

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

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 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	9
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	54
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	54
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	54

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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情况	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	61
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	61
§ 12	备查文件目录	62
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 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	309,592,316.00 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。</p> <p>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。</p>
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；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
邮政编码		510620; 519031	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-15,058,948.82
本期利润	6,807,666.60

加权平均基金份额本期利润	0.0214
本期加权平均净值利润率	1.56%
本期基金份额净值增长率	1.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	113,629,155.70
期末可供分配基金份额利润	0.3670
期末基金资产净值	423,221,471.70
期末基金份额净值	1.3670
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	36.70%

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
过去一个月	-2.91%	0.51%	-3.88%	0.51%	0.97%	0.00%
过去三个月	-1.24%	0.78%	-2.61%	0.79%	1.37%	-0.01%
过去六个月	1.49%	0.98%	0.00%	0.98%	1.49%	0.00%
过去一年	-6.91%	0.90%	-10.40%	0.91%	3.49%	-0.01%
过去三年	-24.53%	1.03%	-33.59%	1.04%	9.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.70%	1.20%	-5.50%	1.21%	42.20%	-0.01%

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2024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 36.70%，同期业绩比较基准收益率为 -5.50%。

§ 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。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，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		
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	2020-09-05	-	10 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，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

<p>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 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 (自 2021 年 09 月 18 日至 2024 年 04 月 26 日)、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)、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证 A50ETF 的基金经理助理</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。本基金管理人制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 31 次，其中 26 次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，5 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。

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

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。

2024 年上半年，在新一轮稳增长宏观政策效应持续释放、内需及外需均有所改善、工业生产保持较快增长速度等积极因素的带动下，我国国民经济运行总体平稳，转型升级稳步推进，内生增长动力持续培育。按不变价格计算，上半年我国国内生产总值同比增长 5.0%。工业生产实现较快增长，全国规模以上工业增加值上半年同比增长 6.0%，其中高技术制造业和装备制造业的增速均快于全部规模以上工业。社会消费品零售、固定资产投资和货物进出口均保持同比增长态势，居民人均可支配收入继续增长。与此同时，我国经济发展仍然面临着诸多内外部挑战。国内大循环不够顺畅、有效需求不足、重点领域风险隐患较多等突出问题有待破局。外部环境更趋严峻复杂，国际层面的风险因素明显增多。

资本市场方面，国务院《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（新“国九条”）和一系列资本市场配套政策举措“组合拳”的推出，有望重塑资本市场生态，切实维护市场秩序和投资者合法权益，筑牢资本市场健康稳定发展的基础，形成促进资本市场高质量发展的合力。上半年 A 股市场整体呈现宽幅震荡的走势。行业方面，银行、煤炭、公用事业等行业表现居前，综

合、计算机、商贸零售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，2024 年上半年末指数点位与 2023 年末基本持平。

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 1.3670 元，本报告期份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.00%。年化跟踪误差 0.47%，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 年下半年，我国各领域进一步全面深化改革的实施方案有望落地。中共二十届三中全会提出高水平社会主义市场经济体制是中国式现代化的重要保障，高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务，对进一步全面深化改革做出系统部署。宏观调控政策方面，在落实好上半年已出台各项稳增长政策的基础上，积极的财政政策将更好地发力见效，稳健的货币政策将坚持灵活适度、精准有效，保持流动性合理充裕。政策聚焦关键环节发力，有望不断增强经济发展内生动力，提高内外循环的质量和水平。另一方面，当前经济运行中面临的主要风险需要有针对性地防范化解。综合来看，我国超大规模市场和完备的产业链蕴含强大的发展动能，经济运行面临的有利条件强于不利因素，宏观政策注重精准发力、加大逆周期调节力度，将巩固实体经济平稳运行的良好态势，同时有力推动新质生产力的不断发展，为完成全年经济社会发展目标提供关键助力。

指数成份公司的盈利是指数基金收益的直接来源，未来随着新一轮深化改革红利的逐步释放，符合高质量发展导向和新质生产力培育方向的 A 股各领域上市公司将迎来中长期发展机遇，财务业绩有望持续增长，为相关指数的上行提供动力。当前 A 股市场宽基指数的整体估值水平仍处于历史低位，在我国经济企稳复苏和全球资本市场流动性转向宽松的趋势下具备修复空间，作为长期资产配置的安全边际凸显。

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。

4.8 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合规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	8,110,798.76	10,259,758.59
结算备付金		2,657,518.59	1,646,868.82
存出保证金		1,231,590.71	1,266,328.95
交易性金融资产	6.4.7.2	411,599,631.87	425,798,662.10
其中：股票投资		411,599,631.87	425,798,662.10
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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	6.4.7.5	-	-
资产总计		423,599,539.93	439,120,764.88
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		164,031.85	21,887.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,052.88	54,439.56
应付托管费		17,684.30	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	6.4.7.6	143,299.20	485,896.30
负债合计		378,068.23	580,369.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	309,592,316.00	325,592,316.00
未分配利润	6.4.7.8	113,629,155.70	112,948,079.42
净资产合计		423,221,471.70	438,540,395.42
负债和净资产总计		423,599,539.93	439,120,764.88

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3670 元，基金份额总额 309,592,316.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,445,224.75	-2,829,754.43
1.利息收入		36,447.09	37,516.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,447.09	37,516.25
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）		-14,451,471.40	1,006,097.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,874,639.39	-3,647,367.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6,998.06	39,695.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	257,069.01	-536,221.80
股利收益	6.4.7.14	5,159,100.92	5,149,991.16
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	21,866,615.42	-3,866,470.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,366.36	-6,897.57
减：二、营业总支出		637,558.15	685,538.73
1. 管理人报酬		324,594.23	353,975.22
2. 托管费		108,198.07	117,991.75
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		927.33	0.08
8. 其他费用	6.4.7.18	203,838.52	213,571.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,807,666.60	-3,515,293.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,807,666.60	-3,515,293.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,807,666.60	-3,515,293.16

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	325,592,316.00	112,948,079.42	438,540,395.42

