易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十八日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 36
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ... 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细 ... 44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 44

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.11 投资组合报告附注 44
8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末上市基金前十名持有人 45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 46
9 开放式基金份额变动 46
10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 49
11 备查文件目录 51
11.1 备查文件目录 51
11.2 存放地点 52
11.3 查阅方式 52

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）
基金简称	易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）
场内简称	标普科技
基金主代码	161128
交易代码	161128
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 12 月 13 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	454,916,835.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 12 月 27 日

注：易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）含人民币份额（份额代码:161128）及美元现汇份额（份额代码：003721），交易代码仅列示人民币份额代码。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	作为追踪标普信息指数的被动式海外指数基金，本基金采用完全复制法，力求追踪误差最小化。
业绩比较基准	标普 500 信息科技指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	李申

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

负责人	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-85104666	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室－42891（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	State Street Bank and Trust Company
	中文	无	道富银行
注册地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,606,078.54
本期利润	99,085,141.77
加权平均基金份额本期利润	0.2361
本期加权平均净值利润率	12.93%
本期基金份额净值增长率	13.40%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	275,690,935.60
期末可供分配基金份额利润	0.6060
期末基金资产净值	947,936,488.83
期末基金份额净值	2.0838
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	108.38%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.88%	1.79%	5.99%	1.79%	-0.11%	0.00%
过去三个月	28.54%	2.04%	28.39%	2.04%	0.15%	0.00%
过去六个月	13.40%	3.21%	15.42%	3.18%	-2.02%	0.03%
过去一年	33.80%	2.35%	36.35%	2.32%	-2.55%	0.03%
过去三年	93.81%	1.71%	98.52%	1.70%	-4.71%	0.01%
自基金合同生效起至今	108.38%	1.59%	124.31%	1.58%	-15.93%	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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

的比较

易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016 年 12 月 13 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 108.38%，同期业绩比较基准收益率为 124.31%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局，为境内外客户提供包括标准化公募基金与定制化私募产品在内的资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从	说明

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		（助理）期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
FAN BING（范冰）	本基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理（自 2017 年 03 月 25 日至 2020 年 03 月 19 日）、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2017-03-25	-	15 年	新加坡籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、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。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数证券投	2018-08-11	2020-04-23	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	资基金（LOF）的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日）、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统中的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 59 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度，在新冠疫情全球扩散的冲击下，全球经济增长的预期一再下调，美国失业救济申请人数远超市场预期。美股盈利预期转负，叠加之前高企的美股估值，造成了美股的大幅下跌，并在短时间内出现了多次熔断。美联储连续两次非常规紧急降息至零利率水平附近，并紧急向市场提供流动性和信贷支持。美国政府也通过 2 万亿美元刺激计划，为经济托底。以微软为代表的指数权重股表现远超大盘，带动标普信息指数表现好于标普 500 指数。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

2020 年二季度，在货币及财政政策刺激下，美股出现明显反弹，美国重启经济，进一步提高了市场的风险偏好。美联储 6 月货币政策会议决议鸽派基调明显，符合市场预期，加息路径点阵图显示，利率预计将维持在当前水平直至 2022 年。美国经济前景仍然充满不确定性，但消费者信心有所回升。美股科技板块在市场反弹中受到资金青睐，表现强于大盘。

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

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.0838 元，本报告期份额净值增长率为 13.40%，同期业绩比较基准收益率为 15.42%，年化跟踪误差 1.599%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年下半年，受疫情影响，美国多地撤回了经济重启计划，美国和中国及欧洲的贸易摩擦升温，叠加美股估值高企，美股可能出现回调和震荡。美国大选结果也将在 2020 年下半年揭晓，需要关注与之相关的事件冲击。美股龙头效应明显，科技龙头公司的集中度预计将进一步提升。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	74,341,706.20	12,766,362.88

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

结算备付金		2,614,700.05	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	893,858,330.24	226,896,537.40
其中：股票投资		893,858,330.24	226,896,537.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		12,674,664.60	-
应收利息	6.4.7.5	4,049.86	1,847.97
应收股利		171,355.48	38,738.49
应收申购款		3,650,123.09	11,777,349.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	1,046,430.00
资产总计		987,314,929.52	252,527,266.07
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	10,404,866.75
应付赎回款		38,013,262.73	1,822,118.64
应付管理人报酬		637,284.98	134,885.14
应付托管费		199,151.59	42,151.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	528,741.39	473,084.93
负债合计		39,378,440.69	12,877,107.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	454,916,835.93	130,423,626.17
未分配利润	6.4.7.10	493,019,652.90	109,226,532.84
所有者权益合计		947,936,488.83	239,650,159.01
负债和所有者权益总计		987,314,929.52	252,527,266.07

