

易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商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。

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 | 9 |
| 4.3 | 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 9 |
| 4.4 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 10 |
| 4.6 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 5 | 托管人报告 | 12 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| 6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 | 资产负债表 | 13 |
| 6.2 | 利润表 | 14 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 | 报表附注 | 16 |
| 7 | 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 | 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 36 |
| 7.3 | 期末按行业分类的权益投资组合 | 36 |
| 7.4 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 | 37 |
| 7.5 | 报告期内权益投资组合的重大变动 | 38 |
| 7.6 | 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |

| | | |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.11 | 投资组合报告附注 | 40 |
| 8 | 基金份额持有人信息 | 41 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 41 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 41 |
| 8.3 | 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 | 41 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 42 |
| 10 | 重大事件揭示 | 42 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 42 |
| 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 | 42 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 42 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 42 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 42 |
| 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 | 43 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 43 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 50 |
| 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| 12 | 备查文件目录 | 53 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 53 |
| 12.2 | 存放地点 | 54 |
| 12.3 | 查阅方式 | 54 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 易方达亚洲精选股票（QDII） |
| 基金主代码 | 118001 |
| 交易代码 | 118001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 1 月 21 日 |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 458,284,565.76 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于亚洲企业，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的持续、稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将基于对全球及亚洲宏观经济，各类资产的风险与收益水平的综合分析与判断在不同区域和行业间进行积极的资产配置。在构建投资组合方面，本基金坚持价值投资的理念，以自下而上的基本面分析、深入的公司研究、对股票价值的评估作为股票投资的根本依据，辅以自上而下的宏观经济分析、国别/地区因素分析、行业分析，争取获得超越比较基准的回报。固定收益品种与货币市场工具的投资将主要用于回避投资风险、取得稳定回报，同时，保持必要的灵活性，及时把握重大的投资机会。 |
| 业绩比较基准 | MSCIAC 亚洲除日本指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |

| | | | |
|-------------|------|--|---------------------|
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张南 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-85102688 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400 881 8088 | 95588 |
| 传真 | | 020-85104666 | 010-66105798 |
| 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） | 北京市西城区复兴门内大街 55号 |
| 办公地址 | | 广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55号 |
| 邮政编码 | | 510620 | 100140 |
| 法定代表人 | | 刘晓艳 | 陈四清 |

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 | Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited |
| | 中文 | 无 | 渣打银行（香港）有限公司 |
| 注册地址 | | 无 | 香港中环德辅道中四至四A号渣打银行大厦32楼 |
| 办公地址 | | 无 | 香港九龙观塘光观塘路三百八十八号渣打中心15楼 |
| 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 | 中国证券报 |
| 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 | 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 |

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 | 16,818,295.13 |
| 本期利润 | 128,975,927.36 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2772 |
| 本期加权平均净值利润率 | 25.89% |
| 本期基金份额净值增长率 | 27.47% |
| 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 | -200,294,622.65 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.4371 |
| 期末基金资产净值 | 591,219,825.64 |
| 期末基金份额净值 | 1.290 |
| 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 | 29.00% |

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 | 13.56% | 1.27% | 6.80% | 1.24% | 6.76% | 0.03% |
| 过去三个月 | 33.82% | 1.64% | 15.54% | 1.31% | 18.28% | 0.33% |
| 过去六个月 | 27.47% | 1.97% | -4.35% | 1.81% | 31.82% | 0.16% |
| 过去一年 | 40.52% | 1.59% | 2.29% | 1.36% | 38.23% | 0.23% |
| 过去三年 | 50.88% | 1.40% | 8.35% | 1.08% | 42.53% | 0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.00% | 1.52% | 37.44% | 1.06% | -8.44% | 0.46% |

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金
 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
 (2010 年 1 月 21 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 29.00%，同期业绩比较基准收益率为 37.44%。

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 |
|----|----|-----------|-----|----|
|----|----|-----------|-----|----|

| | | (助理) 期限 | | 业年限 | |
|----|---|------------|------|------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张坤 | 本基金的基金经理、易方达中小盘混合型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理、易方达优质企业三年持有期混合型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、权益投资决策委员会委员 | 2014-04-08 | - | 12 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行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理。 |

