奥特维	2,636	238,558.00	0.05

521	300373	扬杰科技	6,500	238,550.00	0.05
522	300558	贝达药业	4,618	238,057.90	0.05
523	600499	科达制造	22,500	237,375.00	0.05
524	300595	欧普康视	10,430	235,509.40	0.05
525	600141	兴发集团	12,900	235,425.00	0.05
526	300118	东方日升	13,200	232,980.00	0.05
527	300568	星源材质	15,085	232,610.70	0.05
528	600563	法拉电子	2,500	231,500.00	0.05
529	000519	中兵红箭	16,400	230,256.00	0.05
530	002065	东华软件	37,300	230,141.00	0.05
531	600383	金地集团	52,723	229,872.28	0.05
532	002500	山西证券	42,590	229,560.10	0.05
533	601016	节能风电	76,410	229,230.00	0.05
534	300347	泰格医药	4,150	228,125.50	0.05
535	688385	复旦微电	5,902	227,994.26	0.05
536	603185	弘元绿能	6,844	227,768.32	0.05
537	300395	菲利华	6,200	226,672.00	0.05
538	603858	步长制药	13,157	223,800.57	0.05
539	000830	鲁西化工	22,200	222,666.00	0.05
540	002268	电科网安	9,900	222,354.00	0.05
541	688063	派能科技	2,093	221,858.00	0.05
542	300676	华大基因	4,600	220,800.00	0.05
543	688567	孚能科技	13,507	220,299.17	0.05
544	605358	立昂微	8,000	219,120.00	0.05
545	000998	隆平高科	15,500	218,550.00	0.05
546	688005	容百科技	5,491	218,541.80	0.05
547	688002	睿创微纳	4,931	218,048.82	0.05
548	300073	当升科技	5,700	217,740.00	0.05
549	601636	旗滨集团	31,600	216,144.00	0.05
550	000739	普洛药业	14,000	215,460.00	0.05
551	002407	多氟多	14,080	214,297.60	0.05
552	600258	首旅酒店	13,300	207,746.00	0.05
553	600392	盛和资源	20,300	206,654.00	0.05
554	002266	浙富控股	60,700	206,380.00	0.05
555	603517	绝味食品	7,500	201,450.00	0.05
556	000401	冀东水泥	31,300	200,007.00	0.05
557	603444	吉比特	800	196,096.00	0.04
558	600056	中国医药	17,520	195,698.40	0.04
559	300769	德方纳米	3,100	189,193.00	0.04
560	603613	国联股份	8,460	186,204.60	0.04
561	600481	双良节能	21,600	182,736.00	0.04
562	002541	鸿路钢构	8,110	176,230.30	0.04
563	600885	宏发股份	6,243	172,556.52	0.04
564	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01



565	301526	国际复材	7,451	33,156.95	0.01
566	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
567	688548	广钢气体	1,930	24,607.50	0.01
568	688549	中巨芯	2,778	22,474.02	0.01
569	688563	航材股份	333	20,143.17	0.00
570	688652	京仪装备	385	20,116.25	0.00
571	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
572	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
573	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
574	688582	芯动联科	501	19,373.67	0.00
575	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
576	301291	明阳电气	642	18,207.12	0.00
577	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
578	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
579	301511	德福科技	739	16,753.13	0.00
580	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
581	603296	华勤技术	210	16,327.50	0.00
582	301498	乖宝宠物	399	15,485.19	0.00
583	601096	宏盛华源	3,742	15,192.52	0.00
584	301486	致尚科技	320	15,120.00	0.00
585	688702	盛科通信	309	14,887.62	0.00
586	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
587	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
588	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
589	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
590	301393	昊帆生物	204	12,111.48	0.00
591	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
592	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
593	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
594	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
595	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
596	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
597	301525	儒竞科技	133	10,834.18	0.00
598	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
599	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
600	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
601	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
602	301559	中集环科	556	10,141.44	0.00
603	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
604	688612	威迈斯	257	9,758.29	0.00
605	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
606	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
607	301371	敷尔佳	256	9,620.48	0.00
608	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00

609	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
610	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
611	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
612	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
613	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
614	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
615	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
616	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
617	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
618	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
619	601083	锦江航运	748	8,280.36	0.00
620	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
621	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
622	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
623	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
624	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
625	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
626	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
627	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
628	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
629	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
630	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
631	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
632	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
633	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
634	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
635	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
636	603062	麦加芯彩	112	6,474.72	0.00
637	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
638	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
639	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
640	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
641	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
642	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
643	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
644	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
645	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
646	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
647	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
648	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
649	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
650	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601816	京沪高铁	3,019,072.00	0.65
2	300750	宁德时代	1,723,123.42	0.37
3	688041	海光信息	1,569,900.68	0.34
4	688271	联影医疗	1,373,014.52	0.29
5	000858	五粮液	1,236,747.00	0.26
6	688256	寒武纪	1,188,763.02	0.25
7	600886	国投电力	1,083,525.00	0.23
8	600703	三安光电	1,073,114.00	0.23
9	688223	晶科能源	930,462.69	0.20
10	600519	贵州茅台	887,973.00	0.19
11	688303	大全能源	838,565.15	0.18
12	600221	海航控股	808,420.00	0.17
13	300418	昆仑万维	796,157.00	0.17
14	002594	比亚迪	758,914.00	0.16
15	300760	迈瑞医疗	704,029.00	0.15
16	688126	沪硅产业	673,877.84	0.14
17	600023	浙能电力	645,586.00	0.14
18	603688	石英股份	641,125.00	0.14
19	601901	方正证券	636,285.00	0.14
20	601138	工业富联	634,408.00	0.14