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0838 元，基金份额总额 454,916,835.93 份。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.2 利润表

会计主体：易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		**103,415,188.71**	**27,959,777.71**
1.利息收入		141,407.39	25,386.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	141,407.39	25,386.63
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）		6,543,176.53	4,700,690.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,276,553.44	3,898,546.29
基金投资收益	6.4.7.13	-192,458.67	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-5,887,604.11	-
股利收益	6.4.7.16	4,346,685.87	802,144.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	97,479,063.23	23,161,329.94
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-1,742,529.80	-55,561.40
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	994,071.36	127,931.73
减：二、费用		**4,330,046.94**	**841,378.21**
1．管理人报酬		2,991,873.29	470,273.98
2．托管费		934,960.39	146,960.63
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	95,293.19	7,567.66
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	307,920.07	216,575.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**99,085,141.77**	**27,118,399.50**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**99,085,141.77**	**27,118,399.50**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	130,423,626.17	109,226,532.84	239,650,159.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	99,085,141.77	99,085,141.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	324,493,209.76	284,707,978.29	609,201,188.05
其中：1.基金申购款	681,479,219.18	579,514,297.91	1,260,993,517.09
2.基金赎回款	-356,986,009.42	-294,806,319.62	-651,792,329.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	454,916,835.93	493,019,652.90	947,936,488.83
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	95,334,006.52	23,020,243.81	118,354,250.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,118,399.50	27,118,399.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-20,665,182.71	-8,518,550.02	-29,183,732.73
其中：1.基金申购款	46,320,440.80	21,944,626.52	68,265,067.32
2.基金赎回款	-66,985,623.51	-30,463,176.54	-97,448,800.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	74,668,823.81	41,620,093.29	116,288,917.10

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：

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2236 号《关于准予易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)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《易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 358,188,308.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 40,599.92 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	74,341,706.20
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	74,341,706.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		759,762,826.01	893,858,330.24	134,095,504.23
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		759,762,826.01	893,858,330.24	134,095,504.23

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,049.86
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	4,049.86

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	141,944.11
预提费用	189,398.38
其他应付款	197,398.90
合计	528,741.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,423,626.17	130,423,626.17
本期申购	681,479,219.18	681,479,219.18
本期赎回（以“-”号填列）	-356,986,009.42	-356,986,009.42
本期末	454,916,835.93	454,916,835.93

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	78,784,298.54	30,442,234.30	109,226,532.84

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本期利润	1,606,078.54	97,479,063.23	99,085,141.77
本期基金份额交易产生的变动数	195,300,558.52	89,407,419.77	284,707,978.29
其中：基金申购款	404,428,100.55	175,086,197.36	579,514,297.91
基金赎回款	-209,127,542.03	-85,678,777.59	-294,806,319.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	275,690,935.60	217,328,717.30	493,019,652.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	138,916.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	2,490.68
合计	141,407.39

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	252,710,457.72
减：卖出股票成本总额	244,433,904.28
买卖股票差价收入	8,276,553.44

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	3,888,605.38
减：卖出/赎回基金成本总额	4,081,064.05
基金投资收益	-192,458.67

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
期权投资收益	-
期货投资收益	-5,887,604.11
合计	-5,887,604.11

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,346,685.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,346,685.87

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	97,479,063.23
——股票投资	97,479,063.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
——期权投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	97,479,063.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	994,071.36
其他	-
合计	994,071.36

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	94,367.72
银行间市场交易费用	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

交易基金产生的费用	925.47
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	925.47
合计	95,293.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
银行汇划费	1,122.79
上市费	29,835.26
指数使用费	186,992.14
指数数据费	10,406.76
合计	307,920.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
道富银行	境外资产托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,991,873.29	470,273.98
其中：支付销售机构的客户维护费	863,250.56	148,604.32

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

H＝E×0.80%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人， 若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	934,960.39	146,960.63

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

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	42,439,676.48	135,752.75	5,352,276.06	19,445.82
道富银行-活期存款	31,902,029.72	3,163.96	3,759,787.73	5,716.55