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。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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 开年以来，新型冠状病毒肺炎在全球流行，对全球经济造成了冲击，美联储在 3 月份两次降息总共 150 个基点。二季度以来，新型冠状病毒肺炎在国内基本被控制住，生产和生活逐步恢复，但全球不少其他国家流行加剧，目前仍在抗击疫情中。各国政府积极应对，美国经济出现了明显的放缓迹象，失业率也有所上升，美联储推出大规模的量化宽松政策。中国政府同样采取了宽松的货币政策和积极的财政政策来应对此次疫情对经济的冲击。

本基金在上半年的股票仓位基本稳定，并对结构进行了调整。市场配置方面，保持了港股和港股较高的配置比例。行业方面，增加了互联网等行业的配置，降低了家电等行业的配置。个股方面，增加了业务模式有特色、估值水平合理的个股的投资比例。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.290 元，本报告期份额净值增长率为 27.47%，同期业绩比较基准收益率为 -4.35%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最近，市场的结构分化引起了不少投资者的讨论，分化的一边是市盈率大幅超过历史均值的 TMT、医药以及部分消费行业，而另一边是市盈率大幅低于历史均值的周期行业。在此谈一点个人的想法。首先，不同的投资者有不同的投资期限。以基金为例，可以用单边换手率近似估计出：50% 对应平均持有 2 年，200% 对应平均持有 0.5 年。但实际上，由于公募基金每天面临申购赎回会有一些被动的操作，加上投资中难免犯错，纠错也会带来操作，我认为实际的目标持股期限要比理论期限要长（从个人经验来看估计在 2 倍左右，即大约一半的操作是在做流动性管理和纠错）。不同的投资者会采用不同期限的估值方法，同样是 DCF 的简化，用明年的估值去贴现得到目前的合理价值，和用 5 年或者 10 年后的估值去贴现得到目前的合理价值，两个数值可能是有很大差异的。此外，在较短的时间区间，估值变化是股价的主要决定因素；而只有在较长的时间区间，业绩变化才是股价

主要的决定因素。所以，一个以 5 年期限的投资人买入一个股票，和同时一个以 1 年期限的投资人卖出同一个股票，对两者的投资体系来说，可能都是自洽和合理的。

任何长期有效的投资方法，短期必然间歇性失灵。如果短期一直有效，会导致大量的人采用该方法，从而导致该方法长期失效。因此，一个投资人不论采用何种方法，必然在某些时期面临业绩的落后。我的体会是，一个投资人选择何种投资方法，并不是这种方法在出彩时多灿烂，而是在这种方法阶段性失灵时仍能坦然面对，并且晚上睡得香。这一点，很大程度取决于投资人的性格和价值观。

基金有不同的风格，对于持有人来说如何选择？我的建议是问三个问题：第一，这个管理人的投资体系是否自洽？第二，这个管理人的投资体系是否稳定？第三，我的投资体系和价值观是否与这个管理人的投资体系和价值观匹配？第一和第二个问题通过观察持仓、换手率、长期业绩大致可以判断出来，而第三点持有人通常关注不多，但我认为非常重要，只有持有人自己的投资体系和价值观与管理人匹配（即持有人本身认可的投资周期是多长？投资收益的来源是什么？愿意在何种市场接受策略的阶段性失灵？），才能做到持有基金的久期和基金持有股票的久期基本匹配。如果期限错配，容易导致两方面的负面结果：一方面，业绩阶段性出彩时很兴奋，业绩阶段性不佳时很沮丧，无法做到内心的平静；另一方面，容易导致持有人在业绩阶段性出彩时兴奋而买入，阶段性不佳时失望而卖出，而这恰恰是导致部分持有人收益率低于基金收益率的重要原因。总之，对持有人来说，选择一个和自己价值观匹配的产品，要远比选择一个阶段性业绩出彩的产品重要的多。这样，至少可以使基金的收益率最大程度转化为持有人的收益率，毕竟，后者才是对持有人真正有意义的。

最后，我们对于中国资本市场的长期前景是乐观的。我们相信会有一批优质的企业不断长大、企稳并且长寿。具体来说，我们将坚持深入研究，选择商业模式优秀（生意本身能够产生充沛的自由现金流，并且明智的进行分配）和企业竞争力突出（同行中具备显著领先的地位，相比上下游有较强的议价能力）的高质量企业，长期陪伴并分享这些优秀公司的经营成果。

