

# 易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）

## 2021 年中期报告

### 2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48

§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	59
§11 备查文件目录.....	60
11.1 备查文件目录.....	60
11.2 存放地点.....	60
11.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	易方达中证银行指数（LOF）	
场内简称	银行 LOF 易方达	
基金主代码	161121	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 7 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	1,435,686,332.42 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	2020 年 8 月 18 日	
下属分级基金的基金简称	易方达中证银行指数 （LOF）A	易方达中证银行指数 （LOF）C
下属分级基金的交易代码	161121	009860
报告期末下属分级基金的份额总额	1,071,659,979.67 份	364,026,352.75 份

注：本基金 A 类份额由原易方达银行指数分级证券投资基金转型而来，并增设 C 类份额类别，基金合同于 2020 年 8 月 7 日起生效，C 类份额首次确认日为 2020 年 8 月 10 日。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、股票（含存托凭证）投资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。
业绩比较基准	中证银行指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期而言预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	易方达基金管理有限公司	中国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	020-38798812	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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

## 2.5 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
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：本基金 A 类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，C 类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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

	易方达中证银行指数 (LOF) A	易方达中证银行指数 (LOF) C
本期已实现收益	48,713,299.72	14,628,311.71
本期利润	54,810,457.29	21,317,584.51
加权平均基金份额本期利润	0.0626	0.0763
本期加权平均净值利润率	5.14%	6.28%
本期基金份额净值增长率	8.08%	7.93%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	易方达中证银行指数 (LOF) A	易方达中证银行指数 (LOF) C
期末可供分配利润	43,002,332.82	23,821,937.12
期末可供分配基金份额利润	0.0401	0.0654
期末基金资产净值	1,297,056,927.16	439,414,329.55
期末基金份额净值	1.2103	1.2071
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	易方达中证银行指数 (LOF) A	易方达中证银行指数 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	18.68%	19.31%

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

易方达中证银行指数（LOF）A

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	-3.90%	0.84%	-5.52%	0.84%	1.62%	0.00%
过去三个月	-1.91%	0.95%	-3.93%	0.96%	2.02%	-0.01%
过去六个月	8.08%	1.24%	5.90%	1.25%	2.18%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	18.68%	1.15%	13.41%	1.15%	5.27%	0.00%

易方达中证银行指数（LOF）C

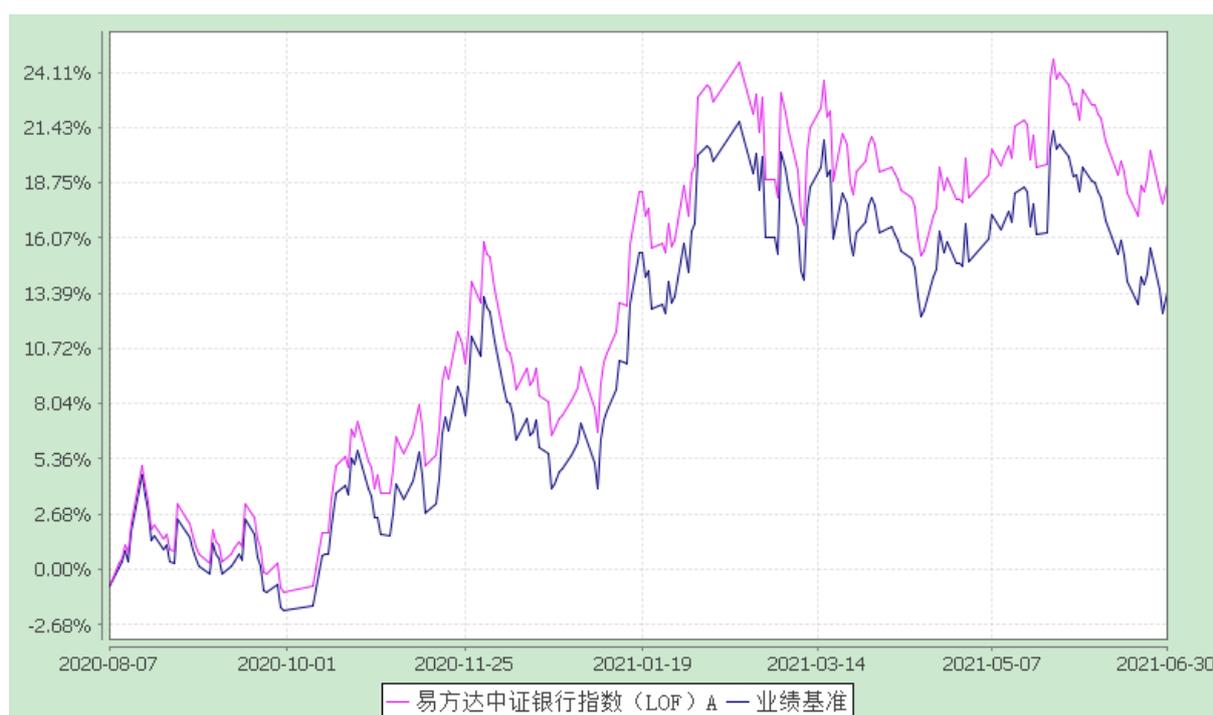
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.92%	0.84%	-5.52%	0.84%	1.60%	0.00%
过去三个月	-1.99%	0.95%	-3.93%	0.96%	1.94%	-0.01%
过去六个月	7.93%	1.24%	5.90%	1.25%	2.03%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.31%	1.15%	14.36%	1.15%	4.95%	0.00%