产			
二、本期期初净资产	325,592,316.00	112,948,079.42	438,540,395.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,000,000.00	681,076.28	-15,318,923.72
（一）、综合收益总额	-	6,807,666.60	6,807,666.60
（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）	-16,000,000.00	-6,126,590.32	-22,126,590.32
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	3,096,746.98	11,096,746.98
2.基金赎回款	-24,000,000.00	-9,223,337.30	-33,223,337.30
（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	309,592,316.00	113,629,155.70	423,221,471.70
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	-8,000,000.00	-7,837,706.85	-15,837,706.85
（一）、综合收益总额	-	-3,515,293.16	-3,515,293.16
（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）	-8,000,000.00	-4,322,413.69	-12,322,413.69
其中：1.基金申购款	10,000,000.00	5,390,827.00	15,390,827.00
2.基金赎回	-18,000,000.00	-9,713,240.69	-27,713,240.69

款			
(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	307,592,316.00	144,103,679.62	451,695,995.62

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：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《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。

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净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳

税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	8,110,798.76
等于：本金	8,110,111.51
加：应计利息	687.25
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	8,110,798.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	479,484,436.18	-	411,599,631.87	-67,884,804.31
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		479,484,436.18	-	411,599,631.87	-67,884,804.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,383,000.00	-	-	-
IC2409	2,081,760.00	-	-	-
IF2409	8,301,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,383,000.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IC2409	IC2409	2	1,950,080.00	-131,680.00
IF2409	IF2409	8	8,216,640.00	-84,600.00
合计	-	-	-	-216,280.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-216,280.00
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指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。

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,917.89
其中：交易所市场	3,917.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
其他应付款	54,845.95
合计	143,299.20

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	325,592,316.00	325,592,316.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
本期末	309,592,316.00	309,592,316.00

6.4.7.8 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	248,393,348.74	-135,445,269.32	112,948,079.42
本期期初	248,393,348.74	-135,445,269.32	112,948,079.42
本期利润	-15,058,948.82	21,866,615.42	6,807,666.60
本期基金份额交易产生的变动数	-11,789,013.41	5,662,423.09	-6,126,590.32
其中：基金申购款	5,894,671.99	-2,797,925.01	3,096,746.98
基金赎回款	-17,683,685.40	8,460,348.10	-9,223,337.30

本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,545,386.51	-107,916,230.81	113,629,155.70

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,834.02
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	21,537.39
其他	75.68
合计	36,447.09

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,884,396.35
股票投资收益——赎回差价收入	-1,990,243.04
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	-19,874,639.39

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	35,688,608.68
减：卖出股票成本总额	53,544,045.51
减：交易费用	28,959.52
买卖股票差价收入	-17,884,396.35

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	33,223,337.30
减：现金支付赎回款总额	11,797,182.30
减：赎回股票成本总额	23,416,398.04
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,990,243.04

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,994.40
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	6,998.06

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,999.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,999.85
减：应计利息总额	3.81
减：交易费用	1.24
买卖债券差价收入	6,994.40

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	257,069.01

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,159,100.92
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	5,159,100.92

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	22,222,155.42
——股票投资	22,222,155.42
——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	-355,540.00
——权证投资	-
——期货投资	-355,540.00
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	21,866,615.42

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-6,366.36
合计	-6,366.36

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	117,210.76
银行汇划费	2,092.40
合计	203,838.52

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	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
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	324,594.23	353,975.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,791.50	3,339.38
应支付基金管理人的净管理费	322,802.73	350,635.84

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	108,198.07	117,991.75

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	71,070,110.00	22.9560%	77,493,010.00	23.8006%
广发证券股份有限公司	3,770,302.00	1.2178%	1,957,302.00	0.6012%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	8,110,798.76	14,834.02	10,284,496.52	16,834.26

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期

2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 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 2024 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 68,200 股（2023 年 12 月 31 日:68,300 股），占本基金净值比例为 0.20%(2023 年 12 月 31 日:0.22%)；持有中银证券发行的 A 股中银证券 31,900 股（2023 年 12 月 31 日:32,600 股），占本基金净值比例为 0.07%(2023 年 12 月 31 日:0.08%)；持有中国银行发行的 A 股中国银行 405,100 股（2023 年 12 月 31 日:406,200 股），占本基金净值比例为 0.44%(2023 年 12 月 31 日:0.37%)。

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（2024 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	受限期	流通受限类	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

				型						
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	959	67,632.37	180,301.59	-

30159 1	肯特 股份	2024-0 2-20	6 个月	新股 流通 受限	19.43	36.98	219	4,255. 17	8,098. 62	-
60103 3	永兴 股份	2024-0 1-11	6 个月	新股 流通 受限	16.20	15.96	620	10,044 .00	9,895. 20	-
60308 2	北自 科技	2024-0 1-23	6 个月	新股 流通 受限	21.28	29.49	107	2,276. 96	3,155. 43	-
60328 5	键邦 股份	2024-0 6-28	1 个月 以内	新股 流通 受限	18.65	18.65	1,158	21,596 .70	21,596 .70	-
60328 5	键邦 股份	2024-0 6-28	6 个月	新股 流通 受限	18.65	18.65	129	2,405. 85	2,405. 85	-
60331 2	西典 新能	2024-0 1-04	6 个月	新股 流通 受限	29.02	25.36	130	3,772. 60	3,296. 80	-
60332 5	博隆 技术	2024-0 1-03	6 个月	新股 流通 受限	72.46	68.06	66	4,782. 36	4,491. 96	-
60334 1	龙旗 科技	2024-0 2-23	6 个月	新股 流通 受限	26.00	37.49	244	6,344. 00	9,147. 56	-
60334 4	星德 胜	2024-0 3-13	6 个月	新股 流通 受限	19.18	22.66	182	3,490. 76	4,124. 12	-
60335 0	安乃 达	2024-0 6-26	1 个月 以内	新股 流通 受限	20.56	20.56	945	19,429 .20	19,429 .20	-
60335 0	安乃 达	2024-0 6-26	6 个月	新股 流通 受限	20.56	20.56	106	2,179. 36	2,179. 36	-
60337 5	盛景 微	2024-0 1-17	6 个月	新股 流通 受限	38.18	38.90	72	2,748. 96	2,800. 80	-
60338 1	永臻 股份	2024-0 6-19	6 个月	新股 流通 受限	23.35	25.13	178	4,156. 30	4,473. 14	-
68853 0	欧莱 新材	2024-0 4-29	6 个月	新股 流通 受限	9.60	16.10	344	3,302. 40	5,538. 40	-
68858 4	上海 合晶	2024-0 2-01	6 个月	新股 流通	22.66	15.89	670	15,182 .20	10,646 .30	-

