

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 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。

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	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.....	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.7	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.8	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.9	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§ 5	托管人报告.....	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6	审计报告.....	17
6.1	审计意见.....	17
6.2	形成审计意见的基础.....	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任.....	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
§ 7	年度财务报表.....	19
7.1	资产负债表.....	19
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	23
§ 8	投资组合报告.....	50
8.1	期末基金资产组合情况.....	50
8.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	51
8.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	51

8.4	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	51
8.5	报告期内权益投资组合的重大变动	88
8.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	90
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	90
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	90
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	90
8.10	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	90
8.11	投资组合报告附注	90
§ 9	基金份额持有人信息	92
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	92
9.2	期末上市基金前十名持有人	92
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	93
§ 10	开放式基金份额变动	93
§ 11	重大事件揭示	93
11.1	基金份额持有人大会决议	93
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	93
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	94
11.4	基金投资策略的改变	94
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	94
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	94
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	94
11.8	其他重大事件	96
§ 12	备查文件目录	99
12.1	备查文件目录	99
12.2	存放地点	99
12.3	查阅方式	99

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）
基金简称	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）
场内简称	标普 500
基金主代码	161125
交易代码	161125
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 2 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	211,864,079.23 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 14 日

注：易方达标普 500 指数（QDII-LOF）含人民币份额（份额代码：161125）及美元现汇份额（份额代码：003718），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	本基金主要采用完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、固定收益品种和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	标普 500 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 负责人	姓名	张南	李申
	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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43

	楼
--	---

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	355,520.32	1,564,054.23	8,975,560.84
本期利润	13,101,555.29	41,926,503.33	-7,898,356.31
加权平均基金份额本期利润	0.0489	0.3317	-0.0555
本期加权平均净值利润率	3.55%	25.87%	-4.79%
本期基金份额净值增长率	7.04%	29.77%	0.13%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	45,339,372.37	31,917,393.07	13,334,330.81
期末可供分配基金份额利润	0.2140	0.1973	0.1016
期末基金资产净值	324,168,665.52	231,197,659.90	144,611,749.53
期末基金份额净值	1.5301	1.4295	1.1016
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末

基金份额累计净值增长率	53.01%	42.95%	10.16%
-------------	--------	--------	--------

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
过去三个月	6.55%	0.98%	6.67%	0.98%	-0.12%	0.00%
过去六个月	10.81%	1.00%	11.09%	1.00%	-0.28%	0.00%
过去一年	7.04%	2.16%	8.61%	2.09%	-1.57%	0.07%
过去三年	39.07%	1.47%	38.55%	1.43%	0.52%	0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	53.01%	1.28%	59.09%	1.25%	-6.08%	0.03%

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

易方达标普 500 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 2 日至 2020 年 12 月 31 日）



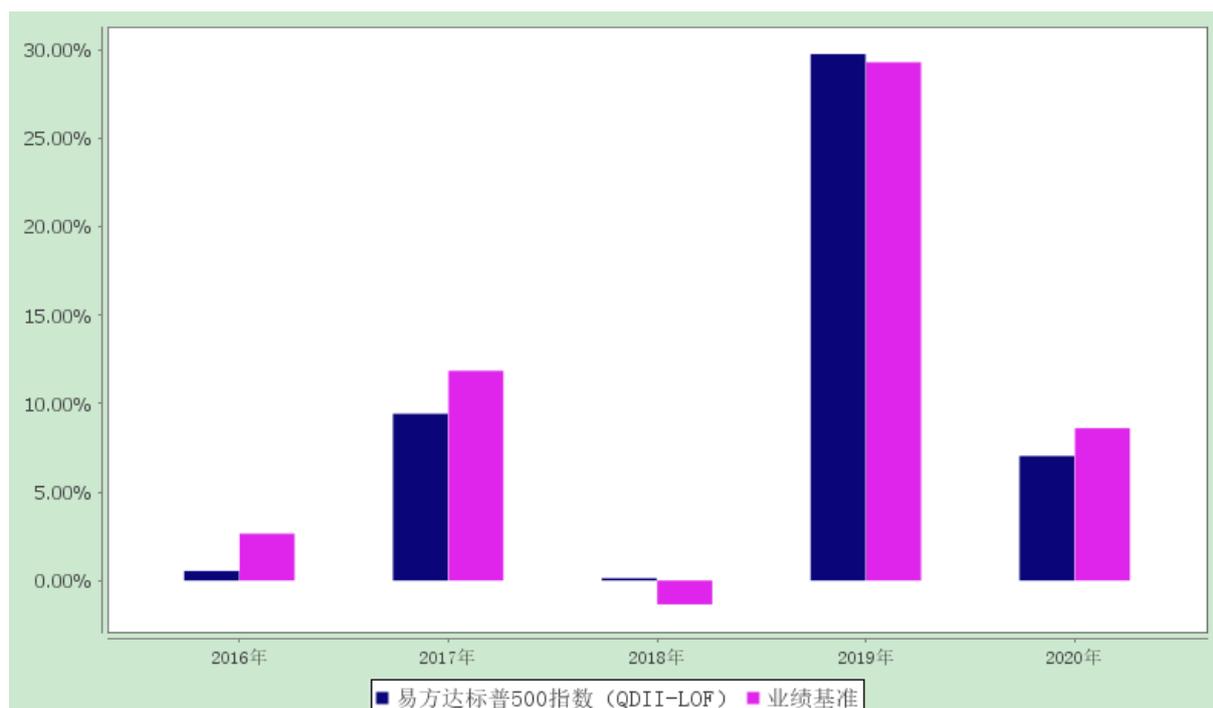
注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 53.01%，同期业绩比较基准收益率为 59.09%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 2 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。本基金管理人始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
FAN BING (范冰)	本基金的基金经理、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、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 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、易方达黄金交易型开放式证券投	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

	<p>资基金联接基金的基金经理、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）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普信息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</p>				理、亚太股票指数基金部基金经理。
刘树荣	<p>本基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普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）、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金</p>	2018-08-11	-	13 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证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。</p>

<p>经理(自 2018 年 08 月 11 日至 2020 年 04 月 22 日)、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理（自 2017 年 07 月 18 日至 2020 年 08 月 06 日）、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）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（自 2017 年 07 月 18 日至 2020 年 12 月 02 日）、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理</p>				
--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行流动性管理。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、

反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

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

对于公司旗下基金在境外的投资交易行为，公司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，并结合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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 99 次，均为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易。

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

回顾 2020 年，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。美股盈利预期转负，叠加之前高企的美股估值，造成了美股在一季度大幅下跌，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。美国政府也通过刺激计划，为经济托底。在货币及财政政策刺激下，美股在二季度出现明显反弹，标普 500 指数创下 1998 年以来最大的单季涨幅。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。在三季度，全球疫情出现再次扩散，美国共和党和民主党就新一轮财政救助的谈判处于僵局，叠加美国大选前的避险情绪，导致美股在 9 月份出现明显回调，波动加大。拜登在 11 月赢得 2020 年美国大选，成为美国第 46 任总统。美联储维持基准利率及资产购买规模不变，符合市场预期。美股从 11 月开始重拾涨势，在四季度末创出年内新高。

作为追踪标普 500 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 1.5301 元，本报告期份额净值增长率为 7.04%，同期业绩比较基准收益率为 8.61%，年化跟踪误差 1.57%，各项指标均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 2021 年，伴随疫苗的研发和接种进程，全球和美国经济预计延续复苏的进程，对企业盈利形成支撑，居民补偿消费也有利于企业补库存。美联储维持宽松的货币政策对股市估值比较有利，后续需要关注拜登新政如何落地，以及通胀是否会出现明显上行。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务创新发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续审视完善制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《关于实施〈公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法〉的规定》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《基金经

理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等最新法规、监管要求以及公司业务创新发展和风险应对管理的需要，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，加强各项政策法规和制度措施的落实执行，适应新的监管环境、市场环境和业务形势，保持公司良好的内控机制。

（2）培育合规文化体系、严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，加大力度开展员工合规风控教育培训，秉持“受人之托、为人理财”的信义义务、践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，促进公司合规文化建设；有针对性地根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及其配套规则的要求开展专项合规宣导与合规培训工作；根据业务实际及时健全完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等管控机制和措施，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

（3）坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

（4）积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询建议，严格进行合规审查。

（5）深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及其配套规则等法律法规和监管政策，进一步加强业务规范与机构管控要求，构建以加强投资者权益保护为中心、促进长期理性投资的机制，持续优化投资者适当性管理机制流程，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”的职责义务，切实保障投资者合法权益。

（6）持续落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套规则，进一步健全信息披露管理工作机制流程，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

（7）持续推动风险为本的反洗钱工作体系建设，全面审视公司面临的洗钱风险与控制措施的有效性，进一步建立完善与风险相适应的政策、程序和控制措施，夯实制度、人员、系统等工作基础，保障资源投入，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，推动反洗钱重点工作提质增效，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

（8）有计划、有重点地对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推

动公司合规、内控体系的健全完善。

(9) 不断完善合规管控框架和机制,促进监察稽核自身工具手段和流程的完善,持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2020 年末,公司已通过 GIPS (全球投资业绩标准) 鉴证,获得 GIPS 鉴证报告,鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 鉴证项目,促进公司进一步夯实运营及内控基础,提升核心竞争力。同时,本年度公司通过 ISAE3402 (《国际鉴证业务准则 3402 号》) 内控鉴证,鉴证日期区间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日,获得控制设计适当性及运行有效性的无保留意见报告。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高监察稽核工作的规范性和有效性,努力防范和控制重大风险,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.9 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 20667 号

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基

金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)不能持续经营。

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

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括

沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	25,835,452.46	16,717,522.77
结算备付金		899,601.01	430,843.14
存出保证金		378,966.19	338,415.46
交易性金融资产	7.4.7.2	300,760,599.43	218,101,528.28
其中：股票投资		300,760,599.43	213,591,554.50
基金投资		-	4,509,973.78
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,147.72	1,584.01
应收股利		203,080.73	179,102.31

应收申购款		2,128,615.08	3,187,462.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		330,207,462.62	238,956,458.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,013,529.29
应付赎回款		5,004,709.86	1,867,491.62
应付管理人报酬		221,374.56	140,872.16
应付托管费		69,179.53	44,022.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	14,334.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	743,533.15	678,548.36
负债合计		6,038,797.10	7,758,798.22
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	211,864,079.23	161,736,153.89
未分配利润	7.4.7.10	112,304,586.29	69,461,506.01
所有者权益合计		324,168,665.52	231,197,659.90
负债和所有者权益总计		330,207,462.62	238,956,458.12

注: 报告截止日 2020 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.5301 元, 基金份额总额 211,864,079.23 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		17,699,999.76	44,271,156.85
1.利息收入		107,769.36	51,664.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	107,769.36	51,664.66
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）		5,872,700.12	3,795,570.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,220,276.08	585,068.07
基金投资收益	7.4.7.13	-1,186,354.67	93,716.29
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-6,967,805.78	342,173.48
股利收益	7.4.7.16	5,806,584.49	2,774,613.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	12,746,034.97	40,362,449.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,767,243.01	-77,944.74
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	740,738.32	139,416.97
减：二、费用		4,598,444.47	2,344,653.52
1. 管理人报酬		2,939,002.50	1,294,024.03
2. 托管费		918,438.39	404,382.58

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	72,285.49	9,624.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		543.25	1,606.67
7. 其他费用	7.4.7.20	668,174.84	635,015.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,101,555.29	41,926,503.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,101,555.29	41,926,503.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	161,736,153.89	69,461,506.01	231,197,659.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,101,555.29	13,101,555.29
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）	50,127,925.34	29,741,524.99	79,869,450.33
其中：1.基金申购款	481,059,011.08	170,759,140.90	651,818,151.98
2.基金赎回款	-430,931,085.74	-141,017,615.91	-571,948,701.65
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）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	211,864,079.23	112,304,586.29	324,168,665.52
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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)	131,277,418.72	13,334,330.81	144,611,749.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,926,503.33	41,926,503.33
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)	30,458,735.17	14,200,671.87	44,659,407.04
其中：1.基金申购款	125,635,527.97	39,616,445.09	165,251,973.06
2.基金赎回款	-95,176,792.80	-25,415,773.22	-120,592,566.02
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)	161,736,153.89	69,461,506.01	231,197,659.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达标普 500 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]2193号《关于准予易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，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

500 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 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 693,199,312.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,037.35 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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 500 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他 各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值

为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的场外人民币基金份额以及登记在易方达基金管理有限公司注册登记系统下的美元份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的场内人民币基金份额，只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2)人民币基金份额的现金分红币种为人民币，美元基金份额的现金分红币种为美元；不同币种份额红利再投资适用的净值为该币种份额的份额净值；

(3)基金收益分配后人民币基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的人民币基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。对于美元基金份额，由于汇率因素影响，收益分配后美元基金份额的基金份额净值可能低于对应的基金份额面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	25,835,452.46	16,717,522.77

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	25,835,452.46	16,717,522.77

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	254,151,197.02	300,760,599.43	46,609,402.41
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	254,151,197.02	300,760,599.43	46,609,402.41
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	179,582,820.70	213,591,554.50	34,008,733.80
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		4,519,923.09	4,509,973.78	-9,949.31
其他		-	-	-
合计		184,102,743.79	218,101,528.28	33,998,784.49

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,770,138.60	-	-	-
ESH1	4,770,138.60	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,770,138.60	-	-	-
项目	上年度末 2019年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,931,472.47	-	-	-
ESH0	7,931,472.47	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,931,472.47	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货

货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

于 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的股指期货情况如下:

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)
ESH1	S&P500 EMINI FUT Mar21	4	4,892,109.02	121,970.42
总额合计				121,970.42
减:可抵销期货暂收款				121,970.42
股指期货投资净额				0.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的股指期货情况如下:

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)
ESH0	S&P500 EMINI FUT Mar 20	7	7,918,025.84	-13,446.63
总额合计				-13,446.63
减:可抵销期货暂收款				-13,446.63
股指期货投资净额				0.00

注:买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,147.72	1,584.01
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	1,147.72	1,584.01

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	17,013.15	4,711.36
预提费用	312,000.00	260,000.00
其他应付款	414,520.00	413,837.00
合计	743,533.15	678,548.36

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	161,736,153.89	161,736,153.89
本期申购	481,059,011.08	481,059,011.08
本期赎回(以“-”号填列)	-430,931,085.74	-430,931,085.74

本期末	211,864,079.23	211,864,079.23
-----	----------------	----------------

7.4.7.10 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	31,917,393.07	37,544,112.94	69,461,506.01
本期利润	355,520.32	12,746,034.97	13,101,555.29
本期基金份额交易产生的变动数	13,066,458.98	16,675,066.01	29,741,524.99
其中：基金申购款	86,448,110.28	84,311,030.62	170,759,140.90
基金赎回款	-73,381,651.30	-67,635,964.61	-141,017,615.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,339,372.37	66,965,213.92	112,304,586.29

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	104,664.67	51,148.88
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	3,104.69	515.78
合计	107,769.36	51,664.66

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	244,296,681.16	18,349,749.02
减：卖出股票成本总额	236,076,405.08	17,764,680.95
买卖股票差价收入	8,220,276.08	585,068.07

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	11,520,335.33	12,161,035.91
减：卖出/赎回基金成本总额	12,706,690.00	12,067,319.62
基金投资收益	-1,186,354.67	93,716.29

7.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出权证成交总额	9,059.96	9,749.40
减：卖出权证成本总额	-	10,458.82
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	-20.66
买卖权证差价收入	9,059.96	-688.76

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
期货投资收益	-6,976,865.74	342,862.24
合计	-6,976,865.74	342,862.24

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,806,584.49	2,768,197.76

基金投资产生的股利收益	-	6,415.26
合计	5,806,584.49	2,774,613.02

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	12,610,617.92	40,375,895.73
——股票投资	12,600,668.61	40,385,845.04
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	9,949.31	-9,949.31
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	135,417.05	-13,446.63
——权证投资	-	-
——期货投资	135,417.05	-13,446.63
——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	12,746,034.97	40,362,449.10

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	740,738.32	139,416.97
其他	-	-
合计	740,738.32	139,416.97

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	71,407.59	8,447.48
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	877.90	1,177.26
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
其他	877.90	1,177.26
合计	72,285.49	9,624.74

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	72,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行汇划费	1,654.84	1,178.50
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	274,996.00	276,573.00
指数数据费	139,524.00	137,264.00
其他	-	-
合计	668,174.84	635,015.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
道富银行	境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
盈峰控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业 (有限合伙)	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业 (有限合伙)	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业 (有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业 (有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业 (有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业 (有限合伙)	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,939,002.50	1,294,024.03
其中：支付销售机构的客户维护费	681,393.11	296,847.90

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：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	918,438.39	404,382.58

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:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	22,126,976.15	103,127.00	15,505,930.33	40,708.39
道富银行-活期存款	3,708,476.31	1,537.67	1,211,592.44	10,440.49

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于托管行道富银行发行的股票 STT US。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有道富银行的股票 STT US 的估值总额为人民币 246,463.87 元(2019 年 12 月 31 日：224,037.87 元)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，

并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 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。本基金在境内交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (2019 年 12 月 31 日：0.00%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31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

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31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

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31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

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31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

7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,835,452.46	-	-	-	25,835,452.46
结算备付金	899,601.01	-	-	-	899,601.01
存出保证金	378,966.19	-	-	-	378,966.19
交易性金融资产	-	-	-	300,760,599.43	300,760,599.43
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	-	-	-	1,147.72	1,147.72
应收股利	-	-	-	203,080.73	203,080.73
应收申购款	161,047.35	-	-	1,967,567.73	2,128,615.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,275,067.01	-	-	302,932,395.61	330,207,462.62
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	-	-	-	5,004,709.86	5,004,709.86
应付管理人报酬	-	-	-	221,374.56	221,374.56
应付托管费	-	-	-	69,179.53	69,179.53

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	-	-	-	743,533.15	743,533.15
负债总计	-	-	-	6,038,797.10	6,038,797.10
利率敏感度缺口	27,275,067.01	-	-	296,893,598.51	324,168,665.52
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	16,717,522.77	-	-	-	16,717,522.77
结算备付金	430,843.14	-	-	-	430,843.14
存出保证金	338,415.46	-	-	-	338,415.46
交易性金融资产	-	-	-	218,101,528.28	218,101,528.28
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	-	-	-	1,584.01	1,584.01
应收股利	-	-	-	179,102.31	179,102.31
应收申购款	283,129.49	-	-	2,904,332.66	3,187,462.15
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,769,910.86	-	-	221,186,547.26	238,956,458.12
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	-	-	-	5,013,529.29	5,013,529.29

应付赎回款	-	-	-	1,867,491.62	1,867,491.62
应付管理人报酬	-	-	-	140,872.16	140,872.16
应付托管费	-	-	-	44,022.56	44,022.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	14,334.23	14,334.23
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	678,548.36	678,548.36
负债总计	-	-	-	7,758,798.22	7,758,798.22
利率敏感度缺口	17,769,910.86	-	-	213,427,749.04	231,197,659.90

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	16,509,620.01	-	-	16,509,620.01
结算备付金	899,601.01	-	-	899,601.01
存出保证金	378,966.19	-	-	378,966.19
交易性金融资产	300,760,599.43	-	-	300,760,599.43
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	35.82	-	-	35.82
应收股利	203,080.73	-	-	203,080.73

应收申购款	1,219,542.63	-	-	1,219,542.63
其他资产	-	-	-	-
资产合计	319,971,445.82	-	-	319,971,445.82
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	152,378.53	-	-	152,378.53
其他负债	574.32	-	-	574.32
负债合计	152,952.85	-	-	152,952.85
资产负债表外汇风险敞口净额	319,818,492.97	-	-	319,818,492.97
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	7,371,076.64	-	-	7,371,076.64
结算备付金	430,843.14	-	-	430,843.14
交易性金融资产	218,101,528.28	-	-	218,101,528.28
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	285.96	-	-	285.96
应收股利	179,102.31	-	-	179,102.31
应收申购款	169,850.73	-	-	169,850.73
其他资产	-	-	-	-
存出保证金	338,415.46	-	-	338,415.46
资产合计	226,591,102.52	-	-	226,591,102.52
以外币计价的负债				
应付证券清算款	5,013,529.29	-	-	5,013,529.29
应付赎回款	586,992.96	-	-	586,992.96
其他负债	410.90	-	-	410.90
负债合计	5,600,933.15	-	-	5,600,933.15
资产负债表外汇风险敞口净额	220,990,169.37	-	-	220,990,169.37

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 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%	-15,990,924.65	-11,049,508.47
假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	15,990,924.65	11,049,508.47	

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	300,760,599.43	92.78	213,591,554.50	92.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	4,509,973.78	1.95
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	300,760,599.43	92.78	218,101,528.28	94.34

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	15,038,029.56	10,905,076.11
	2.业绩比较基准下降 5%	-15,038,029.56	-10,905,076.11

7.4.14 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 12 月 31 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 300,760,599.43 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 218,101,528.28 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	300,760,599.43	91.08
	其中：普通股	293,629,078.96	88.92
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	7,131,520.47	2.16
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	26,735,053.47	8.10
8	其他各项资产	2,711,809.72	0.82

9	合计	330,207,462.62	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 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	300,760,599.43	92.78
合计	300,760,599.43	92.78

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。

8.3 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	6,893,043.02	2.13
材料	7,949,731.85	2.45
工业	25,352,571.64	7.82
非必需消费品	38,231,308.57	11.79
必需消费品	19,579,968.54	6.04
保健	40,495,163.11	12.49
金融	31,445,218.30	9.70
信息技术	82,828,065.28	25.55
电信服务	32,306,000.32	9.97
公用事业	8,345,842.92	2.57
房地产	7,333,685.88	2.26
合计	300,760,599.43	92.78

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 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	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	23,176	20,065,525.42	6.19
2	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	10,964	15,911,705.18	4.91

3	Amazon.com Inc	-	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	619	13,154,457.24	4.06
4	Alphabet Inc	-	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	436	4,986,009.12	1.54
			GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	421	4,812,384.40	1.48
5	Facebook Inc	-	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	3,487	6,215,025.45	1.92
6	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,099	5,060,264.38	1.56
7	Berkshire Hathaway Inc	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	2,823	4,270,997.33	1.32
8	Johnson & Johnson	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	3,818	3,920,661.29	1.21
9	JPMorgan Chase & Co	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	4,421	3,665,535.29	1.13
10	Visa Inc	-	V US	纽约证券交易所	美国	2,459	3,509,463.60	1.08
11	Procter & Gamble Co/The	-	PG US	纽约证券交易所	美国	3,596	3,264,717.01	1.01
12	UnitedHealth Group Inc	-	UNH US	纽约证券交易所	美国	1,376	3,148,497.06	0.97
13	Walt Disney Co/The	-	DIS US	纽约证券交易所	美国	2,626	3,104,408.31	0.96
14	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	898	3,059,757.90	0.94
15	Mastercard Inc	-	MA US	纽约证券交易所	美国	1,276	2,971,801.20	0.92
16	Home Depot	-	HD US	纽约证券交易所	美国	1,562	2,707,170.83	0.84

	Inc/The			所				
17	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克 克证券 交易所	美国	1,700	2,597,823.69	0.80
18	Verizon Communications Inc	-	VZ US	纽约证 券交易 所	美国	6,001	2,300,410.59	0.71
19	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯 克证 券交 易所	美国	696	2,271,210.16	0.70
20	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯 克证 券交 易所	美国	6,622	2,264,093.32	0.70
21	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯 克证 券交 易所	美国	641	2,261,582.08	0.70
22	Bank of America Corp	-	BAC US	纽约证 券交易 所	美国	11,040	2,183,377.70	0.67
23	Coca-Cola Co/The	-	KO US	纽约证 券交易 所	美国	5,609	2,007,043.32	0.62
24	Merck & Co Inc	-	MRK US	纽约证 券交易 所	美国	3,669	1,958,280.39	0.60
25	AT&T Inc	-	T US	纽约证 券交易 所	美国	10,334	1,939,238.39	0.60
26	PepsiCo Inc	-	PEP US	纳斯 克证 券交 易所	美国	2,004	1,939,155.91	0.60
27	Pfizer Inc	-	PFE US	纽约证 券交易 所	美国	8,061	1,936,103.63	0.60
28	Intel Corp	-	INTC US	纳斯 克证 券交 易所	美国	5,943	1,931,894.09	0.60
29	salesforce.com Inc	-	CRM US	纽约证 券交易 所	美国	1,327	1,926,785.42	0.59
30	Walmart Inc	-	WMT US	纽约证 券交易 所	美国	2,011	1,891,474.88	0.58

31	Abbott Laboratories	-	ABT US	纽约证券交易所	美国	2,571	1,836,751.45	0.57
32	AbbVie Inc	-	ABBV US	纽约证券交易所	美国	2,561	1,790,505.31	0.55
33	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	6,128	1,789,310.28	0.55
34	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	575	1,747,521.56	0.54
35	NIKE Inc	-	NKE US	纽约证券交易所	美国	1,820	1,680,001.24	0.52
36	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	587	1,677,016.42	0.52
37	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	6,132	1,649,240.51	0.51
38	QUALCOMM Inc	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,641	1,631,159.36	0.50
39	Costco Wholesale Corp	-	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	640	1,573,409.17	0.49
40	Accenture PLC	-	ACN US	纽约证券交易所	美国	919	1,566,315.23	0.48
41	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	2,792	1,538,469.63	0.47
42	McDonald's Corp	-	MCD US	纽约证券交易所	美国	1,081	1,513,522.20	0.47
43	Medtronic PLC	-	MDT US	纽约证券交易所	美国	1,952	1,491,965.89	0.46
44	NextEra Energy Inc	-	NEE US	纽约证券交易所	美国	2,841	1,430,148.14	0.44
45	Texas	-	TXN US	纳斯达克	美国	1,332	1,426,481.21	0.44

	Instruments Inc			克证券交易所				
46	Honeywell International Inc	-	HON US	纽约证券交易所	美国	1,018	1,412,827.46	0.44
47	Danaher Corp	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	917	1,329,137.66	0.41
48	Union Pacific Corp	-	UNP US	纽约证券交易所	美国	978	1,328,725.16	0.41
49	Bristol-Myers Squibb Co	-	BMJ US	纽约证券交易所	美国	3,277	1,326,331.50	0.41
50	Linde Public Limited	-	LIN US	纽约证券交易所	美国	762	1,310,164.82	0.40
51	Eli Lilly & Co	-	LLY US	纽约证券交易所	美国	1,152	1,269,117.06	0.39
52	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	845	1,267,673.23	0.39
53	Philip Morris International Inc	-	PM US	纽约证券交易所	美国	2,259	1,220,303.83	0.38
54	Citigroup Inc	-	C US	纽约证券交易所	美国	3,020	1,215,022.51	0.37
55	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,702	1,188,053.53	0.37
56	Wells Fargo & Co	-	WFC US	纽约证券交易所	美国	5,996	1,180,741.21	0.36
57	Oracle Corp	-	ORCL US	纽约证券交易所	美国	2,751	1,161,185.49	0.36
58	United Parcel Service Inc	-	UPS US	纽约证券交易所	美国	1,041	1,143,843.68	0.35

59	Lowe's Cos Inc	-	LOW US	纽约证券交易所	美国	1,063	1,113,292.34	0.34
60	Boeing Co/The	-	BA US	纽约证券交易所	美国	770	1,075,474.47	0.33
61	International Business Machines Corp	-	IBM US	纽约证券交易所	美国	1,293	1,062,011.25	0.33
62	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,744	1,043,607.12	0.32
63	Raytheon Technologies Corp	-	RTX US	纽约证券交易所	美国	2,203	1,027,910.10	0.32
64	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	283	1,016,394.70	0.31
65	BlackRock Inc	-	BLK US	纽约证券交易所	美国	206	969,843.13	0.30
66	3M Co	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	837	954,587.85	0.29
67	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	382	946,780.61	0.29
68	American Tower Corp	-	AMT US	纽约证券交易所	美国	645	944,653.49	0.29
69	Caterpillar Inc	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	788	935,877.89	0.29
70	Morgan Stanley	-	MS US	纽约证券交易所	美国	2,073	926,944.85	0.29
71	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	212	915,108.09	0.28
72	Intuitive Surgical	-	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	171	912,801.54	0.28

	Inc			交易所				
73	General Electric Co	-	GE US	纽约证券交易所	美国	12,703	895,166.69	0.28
74	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	60	871,962.84	0.27
75	Goldman Sachs Group Inc/The	-	GS US	纽约证券交易所	美国	499	858,620.01	0.26
76	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	1,899	846,290.62	0.26
77	Target Corp	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	727	837,388.11	0.26
78	Fidelity National Information Services Inc	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	900	830,711.12	0.26
79	Lockheed Martin Corp	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	358	829,202.82	0.26
80	Deere & Co	-	DE US	纽约证券交易所	美国	455	798,763.58	0.25
81	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,615	792,225.30	0.24
82	Mondelez International Inc	-	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	2,074	791,253.61	0.24
83	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	1,742	776,209.80	0.24
84	Stryker Corp	-	SYK US	纽约证券交易所	美国	475	759,459.21	0.23
85	Anthem Inc	-	ANTM US	纽约证券交易所	美国	361	756,323.93	0.23

86	Charles Schwab Corp/The	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	2,180	754,455.92	0.23
87	S&P Global Inc	-	SPGI US	纽约证券交易所	美国	349	748,580.70	0.23
88	American Express Co	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	946	746,323.67	0.23
89	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,325	746,106.00	0.23
90	Zoetis Inc	-	ZTS US	纽约证券交易所	美国	690	745,110.96	0.23
91	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	846	744,380.82	0.23
92	Altria Group Inc	-	MO US	纽约证券交易所	美国	2,695	720,968.83	0.22
93	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	622	715,105.55	0.22
94	Cigna Corp	-	CI US	纽约证券交易所	美国	524	711,777.33	0.22
95	Prologis Inc	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	1,072	697,091.08	0.22
96	Colgate-Palmolive Co	-	CL US	纽约证券交易所	美国	1,243	693,524.64	0.21
97	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,818	691,095.75	0.21
98	Becton Dickinson and Co	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	421	687,350.06	0.21
99	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,121	679,143.24	0.21
100	Chubb	-	CB US	纽约证	美国	655	657,824.76	0.20

	Ltd			券交易 所				
101	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,110	657,269.49	0.20
102	Crown Castle Internatio nal Corp	-	CCI US	纽约证 券交易 所	美国	625	649,186.77	0.20
103	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	209	644,036.54	0.20
104	Duke Energy Corp	-	DUK US	纽约证 券交易 所	美国	1,068	638,044.39	0.20
105	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	319	635,547.84	0.20
106	CME Group Inc	-	CME US	纳斯达 克证券 交易所	美国	521	618,874.04	0.19
107	Southern Co/The	-	SO US	纽约证 券交易 所	美国	1,532	614,063.30	0.19
108	Interconti nental Exchange Inc	-	ICE US	纽约证 券交易 所	美国	814	612,336.16	0.19
109	Global Payments Inc	-	GPN US	纽约证 券交易 所	美国	435	611,433.37	0.19
110	Truist Financial Corp	-	TFC US	纽约证 券交易 所	美国	1,955	611,403.68	0.19
111	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	131	610,453.85	0.19
112	US Bancorp	-	USB US	纽约证 券交易 所	美国	1,988	604,342.24	0.19
113	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达 克证券 交易所	美国	807	599,540.57	0.18
114	PNC	-	PNC US	纽约证	美国	615	597,909.21	0.18

	Financial Services Group Inc			券交易所				
115	FedEx Corp	-	FDX US	纽约证券交易所	美国	351	594,592.08	0.18
116	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	378	582,911.86	0.18
117	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证券交易所	美国	1,184	580,956.22	0.18
118	Estee Lauder Cos Inc	-	EL US	纽约证券交易所	美国	332	576,638.56	0.18
119	Air Products & Chemicals Inc	-	APD US	纽约证券交易所	美国	321	572,257.35	0.18
120	Norfolk Southern Corp	-	NSC US	纽约证券交易所	美国	369	572,090.77	0.18
121	Sherwin-Williams Co/The	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	119	570,630.50	0.18
122	Marsh & McLennan Cos Inc	-	MMC US	纽约证券交易所	美国	736	561,872.19	0.17
123	Illinois Tool Works Inc	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	418	556,063.98	0.17
124	Progressive Corp/The	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	850	548,404.80	0.17
125	Edwards Lifesciences Corp	-	EW US	纽约证券交易所	美国	915	544,668.96	0.17
126	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	536	516,662.98	0.16
127	Humana Inc	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	192	513,978.38	0.16

128	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	212	511,813.16	0.16
129	Ecolab Inc	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	361	509,633.58	0.16
130	General Motors Co	-	GM US	纽约证券交易所	美国	1,827	496,390.12	0.15
131	DuPont De Nemours Inc.	-	DD US	纽约证券交易所	美国	1,065	494,144.71	0.15
132	Boston Scientific Corp	-	BSX US	纽约证券交易所	美国	2,105	493,770.18	0.15
133	Dollar General Corp	-	DG US	纽约证券交易所	美国	356	488,498.38	0.15
134	Regeneron Pharmaceuticals Inc	-	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	154	485,445.64	0.15
135	Emerson Electric Co	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	880	461,477.47	0.14
136	Aon PLC	-	AON US	纽约证券交易所	美国	332	457,667.19	0.14
137	Newmont Goldcorp Corp	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	1,165	455,254.34	0.14
138	Eaton Corp PLC	-	ETN US	纽约证券交易所	美国	579	453,878.96	0.14
139	Moody's Corp	-	MCO US	纽约证券交易所	美国	238	450,721.30	0.14
140	Northrop Grumman Corp	-	NOC US	纽约证券交易所	美国	225	447,360.19	0.14
141	Waste Management Inc	-	WM US	纽约证券交易所	美国	572	440,143.39	0.14

142	Roper Technologies Inc	-	ROP US	纽约证券交易所	美国	155	435,986.97	0.13
143	Kimberly-Clark Corp	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	494	434,597.62	0.13
144	Capital One Financial Corp	-	COF US	纽约证券交易所	美国	672	433,430.84	0.13
145	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	524	419,893.24	0.13
146	HCA Healthcare Inc	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	388	416,357.00	0.13
147	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	776	414,939.27	0.13
148	Twitter Inc	-	TWTR US	纽约证券交易所	美国	1,164	411,268.36	0.13
149	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	126	410,961.82	0.13
150	ConocoPhillips	-	COP US	纽约证券交易所	美国	1,549	404,181.73	0.12
151	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	425	398,214.65	0.12
152	American Electric Power Co Inc	-	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	730	396,629.75	0.12
153	Dow Inc	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	1,091	395,085.96	0.12
154	Exelon Corp	-	EXC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,434	395,040.15	0.12
155	Baxter International	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	745	390,050.69	0.12

	nal Inc			所				
156	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	486	383,925.25	0.12
157	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	224	378,899.38	0.12
158	KLA-Tencor Corp	-	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	224	378,417.06	0.12
159	L3Harris Technologies Inc	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	305	376,167.66	0.12
160	Amphenol Corp	-	APH US	纽约证券交易所	美国	439	374,581.65	0.12
161	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	41	370,973.91	0.11
162	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	106	369,598.26	0.11
163	Digital Realty Trust Inc	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	406	369,577.25	0.11
164	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	411	365,868.96	0.11
165	Sysco Corp	-	SYU US	纽约证券交易所	美国	749	362,919.77	0.11
166	Freeport-McMoRan Inc	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	2,137	362,815.37	0.11
167	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	224	357,881.89	0.11
168	Constellation Brands Inc	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	248	354,461.28	0.11
169	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	426	354,149.78	0.11

				所				
170	MSCI Inc	-	MSCI US	纽约证 券交易 所	美国	121	352,541.20	0.11
171	General Mills Inc	-	GIS US	纽约证 券交易 所	美国	899	344,914.04	0.11
172	Agilent Technolog ies Inc	-	A US	纽约证 券交易 所	美国	444	343,272.12	0.11
173	Travelers Cos Inc/The	-	TRV US	纽约证 券交易 所	美国	373	341,630.78	0.11
174	DexCom Inc	-	DXCM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	141	340,146.43	0.10
175	MetLife Inc	-	MET US	纽约证 券交易 所	美国	1,110	340,041.90	0.10
176	Aptiv PLC	-	APTV US	纽约证 券交易 所	美国	398	338,351.43	0.10
177	Parker-Ha nnifin Corp	-	PH US	纽约证 券交易 所	美国	190	337,715.12	0.10
178	Public Storage	-	PSA US	纽约证 券交易 所	美国	224	337,522.12	0.10
179	Marriott Internatio nal Inc/MD	-	MAR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	392	337,419.80	0.10
180	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	773	336,266.66	0.10
181	Microchip Technolog y Inc	-	MCHP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	372	335,229.27	0.10
182	Trane Technolog ies PLC	-	TT US	纽约证 券交易 所	美国	353	334,345.53	0.10
183	Centene Corp	-	CNC US	纽约证 券交易 所	美国	853	334,111.35	0.10

184	Xilinx Inc	-	XLNX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	360	333,012.63	0.10
185	General Dynamics Corp	-	GD US	纽约证 券交易 所	美国	342	332,094.18	0.10
186	Bank of New York Mellon Corp	-	BK US	纽约证 券交易 所	美国	1,199	332,023.19	0.10
187	T Rowe Price Group Inc	-	TROW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	334	329,926.74	0.10
188	Ford Motor Co	-	F US	纽约证 券交易 所	美国	5,749	329,727.40	0.10
189	IQVIA Holdings Inc	-	IQV US	纽约证 券交易 所	美国	282	329,676.71	0.10
190	Alexion Pharmace uticals Inc	-	ALXN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	323	329,282.47	0.10
191	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	544	328,261.98	0.10
192	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证 券交易 所	美国	348	327,475.34	0.10
193	HP Inc	-	HPQ US	纽约证 券交易 所	美国	2,021	324,263.98	0.10
194	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	239	323,726.45	0.10
195	TransDig m Group Inc	-	TDG US	纽约证 券交易 所	美国	80	323,034.75	0.10
196	Cummins Inc	-	CMI US	纽约证 券交易 所	美国	218	323,033.44	0.10
197	IHS Markit Ltd	-	INFO US	纽约证 券交易 所	美国	549	321,786.34	0.10
198	Johnson	-	JCI US	纽约证	美国	1,050	319,194.85	0.10

	Controls International plc			券交易所				
199	Allstate Corp/The	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	441	316,321.48	0.10
200	Yum! Brands Inc	-	YUM US	纽约证券交易所	美国	444	314,504.36	0.10
201	American International Group Inc	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	1,268	313,237.48	0.10
202	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	106	313,015.24	0.10
203	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	950	311,482.41	0.10
204	Zimmer Biomet Holdings Inc	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	305	306,653.66	0.09
205	SBA Communications Corp	-	SBAC US	纳斯达克证券交易所	美国	165	303,743.56	0.09
206	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	127	301,467.34	0.09
207	ResMed Inc	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	214	296,803.61	0.09
208	Prudential Financial Inc	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	582	296,470.18	0.09
209	Hilton Worldwide Holdings Inc	-	HLT US	纽约证券交易所	美国	408	296,191.83	0.09
210	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	128	295,205.27	0.09
211	Carrier	-	CARR US	纽约证	美国	1,198	294,850.84	0.09

	Global Corp			券交易所				
212	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	643	293,434.02	0.09
213	Ball Corp	-	BLL US	纽约证券交易所	美国	481	292,443.28	0.09
214	Schlumberger Ltd	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	2,043	291,001.99	0.09
215	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	510	287,113.87	0.09
216	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	472	286,971.37	0.09
217	Eversource Energy	-	ES US	纽约证券交易所	美国	505	285,056.89	0.09
218	Public Service Enterprise Group Inc	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	745	283,399.24	0.09
219	Rockwell Automation Inc	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	171	279,843.24	0.09
220	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	465	279,226.24	0.09
221	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	857	278,865.03	0.09
222	Corteva Inc	-	CTVA US	纽约证券交易所	美国	1,102	278,413.83	0.09
223	Motorola Solutions Inc	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	250	277,406.12	0.09
224	Walgreens Boots Alliance Inc	-	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,059	275,565.58	0.09
225	Aflac Inc	-	AFL US	纽约证	美国	948	275,073.86	0.08

				券交易所				
226	Stanley Black & Decker Inc	-	SWK US	纽约证券交易所	美国	235	273,795.24	0.08
227	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	818	269,056.73	0.08
228	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	844	268,907.57	0.08
229	American Water Works Co Inc	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	267	267,367.50	0.08
230	AMETEK Inc	-	AME US	纽约证券交易所	美国	338	266,723.04	0.08
231	Simon Property Group Inc	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	479	266,536.42	0.08
232	Discover Financial Services	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	451	266,405.34	0.08
233	McKesson Corp	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	233	264,410.87	0.08
234	Otis Worldwide Corp	-	OTIS US	纽约证券交易所	美国	599	264,013.44	0.08
235	Southwest Airlines Co	-	LUV US	纽约证券交易所	美国	868	263,981.01	0.08
236	Corning Inc	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	1,120	263,083.97	0.08
237	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	34	262,985.83	0.08
238	VF Corp	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	471	262,484.39	0.08
239	Willis	-	WLTW US	纳斯达克	美国	190	261,186.53	0.08

	Towers Watson PLC			克证券 交易所				
240	Mettler-T oledo Internatio nal Inc	-	MTD US	纽约证 券交易 所	美国	35	260,270.43	0.08
241	Welltower Inc	-	WELL US	纽约证 券交易 所	美国	614	258,886.37	0.08
242	Marathon Petroleum Corp	-	MPC US	纽约证 券交易 所	美国	958	258,535.33	0.08
243	Kinder Morgan Inc/DE	-	KMI US	纽约证 券交易 所	美国	2,864	255,455.58	0.08
244	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	304	252,409.23	0.08
245	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	350	246,732.57	0.08
246	State Street Corp	-	STT US	纽约证 券交易 所	美国	519	246,463.87	0.08
247	Delta Air Lines Inc	-	DAL US	纽约证 券交易 所	美国	939	246,361.89	0.08
248	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达 克证券 交易所	美国	246	245,391.57	0.08
249	Clorox Co/The	-	CLX US	纽约证 券交易 所	美国	186	245,056.45	0.08
250	First Republic Bank/CA	-	FRC US	纽约证 券交易 所	美国	254	243,510.70	0.08
251	Weyerhae user Co	-	WY US	纽约证 券交易 所	美国	1,098	240,220.33	0.07
252	Keysight Technolog ies Inc	-	KEYS US	纽约证 券交易 所	美国	276	237,877.24	0.07
253	Kroger	-	KR US	纽约证	美国	1,145	237,279.29	0.07

	Co/The			券交易 所				
254	Williams Cos Inc/The	-	WMB US	纽约证 券交易 所	美国	1,786	233,652.10	0.07
255	Consolida ted Edison Inc	-	ED US	纽约证 券交易 所	美国	493	232,476.38	0.07
256	Cerner Corp	-	CERN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	450	230,433.37	0.07
257	Fortive Corp	-	FTV US	纽约证 券交易 所	美国	496	229,198.34	0.07
258	Take-Two Interactiv e Software Inc	-	TTWO US	纳斯达 克证券 交易所	美国	169	229,131.72	0.07
259	Edison Internatio nal	-	EIX US	纽约证 券交易 所	美国	557	228,311.08	0.07
260	McCormi ck & Co Inc/MD	-	MKC US	纽约证 券交易 所	美国	365	227,679.86	0.07
261	Arthur J Gallagher & Co	-	AJG US	纽约证 券交易 所	美国	282	227,629.10	0.07
262	Maxim Integrated Products Inc	-	MXIM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	393	227,323.93	0.07
263	LyondellB asell Industries NV	-	LYB US	纽约证 券交易 所	美国	379	226,669.41	0.07
264	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证 券交易 所	美国	179	225,228.85	0.07
265	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证 券交易 所	美国	284	224,981.42	0.07
266	Ameripris e Financial	-	AMP US	纽约证 券交易 所	美国	177	224,433.14	0.07

	Inc							
267	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	600	221,468.16	0.07
268	FleetCor Technologies Inc	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	124	220,743.37	0.07
269	Best Buy Co Inc	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	339	220,729.60	0.07
270	DR Horton Inc	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	487	219,002.00	0.07
271	AvalonBay Communities Inc	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	208	217,732.26	0.07
272	Viatis Inc	-	VTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,775	217,041.01	0.07
273	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	954	215,749.99	0.07
274	Hershey Co/The	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	217	215,684.55	0.07
275	Paycom Software Inc	-	PAYC US	纽约证券交易所	美国	73	215,414.68	0.07
276	Etsy Inc	-	ETSY US	纳斯达克证券交易所	美国	182	211,273.78	0.07
277	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	149	210,386.27	0.06
278	MarketAxess Holdings Inc	-	MKTX US	纳斯达克证券交易所	美国	56	208,479.43	0.06
279	PPL Corp	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	1,132	208,290.47	0.06
280	Alexandria Real	-	ARE US	纽约证券交易所	美国	179	208,153.31	0.06

	Estate Equities Inc			所				
281	Church & Dwight Co Inc	-	CHD US	纽约证 券交易 所	美国	364	207,176.80	0.06
282	Realty Income Corp	-	O US	纽约证 券交易 所	美国	508	206,071.74	0.06
283	CBRE Group Inc	-	CBRE US	纽约证 券交易 所	美国	494	202,165.41	0.06
284	ViacomC BS Inc.	-	VIAC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	830	201,787.75	0.06
285	West Pharmace utical Services Inc	-	WST US	纽约证 券交易 所	美国	109	201,494.07	0.06
286	Lennar Corp	-	LEN US	纽约证 券交易 所	美国	405	201,444.22	0.06
287	Zebra Technolog ies Corp	-	ZBRA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	79	198,109.47	0.06
288	Equity Residentia l	-	EQR US	纽约证 券交易 所	美国	504	194,945.22	0.06
289	SVB Financial Group	-	SIVB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	77	194,852.50	0.06
290	Republic Services Inc	-	RSG US	纽约证 券交易 所	美国	310	194,787.84	0.06
291	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证 券交易 所	美国	295	192,176.57	0.06
292	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	198	191,890.39	0.06
293	Teradyne Inc	-	TER US	纳斯达 克证券 交易所	美国	245	191,656.21	0.06

294	Laboratory Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证券交易所	美国	144	191,252.65	0.06
295	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	195	188,703.04	0.06
296	Fifth Third Bancorp	-	FITB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,048	188,526.28	0.06
297	Las Vegas Sands Corp	-	LVS US	纽约证券交易所	美国	484	188,219.88	0.06
298	International Paper Co	-	IP US	纽约证券交易所	美国	579	187,838.04	0.06
299	Northern Trust Corp	-	NTRS US	纳斯达克证券交易所	美国	307	186,572.86	0.06
300	Ameren Corp	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	364	185,397.46	0.06
301	Teleflex Inc	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	69	185,296.26	0.06
302	Kansas City Southern	-	KSU US	纽约证券交易所	美国	139	185,137.97	0.06
303	Qorvo Inc	-	QRVO US	纳斯达克证券交易所	美国	169	183,347.28	0.06
304	Tyson Foods Inc	-	TSN US	纽约证券交易所	美国	433	182,061.15	0.06
305	Hologic Inc	-	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	382	181,529.63	0.06
306	Synchrony Financial	-	SYF US	纽约证券交易所	美国	799	180,956.94	0.06
307	Old Dominion Freight Line Inc	-	ODFL US	纳斯达克证券交易所	美国	142	180,841.26	0.06

308	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	210	180,582.48	0.06
309	Pioneer Natural Resources Co	-	PXD US	纽约证券交易所	美国	242	179,835.25	0.06
310	WW Grainger Inc	-	GWV US	纽约证券交易所	美国	67	178,513.30	0.06
311	Amcor PLC	-	AMCR US	纽约证券交易所	美国	2,308	177,249.95	0.05
312	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证券交易所	美国	549	175,669.62	0.05
313	Dover Corp	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	212	174,638.95	0.05
314	Xylem Inc/NY	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	262	174,012.43	0.05
315	Cooper Cos Inc/The	-	COO US	纽约证券交易所	美国	73	173,055.75	0.05
316	Expedia Group Inc	-	EXPE US	纳斯达克证券交易所	美国	200	172,779.35	0.05
317	Garmin Ltd	-	GRMN US	纳斯达克证券交易所	美国	220	171,769.30	0.05
318	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	60	170,894.96	0.05
319	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	92	170,464.58	0.05
320	Conagra Brands Inc	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	719	170,110.28	0.05
321	Broadridge Financial Solutions	-	BR US	纽约证券交易所	美国	170	169,934.50	0.05

	Inc							
322	Hartford Financial Services Group Inc	-	HIG US	纽约证券交易所	美国	527	168,423.72	0.05
323	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	422	167,991.51	0.05
324	Catalent Inc	-	CTLT US	纽约证券交易所	美国	242	164,329.22	0.05
325	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	654	163,778.38	0.05
326	Ingersoll-Rand Inc.	-	IR US	纽约证券交易所	美国	547	162,609.12	0.05
327	Akamai Technologies Inc	-	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	237	162,356.67	0.05
328	United Rentals Inc	-	URI US	纽约证券交易所	美国	107	161,911.28	0.05
329	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	446	161,190.74	0.05
330	Halliburton Co	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	1,293	159,453.55	0.05
331	FirstEnergy Corp	-	FE US	纽约证券交易所	美国	798	159,382.30	0.05
332	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	189	156,987.14	0.05
333	Tractor Supply Co	-	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	171	156,853.25	0.05
334	STERIS PLC	-	STE US	纽约证券交易所	美国	126	155,827.92	0.05
335	Ulta Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯达克证券交易所	美国	83	155,516.29	0.05

336	Citrix Systems Inc	-	CTXS US	纳斯达克证券交易所	美国	182	154,497.89	0.05
337	PerkinElmer Inc	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	165	154,493.32	0.05
338	Nucor Corp	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	445	154,441.45	0.05
339	Varian Medical Systems Inc	-	VAR US	纽约证券交易所	美国	135	154,159.57	0.05
340	Healthpeak Properties Inc	-	PEAK US	纽约证券交易所	美国	781	154,050.47	0.05
341	Quest Diagnostics Inc	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	198	153,959.32	0.05
342	KeyCorp	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	1,436	153,757.70	0.05
343	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	81	153,571.16	0.05
344	Expeditors International of Washington Inc	-	EXPD US	纳斯达克证券交易所	美国	247	153,284.06	0.05
345	Incyte Corp	-	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	270	153,234.67	0.05
346	Carnival Corp	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	1,078	152,353.02	0.05
347	Kellogg Co	-	K US	纽约证券交易所	美国	374	151,860.65	0.05
348	Cardinal Health Inc	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	431	150,623.14	0.05
349	Domino's	-	DPZ US	纽约证	美国	60	150,122.29	0.05

	Pizza Inc			券交易 所				
350	AES Corp/VA	-	AES US	纽约证 券交易 所	美国	979	150,115.11	0.05
351	Darden Restauran ts Inc	-	DRI US	纽约证 券交易 所	美国	192	149,231.25	0.05
352	Albemarle Corp	-	ALB US	纽约证 券交易 所	美国	155	149,195.75	0.05
353	Essex Property Trust Inc	-	ESS US	纽约证 券交易 所	美国	96	148,717.61	0.05
354	Celanese Corp	-	CE US	纽约证 券交易 所	美国	175	148,372.96	0.05
355	CarMax Inc	-	KMX US	纽约证 券交易 所	美国	238	146,689.41	0.05
356	Citizens Financial Group Inc	-	CFG US	纽约证 券交易 所	美国	628	146,531.51	0.05
357	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证 券交易 所	美国	1,393	146,517.67	0.05
358	Hewlett Packard Enterprise Co	-	HPE US	纽约证 券交易 所	美国	1,893	146,366.88	0.05
359	ABIOME D Inc	-	ABMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	69	145,960.71	0.05
360	IDEX Corp	-	IEX US	纽约证 券交易 所	美国	112	145,573.13	0.04
361	Waters Corp	-	WAT US	纽约证 券交易 所	美国	90	145,295.17	0.04
362	Nasdaq Inc	-	NDAQ US	纳斯达 克证券 交易所	美国	167	144,641.24	0.04
363	Extra Space	-	EXR US	纽约证 券交易	美国	190	143,635.23	0.04

	Storage Inc			所				
364	Pool Corp	-	POOL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	59	143,400.99	0.04
365	FMC Corp	-	FMC US	纽约证 券交易 所	美国	191	143,232.19	0.04
366	Amerisou rceBergen Corp	-	ABC US	纽约证 券交易 所	美国	224	142,883.83	0.04
367	Duke Realty Corp	-	DRE US	纽约证 券交易 所	美国	546	142,396.94	0.04
368	NetApp Inc	-	NTAP US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	327	141,332.47	0.04
369	Mid-Ame rica Apartmen t Communi ties Inc	-	MAA US	纽约证 券交易 所	美国	169	139,702.09	0.04
370	Genuine Parts Co	-	GPC US	纽约证 券交易 所	美国	213	139,577.99	0.04
371	Brown-Fo rman Corp	-	BF/B US	纽约证 券交易 所	美国	269	139,415.39	0.04
372	Hess Corp	-	HES US	纽约证 券交易 所	美国	403	138,813.14	0.04
373	Teledyne Technolog ies Inc	-	TDY US	纽约证 券交易 所	美国	54	138,112.04	0.04
374	Baker Hughes Company	-	BKR US	纽约证 券交易 所	美国	1,011	137,540.65	0.04
375	Occidenta l Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证 券交易 所	美国	1,216	137,342.36	0.04
376	Fox Corp	-	FOXA US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	490	93,102.49	0.03

			FOX US	纳斯达克 证券交易 所	美国	231	43,529.43	0.01
377	Jacobs Engineeri ng Group Inc	-	J US	纽约证 券交易 所	美国	192	136,503.00	0.04
378	Tiffany & Co	-	TIF US	纽约证 券交易 所	美国	159	136,374.00	0.04
379	Masco Corp	-	MAS US	纽约证 券交易 所	美国	380	136,196.85	0.04
380	Gartner Inc	-	IT US	纽约证 券交易 所	美国	130	135,879.09	0.04
381	Royal Caribbean Cruises Ltd	-	RCL US	纽约证 券交易 所	美国	275	134,019.81	0.04
382	Seagate Technolog y PLC	-	STX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	329	133,438.38	0.04
383	Leidos Holdings Inc	-	LDOS US	纽约证 券交易 所	美国	194	133,064.11	0.04
384	Boston Properties Inc	-	BXP US	纽约证 券交易 所	美国	209	128,910.95	0.04
385	Eastman Chemical Co	-	EMN US	纽约证 券交易 所	美国	197	128,900.44	0.04
386	Huntingto n Bancshare s Inc/OH	-	HBAN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,549	127,652.30	0.04
387	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证 券交易 所	美国	312	126,970.90	0.04
388	JM Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证 券交易 所	美国	168	126,718.78	0.04
389	Westingho use Air Brake	-	WAB US	纽约证 券交易 所	美国	264	126,092.39	0.04

	Technologies Corp							
390	Cincinnati Financial Corp	-	CINF US	纳斯达克证券交易所	美国	221	125,987.79	0.04
391	Principal Financial Group Inc	-	PFGB US	纳斯达克证券交易所	美国	389	125,919.41	0.04
392	Hormel Foods Corp	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	413	125,603.87	0.04
393	Bio-Rad Laboratories Inc	-	BIO US	纽约证券交易所	美国	33	125,519.63	0.04
394	United Airlines Holdings Inc	-	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	443	125,015.45	0.04
395	Packaging Corp of America	-	PKG US	纽约证券交易所	美国	138	124,179.16	0.04
396	Discovery Inc	-	DISCK US	纳斯达克证券交易所	美国	428	73,139.69	0.02
			DISCA US	纳斯达克证券交易所	美国	259	50,850.57	0.02
397	MGM Resorts International	-	MGM US	纽约证券交易所	美国	603	123,976.56	0.04
398	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纳斯达克证券交易所	美国	368	123,731.94	0.04
399	Avery Dennison Corp	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	121	122,461.35	0.04
400	CH Robinson Worldwide Inc	-	CHRW US	纳斯达克证券交易所	美国	199	121,885.98	0.04
401	Evergy Inc	-	EVRG US	纽约证券交易所	美国	329	119,162.88	0.04

402	Hasbro Inc	-	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	194	118,405.79	0.04
403	NortonLifeLock Inc	-	NLOK US	纳斯达克证券交易所	美国	870	117,961.06	0.04
404	Jack Henry & Associates Inc	-	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	111	117,323.51	0.04
405	CenterPoint Energy Inc	-	CNP US	纽约证券交易所	美国	830	117,195.03	0.04
406	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证券交易所	美国	188	117,062.19	0.04
407	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	186	116,108.12	0.04
408	International Flavors & Fragrances Inc	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	163	115,757.73	0.04
409	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	129	115,019.96	0.04
410	Concho Resources Inc	-	CXO US	纽约证券交易所	美国	300	114,218.37	0.04
411	Fortune Brands Home & Security Inc	-	FBHS US	纽约证券交易所	美国	204	114,100.14	0.04
412	Lamb Weston Holdings Inc	-	LW US	纽约证券交易所	美国	222	114,057.08	0.04
413	Whirlpool Corp	-	WHR US	纽约证券交易所	美国	96	113,057.20	0.03
414	UDR Inc	-	UDR US	纽约证	美国	450	112,838.36	0.03

				券交易所				
415	WestRock Co	-	WRK US	纽约证券交易所	美国	396	112,475.44	0.03
416	Textron Inc	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	348	109,741.25	0.03
417	PulteGroup Inc	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	389	109,446.58	0.03
418	Wynn Resorts Ltd	-	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	148	108,958.26	0.03
419	DENTSPLY SIRONA Inc	-	XRAY US	纳斯达克证券交易所	美国	317	108,301.07	0.03
420	Howmet Aerospace Inc	-	HWM US	纽约证券交易所	美国	578	107,635.53	0.03
421	F5 Networks Inc	-	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	90	103,319.18	0.03
422	Allegion PLC	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	136	103,274.03	0.03
423	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	115	103,174.98	0.03
424	Loews Corp	-	L US	纽约证券交易所	美国	351	103,106.60	0.03
425	Advance Auto Parts Inc	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	99	101,745.96	0.03
426	Live Nation Entertainment Inc	-	LYV US	纽约证券交易所	美国	210	100,684.43	0.03
427	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,038	99,086.74	0.03

428	Cboe Global Markets Inc	-	CBOE US	巴兹全球市场	美国	161	97,823.39	0.03
429	News Corp	-	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	610	71,524.00	0.02
			NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	211	24,464.92	0.01
430	BorgWarner Inc	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	377	95,050.05	0.03
431	Quanta Services Inc	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	202	94,924.51	0.03
432	LKQ Corp	-	LKQ US	纳斯达克证券交易所	美国	407	93,584.55	0.03
433	Campbell Soup Co	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	294	92,750.80	0.03
434	CenturyLink Inc	-	LUMN US	纽约证券交易所	美国	1,454	92,500.24	0.03
435	Henry Schein Inc	-	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	211	92,049.77	0.03
436	Lincoln National Corp	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	280	91,914.96	0.03
437	Snap-on Inc	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	81	90,450.38	0.03
438	Everest Re Group Ltd	-	RE US	纽约证券交易所	美国	59	90,117.42	0.03
439	Globe Life Inc	-	GL US	纽约证券交易所	美国	145	89,842.65	0.03
440	WR Berkley Corp	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	207	89,710.46	0.03
441	DaVita	-	DVA US	纽约证	美国	116	88,858.70	0.03

	Inc			券交易 所				
442	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证 券交易 所	美国	360	88,203.60	0.03
443	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证 券交易 所	美国	433	87,809.76	0.03
444	American Airlines Group Inc	-	AAL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	850	87,463.02	0.03
445	Interpubli c Group of Cos Inc	-	IPG US	纽约证 券交易 所	美国	566	86,861.56	0.03
446	Western Union Co/The	-	WU US	纽约证 券交易 所	美国	605	86,609.57	0.03
447	Pinnacle West Capital Corp	-	PNW US	纽约证 券交易 所	美国	166	86,596.52	0.03
448	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证 券交易 所	美国	245	84,869.70	0.03
449	NiSource Inc	-	NI US	纽约证 券交易 所	美国	564	84,420.20	0.03
450	L Brands Inc	-	LB US	纽约证 券交易 所	美国	344	83,475.39	0.03
451	CF Industries Holdings Inc	-	CF US	纽约证 券交易 所	美国	330	83,351.03	0.03
452	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证 券交易 所	美国	326	83,106.48	0.03
453	Newell Brands Inc	-	NWL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	592	82,005.99	0.03
454	Assurant Inc	-	AIZ US	纽约证 券交易 所	美国	92	81,771.61	0.03
455	Mohawk	-	MHK US	纽约证	美国	88	80,932.25	0.02

	Industries Inc			券交易所				
456	Molson Coors Beverage Co	-	TAP US	纽约证券交易所	美国	273	80,496.84	0.02
457	Iron Mountain Inc	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	418	80,403.99	0.02
458	IPG Photonics Corp	-	IPGP US	纳斯达克证券交易所	美国	55	80,311.41	0.02
459	DISH Network Corp	-	DISH US	纳斯达克证券交易所	美国	380	80,185.80	0.02
460	NVR Inc	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	3	79,862.04	0.02
461	Comerica Inc	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	218	79,456.84	0.02
462	Juniper Networks Inc	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	520	76,375.26	0.02
463	Norwegian Cruise Line Holdings	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	460	76,326.98	0.02
464	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	501	75,219.11	0.02
465	Nielsen Holdings PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	550	74,896.06	0.02
466	AO Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	209	74,758.26	0.02
467	Diamondback Energy Inc	-	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	233	73,582.60	0.02
468	Sealed Air Corp	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	244	72,901.14	0.02

469	Regency Centers Corp	-	REG US	纳斯达克证券交易所	美国	241	71,690.32	0.02
470	Robert Half International Inc	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	175	71,343.26	0.02
471	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	63	70,078.99	0.02
472	Zions Bancorp NA	-	ZION US	纳斯达克证券交易所	美国	238	67,459.11	0.02
473	Franklin Resources Inc	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	408	66,527.36	0.02
474	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	678	66,402.47	0.02
475	Cabot Oil & Gas Corp	-	COG US	纽约证券交易所	美国	625	66,390.86	0.02
476	Under Armour Inc	-	UAA US	纽约证券交易所	美国	313	35,066.18	0.01
			UA US	纽约证券交易所	美国	321	31,166.05	0.01
477	PVH Corp	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	108	66,163.27	0.02
478	DXC Technology Co	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	392	65,862.34	0.02
479	Invesco Ltd	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	574	65,280.45	0.02
480	Alaska Air Group Inc	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	189	64,126.72	0.02
481	Vornado Realty Trust	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	254	61,884.50	0.02

482	Perrigo Co PLC	-	PRGO US	纽约证券交易所	美国	211	61,568.43	0.02
483	FLIR Systems Inc	-	FLIR US	纳斯达克证券交易所	美国	210	60,057.14	0.02
484	Leggett & Platt Inc	-	LEG US	纽约证券交易所	美国	204	58,966.83	0.02
485	People's United Financial Inc	-	PBCT US	纳斯达克证券交易所	美国	686	57,875.73	0.02
486	Devon Energy Corp	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	555	57,253.06	0.02
487	Federal Realty Investment Trust	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	102	56,650.75	0.02
488	Apache Corp	-	APA US	纳斯达克证券交易所	美国	582	53,886.41	0.02
489	Marathon Oil Corp	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	1,216	52,921.64	0.02
490	Ralph Lauren Corp	-	RL US	纽约证券交易所	美国	78	52,797.66	0.02
491	Flowserve Corp	-	FLS US	纽约证券交易所	美国	215	51,695.15	0.02
492	National Oilwell Varco Inc	-	NOV US	纽约证券交易所	美国	572	51,243.69	0.02
493	Hanesbrands Inc	-	HBI US	纽约证券交易所	美国	530	50,420.51	0.02
494	Unum Group	-	UNM US	纽约证券交易所	美国	336	50,292.89	0.02
495	SL Green Realty Corp	-	SLG US	纽约证券交易所	美国	115	44,706.66	0.01

496	Vontier Corp	-	VNT US	纽约证券交易所	美国	196	42,714.61	0.01
497	TechnipFMC PLC	-	FTI US	纽约证券交易所	美国	682	41,829.83	0.01
498	Gap Inc/The	-	GPS US	纽约证券交易所	美国	317	41,760.86	0.01
499	HollyFrontier Corp	-	HFC US	纽约证券交易所	美国	241	40,649.15	0.01
500	Xerox Holdings Corp	-	XRX US	纽约证券交易所	美国	242	36,617.61	0.01

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	Microsoft Corp	MSFT US	15,049,308.11	6.51
2	Apple Inc	AAPL US	14,626,342.50	6.33
3	Amazon.com Inc	AMZN US	11,112,413.50	4.81
4	Alphabet Inc	GOOG US	5,007,929.45	2.17
		GOOGL US	4,988,113.74	2.16
5	Facebook Inc	FB US	5,936,296.97	2.57
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	5,253,305.32	2.27
7	Tesla Inc	TSLA US	4,988,792.36	2.16
8	JPMorgan Chase & Co	JPM US	4,780,012.90	2.07
9	Johnson & Johnson	JNJ US	4,500,261.92	1.95
10	Visa Inc	V US	3,726,666.72	1.61
11	Procter & Gamble Co/The	PG US	3,529,503.27	1.53
12	Mastercard Inc	MA US	3,313,602.16	1.43
13	Bank of America Corp	BAC US	3,141,426.99	1.36
14	UnitedHealth Group Inc	UNH US	3,099,151.00	1.34
15	AT&T Inc	T US	3,043,552.25	1.32
16	Exxon Mobil Corp	XOM US	2,967,065.42	1.28
17	Intel Corp	INTC US	2,961,370.95	1.28
18	Walt Disney Co/The	DIS US	2,917,193.60	1.26

19	Verizon Communications Inc	VZ US	2,871,886.78	1.24
20	Home Depot Inc/The	HD US	2,867,690.85	1.24

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。

8.5.2 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	Apple Inc	AAPL US	14,960,416.83	6.47
2	Microsoft Corp	MSFT US	13,594,162.12	5.88
3	Amazon.com Inc	AMZN US	11,346,094.15	4.91
4	Alphabet Inc	GOOG US	4,378,641.76	1.89
		GOOGL US	4,213,441.75	1.82
5	Facebook Inc	FB US	5,557,069.47	2.40
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	4,000,320.78	1.73
7	Johnson & Johnson	JNJ US	3,820,821.87	1.65
8	JPMorgan Chase & Co	JPM US	3,250,563.07	1.41
9	Procter & Gamble Co/The	PG US	3,035,950.23	1.31
10	Visa Inc	V US	2,997,074.09	1.30
11	UnitedHealth Group Inc	UNH US	2,692,475.74	1.16
12	Mastercard Inc	MA US	2,658,555.31	1.15
13	Home Depot Inc/The	HD US	2,529,846.02	1.09
14	NVIDIA Corp	NVDA US	2,410,613.25	1.04
15	Verizon Communications Inc	VZ US	2,403,294.55	1.04
16	Intel Corp	INTC US	2,283,736.97	0.99
17	Walt Disney Co/The	DIS US	2,267,660.29	0.98
18	AT&T Inc	T US	2,227,008.81	0.96
19	Bank of America Corp	BAC US	2,165,164.12	0.94
20	Netflix Inc	NFLX US	2,079,538.52	0.90

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。

8.5.3 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	310,793,540.67
卖出收入（成交）总额	244,296,681.16

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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Mar21	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为 121,970.42 元，已包含在结算备付金中。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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 iPhone6、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处以创纪录的 11 亿欧元罚款，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 9 月 7 日，意大利竞争管理局向苹果公司发起反垄断调查。

2020 年 6 月 19 日，法国最高行政法院裁定，维持对谷歌 5000 万欧元的罚款，原因是谷歌对安卓用户的数据保护选项的提供“不够清晰和透明”。

2020 年 9 月 7 日，意大利竞争管理局向谷歌公司发起反垄断调查。

2020 年 10 月 28 日，谷歌因在意大利在线广告市场中的垄断行为被意大利反托拉斯机构 AGCM 发起

调查。

2020 年 12 月 10 日，谷歌因违反隐私保护规定被法国国家信息与自由委员会处以 1 亿欧元的罚款。2020 年 5 月 19 日，Facebook 公司同意支付 900 万美元的罚款，以解决加拿大竞争局对其在 Facebook 和 Messenger 上做出虚假或误导性隐私声明的调查。Facebook 还将额外支付 50 万美元作为联邦调查局的调查费用。

2020 年 6 月 12 日，英国公平竞争及市场管理局表示已经开始调查 Facebook 以 4 亿美元收购动态图片公司 Giphy 的交易，因该交易可能减少英国国内的竞争。

2020 年 1 月 31 日，美国加州圣迭戈高等法院裁决对强生罚款 3.44 亿美元，理由是其相关产品在安全性上误导消费者。

2020 年 3 月 25 日，欧盟委员会表示，已对强生公司收购武田药品工业旗下相关产品的计划展开调查，因该笔交易可能会阻碍竞争。

2020 年 7 月 8 日，亚马逊涉嫌违反多项制裁令的要求，向美制裁地区及个人售卖商品和服务，将支付罚款 134,523 美元。

2020 年 12 月 10 日，亚马逊因违反隐私保护规定被法国国家信息与自由委员会处以 3500 万欧元的罚款。

2020 年 11 月 24 日，摩根大通因未能对其信托业务维持足够的内部控制和内部审计被美国货币监理署罚款 2.5 亿美元。

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。除谷歌、FACEBOOK、摩根大通、苹果、强生、亚马逊外，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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	378,966.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	203,080.73
4	应收利息	1,147.72
5	应收申购款	2,128,615.08
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,711,809.72

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
70,892	2,988.55	29,953,414.23	14.14%	181,910,665.00	85.86%

注：持有人户数及结构包含人民币份额及美元现汇份额。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	马国芳	2,356,520.00	7.23%
2	任钢	1,706,415.00	5.24%
3	梅阳	1,666,700.00	5.12%
4	彭建军	1,376,600.00	4.23%
5	杨巧伟	1,103,683.00	3.39%
6	许可	1,000,000.00	3.07%
7	安洁	986,555.00	3.03%
8	李丽	750,012.00	2.30%

9	袁达能	676,400.00	2.08%
10	周向东	556,013.00	1.71%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	140,052.84	0.0661%

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 500 指数 (QDII-LOF) 人民币份额及美元现汇份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月2日)基金份额总额	693,199,312.42
本报告期期初基金份额总额	161,736,153.89
本报告期基金总申购份额	481,059,011.08
减：本报告期基金总赎回份额	430,931,085.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	211,864,079.23

注：本基金份额变动含易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) 人民币份额及美元现汇份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。

本基金管理人于 2020 年 7 月 24 日发布公告, 自 2020 年 7 月 24 日起聘任胡剑先生、张清华先生担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 9 月 19 日发布公告, 自 2020 年 9 月 19 日起聘任冯波先生、陈皓先生担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 9 月 30 日发布公告, 自 2020 年 9 月 28 日起张优造先生不再担任公司副总经理。

本基金管理人于 2020 年 12 月 12 日发布公告, 自 2020 年 12 月 10 日起汪兰英女士不再担任公司首席大类资产配置官 (副总经理级)。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务, 本报告年度的审计费用为 72,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	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	3,423,015.81	0.62%	2,739.19	4.63%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	548,880,854.40	99.38%	56,472.97	95.37%	-
State Street Securities Hong Kong	1	-	-	-	-	-

Limited						
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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		额的比例		交总额的 比例		额的比例		额的比例
Goldman Sachs	-	-	-	-	1,124. 22	12.41%	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	7,935. 73	87.59%	19,708, 441.47	100.00%
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Everbright Securities (International) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Futures (Hong Kong) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2020 年 1 月 20 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-15
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	证券时报	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	证券时报、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	证券时报、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	证券时报、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 500 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	证券时报、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	关于易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）场外人民币基金份额在直销中心开展赎回费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
8	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-05
9	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）暂	证券时报、基金管理人网	2020-03-10

	停大额申购业务的公告	站及中国证监会基金电 子披露网站	
10	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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-03-10
11	易方达标普 500 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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-03-11
12	易方达标普 500 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	证券时报、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部分开放式基金增加弘业期货为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-03-24
14	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	证券时报	2020-03-31
15	易方达标普 500 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	证券时报、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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-04-10
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	证券时报、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	证券时报	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	证券时报、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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-05-14
21	易方达标普 500 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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-05-20
22	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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-05-23
23	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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-06-03
24	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	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电	2020-06-04

	额限制的公告	子披露网站	
25	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-22
26	易方达标普 500 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30
27	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报	2020-07-21
28	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-24
29	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	证券时报	2020-08-28
30	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2020 年 9 月 7 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-02
31	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中金财富申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-08
32	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-19
33	易方达基金管理有限公司关于延长旗下部分开放式基金在直销中心开展赎回费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-25
34	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-30
35	易方达基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-28
36	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报	2020-10-28
37	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加江苏银行为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-18
38	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2020 年 11 月 26 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-23
39	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）调整大额申购业务金额限制的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
40	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基	证券时报、基金管理人网	2020-12-08

	金增加中国人寿为销售机构的公告	站及中国证监会基金电 子披露网站	
41	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-12-10
42	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-12-12
43	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2020 年 12 月 25 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2020-12-22

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
2. 《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《易方达标普 500 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。

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

二〇二一年三月三十日