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司和道富银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标普信息科技指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资境外上市企业，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2019 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 2020年6月30日	上年度末 2019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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	74,341,706.20	-	-	-	74,341,706.20
结算备付金	2,614,700.05	-	-	-	2,614,700.05
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	893,858,330.24	893,858,330.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	12,674,664.60	12,674,664.60
应收利息	-	-	-	4,049.86	4,049.86
应收股利	-	-	-	171,355.48	171,355.48
应收申购款	232,506.67	-	-	3,417,616.42	3,650,123.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	77,188,912.92	-	-	910,126,016.60	987,314,929.52
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	38,013,262.73	38,013,262.73
应付管理人报酬	-	-	-	637,284.98	637,284.98
应付托管费	-	-	-	199,151.59	199,151.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	528,741.39	528,741.39
负债总计	-	-	-	39,378,440.69	39,378,440.69

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

利率敏感度缺口	77,188,912.92	-	-	870,747,575.91	947,936,488.83
上年度末 2019 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	12,766,362.88	-	-	-	12,766,362.88
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	226,896,537.40	226,896,537.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,847.97	1,847.97
应收股利	-	-	-	38,738.49	38,738.49
应收申购款	2,572,120.53	-	-	9,205,228.80	11,777,349.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,046,430.00	1,046,430.00
资产总计	15,338,483.41	-	-	237,188,782.66	252,527,266.07
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	10,404,866.75	10,404,866.75
应付赎回款	-	-	-	1,822,118.64	1,822,118.64
应付管理人报酬	-	-	-	134,885.14	134,885.14
应付托管费	-	-	-	42,151.60	42,151.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	473,084.93	473,084.93

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

负债总计	-	-	-	12,877,107.06	12,877,107.06
利率敏感度缺口	15,338,483.41	-	-	224,311,675.60	239,650,159.01

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	40,354,618.85	-	-	40,354,618.85
结算备付金	2,614,700.05	-	-	2,614,700.05
交易性金融资产	893,858,330.24	-	-	893,858,330.24
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	12,674,664.60	-	-	12,674,664.60
应收利息	351.21	-	-	351.21
应收股利	171,355.48	-	-	171,355.48
应收申购款	59,663.83	-	-	59,663.83
其他资产	-	-	-	-
资产合计	**949,733,684.26**	-	-	**949,733,684.26**
以外币计价的负债				
应付证券清算	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

款				
应付赎回款	521,515.40	-	-	521,515.40
其他负债	1,952.74	-	-	1,952.74
负债合计	**523,468.14**	**-**	**-**	**523,468.14**
资产负债表外汇风险敞口净额	**949,210,216.12**	**-**	**-**	**949,210,216.12**
项目	**上年度末 2019年12月31日**			
	美元 折合人民币	**港币 折合人民币**	**其他币种 折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产				
银行存款	9,439,406.64	-	-	9,439,406.64
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	226,896,537.40	-	-	226,896,537.40
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	373.79	-	-	373.79
应收股利	38,738.49	-	-	38,738.49
应收申购款	775,351.40	-	-	775,351.40
其他资产	1,046,430.00	-	-	1,046,430.00
资产合计	**238,196,837.72**	**-**	**-**	**238,196,837.72**
以外币计价的负债				
应付证券清算款	10,404,866.75	-	-	10,404,866.75
应付赎回款	456,312.20	-	-	456,312.20
其他负债	161.78	-	-	161.78
负债合计	**10,861,340.73**	**-**	**-**	**10,861,340.73**
资产负债表外汇风险敞口净额	**227,335,496.99**	**-**	**-**	**227,335,496.99**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-47,460,510.81	-11,366,774.85
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	47,460,510.81	11,366,774.85

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	893,858,330.24	94.30	226,896,537.40	94.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	893,858,330.24	94.30	226,896,537.40	94.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	44,692,916.32	11,344,826.83
	2.业绩比较基准下降 5%	-44,692,916.32	-11,344,826.83

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 893,858,330.24 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 226,896,537.40 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额) 。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同) 。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	893,858,330.24	90.53
	其中：普通股	893,858,330.24	90.53
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	76,956,406.25	7.79
8	其他各项资产	16,500,193.03	1.67
9	合计	987,314,929.52	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	893,858,330.24	94.30
合计	893,858,330.24	94.30