				受限						
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	168	14,609.28	29,388.24	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	833	13,069.77	15,652.07	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 2024 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。

6.4.13.2 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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024 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(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。

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。

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。

6.4.13.4 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。

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	8,110,798.76	-	-	-	8,110,798.76
结算备付金	2,657,518.59	-	-	-	2,657,518.59
存出保证金	1,231,590.71	-	-	-	1,231,590.71
交易性金融资产	-	-	-	411,599,631.87	411,599,631.87
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	11,999,908.06	-	-	411,599,631.87	423,599,539.93
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	-	-	-	164,031.85	164,031.85
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	53,052.88	53,052.88
应付托管费	-	-	-	17,684.30	17,684.30
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	-	-	-	143,299.20	143,299.20
负债总计	-	-	-	378,068.23	378,068.23
利率敏感度缺口	11,999,908.06	-	-	411,221,563.64	423,221,471.70
上年度末 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

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，因此无重大外汇风险。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	411,599,631.87	97.25	425,798,662.10	97.09
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	411,599,631.87	97.25	425,798,662.10	97.09

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	20,537,992.08	21,253,730.07
	2.业绩比较基准下降 5%	-20,537,992.08	-21,253,730.07

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024年6月30日
第一层次	411,132,056.15
第二层次	45,611.11
第三层次	421,964.61
合计	411,599,631.87

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 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	411,599,631.87	97.17
	其中：股票	411,599,631.87	97.17
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	10,768,317.35	2.54
8	其他各项资产	1,231,590.71	0.29
9	合计	423,599,539.93	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	4,515,304.80	1.07
B	采矿业	27,191,064.84	6.42
C	制造业	220,624,981.89	52.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,446,555.32	5.07
E	建筑业	8,659,471.40	2.05
F	批发和零售业	2,715,883.88	0.64

G	交通运输、仓储和邮政业	16,851,520.60	3.98
H	住宿和餐饮业	238,992.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,729,120.21	3.48
J	金融业	82,615,224.82	19.52
K	房地产业	3,876,029.20	0.92
L	租赁和商务服务业	3,184,952.42	0.75
M	科学研究和技术服务业	1,671,567.25	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	409,558.80	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,257,227.04	0.30
R	文化、体育和娱乐业	1,368,593.40	0.32
S	综合	243,584.00	0.06
	合计	411,599,631.87	97.25

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	14,500	21,277,155.00	5.03
2	300750	宁德时代	50,700	9,127,521.00	2.16
3	600900	长江电力	282,221	8,161,831.32	1.93
4	600036	招商银行	237,687	8,126,518.53	1.92
5	000858	五粮液	44,800	5,736,192.00	1.36
6	002594	比亚迪	20,900	5,230,225.00	1.24
7	601318	中国平安	124,009	5,129,012.24	1.21
8	601288	农业银行	977,200	4,260,592.00	1.01
9	601166	兴业银行	239,357	4,217,470.34	1.00
10	601138	工业富联	152,400	4,175,760.00	0.99
11	601899	紫金矿业	237,200	4,167,604.00	0.98
12	601398	工商银行	724,200	4,127,940.00	0.98
13	300760	迈瑞医疗	13,977	4,066,049.07	0.96
14	601328	交通银行	451,849	3,375,312.03	0.80
15	601088	中国神华	76,000	3,372,120.00	0.80
16	002475	立讯精密	82,786	3,254,317.66	0.77
17	601816	京沪高铁	565,800	3,038,346.00	0.72
18	600809	山西汾酒	14,072	2,967,503.36	0.70

19	600309	万华化学	36,200	2,927,132.00	0.69
20	601225	陕西煤业	111,700	2,878,509.00	0.68
21	600276	恒瑞医药	73,473	2,825,771.58	0.67
22	600000	浦发银行	338,247	2,783,772.81	0.66
23	002714	牧原股份	63,024	2,747,846.40	0.65
24	000333	美的集团	40,000	2,580,000.00	0.61
25	600030	中信证券	141,065	2,571,614.95	0.61
26	601857	中国石油	248,751	2,567,110.32	0.61
27	601668	中国建筑	479,580	2,546,569.80	0.60
28	000568	泸州老窖	17,000	2,439,330.00	0.58
29	600028	中国石化	374,000	2,363,680.00	0.56
30	601985	中国核电	217,600	2,319,616.00	0.55
31	600406	国电南瑞	92,537	2,309,723.52	0.55
32	601919	中远海控	147,020	2,277,339.80	0.54
33	000001	平安银行	223,600	2,269,540.00	0.54
34	601601	中国太保	78,857	2,196,956.02	0.52
35	601766	中国中车	280,300	2,105,053.00	0.50
36	600150	中国船舶	51,300	2,088,423.00	0.49
37	600690	海尔智家	72,653	2,061,892.14	0.49
38	002352	顺丰控股	56,400	2,012,916.00	0.48
39	002371	北方华创	6,100	1,951,329.00	0.46
40	300059	东方财富	181,925	1,921,128.00	0.45
41	600887	伊利股份	73,378	1,896,087.52	0.45
42	688041	海光信息	26,881	1,890,271.92	0.45
43	601988	中国银行	405,100	1,871,562.00	0.44
44	603288	海天味业	53,356	1,839,181.32	0.43
45	300308	中际旭创	12,940	1,784,167.20	0.42
46	000725	京东方 A	425,900	1,741,931.00	0.41
47	603993	洛阳钼业	202,800	1,723,800.00	0.41
48	600050	中国联通	366,400	1,722,080.00	0.41
49	601818	光大银行	535,200	1,696,584.00	0.40
50	600019	宝钢股份	254,900	1,695,085.00	0.40
51	601658	邮储银行	331,300	1,679,691.00	0.40
52	002142	宁波银行	76,120	1,679,207.20	0.40
53	600031	三一重工	97,800	1,613,700.00	0.38
54	601127	赛力斯	17,400	1,585,488.00	0.37
55	600886	国投电力	86,000	1,568,640.00	0.37
56	600919	江苏银行	210,366	1,563,019.38	0.37
57	601390	中国中铁	236,700	1,543,284.00	0.36
58	600016	民生银行	407,080	1,542,833.20	0.36
59	300498	温氏股份	76,320	1,512,662.40	0.36
60	300274	阳光电源	23,860	1,480,035.80	0.35
61	600989	宝丰能源	84,500	1,464,385.00	0.35
62	601006	大秦铁路	201,400	1,442,024.00	0.34