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

## 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	2,767,695.00	0.59
2	300750	宁德时代	2,352,969.40	0.50
3	000858	五粮液	1,608,155.00	0.34
4	300124	汇川技术	1,161,756.00	0.25
5	002594	比亚迪	1,029,608.00	0.22
6	300760	迈瑞医疗	898,182.00	0.19

7	600036	招商银行	895,852.00	0.19
8	000568	泸州老窖	781,409.00	0.17
9	601318	中国平安	751,248.00	0.16
10	688249	晶合集成	635,868.49	0.14
11	002371	北方华创	619,085.00	0.13
12	300059	东方财富	598,146.00	0.13
13	002352	顺丰控股	562,741.00	0.12
14	000001	平安银行	555,815.00	0.12
15	002013	中航机电	515,148.00	0.11
16	301526	国际复材	503,687.24	0.11
17	001286	陕西能源	502,457.87	0.11
18	002304	洋河股份	499,047.00	0.11
19	688475	萤石网络	489,551.78	0.10
20	601166	兴业银行	481,170.00	0.10

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	106,877,114.00
卖出股票收入（成交）总额	93,345,468.66

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货

合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,266,328.95
2	应收清算款	149,146.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,415,475.37
---	----	--------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司一易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
3,683	88,404.10	172,704,98 6.00	53.04%	152,887,330 .00	46.96%	77,493,010 .00	23.80%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国银行股份有限公司一易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国工商银行股份有限公司一兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	34,364,700.00	10.55%
2	竞技世界（北京）网络技术有限公司	20,923,200.00	6.43%
3	陈建敏	10,000,000.00	3.07%
4	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	3.07%
5	招商银行股份有限公司一兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中	3,806,900.00	1.17%

	基金 (FOF)		
6	韩静兰	3,521,700.00	1.08%
7	于立	3,431,000.00	1.05%
8	中国平安财产保险股份有限公司—传 统一—普通保险产品	3,400,000.00	1.04%
9	华泰证券股份有限公司	3,235,298.00	0.99%
10	贾文琳	3,000,000.00	0.92%
11	中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式 指数证券投资基金发起式联接基金	77,493,010.00	23.80%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	0.00	0.0000%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年5月17日)基金份额总额	1,743,592,316.00
本报告期期初基金份额总额	315,592,316.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	26,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	325,592,316.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起王骏先生担任公司副总经理级高级管理人员（首席市场官）。本基金管理人于 2023 年 8 月 23 日发布公告，自 2023 年 8 月 21 日起刘晓艳女士担任公司董事长（联席），并仍担任公司总经理，原任公司副董事长职务自行免去；自 2023 年 8 月 21 日起吴欣荣先生担任公司执行总经理（总经理级），原任公司副总经理职务自行免去。

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 6 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 50,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注



	单元 数量	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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	35,582,912.82	19.46%	15,410.18	19.66%	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	54,062,597.36	29.57%	22,567.32	28.79%	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	92,769,531.95	50.73%	40,231.22	51.33%	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	441,266.00	0.24%	172.57	0.22%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

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

元的选择标准如下：

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	172,132.87	41.64%	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	241,291.73	58.36%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东海证券为一级交易商的公告	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	2023-03-01
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中金财富为一级交易商的公告	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	2023-03-17
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为一级交易商的公告	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	2023-03-29
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
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	2023-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
8	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	2023-04-22
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2023-05-26

		金电子披露网站	
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	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	2023-06-06
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-06-15
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-06-16
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加西部证券为一级交易商的公告	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	2023-07-03
14	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-07-20
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加山西证券为一级交易商的公告	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	2023-07-25
16	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国海证券为一级交易商的公告	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	2023-08-01
17	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	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	2023-08-11
18	易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-19
19	易方达基金管理有限公司董事长（联席）任职公告	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	2023-08-23
20	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	2023-08-23
21	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报	2023-08-30
22	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东莞证券为一级交易商的公告	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	2023-09-05
23	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加平安证券为一级交易商的公告	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	2023-09-15
24	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-10-25
25	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加	中国证券报、基金管理	2023-10-26

	甬兴证券为一级交易商的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
26	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加上海证券为一级交易商的公告	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	2023-11-13
27	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-12-16
28	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加金元证券为一级交易商的公告	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	2023-12-18
29	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加信达证券为一级交易商的公告	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	2023-12-20

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国银行股份有限公司一易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2023 年 01 月 01 日~2023 年 12 月 31 日	68,060,760.00	22,384,700.00	12,952,450.00	77,493,010.00	23.80%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

- 2.《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日