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。

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

本报告期内，本基金托管人在对易方达亚洲精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达亚洲精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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 | 32,161,222.02 | 34,633,967.54 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 546,759,036.66 | 446,466,559.79 |
| 其中：股票投资 | | 546,759,036.66 | 446,466,559.79 |
| 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 | | 8,495,054.39 | 6,413,217.02 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,682.66 | 1,948.95 |
| 应收股利 | | 601,750.40 | - |
| 应收申购款 | | 20,759,828.04 | 709,580.18 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 608,778,574.17 | 488,225,273.48 |
| 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 | | 8,529,921.81 | - |
| 应付赎回款 | | 7,961,208.66 | 4,111,837.08 |
| 应付管理人报酬 | | 688,967.48 | 638,107.96 |
| 应付托管费 | | 160,759.11 | 148,891.83 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 3,509.26 | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 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 | 214,382.21 | 296,030.34 |
| 负债合计 | | 17,558,748.53 | 5,194,867.21 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 458,284,565.76 | 477,085,672.86 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 132,935,259.88 | 5,944,733.41 |
| 所有者权益合计 | | 591,219,825.64 | 483,030,406.27 |
| 负债和所有者权益总计 | | 608,778,574.17 | 488,225,273.48 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.290 元，基金份额总额 458,284,565.76 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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 | | 134,333,081.71 | 66,777,719.14 |
| 1.利息收入 | | 46,719.87 | 45,694.76 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 46,719.87 | 45,694.76 |
| 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） | | 21,643,838.60 | -32,561,962.37 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 20,385,241.52 | -35,070,639.31 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,258,597.08 | 2,508,676.94 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 112,157,632.23 | 99,409,798.10 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 330,143.14 | -179,563.41 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 154,747.87 | 63,752.06 |
| 减：二、费用 | | 5,357,154.35 | 5,799,578.46 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------------|----------------------|
| 1. 管理人报酬 | | 3,713,651.68 | 4,067,743.54 |
| 2. 托管费 | | 866,518.83 | 949,140.10 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 598,053.33 | 577,024.88 |
| 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 | 178,930.51 | 205,669.94 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 128,975,927.36 | 60,978,140.68 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 128,975,927.36 | 60,978,140.68 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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） | 477,085,672.86 | 5,944,733.41 | 483,030,406.27 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 128,975,927.36 | 128,975,927.36 |
| 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） | -18,801,107.10 | -1,985,400.89 | -20,786,507.99 |
| 其中：1.基金申购款 | 207,523,586.48 | 23,787,548.53 | 231,311,135.01 |
| 2.基金赎回款 | -226,324,693.58 | -25,772,949.42 | -252,097,643.00 |
| 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） | 458,284,565.76 | 132,935,259.88 | 591,219,825.64 |
| 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） | 619,641,561.04 | -113,301,013.77 | 506,340,547.27 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 60,978,140.68 | 60,978,140.68 |

| | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 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） | -21,203,419.45 | 3,253,972.83 | -17,949,446.62 |
| 其中：1.基金申购款 | 54,620,820.93 | -3,252,344.31 | 51,368,476.62 |
| 2.基金赎回款 | -75,824,240.38 | 6,506,317.14 | -69,317,923.24 |
| 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） | 598,438,141.59 | -49,068,900.26 | 549,369,241.33 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达亚洲精选股票型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1064号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2009]367号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于2010年1月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为592,067,217.31份基金份额，其中认购资金利息折合107,302.70份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为渣打银行（香港）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》、《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款 | 32,161,222.02 |
| 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 | 32,161,222.02 |

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 | 355,123,251.10 | 546,759,036.66 | 191,635,785.56 |
| 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 | 355,123,251.10 | 546,759,036.66 | 191,635,785.56 |

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

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,682.66 |
| 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 | 1,682.66 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,509.26 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 3,509.26 |

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 | 18,906.83 |

| | |
|------|------------|
| 预提费用 | 195,475.38 |
| 合计 | 214,382.21 |

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 | 477,085,672.86 | 477,085,672.86 |
| 本期申购 | 207,523,586.48 | 207,523,586.48 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -226,324,693.58 | -226,324,693.58 |
| 本期末 | 458,284,565.76 | 458,284,565.76 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末 | -225,670,717.86 | 231,615,451.27 | 5,944,733.41 |
| 本期利润 | 16,818,295.13 | 112,157,632.23 | 128,975,927.36 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,557,800.08 | -10,543,200.97 | -1,985,400.89 |
| 其中：基金申购款 | -93,179,184.91 | 116,966,733.44 | 23,787,548.53 |
| 基金赎回款 | 101,736,984.99 | -127,509,934.41 | -25,772,949.42 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -200,294,622.65 | 333,229,882.53 | 132,935,259.88 |