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	893,858,330.24	94.30
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	893,858,330.24	94.30

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	135,777	195,620,583.08	20.64
2	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	72,948	188,395,621.52	19.87
3	Visa Inc	-	V US	纽约证券交易所	美国	30,207	41,309,492.68	4.36
4	Mastercard Inc	-	MA US	纽约证券交易所	美国	15,825	33,128,183.97	3.49
5	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达	美国	75,808	32,109,728.09	3.39

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

				克证券交易所				
6	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	11,014	29,622,955.31	3.12
7	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	8,627	26,586,491.43	2.80
8	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	21,023	25,931,056.59	2.74
9	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	75,931	25,071,495.92	2.64
10	salesforce.com Inc	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	16,132	21,394,302.52	2.26
11	Accenture PLC	-	ACN US	纽约证券交易所	美国	11,406	17,338,377.40	1.83
12	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	7,159	15,995,790.36	1.69
13	Texas Instruments Inc	-	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	16,433	14,771,362.66	1.56
14	Oracle Corp	-	ORCL US	纽约证券交易所	美国	37,266	14,581,588.24	1.54
15	International Business Machines Corp	-	IBM US	纽约证券交易所	美国	15,898	13,592,650.34	1.43
16	QUALCOMM Inc	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	20,142	13,006,116.31	1.37
17	Fidelity National Information Services Inc	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	11,062	10,501,047.69	1.11
18	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交易	美国	3,415	9,792,930.05	1.03

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

				所				
19	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	4,669	9,790,319.20	1.03
20	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	7,695	8,111,043.68	0.86
21	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	20,970	7,810,328.82	0.82
22	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	19,914	7,263,349.52	0.77
23	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	16,410	7,022,754.27	0.74
24	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	10,069	6,958,693.85	0.73
25	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	3,925	6,646,381.50	0.70
26	Global Payments Inc	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	5,356	6,431,617.58	0.68
27	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	2,600	5,953,831.18	0.63
28	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	6,597	5,727,712.52	0.60
29	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	9,820	3,950,165.61	0.42
30	KLA-Tencor Corp	-	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	2,817	3,878,505.21	0.41
31	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,700	3,727,356.75	0.39

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

32	Amphenol Corp	-	APH US	纽约证券交易所	美国	5,298	3,593,563.97	0.38
33	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	5,992	3,459,380.68	0.36
34	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	4,999	3,396,064.75	0.36
35	Microchip Technology Inc	-	MCHP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,376	3,262,492.43	0.34
36	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,567	3,236,329.07	0.34
37	HP Inc	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	25,974	3,205,079.52	0.34
38	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	5,833	3,128,075.31	0.33
39	Xilinx Inc	-	XLNX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,417	3,076,670.21	0.32
40	Motorola Solutions Inc	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	3,045	3,020,793.27	0.32
41	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	3,031	2,743,615.34	0.29
42	FleetCor Technologies Inc	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	1,523	2,712,016.21	0.29
43	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,821	2,666,404.69	0.28
44	Corning Inc	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	13,590	2,491,849.49	0.26
45	Keysight Technologies Inc	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	3,435	2,450,776.35	0.26
46	Fortinet	-	FTNT US	纳斯达	美国	2,438	2,369,255.63	0.25

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	Inc			克证券交易所				
47	Akamai Technologies Inc	-	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	2,959	2,243,347.08	0.24
48	Citrix Systems Inc	-	CTXS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,106	2,205,253.35	0.23
49	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	2,631	2,163,987.79	0.23
50	Maxim Integrated Products Inc	-	MXIM US	纳斯达克证券交易所	美国	4,774	2,048,468.48	0.22
51	Paycom Software Inc	-	PAYC US	纽约证券交易所	美国	864	1,894,521.77	0.20
52	Broadridge Financial Solutions Inc	-	BR US	纽约证券交易所	美国	2,099	1,875,167.06	0.20
53	Jack Henry & Associates Inc	-	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,409	1,835,702.10	0.19
54	Zebra Technologies Corp	-	ZBRA US	纳斯达克证券交易所	美国	988	1,790,254.05	0.19
55	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	700	1,719,015.87	0.18
56	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	5,445	1,701,888.79	0.18
57	Hewlett Packard Enterprise Co	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	23,690	1,631,850.94	0.17
58	Qorvo Inc	-	QRVO US	纳斯达克证券交易所	美国	2,085	1,631,506.53	0.17
59	Leidos Holdings	-	LDOS US	纽约证券交易	美国	2,437	1,616,064.30	0.17