63	600436	片仔癀	6,953	1,440,453.01	0.34
64	600905	三峡能源	328,200	1,430,952.00	0.34
65	601169	北京银行	243,800	1,423,792.00	0.34
66	601888	中国中免	22,458	1,403,400.42	0.33
67	002304	洋河股份	17,344	1,400,354.56	0.33
68	603501	韦尔股份	14,000	1,391,180.00	0.33
69	000063	中兴通讯	46,400	1,297,808.00	0.31
70	000625	长安汽车	94,888	1,274,345.84	0.30
71	000651	格力电器	32,400	1,270,728.00	0.30
72	000338	潍柴动力	77,900	1,265,096.00	0.30
73	601009	南京银行	118,400	1,230,176.00	0.29
74	600104	上汽集团	88,500	1,226,610.00	0.29
75	600795	国电电力	204,700	1,226,153.00	0.29
76	601012	隆基绿能	86,908	1,218,450.16	0.29
77	600048	保利发展	137,300	1,202,748.00	0.28
78	688111	金山办公	5,261	1,196,877.50	0.28
79	600999	招商证券	85,547	1,189,958.77	0.28
80	601229	上海银行	162,642	1,180,780.92	0.28
81	601211	国泰君安	86,600	1,173,430.00	0.28
82	601600	中国铝业	151,700	1,157,471.00	0.27
83	603259	药明康德	29,175	1,143,368.25	0.27
84	002230	科大讯飞	26,600	1,142,470.00	0.27
85	600547	山东黄金	41,684	1,141,307.92	0.27
86	600346	恒力石化	80,800	1,127,160.00	0.27
87	002493	荣盛石化	115,950	1,120,077.00	0.26
88	600893	航发动力	30,636	1,119,745.80	0.26
89	000166	申万宏源	258,700	1,114,997.00	0.26
90	300015	爱尔眼科	107,597	1,110,401.04	0.26
91	601669	中国电建	198,500	1,109,615.00	0.26
92	600660	福耀玻璃	23,035	1,103,376.50	0.26
93	000792	盐湖股份	62,600	1,092,370.00	0.26
94	600585	海螺水泥	46,100	1,087,499.00	0.26
95	002938	鹏鼎控股	26,800	1,065,568.00	0.25
96	000538	云南白药	20,680	1,057,782.00	0.25
97	600674	川投能源	56,000	1,050,000.00	0.25
98	688271	联影医疗	9,560	1,048,732.00	0.25
99	300433	蓝思科技	57,200	1,043,900.00	0.25
100	601688	华泰证券	84,200	1,043,238.00	0.25
101	688012	中微公司	7,203	1,017,495.78	0.24
102	600011	华能国际	105,200	1,012,024.00	0.24
103	002027	分众传媒	166,400	1,008,384.00	0.24
104	600188	兖矿能源	43,900	997,847.00	0.24
105	688036	传音控股	13,018	996,397.72	0.24
106	000596	古井贡酒	4,700	992,029.00	0.23

107	600438	通威股份	51,900	991,809.00	0.23
108	601628	中国人寿	31,879	989,842.95	0.23
109	601111	中国国航	133,600	985,968.00	0.23
110	600015	华夏银行	152,782	977,804.80	0.23
111	000425	徐工机械	136,200	973,830.00	0.23
112	601066	中信建投	49,700	956,228.00	0.23
113	600837	海通证券	110,800	948,448.00	0.22
114	688256	寒武纪	4,771	947,854.57	0.22
115	000895	双汇发展	39,700	943,669.00	0.22
116	300014	亿纬锂能	23,591	941,752.72	0.22
117	000100	TCL 科技	215,520	931,046.40	0.22
118	001979	招商蛇口	104,000	914,160.00	0.22
119	600023	浙能电力	128,300	912,213.00	0.22
120	002311	海大集团	19,200	903,360.00	0.21
121	601881	中国银河	83,100	902,466.00	0.21
122	600926	杭州银行	68,060	888,183.00	0.21
123	300502	新易盛	8,200	865,510.00	0.20
124	003816	中国广核	181,300	839,419.00	0.20
125	000776	广发证券	68,200	829,994.00	0.20
126	601995	中金公司	27,900	826,119.00	0.20
127	600489	中金黄金	55,600	822,880.00	0.19
128	605499	东鹏饮料	3,800	819,850.00	0.19
129	601939	建设银行	110,600	818,440.00	0.19
130	600089	特变电工	58,035	804,945.45	0.19
131	603392	万泰生物	12,150	800,442.00	0.19
132	002463	沪电股份	21,910	799,715.00	0.19
133	601868	中国能建	373,700	792,244.00	0.19
134	600115	中国东航	197,200	790,772.00	0.19
135	601872	招商轮船	93,500	790,075.00	0.19
136	300124	汇川技术	15,400	790,020.00	0.19
137	600845	宝信软件	24,733	789,724.69	0.19
138	000002	万科 A	112,000	776,160.00	0.18
139	300122	智飞生物	27,550	772,226.50	0.18
140	002241	歌尔股份	39,400	768,694.00	0.18
141	600029	南方航空	129,400	762,166.00	0.18
142	688008	澜起科技	13,201	754,569.16	0.18
143	601825	沪农商行	111,200	747,264.00	0.18
144	600160	巨化股份	30,800	743,204.00	0.18
145	603986	兆易创新	7,740	740,098.80	0.17
146	601901	方正证券	94,900	733,577.00	0.17
147	600010	包钢股份	523,200	732,480.00	0.17
148	000938	紫光股份	32,638	729,459.30	0.17
149	601633	长城汽车	28,600	723,580.00	0.17
150	601100	恒立液压	15,432	718,822.56	0.17

151	601689	拓普集团	13,400	718,374.00	0.17
152	601336	新华保险	23,900	717,717.00	0.17
153	600111	北方稀土	41,700	717,240.00	0.17
154	002648	卫星化学	38,369	689,874.62	0.16
155	688223	晶科能源	96,070	682,097.00	0.16
156	002001	新和成	35,476	681,139.20	0.16
157	601916	浙商银行	245,480	677,524.80	0.16
158	000983	山西焦煤	65,440	674,686.40	0.16
159	600027	华电国际	97,000	673,180.00	0.16
160	600703	三安光电	57,300	671,556.00	0.16
161	603369	今世缘	14,500	669,900.00	0.16
162	601838	成都银行	43,500	660,765.00	0.16
163	600958	东方证券	86,152	654,755.20	0.15
164	600039	四川路桥	82,740	652,818.60	0.15
165	600426	华鲁恒升	24,486	652,307.04	0.15
166	601788	光大证券	44,540	651,174.80	0.15
167	600066	宇通客车	25,200	650,160.00	0.15
168	600584	长电科技	20,500	650,055.00	0.15
169	300033	同花顺	6,200	642,940.00	0.15
170	300408	三环集团	22,000	642,180.00	0.15
171	601021	春秋航空	11,300	636,529.00	0.15
172	002736	国信证券	73,000	634,370.00	0.15
173	601618	中国中冶	203,400	630,540.00	0.15
174	002916	深南电路	5,920	626,158.40	0.15
175	000999	华润三九	14,690	625,500.20	0.15
176	601360	三六零	81,389	625,067.52	0.15
177	000157	中联重科	80,800	620,544.00	0.15
178	600803	新奥股份	29,800	619,840.00	0.15
179	601699	潞安环能	34,100	618,233.00	0.15
180	600026	中远海能	39,600	618,156.00	0.15
181	600522	中天科技	38,900	616,565.00	0.15
182	001965	招商公路	51,800	614,348.00	0.15
183	600233	圆通速递	39,200	613,480.00	0.14
184	000977	浪潮信息	16,828	612,034.36	0.14
185	300832	新产业	9,000	606,960.00	0.14
186	601607	上海医药	31,700	605,787.00	0.14
187	300896	爱美客	3,500	602,350.00	0.14
188	000301	东方盛虹	75,300	600,141.00	0.14
189	600085	同仁堂	15,700	599,897.00	0.14
190	002252	上海莱士	75,700	591,974.00	0.14
191	600600	青岛啤酒	8,127	591,401.79	0.14
192	600741	华域汽车	36,100	591,318.00	0.14
193	002028	思源电气	8,800	588,720.00	0.14
194	600875	东方电气	31,600	583,020.00	0.14

195	002236	大华股份	37,700	582,842.00	0.14
196	000786	北新建材	19,400	575,404.00	0.14
197	688396	华润微	15,328	573,880.32	0.14
198	601117	中国化学	69,600	573,504.00	0.14
199	002600	领益智造	80,400	572,448.00	0.14
200	603195	公牛集团	7,395	570,302.40	0.13
201	300394	天孚通信	6,440	569,424.80	0.13
202	688169	石头科技	1,446	567,699.60	0.13
203	600183	生益科技	26,900	566,514.00	0.13
204	601567	三星医疗	16,100	563,500.00	0.13
205	002422	科伦药业	18,500	561,105.00	0.13
206	000963	华东医药	20,140	560,093.40	0.13
207	600362	江西铜业	23,600	558,848.00	0.13
208	002920	德赛西威	6,400	557,376.00	0.13
209	601319	中国人保	107,800	555,170.00	0.13
210	600161	天坛生物	22,680	553,392.00	0.13
211	002128	电投能源	25,900	546,490.00	0.13
212	600196	复星医药	24,200	535,788.00	0.13
213	000807	云铝股份	39,500	533,645.00	0.13
214	601727	上海电气	144,200	533,540.00	0.13
215	000617	中油资本	96,000	529,920.00	0.13
216	002460	赣锋锂业	18,460	528,879.00	0.12
217	300628	亿联网络	14,360	528,017.20	0.12
218	601058	赛轮轮胎	37,500	525,000.00	0.12
219	000630	铜陵有色	144,300	520,923.00	0.12
220	000708	中信特钢	38,300	519,731.00	0.12
221	000933	神火股份	25,600	517,888.00	0.12
222	600733	北汽蓝谷	63,900	516,312.00	0.12
223	000975	银泰黄金	31,640	515,415.60	0.12
224	605117	德业股份	6,928	515,027.52	0.12
225	600985	淮北矿业	30,700	513,918.00	0.12
226	002049	紫光国微	9,680	509,168.00	0.12
227	300999	金龙鱼	18,608	508,928.80	0.12
228	600219	南山铝业	133,400	508,254.00	0.12
229	601077	渝农商行	100,800	506,016.00	0.12
230	002466	天齐锂业	16,900	505,479.00	0.12
231	600398	海澜之家	54,700	505,428.00	0.12
232	002601	龙佰集团	27,200	505,104.00	0.12
233	600176	中国巨石	45,579	503,647.95	0.12
234	600256	广汇能源	74,788	501,079.60	0.12
235	601377	兴业证券	98,830	500,079.80	0.12
236	688009	中国通号	82,245	493,470.00	0.12
237	600642	申能股份	55,800	492,714.00	0.12
238	601168	西部矿业	27,100	486,445.00	0.11

239	300782	卓胜微	6,116	475,457.84	0.11
240	601878	浙商证券	44,200	473,824.00	0.11
241	000876	新希望	51,800	473,452.00	0.11
242	601179	中国西电	58,800	472,752.00	0.11
243	600332	白云山	16,032	470,218.56	0.11
244	601877	正泰电器	24,500	466,970.00	0.11
245	600415	小商品城	62,800	465,976.00	0.11
246	000423	东阿阿胶	7,400	463,240.00	0.11
247	600018	上港集团	80,000	462,400.00	0.11
248	600009	上海机场	14,200	457,950.00	0.11
249	600918	中泰证券	79,800	452,466.00	0.11
250	300661	圣邦股份	5,435	449,909.30	0.11
251	300413	芒果超媒	21,510	449,559.00	0.11
252	300418	昆仑万维	13,800	444,912.00	0.11
253	002078	太阳纸业	31,800	443,610.00	0.10
254	600487	亨通光电	28,100	443,137.00	0.10
255	603198	迎驾贡酒	7,700	442,750.00	0.10
256	603806	福斯特	29,971	440,573.70	0.10
257	601233	桐昆股份	27,500	438,900.00	0.10
258	601865	福莱特	21,700	436,170.00	0.10
259	300866	安克创新	6,110	435,093.10	0.10
260	603799	华友钴业	19,637	434,566.81	0.10
261	601238	广汽集团	56,100	434,214.00	0.10
262	688188	柏楚电子	2,348	433,323.40	0.10
263	000408	藏格矿业	18,000	433,260.00	0.10
264	002532	天山铝业	53,300	432,263.00	0.10
265	688126	沪硅产业	31,298	432,225.38	0.10
266	000661	长春高新	4,700	431,319.00	0.10
267	002223	鱼跃医疗	11,400	428,640.00	0.10
268	300316	晶盛机电	14,900	428,077.00	0.10
269	002180	纳思达	16,200	428,004.00	0.10
270	002459	晶澳科技	38,016	425,779.20	0.10
271	002625	光启技术	24,500	425,075.00	0.10
272	603260	合盛硅业	9,100	425,061.00	0.10
273	601991	大唐发电	141,200	425,012.00	0.10
274	688599	天合光能	24,829	420,106.68	0.10
275	688303	大全能源	20,364	415,221.96	0.10
276	002353	杰瑞股份	11,800	413,944.00	0.10
277	600061	国投资本	73,208	413,625.20	0.10
278	600348	华阳股份	41,050	408,858.00	0.10
279	600515	海南机场	130,200	408,828.00	0.10
280	002050	三花智控	21,400	408,312.00	0.10
281	688187	时代电气	8,249	407,335.62	0.10
282	600096	云天化	20,900	405,878.00	0.10

283	002384	东山精密	19,600	405,720.00	0.10
284	002064	华峰化学	56,500	405,105.00	0.10
285	300765	新诺威	15,960	402,670.80	0.10
286	600745	闻泰科技	14,200	401,150.00	0.09
287	603568	伟明环保	19,420	399,663.60	0.09
288	002129	TCL 中环	46,075	398,548.75	0.09
289	600418	江淮汽车	25,100	397,584.00	0.09
290	000027	深圳能源	54,180	395,514.00	0.09
291	688072	拓荆科技	3,271	392,879.81	0.09
292	300442	润泽科技	16,400	392,780.00	0.09
293	600588	用友网络	38,922	389,220.00	0.09
294	002156	通富微电	17,300	387,347.00	0.09
295	002074	国轩高科	20,200	386,830.00	0.09
296	300751	迈为股份	3,228	385,681.44	0.09
297	603606	东方电缆	7,900	385,599.00	0.09
298	601958	金钼股份	36,800	383,088.00	0.09
299	002709	天赐材料	21,800	382,808.00	0.09
300	301236	软通动力	10,850	382,028.50	0.09
301	600570	恒生电子	21,487	379,460.42	0.09
302	600177	雅戈尔	53,000	377,360.00	0.09
303	601577	长沙银行	46,000	376,280.00	0.09
304	002340	格林美	58,500	372,645.00	0.09
305	601799	星宇股份	3,300	369,732.00	0.09
306	600060	海信视像	14,900	368,626.00	0.09
307	603160	汇顶科技	5,300	364,375.00	0.09
308	600970	中材国际	30,200	364,212.00	0.09
309	601216	君正集团	96,600	356,454.00	0.08
310	603979	金诚信	7,000	353,710.00	0.08
311	601108	财通证券	53,150	351,321.50	0.08
312	002812	恩捷股份	11,100	351,315.00	0.08
313	603338	浙江鼎力	5,800	350,436.00	0.08
314	000932	华菱钢铁	79,100	350,413.00	0.08
315	600282	南钢股份	70,200	349,596.00	0.08
316	688777	中控技术	9,187	346,349.90	0.08
317	002409	雅克科技	5,500	346,005.00	0.08
318	000988	华工科技	11,500	344,195.00	0.08
319	002595	豪迈科技	9,000	343,530.00	0.08
320	603659	璞泰来	24,312	343,528.56	0.08
321	688120	华海清科	1,803	341,812.74	0.08
322	000921	海信家电	10,600	341,744.00	0.08
323	600038	中直股份	8,300	341,213.00	0.08
324	002294	信立泰	12,800	340,864.00	0.08
325	002444	巨星科技	13,800	340,860.00	0.08
326	600132	重庆啤酒	5,600	339,920.00	0.08

327	603939	益丰药房	13,844	339,870.20	0.08
328	601231	环旭电子	21,100	338,655.00	0.08
329	601555	东吴证券	57,259	337,828.10	0.08
330	600873	梅花生物	33,700	337,674.00	0.08
331	002281	光迅科技	9,000	336,330.00	0.08
332	600566	济川药业	10,600	336,126.00	0.08
333	300919	中伟股份	10,720	332,212.80	0.08
334	603899	晨光股份	10,600	331,568.00	0.08
335	002555	三七互娱	25,300	330,165.00	0.08
336	600460	士兰微	18,800	329,188.00	0.08
337	600546	山煤国际	22,500	328,950.00	0.08
338	002007	华兰生物	20,690	326,695.10	0.08
339	600895	张江高科	17,600	325,248.00	0.08
340	600582	天地科技	47,200	325,208.00	0.08
341	601990	南京证券	42,300	324,864.00	0.08
342	301269	华大九天	4,200	323,610.00	0.08
343	000066	中国长城	36,900	322,875.00	0.08
344	600079	人福医药	18,700	321,079.00	0.08
345	600109	国金证券	42,500	320,875.00	0.08
346	002085	万丰奥威	24,200	320,408.00	0.08
347	600352	浙江龙盛	37,300	320,407.00	0.08
348	300207	欣旺达	21,100	320,087.00	0.08
349	601928	凤凰传媒	29,200	320,032.00	0.08
350	600021	上海电力	32,300	319,447.00	0.08
351	300003	乐普医疗	21,500	319,060.00	0.08
352	600968	海油发展	77,200	318,064.00	0.08
353	002673	西部证券	51,200	316,928.00	0.07
354	300759	康龙化成	17,050	316,789.00	0.07
355	002966	苏州银行	42,200	316,500.00	0.07
356	601666	平煤股份	28,200	315,840.00	0.07
357	603486	科沃斯	6,600	311,388.00	0.07
358	600497	驰宏锌锗	58,300	311,322.00	0.07
359	300223	北京君正	5,600	310,464.00	0.07
360	600988	赤峰黄金	19,000	310,460.00	0.07
361	688363	华熙生物	5,488	310,456.16	0.07
362	002939	长城证券	46,300	310,210.00	0.07
363	688065	凯赛生物	6,817	309,423.63	0.07
364	603833	欧派家居	5,764	308,719.84	0.07
365	603658	安图生物	6,700	308,669.00	0.07
366	000783	长江证券	63,700	307,671.00	0.07
367	600153	建发股份	34,400	307,192.00	0.07
368	000831	中国稀土	12,100	306,735.00	0.07
369	603156	养元饮品	14,400	306,288.00	0.07
370	002032	苏泊尔	6,100	305,610.00	0.07

371	603816	顾家家居	9,430	304,494.70	0.07
372	601966	玲珑轮胎	16,575	304,482.75	0.07
373	000728	国元证券	50,000	303,000.00	0.07
374	000738	航发控制	15,000	301,050.00	0.07
375	002739	万达电影	24,800	299,832.00	0.07
376	600583	海油工程	50,700	299,637.00	0.07
377	002185	华天科技	36,700	299,105.00	0.07
378	688728	格科微	24,690	298,995.90	0.07
379	000683	远兴能源	43,000	297,130.00	0.07
380	000703	恒逸石化	41,780	296,220.20	0.07
381	002152	广电运通	28,300	296,018.00	0.07
382	601198	东兴证券	37,000	294,520.00	0.07
383	002603	以岭药业	19,140	293,416.20	0.07
384	002465	海格通信	28,300	293,188.00	0.07
385	600536	中国软件	9,790	292,916.80	0.07
386	601866	中远海发	113,500	292,830.00	0.07
387	002602	世纪华通	85,360	292,784.80	0.07
388	000960	锡业股份	18,900	292,761.00	0.07
389	688122	西部超导	7,615	291,806.80	0.07
390	002456	欧菲光	37,300	291,313.00	0.07
391	600521	华海药业	17,070	291,043.50	0.07
392	603893	瑞芯微	4,900	289,933.00	0.07
393	601696	中银证券	31,900	289,652.00	0.07
394	002414	高德红外	48,903	288,038.67	0.07
395	000729	燕京啤酒	32,400	286,092.00	0.07
396	688099	晶晨股份	4,819	285,863.08	0.07
397	300251	光线传媒	33,600	282,576.00	0.07
398	600998	九州通	57,881	282,459.28	0.07
399	002372	伟星新材	18,300	282,186.00	0.07
400	600549	厦门钨业	16,300	281,175.00	0.07
401	688082	盛美上海	3,295	278,460.45	0.07
402	603885	吉祥航空	25,200	276,948.00	0.07
403	600298	安琪酵母	9,900	276,507.00	0.07
404	600369	西南证券	76,600	274,228.00	0.06
405	002262	恩华药业	11,500	273,010.00	0.06
406	603596	伯特利	7,000	272,300.00	0.06
407	002831	裕同科技	10,600	271,254.00	0.06
408	000800	一汽解放	34,600	270,918.00	0.06
409	603589	口子窖	6,900	270,411.00	0.06
410	000937	冀中能源	40,300	270,010.00	0.06
411	603529	爱玛科技	9,800	267,834.00	0.06
412	000629	钒钛股份	107,100	267,750.00	0.06
413	601880	辽港股份	216,100	265,803.00	0.06
414	000733	振华科技	6,400	265,792.00	0.06

415	600511	国药股份	8,600	264,794.00	0.06
416	002821	凯莱英	4,020	264,516.00	0.06
417	002202	金风科技	39,346	264,405.12	0.06
418	300146	汤臣倍健	19,500	264,225.00	0.06
419	601456	国联证券	27,200	262,208.00	0.06
420	600486	扬农化工	4,620	260,799.00	0.06
421	688538	和辉光电	131,558	260,484.84	0.06
422	000513	丽珠集团	7,000	260,470.00	0.06
423	002120	韵达股份	33,270	257,509.80	0.06
424	600004	白云机场	27,000	255,960.00	0.06
425	600598	北大荒	20,400	254,796.00	0.06
426	000009	中国宝安	29,600	254,560.00	0.06
427	603000	人民网	12,700	253,873.00	0.06
428	603345	安井食品	3,400	252,654.00	0.06
429	600704	物产中大	58,100	252,154.00	0.06
430	002430	杭氧股份	11,200	249,200.00	0.06
431	002080	中材科技	19,300	248,970.00	0.06
432	600848	上海临港	27,320	248,885.20	0.06
433	600378	昊华科技	8,600	248,540.00	0.06
434	300454	深信服	4,900	247,597.00	0.06
435	002797	第一创业	48,500	246,865.00	0.06
436	300037	新宙邦	8,580	245,044.80	0.06
437	600673	东阳光	34,600	243,584.00	0.06
438	300144	宋城演艺	30,180	242,345.40	0.06
439	603290	斯达半导	2,800	241,108.00	0.06
440	300487	蓝晓科技	5,750	240,120.00	0.06
441	600699	均胜电子	16,200	240,084.00	0.06
442	600380	健康元	21,400	239,038.00	0.06
443	600754	锦江酒店	10,400	238,992.00	0.06
444	002508	老板电器	10,800	238,680.00	0.06
445	600839	四川长虹	52,800	237,072.00	0.06
446	300496	中科创达	5,200	237,068.00	0.06
447	002850	科达利	3,100	236,778.00	0.06
448	300957	贝泰妮	4,900	236,768.00	0.06
449	000723	美锦能源	49,700	236,572.00	0.06
450	300699	光威复材	9,520	236,381.60	0.06
451	002841	视源股份	8,000	236,240.00	0.06
452	600637	东方明珠	38,500	234,080.00	0.06
453	002517	恺英网络	24,500	233,975.00	0.06
454	002056	横店东磁	18,700	233,189.00	0.06
455	600072	中船科技	17,200	232,544.00	0.05
456	000987	越秀资本	46,693	231,597.28	0.05
457	000709	河钢股份	118,700	230,278.00	0.05
458	688114	华大智造	4,834	229,179.94	0.05

459	600655	豫园股份	43,600	224,540.00	0.05
460	600977	中国电影	20,800	223,808.00	0.05
461	002738	中矿资源	8,336	223,404.80	0.05
462	600705	中航产融	100,500	223,110.00	0.05
463	600702	舍得酒业	3,900	221,013.00	0.05
464	002756	永兴材料	6,170	220,762.60	0.05
465	000825	太钢不锈	64,000	216,320.00	0.05
466	601162	天风证券	98,700	215,166.00	0.05
467	600779	水井坊	5,700	214,491.00	0.05
468	600170	上海建工	99,600	214,140.00	0.05
469	300347	泰格医药	4,350	211,410.00	0.05
470	600884	杉杉股份	25,700	208,684.00	0.05
471	600166	福田汽车	91,900	206,775.00	0.05
472	300142	沃森生物	17,900	203,702.00	0.05
473	600872	中炬高新	8,900	201,941.00	0.05
474	300601	康泰生物	12,820	200,120.20	0.05
475	600563	法拉电子	2,600	198,068.00	0.05
476	300763	锦浪科技	4,700	195,708.00	0.05
477	603728	鸣志电器	4,800	193,104.00	0.05
478	603233	大参林	13,020	186,186.00	0.04
479	600732	爱旭股份	20,400	184,620.00	0.04
480	603688	石英股份	6,100	180,621.00	0.04
481	301589	诺瓦星云	959	180,301.59	0.04
482	002271	东方雨虹	14,400	177,696.00	0.04
483	603077	和邦生物	98,800	163,020.00	0.04
484	603882	金城医学	5,400	146,826.00	0.03
485	688692	达梦数据	168	29,388.24	0.01
486	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
487	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
488	688709	成都华微	833	15,652.07	0.00
489	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
490	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
491	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
492	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
493	688584	上海合晶	670	10,646.30	0.00
494	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
495	601033	永兴股份	620	9,895.20	0.00
496	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
497	603341	龙旗科技	244	9,147.56	0.00
498	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
499	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
500	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
501	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
502	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00

503	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
504	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
505	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
506	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
507	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
508	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
509	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
510	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
511	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
512	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
513	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
514	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	000333	美的集团	2,699,886.00	0.62
2	600519	贵州茅台	1,130,096.00	0.26
3	300750	宁德时代	605,338.00	0.14
4	001965	招商公路	586,398.22	0.13
5	000708	中信特钢	578,534.00	0.13
6	000858	五粮液	477,042.00	0.11
7	601567	三星医疗	457,051.00	0.10
8	000921	海信家电	430,621.00	0.10
9	688041	海光信息	416,828.46	0.10
10	601881	中国银河	406,170.00	0.09
11	603979	金诚信	397,862.00	0.09
12	600036	招商银行	388,960.00	0.09
13	601666	平煤股份	366,713.00	0.08
14	600282	南钢股份	363,552.00	0.08
15	002085	万丰奥威	362,032.00	0.08
16	688114	华大智造	347,031.66	0.08
17	600582	天地科技	337,556.00	0.08
18	600900	长江电力	332,498.00	0.08
19	600968	海油发展	324,390.00	0.07
20	300760	迈瑞医疗	323,912.00	0.07

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	300750	宁德时代	666,790.00	0.15
2	600221	海航控股	546,453.00	0.12
3	000858	五粮液	521,356.00	0.12
4	688692	达梦数据	373,736.00	0.09
5	300760	迈瑞医疗	353,064.78	0.08
6	002371	北方华创	343,509.00	0.08
7	002244	滨江集团	306,812.00	0.07
8	301565	中仑新材	289,964.96	0.07
9	600157	永泰能源	285,430.00	0.07
10	002568	百润股份	269,723.08	0.06
11	601155	新城控股	266,033.20	0.06
12	601933	永辉超市	262,416.00	0.06
13	000069	华侨城 A	260,633.00	0.06
14	002138	顺络电子	259,651.00	0.06
15	300724	捷佳伟创	258,565.00	0.06
16	601615	明阳智能	256,670.00	0.06
17	300373	扬杰科技	253,610.00	0.06
18	002299	圣农发展	248,167.00	0.06
19	000591	太阳能	248,000.00	0.06
20	000021	深科技	246,951.00	0.06

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	33,778,702.06
卖出股票收入（成交）总额	35,688,608.68

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、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。

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	1,231,590.71
2	应收清算款	-
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	1,231,590.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	中国银行股份有限公司 —易方达 MSCI 中国 A

						股国际通交易型开放式 指数证券投资基金发起 式联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,391	91,298.24	167,701,686 .00	54.17%	141,890,63 0.00	45.83%	71,070,110. 00	22.96%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	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	11.10%
2	竞技世界（北京）网络技术有限公司	20,923,200.00	6.76%
3	陈建敏	10,000,000.00	3.23%
4	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	3.23%
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基金 （FOF）	3,806,900.00	1.23%
6	东方证券股份有限公司	3,800,744.00	1.23%
7	广发证券股份有限公司	3,770,302.00	1.22%
8	于立	3,431,000.00	1.11%
9	国泰君安证券股份有限公司	3,402,426.00	1.10%
10	邓德权	3,174,900.00	1.03%
11	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	71,070,110.00	22.96%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年5月17日）基金份额总额	1,743,592,316.00
本报告期期初基金份额总额	325,592,316.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	309,592,316.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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。

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	
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	15,701,822.89	23.19%	1,570.79	23.19%	-
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	22,738,188.33	33.58%	2,274.72	33.59%	-
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	28,883,156.44	42.66%	2,888.38	42.65%	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	383,687.00	0.57%	38.35	0.57%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中信建投证券股份有限公司，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。本报告期内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
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	-	-	-	-	-	-
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	30,999.30	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储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	2024-03-11
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤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	2024-04-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
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	2024-04-23
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源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	2024-04-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型	1	2024 年 01 月 01 日~2024 年 06 月 30 日	77,493,010.00	5,945,000.00	12,367,900.00	71,070,110.00	22.96%

开放式指数证券投资 基金发起式联接基金							
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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日