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 | 44,662.53 |
| 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 | 753.67 |
| 其他 | 1,303.67 |
| 合计 | 46,719.87 |

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 | 276,519,270.68 |
| 减：卖出股票成本总额 | 256,134,029.16 |
| 买卖股票差价收入 | 20,385,241.52 |

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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 | 1,258,597.08 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,258,597.08 |

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 | 112,157,632.23 |
| ——股票投资 | 112,157,632.23 |
| ——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 | 112,157,632.23 |

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 | 154,747.87 |
| 其他 | - |
| 合计 | 154,747.87 |

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 | 598,053.33 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 598,053.33 |

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 | 35,803.04 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 银行汇划费 | 2,643.53 |
| 其他 | 80,811.60 |
| 合计 | 178,930.51 |

注：“其他”主要包含支付给交易所的结算服务费用和存托凭证托管机构的存托服务费用。

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 |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 渣打银行(香港)有限公司(以下简称“渣打银行”) | 境外资产托管人 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 3,713,651.68 | 4,067,743.54 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 488,641.21 | 440,540.52 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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 | 866,518.83 | 949,140.10 |

注：本基金的托管费（包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|----------------------|----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 140,261,977.48 | 222,261,977.48 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 40,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 100,261,977.48 | 222,261,977.48 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 21.8777% | 37.1403% |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 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 |
| 中国工商银行-活期存款 | 8,127,009.08 | 39,828.90 | 12,269,149.68 | 37,825.85 |
| 渣打银行-活期存款 | 24,034,212.94 | 4,833.63 | 25,327,240.25 | 7,228.48 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和渣打银行（香港）有限公司保管，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

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|-----------------------------|------------|--------|--------|------|--------|---------|--------------|------------|----|
| 940 HK | China Animal Healthcare Ltd | 2015-03-30 | 重大事项停牌 | - | - | - | 850,000 | 3,230,137.15 | - | - |
| 967 HK | Sound Global Ltd | 2016-04-13 | 重大事项停牌 | 2.72 | - | - | 300,000 | 1,741,184.48 | 816,615.36 | - |

注：根据香港联合交易所有限公司于 2020 年 1 月 24 日发布的《关于中国动物保健品有限公司取消上市地位》的通告，由 2020 年 1 月 30 日上午 9 时起，中国动物保健品有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

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 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。

本基金属股票基金，投资于股票及其他权益类证券占基金资产的比例不低于 60%，其中投资于在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外），合计不低于股票资产的 80%（亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业）。理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

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（本基金为进行避险和组合的有效管理可以投资衍生品），或者基金所投资证券之发行人出现违约（包括国家信用风险）、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投资备选库制度和交易对手备选库制度及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 |

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 |

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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 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 | 32,161,222.02 | - | - | - | 32,161,222.02 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 546,759,036.66 | 546,759,036.66 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|--------------------------------------|---------------|--------------|--------------|----------------|----------------|
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 8,495,054.39 | 8,495,054.39 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,682.66 | 1,682.66 |
| 应收股利 | - | - | - | 601,750.40 | 601,750.40 |
| 应收申购款 | 453,023.19 | - | - | 20,306,804.85 | 20,759,828.04 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 32,614,245.21 | - | - | 576,164,328.96 | 608,778,574.17 |
| 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 | - | - | - | 8,529,921.81 | 8,529,921.81 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 7,961,208.66 | 7,961,208.66 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 688,967.48 | 688,967.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | 160,759.11 | 160,759.11 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 3,509.26 | 3,509.26 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 214,382.21 | 214,382.21 |
| 负债总计 | - | - | - | 17,558,748.53 | 17,558,748.53 |
| 利率敏感度缺口 | 32,614,245.21 | - | - | 558,605,580.43 | 591,219,825.64 |
| 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 | 34,633,967.54 | - | - | - | 34,633,967.54 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 交易性金融资产 | - | - | - | 446,466,559.79 | 446,466,559.79 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 6,413,217.02 | 6,413,217.02 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,948.95 | 1,948.95 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | 58,418.18 | - | - | 651,162.00 | 709,580.18 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 34,692,385.72 | - | - | 453,532,887.76 | 488,225,273.48 |
| 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 | - | - | - | 4,111,837.08 | 4,111,837.08 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 638,107.96 | 638,107.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | 148,891.83 | 148,891.83 |
| 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 | - | - | - | 296,030.34 | 296,030.34 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,194,867.21 | 5,194,867.21 |
| 利率敏感度缺口 | 34,692,385.72 | - | - | 448,338,020.55 | 483,030,406.27 |

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 | 184,005.06 | 23,851,527.15 | 42.72 | 24,035,574.93 |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 219,960,348.18 | 326,798,688.48 | - | 546,759,036.66 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 8,495,054.39 | - | 8,495,054.39 |
| 应收利息 | 0.50 | 9.94 | 0.01 | 10.45 |
| 应收股利 | - | 588,291.90 | - | 588,291.90 |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | 220,144,353.74 | 359,733,571.86 | 42.73 | 579,877,968.33 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | 8,529,919.64 | - | - | 8,529,919.64 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | 8,529,919.64 | - | - | 8,529,919.64 |
| 资产负债表 外汇风险敞 口净额 | 211,614,434.10 | 359,733,571.86 | 42.73 | 571,348,048.69 |
| 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 | 10,646,067.13 | 19,108,983.22 | 43.77 | 29,755,094.12 |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 189,559,050.45 | 256,907,509.34 | - | 446,466,559.79 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | 2,916,026.69 | 3,497,190.33 | - | 6,413,217.02 |
| 应收利息 | 29.58 | 7.96 | 0.01 | 37.55 |
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | 203,121,173.85 | 279,513,690.85 | 43.78 | 482,634,908.48 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表 外汇风险敞 口净额 | 203,121,173.85 | 279,513,690.85 | 43.78 | 482,634,908.48 |

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外其他因素保持不变 | | |
|----|-------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 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% | -28,567,402.43 | -24,131,745.42 |
| | 假设人民币对一揽子货币平均贬值 | 28,567,402.43 | 24,131,745.42 |

| | | | |
|--|------|--|--|
| | 值 5% | | |
|--|------|--|--|

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 | 546,759,036.6 6 | 92.48 | 446,466,559.7 9 | 92.43 |
| 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 | 546,759,036.6 6 | 92.48 | 446,466,559.7 9 | 92.43 |

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 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% | 27,337,951.81 | 22,323,327.98 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -27,337,951.81 | -22,323,327.98 |

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 545,942,421.30 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为 816,615.36 元(2019 年 12 月 31 日：第一层次 445,269,797.71 元，无属于第二层次的余额，第三层 1,196,762.08 元)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的第三层次金融工具公允价值为 816,615.36 元 (2019 年 12 月 31 日：1,196,762.08 元)。

上述第三层次资产变动如下：

| | |
|--|--------------|
| | 交易性金融资产 |
| | 权益工具投资 |
| 2020 年 1 月 1 日 | 1,196,762.08 |
| 购买 | - |
| 出售 | - |
| 转入第三层级 | - |
| 转出第三层级 | - |
| 当期利得或损失总额 | -380,146.72 |
| 计入损益的利得或损失 | -380,146.72 |
| 2020 年 6 月 30 日 | 816,615.36 |
| 2020 年 6 月 30 日仍持有的资产计入 2020 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年/期初起算/从转入第三层级起算) | |
| ——公允价值变动损益 | -380,146.72 |

| | |
|---|--------------|
| | 交易性金融资产 |
| | 权益工具投资 |
| 2019 年 1 月 1 日 | 1,170,603.20 |
| 购买 | - |
| 出售 | - |
| 转入第三层级 | - |
| 转出第三层级 | - |
| 当期利得或损失总额 | 26,158.88 |
| 计入损益的利得或损失 | 26,158.88 |
| 2019 年 12 月 31 日 | 1,196,762.08 |
| 2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年/期初起算/从转入第三层次起算) ——公允价值变动损益 | 26,158.88 |

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司盈利预期及市盈率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的盈利预期及市盈率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(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 | 546,759,036.66 | 89.81 |
| | 其中：普通股 | 344,225,585.68 | 56.54 |
| | 存托凭证 | 202,533,450.98 | 33.27 |
| | 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 | 32,161,222.02 | 5.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 29,858,315.49 | 4.90 |
| 9 | 合计 | 608,778,574.17 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 9,993,033.60 元,占净值比例 1.69%。

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（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 中国香港 | 326,798,688.48 | 55.28 |
| 美国 | 219,960,348.18 | 37.20 |
| 合计 | 546,759,036.66 | 92.48 |

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 | 275,411,804.66 | 46.58 |
| 必需消费品 | - | - |
| 保健 | 146,407,822.24 | 24.76 |

| | | |
|------|----------------|-------|
| 金融 | 62,638,234.56 | 10.59 |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | 61,484,559.84 | 10.40 |
| 公用事业 | 816,615.36 | 0.14 |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 546,759,036.66 | 92.48 |

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 | Hong Kong Exchange s and Clearing Ltd. | 香港交易 及结算有 限公司 | 388 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 207,800 | 62,638,234.56 | 10.59 |
| 2 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控 股有限 公司 | 700 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 135,000 | 61,484,559.84 | 10.40 |
| 3 | JD.com Inc | 京东商 城电子 商务有 限公司 | JD US | 纳斯 达克证 券交易 所 | 美国 | 133,000 | 56,663,893.23 | 9.58 |
| 4 | Alibaba Group Holding Ltd | 阿里巴 巴集团 控股有 限公司 | BABA US | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 37,000 | 56,500,781.55 | 9.56 |
| 5 | Meituan Dianping | 美团点 评 | 3690 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 355,000 | 55,742,219.28 | 9.43 |
| 6 | Sino Biopharm aceutical Limited | 中国生 物制药 有限公 司 | 1177 HK | 香港证 券交易 所 | 中国香港 | 4,160,000 | 55,478,691.84 | 9.38 |
| 7 | NEW Oriental Education & Technolog y Group | 新东方 教育科 技集团 有限公 司 | EDU US | 纽约证 券交易 所 | 美国 | 60,000 | 55,317,797.10 | 9.36 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|-------------|---------|-----------|------|---------|---------------|------|
| | Inc | | | | | | | |
| 8 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 药明生物技术有限公司 | 2269 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 400,000 | 51,810,316.80 | 8.76 |
| 9 | Innovent Biologics, Inc. | 信达生物制药 | 1801 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 413,000 | 21,691,916.40 | 3.67 |
| 10 | Huazhu Group Ltd | - | HTHT US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 76,000 | 18,858,372.10 | 3.19 |
| 11 | STAAR Surgical Co | - | STAA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 40,000 | 17,426,897.20 | 2.95 |
| 12 | Haier Electronics Group Co., Limited | 海尔电器集团有限公司 | 1169 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 800,000 | 17,136,134.40 | 2.90 |
| 13 | Pinduoduo Inc. | 拼多多 | PDD US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 25,000 | 15,192,607.00 | 2.57 |
| 14 | Sound Global Ltd. | 桑德国际有限公司 | 967 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 300,000 | 816,615.36 | 0.14 |
| 15 | China Animal Healthcare Ltd | 中国动物保健品有限公司 | 940 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 850,000 | 0.00 | 0.00 |

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.本报告期末本基金投资腾讯、香港交易所占基金资产净值比例超过 10%，属于被动超标。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|-------------------------|---------|---------------|----------------|
| 1 | JD.com Inc | JD US | 47,384,306.05 | 9.81 |
| 2 | Meituan Dianping | 3690 HK | 43,742,081.66 | 9.06 |
| 3 | Haier Electronics Group | 1169 HK | 35,589,274.02 | 7.37 |

| | Co.,Limited | | | |
|----|---|---------|---------------|------|
| 4 | Huazhu Group Ltd | HTHT US | 18,640,127.25 | 3.86 |
| 5 | STAAR Surgical Co | STAA US | 16,361,457.88 | 3.39 |
| 6 | Innovent Biologics, Inc. | 1801 HK | 14,559,076.63 | 3.01 |
| 7 | Trip.com Group Ltd | TCOM US | 11,380,652.22 | 2.36 |
| 8 | NEW Oriental Education & Technology Group Inc | EDU US | 10,551,582.62 | 2.18 |
| 9 | Pinduoduo Inc. | PDD US | 9,717,558.60 | 2.01 |
| 10 | iQIYI Inc | IQ US | 9,634,009.72 | 1.99 |
| 11 | Alibaba Group Holding Ltd | BABA US | 7,378,918.14 | 1.53 |
| 12 | CSPC Pharmaceutical Group Limited | 1093 HK | 6,646,370.99 | 1.38 |
| 13 | Sino Biopharmaceutical Limited | 1177 HK | 5,458,179.44 | 1.13 |
| 14 | Tencent Holdings Ltd | 700 HK | 4,475,935.32 | 0.93 |
| 15 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd. | 388 HK | 2,749,343.26 | 0.57 |

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

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|---|---------|---------------|----------------|
| 1 | TAL Education Group | TAL US | 52,277,715.97 | 10.82 |
| 2 | CSPC Pharmaceutical Group Limited | 1093 HK | 50,123,429.86 | 10.38 |
| 3 | Trip.com Group Ltd | TCOM US | 46,390,402.45 | 9.60 |
| 4 | Haier Electronics Group Co.,Limited | 1169 HK | 39,194,047.28 | 8.11 |
| 5 | Meituan Dianping | 3690 HK | 17,925,463.94 | 3.71 |
| 6 | Sino Biopharmaceutical Limited | 1177 HK | 14,927,819.20 | 3.09 |
| 7 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 2269 HK | 14,525,657.53 | 3.01 |
| 8 | JD.com Inc | JD US | 11,983,479.01 | 2.48 |
| 9 | iQIYI Inc | IQ US | 9,976,649.28 | 2.07 |
| 10 | Tencent Holdings Ltd | 700 HK | 7,263,206.13 | 1.50 |
| 11 | NEW Oriental Education & Technology Group Inc | EDU US | 6,764,029.27 | 1.40 |
| 12 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd. | 388 HK | 3,610,856.22 | 0.75 |
| 13 | Alibaba Group Holding Ltd | BABA US | 1,556,514.54 | 0.32 |

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 | 244,268,873.80 |
| 卖出收入（成交）总额 | 276,519,270.68 |

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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 | 8,495,054.39 |
| 3 | 应收股利 | 601,750.40 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息 | 1,682.66 |
| 5 | 应收申购款 | 20,759,828.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 29,858,315.49 |

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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金可以将不高于 20% 的股票资产投资于除在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外）之外的其他企业，本报告期末该部分股票的投资比例为 2.95%。

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 |
| 32,252 | 14,209.49 | 155,113,513.60 | 33.85% | 303,171,052.16 | 66.15% |

8.2 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 | 12,589,680.92 | 2.7471% |

8.3 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 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | >100 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2010年1月21日）基金份额总额 | 592,067,217.31 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 477,085,672.86 |
| 本报告期基金总申购份额 | 207,523,586.48 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 226,324,693.58 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 458,284,565.76 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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 | |
| 国信证券 | 1 | 15,969,251.34 | 3.07% | 12,775.40 | 4.08% | - |
| UBS Securities Asia Limited | 1 | 57,204,192.83 | 10.98% | 57,204.20 | 18.29% | - |
| Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited | 1 | 31,324,222.93 | 6.01% | 25,059.37 | 8.01% | - |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | 1 | 14,063,577.85 | 2.70% | 4,806.75 | 1.54% | - |
| China Merchants Securities (HK) Co Ltd | 1 | 14,815,747.24 | 2.84% | 11,852.60 | 3.79% | - |
| Credit Suisse (Hong Kong) Limited | 1 | 25,876,716.50 | 4.97% | 20,701.38 | 6.62% | - |
| China Intl Capital Corp HK Secs Ltd | 1 | 13,845,820.69 | 2.66% | 11,076.65 | 3.54% | - |
| Haitong International Securities Company Limited | 1 | 82,047,067.21 | 15.75% | 45,954.07 | 14.69% | - |
| Goldman Sachs | 1 | 65,450,607.73 | 12.57% | 52,360.42 | 16.74% | - |
| Citigroup Global Markets Limited | 1 | 200,190,940.15 | 38.44% | 71,046.03 | 22.71% | - |
| Shenyin Wanguo | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|
| Securities HK Ltd | | | | | | |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| Shin Han Investment Corp. | 1 | - | - | - | - | - |
| Hyundai Securities (Asia) Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| Daishin Securities (Asia) Ltd | 1 | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG London | 1 | - | - | - | - | - |
| Nomura Asset Management HongKong Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| CLSA Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| Mirae Asset Securities Co., Ltd | 1 | - | - | - | - | - |
| JP Morgan Securities Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| Knight Capital Europe Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| CCB International Securities Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| BOCOM International Securities Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| Daewoo Securities | 1 | - | - | - | - | - |
| Woori Investment & Securities | 1 | - | - | - | - | - |
| First Shanghai Securities Ltd. | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited | 1 | - | - | - | - | - |
| KGI Institutional Equities | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，新增中信建投证券股份有限公司一个交易单元。

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 | 成交金额 | 占当期债券回购成 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的 | 成交金额 | 占当期基金成交总 |
| | | | | | | | | |

| | | 比例 | | 交总额的 比例 | | 比例 | | 额的比例 |
|--|---|----|---|------------|---|----|---|------|
| 国信 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| UBS Secur ities Asia Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Sanfo rd C. Berns tein (H.K.) Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Morg an Stanl ey & Co. Inter natio nal PLC | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Chin a Merc hants Secur ities (HK) Co Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Credi t Suiss e (Hon g Kong) Limit | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ed | | | | | | | | |
| China Intl Capital Corp HK Secs Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Haitong International Securities Company Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Citigroup Global Markets Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Shenyin Wanguo Securities HK Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Shin Han Investment Corp. | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Hyundai Securities (Asia) Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Daishin Securities (Asia) Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank AG London | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Nomura Asset Management Hong Kong Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CLS A Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Mira Asset Securities Co., | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Ltd | | | | | | | | |
| JP Morg an Secur ities Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Knig ht Capit al Euro pe Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CCB Inter natio nal Secur ities Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BOC OM Inter natio nal Secur ities Limit ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Daew oo Secur ities | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Woor i Inves tment & Secur ities | - | - | - | - | - | - | - | - |
| First | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Shanghai Securities Ltd. | | | | | | | | |
| Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| KGI Institutional Equities | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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部分开放式基金参加浦发银行“极客智投”申购费率优惠活动的公告 | 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 | 2020-01-03 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 2 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告 | 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 | 2020-01-06 |
| 3 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加微众银行为销售机构、参加微众银行费率优惠活动的公告 | 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 | 2020-01-15 |
| 4 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 1 月 20 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2020-01-15 |
| 5 | 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 | 中国证券报 | 2020-01-18 |
| 6 | 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 | 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 | 2020-01-23 |
| 7 | 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 | 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 | 2020-01-30 |
| 8 | 易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 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 | 2020-02-04 |
| 9 | 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 | 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 | 2020-02-04 |
| 10 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 2 月 17 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2020-02-12 |
| 11 | 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 | 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 | 2020-03-05 |
| 12 | 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 | 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 | 2020-03-10 |
| 13 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金在直销中心暂停申购及转换转入业务的公告 | 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 | 2020-03-11 |
| 14 | 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 | 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 | 2020-03-17 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加华瑞保险销售为销售机构、参加华瑞保险销售费率优惠活动的公告 | 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 | 2020-03-23 |
| 16 | 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 | 中国证券报 | 2020-03-31 |
| 17 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 | 中国证券报、基金管理人 | 2020-04-07 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 4 月 10 日、4 月 13 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 18 | 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 | 2020-04-10 |
| 19 | 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 | 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 | 2020-04-17 |
| 20 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国国际期货费率优惠活动的公告 | 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 | 2020-04-17 |
| 21 | 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 | 中国证券报 | 2020-04-21 |
| 22 | 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 | 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 | 2020-04-22 |
| 23 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 4 月 30 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2020-04-27 |
| 24 | 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 | 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 | 2020-05-14 |
| 25 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加万联证券费率优惠活动的公告 | 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 | 2020-05-18 |
| 26 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2020-05-20 |
| 27 | 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 | 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 | 2020-05-23 |
| 28 | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金在包商银行股份有限公司相关业务安排的提示性公告 | 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 | 2020-05-29 |
| 29 | 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 | 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 | 2020-06-03 |
| 30 | 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 | 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 | 2020-06-04 |
| 31 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-06-22 |
| 32 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 | 中国证券报、基金管理人 | 2020-06-24 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | 7月1日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 33 | 易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2020 年 7 月 3 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 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 | 2020-06-30 |

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 |
| 机构 | 1 | 2020年01月01日~2020年06月30日 | 140,261,977.48 | - | 40,000,000.00 | 100,261,977.48 | 21.88% |
| 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；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；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> | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的文件；
- 3.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.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

二〇二〇年八月二十八日