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	Inc			所				
60	Gartner Inc	-	IT US	纽约证券交易所	美国	1,673	1,437,032.94	0.15
61	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	963	1,431,891.81	0.15
62	Seagate Technology PLC	-	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,102	1,405,831.68	0.15
63	NortonLifeLock Inc	-	NLOK US	纳斯达克证券交易所	美国	9,844	1,381,964.56	0.15
64	NetApp Inc	-	NTAP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,179	1,312,696.68	0.14
65	Western Union Co/The	-	WU US	纽约证券交易所	美国	7,676	1,174,879.27	0.12
66	F5 Networks Inc	-	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	1,113	1,099,030.36	0.12
67	Juniper Networks Inc	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	6,128	991,739.40	0.10
68	IPG Photonics Corp	-	IPGP US	纳斯达克证券交易所	美国	682	774,398.05	0.08
69	FLIR Systems Inc	-	FLIR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,343	672,945.48	0.07
70	DXC Technology Co	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	4,787	559,177.85	0.06
71	Xerox Holdings Corp	-	XRX US	纽约证券交易所	美国	3,931	425,513.28	0.04

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Microsoft Corp	MSFT US	168,566,850.95	70.34
2	Apple Inc	AAPL US	162,658,363.75	67.87
3	Visa Inc	V US	42,623,261.88	17.79
4	Mastercard Inc	MA US	34,900,557.49	14.56
5	Intel Corp	INTC US	33,796,156.87	14.10
6	Cisco Systems Inc	CSCO US	23,828,006.28	9.94
7	Adobe Inc	ADBE US	22,091,837.42	9.22
8	NVIDIA Corp	NVDA US	21,244,383.15	8.86
9	salesforce.com Inc	CRM US	20,218,800.40	8.44
10	PayPal Holdings Inc	PYPL US	17,301,209.09	7.22
11	Accenture PLC	ACN US	15,886,932.22	6.63
12	International Business Machines Corp	IBM US	15,550,178.98	6.49
13	Broadcom Inc	AVGO US	14,727,674.31	6.15
14	Texas Instruments Inc	TXN US	14,587,046.73	6.09
15	Oracle Corp	ORCL US	14,428,955.02	6.02
16	QUALCOMM Inc	QCOM US	12,238,237.42	5.11
17	Fidelity National Information Services Inc	FIS US	11,436,738.72	4.77
18	Intuit Inc	INTU US	9,403,651.54	3.92
19	Automatic Data Processing Inc	ADP US	9,201,425.98	3.84
20	Fiserv Inc	FISV US	8,299,869.89	3.46
21	ServiceNow Inc	NOW US	8,030,139.14	3.35
22	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	7,750,069.24	3.23
23	Micron Technology Inc	MU US	7,596,953.89	3.17
24	Global Payments Inc	GPN US	7,308,855.71	3.05
25	Applied Materials Inc	AMAT US	7,118,499.98	2.97
26	Lam Research Corp	LRCX US	5,619,728.53	2.34
27	Autodesk Inc	ADSK US	5,353,626.56	2.23
28	Analog Devices Inc	ADI US	5,273,321.62	2.20

注：1.买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1	Apple Inc	AAPL US	56,277,927.73	23.48
2	Microsoft Corp	MSFT US	54,554,507.11	22.76
3	Visa Inc	V US	13,267,465.06	5.54
4	Intel Corp	INTC US	10,959,140.50	4.57
5	Mastercard Inc	MA US	10,325,636.00	4.31
6	NVIDIA Corp	NVDA US	7,348,257.46	3.07
7	Cisco Systems Inc	CSCO US	7,287,186.86	3.04
8	Adobe Inc	ADBE US	7,265,551.02	3.03
9	PayPal Holdings Inc	PYPL US	6,373,937.83	2.66
10	salesforce.com Inc	CRM US	5,742,966.31	2.40
11	Oracle Corp	ORCL US	5,062,414.35	2.11
12	Accenture PLC	ACN US	4,742,270.80	1.98
13	Texas Instruments Inc	TXN US	4,641,994.69	1.94
14	International Business Machines Corp	IBM US	4,217,529.17	1.76
15	Broadcom Inc	AVGO US	4,196,642.86	1.75
16	QUALCOMM Inc	QCOM US	3,847,003.76	1.61
17	Fidelity National Information Services Inc	FIS US	3,209,535.84	1.34
18	Intuit Inc	INTU US	2,831,604.94	1.18
19	Automatic Data Processing Inc	ADP US	2,570,148.38	1.07
20	ServiceNow Inc	NOW US	2,505,514.11	1.05