### 3.2.2 自基金转型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

易方达中证银行指数证券投资基金（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

易方达中证银行指数（LOF）A

（2020年8月7日至2021年6月30日）



易方达中证银行指数（LOF）C

（2020年8月10日至2021年6月30日）



注：1.本基金由原易方达银行指数分级证券投资基金于2020年8月7日转型而来，截至报告期末，本基金合同生效未满一年。

2.自2020年8月7日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2020年8月10日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十三部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

4.自基金转型至报告期末，A类基金份额净值增长率为18.68%，同期业绩比较基准收益率为13.41%。C类基金份额净值增长率为19.31%，同期业绩比较基准收益率为14.36%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
刘树荣	本基金的基金经理、易方达中证银行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 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 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、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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、易方达中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金（LOF）的基金经理	2020-08-07	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、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、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理。

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

2. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 15 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。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证银行指数，中证银行指数由沪深交易所上市交易的银行股组成，是衡量银行股整体走势最具代表性的指数。报告期内，本基金主要采取完全复制法的投资策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

回顾 2021 年上半年，银行板块行情主要由经济预期和经营业绩驱动。此外，市场风险偏好、流

动性环境对银行股走势也有较大影响。2021 年上半年，银行板块行情分为几个阶段：春节前，板块上涨幅度较大，主要是市场流动性较为平稳的情况下，经济向好、银行年报盈利增速回升驱动；春节后至 4 月中，银行板块跟随大盘回调，主要是经济高位回落预期升温，银行年报的带动作用弱化，叠加机构重仓板块大幅回调，市场风险偏好大幅降低；4 月中旬至 5 月底，银行板块逐渐回升至春节前高点附近，主要是一季度银行业绩较好，叠加大盘止跌回升带动；6 月份，板块持续下挫，主要是经济下行预期升温，5、6 月 PMI 连续走弱，市场对银行信用风险等不利因素担忧升温。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.2103 元，本报告期份额净值增长率为 8.08%，同期业绩比较基准收益率为 5.90%；C 类基金份额净值为 1.2071 元，本报告期份额净值增长率为 7.93%，同期业绩比较基准收益率为 5.90%，年化跟踪误差 1.00%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对国内经济高位回落的预期已有较长时间，但二季度 GDP 环比增速和复合增速均较一季度明显提升，6 月多数经济指标也偏强，指向当前经济总体仍偏强、总体不差。展望下半年经济增长虽然会放缓，但更多是回到疫情前正常的水平，实质性下行的迹象尚不明显，宏观经济仍将保持平稳运行。市场对宏观经济和银行信用风险担忧、息差难以提升等因素的影响下，银行板块估值仍将受到压制。但证券市场上没有不变的热点，不变的只有风格切换和行业轮动。短期内银行板块估值难以迅速提升，但总体而言银行板块业绩不差，7 月份国新办的新闻发布会上，发言人指出预计今年上半年银行业利润增速会有明显的回升，同时资产质量也在继续改善。当前银行板块估值处于历史底部，配置性价比较高。作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，致力于为投资者提供分享经济增长的优质指数产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证银行指数（LOF）A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证银行指数（LOF）C:本报告期内未实施利润分配。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	88,906,423.90	45,132,427.78
结算备付金		1,242,482.51	808,272.53
存出保证金		277,179.56	119,268.56
交易性金融资产	6.4.7.2	1,642,292,365.96	759,258,387.13
其中：股票投资		1,636,649,392.48	758,947,389.86
基金投资		-	-
债券投资		5,642,973.48	310,997.27
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	42,842.26	16,768.25
应收股利		1,021,799.30	-
应收申购款		29,496,335.33	14,827,298.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,763,279,428.82</b>	<b>820,162,422.88</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		9,244,260.41	6,087,958.39
应付赎回款		15,893,691.58	10,113,368.46
应付管理人报酬		659,880.34	279,947.81
应付托管费		131,976.08	55,989.57
应付销售服务费		92,352.31	43,321.81
应付交易费用	6.4.7.7	417,122.75	428,186.98

应交税费		7,335.83	386.94
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	361,552.81	246,583.80
负债合计		26,808,172.11	17,255,743.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,303,420,051.87	652,724,040.84
未分配利润	6.4.7.10	433,051,204.84	150,182,638.28
所有者权益合计		1,736,471,256.71	802,906,679.12
负债和所有者权益总计		1,763,279,428.82	820,162,422.88

注：1.本基金由原易方达银行指数分级证券投资基金于 2020 年 8 月 7 日转型而来，2020 年度实际报告期间为 2020 年 8 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2103 元，C 类基金份额净值 1.2071 元；基金份额总额 1,435,686,332.42 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,071,659,979.67 份，C 类基金份额总额 364,026,352.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>82,625,138.66</b>
1.利息收入		1,246,372.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	172,852.65
债券利息收入		2,299.79
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		1,071,220.05
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		67,357,022.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	42,664,774.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	775,948.50
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-

股利收益	6.4.7.15	23,916,299.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	12,786,430.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,235,313.01
<b>减：二、费用</b>		<b>6,497,096.86</b>
1. 管理人报酬		3,468,427.60
2. 托管费		693,685.52
3. 销售服务费		501,843.61
4. 交易费用	6.4.7.18	1,549,719.22
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,857.07
7. 其他费用	6.4.7.19	279,563.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>76,128,041.80</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>76,128,041.80</b>

注：本基金由原易方达银行指数分级证券投资基金于 2020 年 8 月 7 日转型而来，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	652,724,040.84	150,182,638.28	802,906,679.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,128,041.80	76,128,041.80
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）	650,696,011.03	206,740,524.76	857,436,535.79
其中：1.基金申购款	1,899,118,666.66	583,296,203.29	2,482,414,869.95
2.基金赎回款	-1,248,422,655.63	-376,555,678.53	-1,624,978,334.16
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）	1,303,420,051.87	433,051,204.84	1,736,471,256.71

注：本基金由原易方达银行指数分级证券投资基金于 2020 年 8 月 7 日转型而来，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由易方达银行指数分级证券投资基金转型而来。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[2020]853 号《关于准予易方达银行指数分级证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于 2020 年 7 月 8 日发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达银行指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，易方达银行指数分级证券投资基金转型为易方达中证银行指数证券投资基金（LOF），并相应调整基金合同中基金运作方式、折算机制、配对转换机制、份额分类方式、基金上市、申购赎回、投资范围、投资策略、风险收益特征、基金费率、基金资产估值、收益分配政策等条款，基金名称相应变更为“易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）”。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。依据基金份额持有人大会决议，2020 年 8 月 7 日起，原《易方达银行指数分级证券投资基金基金合同》失效，《易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效。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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自 2020 年 8 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2020 年 8 月 10 日。

### 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》、《易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行

业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	88,906,423.90
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	88,906,423.90

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,612,442,112.18	1,636,649,392.48	24,207,280.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,642,973.48	5,642,973.48
	银行间市场	-	-
	合计	5,642,973.48	5,642,973.48
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,618,085,085.66	1,642,292,365.96	24,207,280.30

**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 2021年6月30日
应收活期存款利息	8,017.00
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	503.28
应收债券利息	395.78
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	-
应收出借证券利息	33,813.97
其他	112.23
合计	42,842.26

**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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	417,122.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	417,122.75

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	45,789.91
应付证券出借违约金	-
预提费用	239,012.93
其他应付款	76,749.97
合计	361,552.81

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 易方达中证银行指数（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	522,926,526.01	458,383,904.30
本期申购	1,274,619,704.43	1,117,304,384.14
本期赎回（以“-”号填列）	-725,886,250.77	-636,294,589.32
本期末	1,071,659,979.67	939,393,699.12

##### 易方达中证银行指数（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,340,136.54	194,340,136.54
本期申购	781,814,282.52	781,814,282.52
本期赎回（以“-”号填列）	-612,128,066.31	-612,128,066.31
本期末	364,026,352.75	364,026,352.75

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

##### 易方达中证银行指数（LOF）A

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	-5,955,646.60	133,123,657.34	127,168,010.74
本期利润	48,713,299.72	6,097,157.57	54,810,457.29
本期基金份额交易产生的变动数	244,679.70	175,440,080.31	175,684,760.01
其中：基金申购款	626,287.02	421,432,723.82	422,059,010.84

基金赎回款	-381,607.32	-245,992,643.51	-246,374,250.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,002,332.82	314,660,895.22	357,663,228.04

## 易方达中证银行指数（LOF）C

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	3,076,201.35	19,938,426.19	23,014,627.54
本期利润	14,628,311.71	6,689,272.80	21,317,584.51
本期基金份额交易产生的变动数	6,117,424.06	24,938,340.69	31,055,764.75
其中：基金申购款	23,124,577.90	138,112,614.55	161,237,192.45
基金赎回款	-17,007,153.84	-113,174,273.86	-130,181,427.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,821,937.12	51,566,039.68	75,387,976.80

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	150,244.54
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	14,103.90
其他	8,504.21
合计	172,852.65

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	369,260,125.56
减：卖出股票成本总额	326,595,350.87
买卖股票差价收入	42,664,774.69

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,687,702.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,909,717.27
减：应收利息总额	2,036.33

买卖债券差价收入	775,948.50
----------	------------

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,916,299.60
其中：证券出借权益补偿收入	2,462,391.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,916,299.60

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	12,786,430.37
——股票投资	12,786,430.37
——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	-
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	12,786,430.37

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,235,313.01
其他	-
合计	1,235,313.01

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	1,549,719.22
银行间市场交易费用	-
合计	1,549,719.22

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	21,813.77
上市费	29,752.78
指数使用费	138,737.14
合计	279,563.84

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,468,427.60
其中：支付销售机构的客户维护费	993,939.53

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	693,685.52

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证银行指数（LOF）A	易方达中证银行指数（LOF）C	合计
易方达基金管理有限公司	-	52,213.86	52,213.86
合计	-	52,213.86	52,213.86

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

###### 易方达中证银行指数（LOF）A

无。

###### 易方达中证银行指数（LOF）C

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	88,906,423.90	150,244.54

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保管，按银行同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30

注：报告期内本基金参与了九丰能源首次公开发行的申购，此次发行的分销商广发证券股份有限公司为本基金管理人的关联方。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于托管行发行的股票建设银行。于2021年6月30日，本基金持有中国建设银行的A股的估值总额为人民币29,434,595.75元(2020年12月31日:13,928,757.40元)。

## 6.4.11 利润分配情况

## 易方达中证银行指数（LOF）A

本报告期内未发生利润分配。

## 易方达中证银行指数（LOF）C

本报告期内未发生利润分配。

## 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

				受限						
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
30100	可靠	2021-0	2021-1	新股	12.54	27.89	801	10,044	22,339	-

9	股份	6-08	2-17	流通受限				.54	.89	
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2022-01-10	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-

688538	和辉光电	2021-05-20	2021-11-29	新股流通受限	2.65	3.38	375,156	994,163.40	1,268,027.28	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新股流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	新股流通受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-
<b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	52,360	5,235,977.05	5,235,977.05	老股东配债
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	4,070	406,996.43	406,996.43	新债网下发行

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值总 额
1	000001	平安银行	2021年7月1日 -2021年7月6日	22.62	316,300.00	7,154,706.00
2	002142	宁波银行	2021年7月6日 -2021年7月6日	38.97	34,200.00	1,332,774.00
3	002839	张家港行	2021年7月1日 -2021年7月6日	5.44	124,400.00	676,736.00
4	002958	青农商行	2021年7月1日 -2021年7月6日	4.28	284,500.00	1,217,660.00
5	600000	浦发银行	2021年7月5日 -2021年7月5日	10.00	111,000.00	1,110,000.00
6	600015	华夏银行	2021年7月2日 -2021年7月6日	6.19	189,100.00	1,170,529.00
7	600016	民生银行	2021年7月1日 -2021年7月6日	4.41	849,300.00	3,745,413.00
8	600036	招商银行	2021年7月1日 -2021年7月2日	54.19	20,800.00	1,127,152.00
9	600919	江苏银行	2021年7月1日 -2021年7月5日	7.10	377,600.00	2,680,960.00
10	600926	杭州银行	2021年7月2日 -2021年7月2日	14.75	185,700.00	2,739,075.00
11	600928	西安银行	2021年7月1日 -2021年7月1日	4.66	107,700.00	501,882.00
12	601009	南京银行	2021年7月5日 -2021年7月5日	10.52	10,000.00	105,200.00
13	601128	常熟银行	2021年7月1日 -2021年7月6日	6.20	108,700.00	673,940.00
14	601166	兴业银行	2021年7月5日 -2021年7月5日	20.55	701,200.00	14,409,660.00
15	601169	北京银行	2021年7月2日 -2021年7月2日	4.87	94,500.00	460,215.00
16	601229	上海银行	2021年7月5日 -2021年7月5日	8.20	53,100.00	435,420.00
17	601328	交通银行	2021年7月2日 -2021年7月6日	4.90	2,067,400.00	10,130,260.00
18	601398	工商银行	2021年7月1日 -2021年7月5日	5.17	450,100.00	2,327,017.00
19	601577	长沙银行	2021年7月1日 -2021年7月6日	8.94	56,700.00	506,898.00
20	601658	邮储银行	2021年7月1日 -2021年7月6日	5.02	197,400.00	990,948.00
21	601818	光大银行	2021年7月2日	3.78	814,400.00	3,078,432.00

			-2021 年 7 月 2 日			0
22	601838	成都银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	12.64	237,600.00	3,003,264.0 0
23	601860	紫金银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	3.63	182,000.00	660,660.00
24	601939	建设银行	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	6.65	785,900.00	5,226,235.0 0
25	601988	中国银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	3.08	318,100.00	979,748.00
26	601997	贵阳银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	7.16	216,600.00	1,550,856.0 0
27	603323	苏农银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	4.38	53,000.00	232,140.00
合计	-	-	-	-	8,947,300.0 0	68,227,780. 00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、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，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，

因此,本基金违约风险可能性很小。于2021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0.32%(2020年12月31日:0.04%)。

#### 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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	5,643,369.26	311,021.81
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	5,643,369.26	311,021.81

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021 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

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	88,906,423.90	-	-	-	88,906,423.90
结算备付金	1,242,482.51	-	-	-	1,242,482.51
存出保证金	277,179.56	-	-	-	277,179.56
交易性金融资产	-	-	5,642,973.48	1,636,649,392.48	1,642,292,365.96
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	-	-	-	42,842.26	42,842.26
应收股利	-	-	-	1,021,799.30	1,021,799.30
应收申购款	870,123.33	-	-	28,626,212.00	29,496,335.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	91,296,209.30	-	5,642,973.48	1,666,340,246.04	1,763,279,428.82
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	-	-	-	9,244,260.41	9,244,260.41
应付赎回款	-	-	-	15,893,691.58	15,893,691.58
应付管理人报酬	-	-	-	659,880.34	659,880.34

应付托管费	-	-	-	131,976.08	131,976.08
应付销售服务费	-	-	-	92,352.31	92,352.31
应付交易费用	-	-	-	417,122.75	417,122.75
应交税费	-	-	-	7,335.83	7,335.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	361,552.81	361,552.81
负债总计	-	-	-	26,808,172.11	26,808,172.11
利率敏感度缺口	91,296,209.30	-	5,642,973.48	1,639,532,073.93	1,736,471,256.71
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	45,132,427.78	-	-	-	45,132,427.78
结算备付金	808,272.53	-	-	-	808,272.53
存出保证金	119,268.56	-	-	-	119,268.56
交易性金融资产	-	-	310,997.27	758,947,389.86	759,258,387.13
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	-	-	-	16,768.25	16,768.25
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,637,412.40	-	-	13,189,886.23	14,827,298.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	47,697,381.27	-	310,997.27	772,154,044.34	820,162,422.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	6,087,958.39	6,087,958.39
应付赎回款	-	-	-	10,113,368.46	10,113,368.46
应付管理人报酬	-	-	-	279,947.81	279,947.81
应付托管费	-	-	-	55,989.57	55,989.57
应付销售服务费	-	-	-	43,321.81	43,321.81
应付交易费用	-	-	-	428,186.98	428,186.98
应交税费	-	-	-	386.94	386.94
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	246,583.80	246,583.80
负债总计	-	-	-	17,255,743.76	17,255,743.76
利率敏感度缺口	47,697,381.27	-	310,997.27	754,898,300.58	802,906,679.12

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,636,649,392.48	94.25	758,947,389.86	94.52
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>1,636,649,392.48</b>	<b>94.25</b>	<b>758,947,389.86</b>	<b>94.52</b>

#### 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	86,002,539.34	39,773,683.66
	2.业绩比较基准下降 5%	-86,002,539.34	-39,773,683.66

#### 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 2021 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 1,634,035,325.77 元，属于第二层次的余额为 8,257,040.19 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 751,626,609.13 元，第二层次 7,631,778.00 元，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 2021 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(2020 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	1,636,649,392.48	92.82
	其中：股票	1,636,649,392.48	92.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,642,973.48	0.32
	其中：债券	5,642,973.48	0.32
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合	90,148,906.41	5.11

	计		
8	其他各项资产	30,838,156.45	1.75
9	合计	1,763,279,428.82	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 68,227,780.00 元，占净值比例 3.93%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,879,001.71	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,151,678.21	0.30
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	82,472.34	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.00
J	金融业	1,628,361,901.47	93.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,636,649,392.48	94.25

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	600036	招商银行	4,504,674	244,108,284.06	14.06
2	601166	兴业银行	9,599,177	197,263,087.35	11.36
3	000001	平安银行	6,404,994	144,880,964.28	8.34
4	601398	工商银行	23,136,191	119,614,107.47	6.89
5	002142	宁波银行	2,379,630	92,734,181.10	5.34
6	601328	交通银行	18,136,650	88,869,585.00	5.12
7	600000	浦发银行	7,750,154	77,501,540.00	4.46
8	600016	民生银行	14,045,108	61,938,926.28	3.57
9	601288	农业银行	18,966,024	57,467,052.72	3.31
10	600919	江苏银行	7,799,610	55,377,231.00	3.19
11	601229	上海银行	6,564,497	53,828,875.40	3.10
12	601169	北京银行	9,769,664	47,578,263.68	2.74
13	601988	中国银行	13,912,654	42,850,974.32	2.47
14	601818	光大银行	10,918,922	41,273,525.16	2.38
15	601658	邮储银行	7,170,500	35,995,910.00	2.07
16	601009	南京银行	3,297,894	34,693,844.88	2.00
17	601939	建设银行	4,426,255	29,434,595.75	1.70
18	600926	杭州银行	1,954,321	28,826,234.75	1.66
19	600015	华夏银行	4,056,799	25,111,585.81	1.45
20	601916	浙商银行	5,508,400	21,868,348.00	1.26
21	601838	成都银行	1,428,600	18,057,504.00	1.04
22	601077	渝农商行	4,080,300	16,280,397.00	0.94
23	601997	贵阳银行	1,686,920	12,078,347.20	0.70
24	601128	常熟银行	1,806,600	11,200,920.00	0.65
25	601998	中信银行	2,008,942	10,245,604.20	0.59
26	002966	苏州银行	1,092,500	8,029,875.00	0.46
27	002958	青农商行	1,820,900	7,793,452.00	0.45
28	601577	长沙银行	790,919	7,070,815.86	0.41
29	600908	无锡银行	971,200	5,632,960.00	0.32
30	002807	江阴银行	1,416,320	5,580,300.80	0.32
31	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.30
32	002839	张家港行	825,300	4,489,632.00	0.26
33	601860	紫金银行	1,193,600	4,332,768.00	0.25
34	002936	郑州银行	1,143,270	4,195,800.90	0.24
35	600928	西安银行	869,500	4,051,870.00	0.23
36	603323	苏农银行	823,030	3,604,871.40	0.21
37	002948	青岛银行	537,300	2,670,381.00	0.15
38	601187	厦门银行	189,300	1,794,564.00	0.10
39	688538	和辉光电	375,156	1,268,027.28	0.07
40	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.02
41	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01

42	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.01
43	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.01
44	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
45	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
46	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
47	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
48	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
49	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
50	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
51	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
52	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
53	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
54	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
55	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
56	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
57	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
58	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
59	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
60	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
61	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
62	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
63	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
64	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
65	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
66	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
67	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
68	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
69	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
70	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
71	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
72	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
73	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
74	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
75	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
76	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
77	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
78	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
79	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
80	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
81	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
82	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
83	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
84	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
85	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00

86	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
87	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
88	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
89	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
90	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
91	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
92	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
93	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
94	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
95	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
96	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
97	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
98	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
99	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
100	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
101	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	181,224,578.11	22.57
2	601166	兴业银行	150,678,837.00	18.77
3	000001	平安银行	98,435,065.61	12.26
4	601398	工商银行	82,666,766.50	10.30
5	002142	宁波银行	70,273,526.66	8.75
6	601328	交通银行	58,197,021.87	7.25
7	600000	浦发银行	54,408,035.62	6.78
8	600016	民生银行	48,194,040.30	6.00
9	601288	农业银行	41,695,896.25	5.19
10	601229	上海银行	37,170,991.18	4.63
11	601658	邮储银行	34,607,415.00	4.31
12	600919	江苏银行	33,617,245.05	4.19
13	601169	北京银行	32,214,894.04	4.01
14	601988	中国银行	30,381,164.00	3.78
15	601818	光大银行	30,252,080.00	3.77
16	601009	南京银行	23,615,128.35	2.94
17	600926	杭州银行	20,940,797.17	2.61
18	601939	建设银行	20,664,039.18	2.57
19	601916	浙商银行	19,105,768.00	2.38

20	600015	华夏银行	17,312,665.23	2.16
----	--------	------	---------------	------

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	82,916,160.71	10.33
2	601166	兴业银行	42,163,380.00	5.25
3	000001	平安银行	27,649,642.89	3.44
4	601398	工商银行	22,963,218.25	2.86
5	601328	交通银行	16,305,862.00	2.03
6	002142	宁波银行	15,416,052.44	1.92
7	600000	浦发银行	15,188,205.57	1.89
8	600016	民生银行	12,961,076.86	1.61
9	601009	南京银行	12,676,957.19	1.58
10	601288	农业银行	11,648,886.00	1.45
11	600919	江苏银行	10,544,044.63	1.31
12	601229	上海银行	10,176,240.54	1.27
13	601169	北京银行	8,634,693.00	1.08
14	601988	中国银行	8,239,162.00	1.03
15	601818	光大银行	7,630,040.00	0.95
16	600926	杭州银行	5,864,087.00	0.73
17	601939	建设银行	5,649,658.17	0.70
18	600015	华夏银行	4,690,219.85	0.58
19	601838	成都银行	3,106,305.91	0.39
20	601997	贵阳银行	2,370,943.00	0.30

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,191,510,923.12
卖出股票收入（成交）总额	369,260,125.56

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,642,973.48	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,642,973.48	0.32

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	56,430	5,642,973.48	0.32

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 7 月 28 日，上海银保监局对交通银行股份有限公司太平洋信用卡中心存在以下违法违规行为：1、2019 年 6 月该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2019 年 5 月和 7 月该中心对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，处以责令改正，并处罚款共计 100 万元。

2020 年 8 月 6 日，上海市黄浦区城市管理行政执法局对交通银行太平洋信用卡中心上海分中心占用城市道路的行为罚款 300 元。

2020 年 7 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元”的行政处罚决定：1、违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资；2、为“四证”不全的房地产项目提供融资；3、违规为土地储备中心提供融资；4、违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺；5、多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事；6、多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限；7、股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告；8、多名拟任高管人员及董事未经核准即履职；9、关联交易不合规；10、理财产品风险信息披露不合规；11、年报信息披露不真实；12、贷款资金被挪用，虚增贷款；13、以贷转存，虚增存款；14、贸易背景审查不尽职；15、向关系人发放信用贷款；16、违规转让正常类信贷资产；17、违规转让不良资产；18、同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产；19、同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产；20、同业存放业务期限超过一年；21、违规开展票据转贴现交易；22、个别理财产品管理费长期未入账；23、理财业务风险隔离不充分；24、违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品；25、非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求；26、违规出具补充协议及与事实不符的投资说明；27、以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险；28、向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务；29、代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范；30、迟报瞒报多起案件（风险）信息。

2020 年 12 月 11 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对民生银行违反办理售汇业务的行为，没收违法所得 1910822.20 元人民币，并处 80 万元人民币罚款。

2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。

2021 年 6 月 10 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款人民币 25 万元的行政处罚决定：代理销售保险不规范。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元的行政处罚决定：

（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财产品；（十五）信贷资金用于承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节收益；（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；（二十一）开立同业银行结算账户不合规；（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责；（二十三）对小微企业不当收费；（二十四）未按规定报送案件。

2020 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元的行政处罚决定：农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）。

2021 年 1 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 420 万元的行政处罚决定：1、发生重要信息系统突发事件未报告；2、制卡数据违规明文留存；3、生产网络、分行无线互联网络保护不当；4、数据安全较粗放，存在数据泄露风险；5、网络信息系统存在较多漏洞；6、互联网门户网站泄露敏感信息。

2020 年 11 月 6 日，中国人民银行衡水市中心支行对中国工商银行股份有限公司违反反洗钱法的行为，处以 21 万元罚款，对高管及直接责任人各处 1 万元罚款，共计 23 万元。

2020 年 11 月 10 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国工商银行股份有限公司违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务的违法事实，处以 100 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

2020 年 12 月 25 日中国银行保险监督管理委员会针对中国工商银行股份有限公司如下违法违规行为作出罚款 5470 万元的行政处罚决定：1、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；2、关键岗位未进行实质性轮岗；3、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；4、为同业投资业务提供隐性担保；5、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；6、非标准化债权资产限额测算不准确；7、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例；8、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；9、为违规的政府购买服务项目提供融资；10、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；11、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；12、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；13、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；14、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；15、全权委托业务不规范；16、用其他资金支付结构性存款收益；17、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；18、理财资金承接本行自营贷款；19、封闭式理财产品相互交易调节收益；20、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益；21、高净值客户认定不审慎；22、理财产品信息披露不到位；23、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记。

2020 年 10 月 16 日，中国银保监会宁波银保监局对平安银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 100 万元的行政处罚决定：贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等。

2021 年 5 月 10 日，中国银行保监会上海监督局对平安银行股份有限公司资金运营中心的如下违法违规行为作出责令整改，并处罚共计 300 万元的行政处罚决定：1、2016 年 5 月，该中心违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资。2、2017 年 3 月，该中心违规向土地储备项目提供融资。3、2017 年 3 月，该中心违规提供政府性融资。4、2016 年 5 月至 2018 年 5 月，该中心黄金份额租赁款违规用于证券交易所股票质押回购。5、2018 年 1 月，该中心虚增存款。6、2016 年 1 月至 2019 年 8 月，该中心向黄金产业链外企业提供实物黄金租赁。

2021 年 5 月 18 日，中国银保监会深圳监管局对平安银行信用卡中心的如下违法违规行为作出处罚 40 万元的行政处罚决定：未对申领首张信用卡的客户进行亲访亲签。

2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局对平安银行股份有限公司的如下违法违规行为做出罚款 210 万元的行政处罚决定：利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，

贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品。

2020 年 8 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司 2013 年至 2018 年如下违法违规行为作出罚款共计 2100 万元的行政处罚决定：1、未按专营部门制规定开展同业业务；2、同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3、延迟支付同业投资资金吸收存款；4、为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5、未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6、个人消费贷款贷后管理未尽职；7、通过票据转贴现业务调节信贷规模；8、银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9、办理无真实贸易背景的贴现业务；10、委托贷款资金来源审查未尽职；11、未按权限和程序办理委托贷款业务；12、未按权限和程序办理非融资性保函业务。

2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局上海市分局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为罚款 140 万元人民币：1、违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易。2、违反银行交易记录管理规定。

2021 年 4 月 23 日，上海银保监局对上海浦东发展银行股份有限公司的如下违法违规行为责令整改，并处罚款共计 760 万元的行政处罚决定：2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务。

2021 年 5 月 7 日，上海银保监局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为责令整改，并处罚款人民币 40 万元的行政处罚决定：信用卡资金流向管控严重违反审慎经营规则。

2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定：1、2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

2020 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司涉嫌违反法律法规的行为处以责令整改，并处以罚款人民币 120 万元。

2020 年 11 月 27 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司违反规定办理结汇、售汇的行为，作出“责令改正、罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 万元人民币”的行政处罚决定。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 7170 万元的行政处罚决定：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品

出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。

2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款”的行政处罚决定：1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务。

2020 年 10 月 22 日，上海银保监局对兴业银行股份有限公司信用卡中心信用卡授信审批严重违反审慎经营规则作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚。

2020 年 12 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会江苏银保监局对江苏银行股份有限公司如下违法违规行为作出责令改正、并处罚款 240 万元的行政处罚决定：1. 个人贷款资金用途管控不严；2. 发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款；3. 理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；4. 个人理财资金对接项目资本金；5. 理财业务未与自营业务相分离；6. 理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求。

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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	277,179.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,021,799.30
4	应收利息	42,842.26
5	应收申购款	29,496,335.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,838,156.45

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601166	兴业银行	14,409,660.00	0.83	转融通流通受限
2	601328	交通银行	10,130,260.00	0.58	转融通流通受限

3	000001	平安银行	7,154,706.00	0.41	转融通流通受限
4	600016	民生银行	3,745,413.00	0.22	转融通流通受限
5	600919	江苏银行	2,680,960.00	0.15	转融通流通受限
6	601398	工商银行	2,327,017.00	0.13	转融通流通受限
7	002142	宁波银行	1,332,774.00	0.08	转融通流通受限
8	600036	招商银行	1,127,152.00	0.06	转融通流通受限
9	600000	浦发银行	1,110,000.00	0.06	转融通流通受限

## §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

份额级别	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
易方达中证银行指数（LOF）A	169,878	6,308.41	270,436,858.05	25.24%	801,223,121.62	74.76%
易方达中证银行指数（LOF）C	75,903	4,795.94	31,135,669.33	8.55%	332,890,683.42	91.45%
合计	245,781	5,841.32	301,572,527.38	21.01%	1,134,113,805.04	78.99%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

易方达中证银行指数（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴美兰	3,422,726.00	14.44%
2	赵冬	2,939,574.00	12.40%
3	黄峻	389,067.00	1.64%
4	胥怀建	329,102.00	1.39%
5	太平洋资管—建设银行—太平洋卓越第三极稳定增值二号产品	313,431.00	1.32%
6	樊向军	307,600.00	1.30%
7	刘阳彬	300,000.00	1.27%

8	于扬	246,826.00	1.04%
9	黎宇明	231,764.00	0.98%
10	柴锐	213,378.00	0.90%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达中证银行指数（LOF）A	1,047,851.97	0.0978%
	易方达中证银行指数（LOF）C	1,874.87	0.0005%
	合计	1,049,726.84	0.0731%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	易方达中证银行指数（LOF）A	0
	易方达中证银行指数（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证银行指数（LOF）A	0
	易方达中证银行指数（LOF）C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证银行指数（LOF）A	易方达中证银行指数（LOF）C
基金合同生效日（2020年8月7日）基金份额总额	343,156,203.84	-
本报告期期初基金份额总额	522,926,526.01	194,340,136.54
本报告期基金总申购份额	1,274,619,704.43	781,814,282.52
减：本报告期基金总赎回份额	725,886,250.77	612,128,066.31
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,071,659,979.67	364,026,352.75

## §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 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟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，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。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	34,436,329.57	2.22%	27,549.29	2.71%	-
华西证券	2	22,461,917.70	1.45%	17,969.54	1.77%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	45,829,920.11	2.96%	36,663.96	3.60%	-
中信证券	3	37,677,658.07	2.43%	30,142.17	2.96%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	7,799,715.61	0.50%	6,239.77	0.61%	-
太平洋证券	1	1,301,630.11	0.08%	1,041.33	0.10%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	23,915,873.69	1.54%	19,132.71	1.88%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	737,475,529.72	47.62%	368,738.98	36.23%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	72,734,811.19	4.70%	58,187.69	5.72%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	255,530,127.35	16.50%	204,424.14	20.08%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	100,502,310.77	6.49%	80,401.82	7.90%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	35,870,893.20	2.32%	28,696.63	2.82%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	173,263,950.33	11.19%	138,611.19	13.62%	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司,无新增交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	313,799.00	2.14%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	7,462,114.21	50.81%	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	6,658,935.50	45.34%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	252,853.39	1.72%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-

### 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增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
2	易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）C类基金份额增加众禄基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-15
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
5	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加万得基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-01
6	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加腾安基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
7	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加腾安基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-04
8	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加诺亚正行为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-09
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30

	的公告		
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
11	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	上海证券报	2021-04-19

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达银行指数分级证券投资基金变更注册的文件；
- 2.《易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日