注：1.卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	813,916,633.89
卖出收入（成交）总额	252,710,457.72

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 2019 年 11 月 25 日，苹果公司由于违反美国制裁法规，被处以 46.7 万美元的罚款。

2020 年 2 月 7 日，苹果公司被法国竞争和欺诈监管机构 DGCCRF 罚款 2500 万欧元，原因是该公司未告知用户 IOS 系统更新，可能导致 iPhone 6、SE 和 7 降速。

2020 年 3 月 16 日，法国反垄断监管机构对苹果公司（Apple Inc.）处以创纪录的 11 亿欧元（约合 12 亿美元）罚款，依据是该公司与供应商达成协议，对独立经销商构成不正当竞争。

2020 年 6 月 16 日，欧盟委员会宣布，将对苹果的软件商店和苹果支付服务展开反垄断调查。欧盟委员会表示，苹果公司施加的一些限制措施可能违反了欧盟的竞争规则。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除苹果外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	12,674,664.60
3	应收股利	171,355.48
4	应收利息	4,049.86
5	应收申购款	3,650,123.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8	其他	-
9	合计	16,500,193.03

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
143,639	3,167.08	22,264,287.27	4.89%	432,652,548.66	95.11%

注：持有人户数及结构包含人民币份额及美元现汇份额。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海威海储运中心	11,722,149.00	13.67%
2	付新华	2,115,456.00	2.47%
3	马国芳	1,901,509.00	2.22%
4	深圳睿泉毅信投资管理有限公司－睿泉成长 1 号证券投资基金	1,660,183.00	1.94%
5	中国对外经济贸易信托有限公司－外贸信托－海淘港股通昭盈亮帆 G 期证券投资集合资	1,215,456.00	1.42%
6	刘辰玮	1,149,603.00	1.34%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7	刘永济	1,016,393.00	1.19%
8	刘钢	852,574.00	0.99%
9	上海尚雅投资管理有限公司－尚雅浩然家族 5 号私募证券投资基金	818,322.00	0.95%
10	胡泳龙	800,416.00	0.93%

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	63,029.35	0.0139%

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 13 日）基金份额总额	358,188,308.79
本报告期期初基金份额总额	130,423,626.17
本报告期基金总申购份额	681,479,219.18
减：本报告期基金总赎回份额	356,986,009.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	454,916,835.93

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

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 6 月 22 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起聘任张坤先生、陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Goldman Sachs	1	524,362.83	0.05%	419.49	0.51%	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	1,066,102,728.78	99.95%	82,522.38	99.49%	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

Everbright Securities (International) Limited	1	-	-	-	-	-
GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd.	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易账户，于如下证券经营机构 GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd. 新增一个交易账户。

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

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

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

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

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

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

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

c）基金交易账户的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2）基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Goldman	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

Sachs								
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	7,969,669.43	100.00%
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Everbright Securities (International) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）2020 年 1 月 20 日暂停申购、赎回、	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2020-01-15

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	定期定额投资业务的公告	子披露网站	
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报	2020-01-18
3	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-23
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 1 月 31 日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-30
5	易方达基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-04
6	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）2020 年 2 月 17 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-12
7	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中金公司费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-05
8	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）暂停大额申购业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-10
9	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加百度百盈费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-10
10	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）暂停申购及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-11
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加腾安基金费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-17
12	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）恢复申购、定期定额投资业务并暂停大额申购业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-19
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	证券日报	2020-03-31
14	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加国信证券费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-01
15	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）2020 年 4 月 10 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-07
16	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-10

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

17	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-17
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报	2020-04-21
19	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加国联证券费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-22
20	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-23
21	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中金公司申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-14
22	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）2020 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
23	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加华夏财富费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-23
24	易方达基金管理有限公司关于暂停上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-03
25	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在招商银行最低定期定额投资金额限制的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-04
26	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-22
27	易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）2020 年 7 月 3 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）注册的文件；

2.《易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn