

易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
发起式联接基金
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末投资目标基金明细	40
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.9 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	42
7.10 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	42
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.13	投资组合报告附注	43
§8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	46
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	46
§9	开放式基金份额变动	47
§10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	50
§11	备查文件目录	51
11.1	备查文件目录	51
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	易方达上证 50ETF 联接发起式	
基金主代码	007379	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 9 月 9 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	166,317,218.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	易方达上证 50ETF 联接发起式 C
下属分级基金的交易代码	007379	007380
报告期末下属分级基金的份额总额	97,466,352.47 份	68,850,865.96 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 9 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

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	本基金为易方达上证 50ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达上证 50ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、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、融资及转融通证券出借等。

业绩比较基准	上证 50 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 ETF 联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于易方达上证 50ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证 50 指数的表现密切相关。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	上证 50 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	张燕
	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-38798812	0755-83195201
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）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	510620	518040
法定代表人	刘晓艳	缪建民

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	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 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

§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）	
	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	易方达上证 50ETF 联接发起式 C
本期已实现收益	2,859,160.94	1,342,182.84
本期利润	-2,439,516.31	204,338.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0273	0.0046
本期加权平均净值利润率	-1.98%	0.34%
本期基金份额净值增长率	-0.71%	-0.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	易方达上证 50ETF 联接发起式 C
期末可供分配利润	22,722,822.48	15,871,976.09
期末可供分配基金份额利润	0.2331	0.2305
期末基金资产净值	133,618,435.16	94,199,802.28
期末基金份额净值	1.3709	1.3682
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	

	易方达上证 50ETF 联接 发起式 A	易方达上证 50ETF 联接发 起式 C
基金份额累计净值增长率	37.09%	36.82%

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

易方达上证 50ETF 联接发起式 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	-2.10%	0.71%	-3.94%	0.72%	1.84%	-0.01%
过去三个月	1.56%	0.98%	-1.07%	0.99%	2.63%	-0.01%
过去六个月	-0.71%	1.21%	-3.66%	1.23%	2.95%	-0.02%
过去一年	26.47%	1.24%	18.03%	1.26%	8.44%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	37.09%	1.18%	16.66%	1.21%	20.43%	-0.03%

易方达上证 50ETF 联接发起式 C

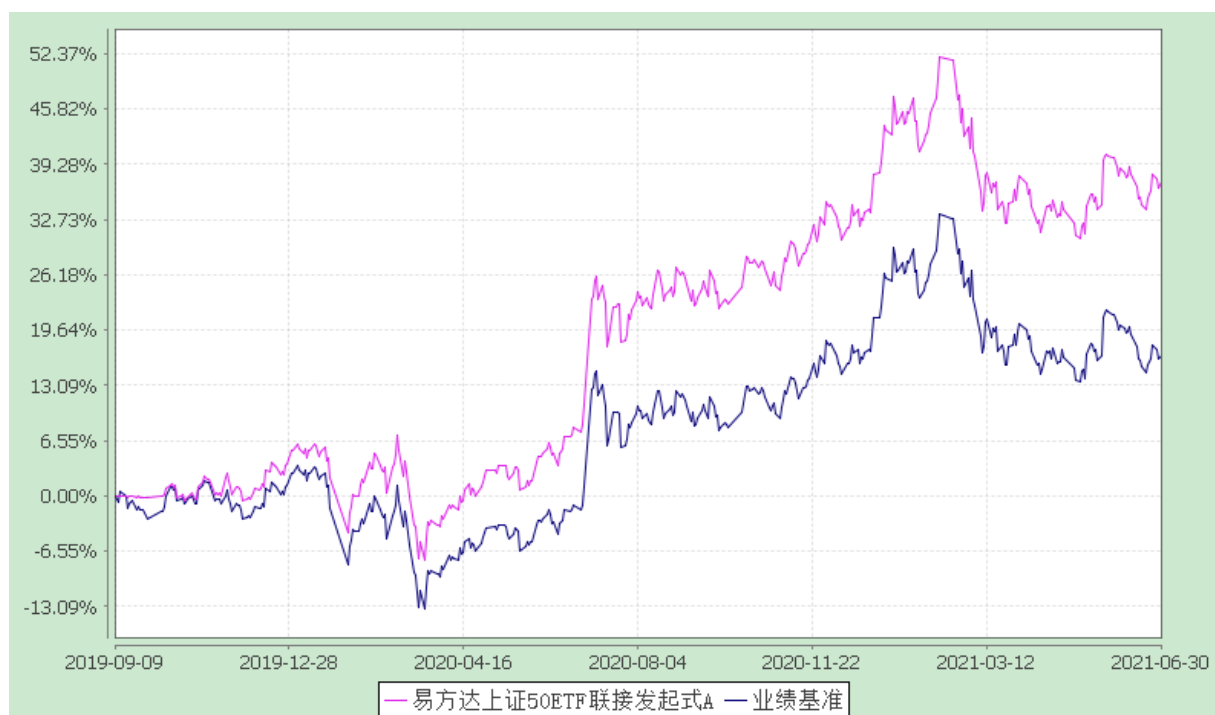
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.11%	0.71%	-3.94%	0.72%	1.83%	-0.01%
过去三个月	1.54%	0.98%	-1.07%	0.99%	2.61%	-0.01%
过去六个月	-0.76%	1.21%	-3.66%	1.23%	2.90%	-0.02%
过去一年	26.35%	1.25%	18.03%	1.26%	8.32%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	36.82%	1.18%	16.66%	1.21%	20.16%	-0.03%

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

易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 9 月 9 日至 2021 年 6 月 30 日)

易方达上证 50ETF 联接发起式 A



易方达上证 50ETF 联接发起式 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 37.09%，C 类基金份额净值增长率为 36.82%，同期业绩比较基准收益率为 16.66%。

§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		
余海燕	本基金的基金经理、易方达上证 50 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、易方达中证 500 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、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2017 年 07 月 27 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达中证军工交易	2019-09-09	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理。

型开放式指数证券投资基金的基金经理(自 2017 年 07 月 14 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自 2015 年 07 月 08 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达中证全指证券公司指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自 2015 年 07 月 08 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达中证国有企业改革指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自 2015 年 06 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达上证 50 指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自 2015 年 04 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招

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

4.3 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

2021 年上半年中国经济稳健复苏，GDP 保持了较高的增长，增长质量也在不断上行。从趋势上看，经济已经形成稳中加固的恢复态势；从结构上看，比较能代表经济内生动能的制造业投资明显向好，即便受到了广深局部疫情的扰动，消费也维持了逐渐改善态势，这对经济后续的稳步恢复也起到了较强的支撑作用。根据国家统计局公布的数据，二季度 GDP 增长 7.9%，两年平均增长 5.5%，相比一季度加快 0.5 个百分点。工业生产运行平稳，6 月份规模以上工业增加值同比实际增长 8.3%，两年复合增速来看，则连续 4 个月保持在 6.5% 左右的区间范围，反映出工业生产仍然在较高景气区间延续平稳增长。制造业投资继续向好，上半年固定资产投资增速累计同比增长 12.6%，其中两年平均增速 4.4%。消费的修复节奏也好于市场预期，6 月份社会消费品零售总额同比增长 12.1%，两年复合增速 4.9%，较上月的复合增速抬升 0.4 个百分点。宏观政策方面，货币政策延续“温和正常化”态势，市场流动性依然保持在合理充裕的水平。资本市场方面，A 股市场在春节前延续了去年四季

度以来的普涨行情，春节后经济复苏预期继续强化带动了部分价值板块反弹，A 股市场出现了较大的风格转换；后续随着美债收益率加速反弹引发了市场的担忧，投资者风险偏好明显回落，市场主要指数均出现了不同幅度的调整；二季度以来 A 股市场整体震荡上涨，市场再次出现风格切换，以创业板指为代表的成长板块大幅反弹，不同指数间表现差异明显，最终上半年上证综指以上涨 3.40% 收官。在风格方面，创业板、科创板等成长板块经过 2、3 月份的调整后大幅反弹再次显著跑赢价值板块，报告期间创业板指、科创 50 指数、上证 50 指数、沪深 300 指数收益率分别为 17.22%、14.01%、-3.90%、0.24%；行业方面，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色金属、电子等板块涨幅居前，保险、家用电器、国防军工、证券公司、房地产等板块表现相对落后。

本基金是易方达上证 50ETF 的联接基金，主要投资于易方达上证 50ETF。报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，依据基金申购赎回变动的情况进行日常操作，控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低水平上。

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 1.3709 元，本报告期份额净值增长率为-0.71%，同期业绩比较基准收益率为-3.66%；C 类基金份额净值为 1.3682 元，本报告期份额净值增长率为-0.76%，同期业绩比较基准收益率为-3.66%，年化跟踪误差 0.95%，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

展望下一阶段，随着疫苗逐步落地，百年一遇的疫情渐行渐远，全球经济会进一步复苏。下半年中国经济在全球将率先演绎“疫后复苏、政策退出”的情景，经济增长动能可能会有所回落，主要是由于受抑制需求消退、重新开放的发达市场转向服务消费导致我国出口减弱、房地产收紧调控的影响终将显现、原材料价格飙升拖累实际需求等因素导致。与此同时，宏观政策将保持“相机抉择”的态势，在经济增速回落的背景下政策可能稳中趋松。这种市场环境下资本市场的焦点可能会从此前的通胀转向更加关注增长可持续性，产业升级、消费升级所代表的“新经济”趋势可能会重回市场的主线。在当前时点，流动性推升全球多数主要国家地区的股票市场创下历史或阶段性新高，相比之下 A 股的宏观经济复苏更早、企业的盈利增速确定性更高、货币政策更早常态化，且 A 股正处于资本市场制度建设和对外开放的上升期；同时我们也看到了疫情检验了中国制造业的韧性和竞争力，中国制造业正在借助内需大市场衍生出的众多优势实现了产业升级与产业自主趋势强化；本次疫情更是一场对不同经济体的大考，中国从社会管理、社会组织、资源动员、制度等方面都经受了考验，领先全球，这一因素理应也会在未来逐步体现到中国资产的风险溢价中。当前海外刺激政策仍

持续、国内经济表现强劲的基本面环境意味着风险资产仍更受青睐。资本市场在近年持续改革之后与新经济领域正在形成相互促进的良性互动，资本市场也在进入快速发展的新阶段。改革与开放继续落地，中国资本市场正在经历新的大发展，股市流动性相对充裕。中国经济依然具有较强的内生动力，中长期乐观趋势不改。2021 年是中国“十四五”规划的开局之年，在十四五规划纲要中，强调高质量发展是新阶段的显著特征，中国经济的结构转型仍在深化，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点，A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地。通过资本市场把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业升级，改善上市公司业绩，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，既为短期投资者提供“高弹性、高波动”的投资工具，又为长期看好中国资本市场的投资者提供方便、高效的工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达上证 50ETF 联接发起式 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达上证 50ETF 联接发起式 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合规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	13,487,526.78	7,663,700.86
结算备付金		107,170.25	109,367.48
存出保证金		34,450.53	46,065.96
交易性金融资产	6.4.7.2	215,438,857.33	143,539,527.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		215,438,857.33	143,539,527.97

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	829,762.67
应收利息	6.4.7.5	1,262.20	1,006.76
应收股利		-	-
应收申购款		5,083,179.72	3,532,739.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	44,814.00	-
资产总计		234,197,260.81	155,722,171.23
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		3,899,199.09	-
应付赎回款		2,237,865.75	3,893,875.69
应付管理人报酬		1,543.32	1,159.46
应付托管费		514.45	386.47
应付销售服务费		6,274.65	5,309.76
应付交易费用	6.4.7.7	40,693.06	47,478.22
应交税费		2,935.86	39,792.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	189,997.19	140,811.67
负债合计		6,379,023.37	4,128,813.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	166,317,218.43	109,853,107.19
未分配利润	6.4.7.10	61,501,019.01	41,740,250.54
所有者权益合计		227,818,237.44	151,593,357.73
负债和所有者权益总计		234,197,260.81	155,722,171.23

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.3709 元，C 类基金份额净值 1.3682 元；基金份额总额 166,317,218.43 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 97,466,352.47 份，C 类基金份额总额 68,850,865.96 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-2,012,983.76	5,123,442.87
1.利息收入		20,041.50	21,556.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,041.50	21,531.24
债券利息收入		-	25.12
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,328,860.00	2,371,084.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-341,758.55	1,860,120.76
基金投资收益	6.4.7.13	4,667,483.75	469,280.16
债券投资收益	6.4.7.14	-	41,508.40
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,134.80	174.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,436,521.27	2,697,205.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	74,636.01	33,596.40
减：二、费用		222,193.73	243,030.30
1. 管理人报酬		7,981.58	22,980.34
2. 托管费		2,660.62	7,660.05
3. 销售服务费		30,038.02	33,069.94
4. 交易费用	6.4.7.19	92,485.93	95,596.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		15,620.29	742.12
7. 其他费用	6.4.7.20	73,407.29	82,981.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,235,177.49	4,880,412.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,235,177.49	4,880,412.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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）	109,853,107.19	41,740,250.54	151,593,357.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,235,177.49	-2,235,177.49
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）	56,464,111.24	21,995,945.96	78,460,057.20
其中：1.基金申购款	202,145,061.63	79,739,813.92	281,884,875.55
2.基金赎回款	-145,680,950.39	-57,743,867.96	-203,424,818.35
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）	166,317,218.43	61,501,019.01	227,818,237.44
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	105,871,211.17	5,648,651.99	111,519,863.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,880,412.57	4,880,412.57
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）	5,416,449.88	-1,235,760.02	4,180,689.86
其中：1.基金申购款	154,201,757.46	2,158,679.38	156,360,436.84
2.基金赎回款	-148,785,307.58	-3,394,439.40	-152,179,746.98
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）	111,287,661.05	9,293,304.54	120,580,965.59

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

易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]754 号《关于准予易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》于 2019 年 9 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 261,815,342.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,310.92 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	13,487,526.78
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	13,487,526.78

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	-	-	-
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	198,340,096.70	215,438,857.33	17,098,760.63
其他	-	-	-
合计	198,340,096.70	215,438,857.33	17,098,760.63

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	1,198.50
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	48.20
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	-
应收出借证券利息	-
其他	15.50
合计	1,262.20

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	44,814.00

待摊费用	-
合计	44,814.00

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	40,693.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,693.06

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	572.83
应付证券出借违约金	-
预提费用	189,424.36
合计	189,997.19

6.4.7.9 实收基金

易方达上证 50ETF 联接发起式 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	68,920,634.19	68,920,634.19
本期申购	88,304,059.74	88,304,059.74
本期赎回（以“-”号填列）	-59,758,341.46	-59,758,341.46
本期末	97,466,352.47	97,466,352.47

易方达上证 50ETF 联接发起式 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	40,932,473.00	40,932,473.00

本期申购	113,841,001.89	113,841,001.89
本期赎回（以“-”号填列）	-85,922,608.93	-85,922,608.93
本期末	68,850,865.96	68,850,865.96

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

易方达上证 50ETF 联接发起式 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	13,729,586.32	12,511,078.36	26,240,664.68
本期利润	2,859,160.94	-5,298,677.25	-2,439,516.31
本期基金份额交易产生的变动数	6,134,075.22	6,216,859.10	12,350,934.32
其中：基金申购款	19,292,642.22	16,738,291.32	36,030,933.54
基金赎回款	-13,158,567.00	-10,521,432.22	-23,679,999.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,722,822.48	13,429,260.21	36,152,082.69

易方达上证 50ETF 联接发起式 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	8,078,087.64	7,421,498.22	15,499,585.86
本期利润	1,342,182.84	-1,137,844.02	204,338.82
本期基金份额交易产生的变动数	6,451,705.61	3,193,306.03	9,645,011.64
其中：基金申购款	25,227,678.38	18,481,202.00	43,708,880.38
基金赎回款	-18,775,972.77	-15,287,895.97	-34,063,868.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,871,976.09	9,476,960.23	25,348,936.32

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	18,418.51
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	1,245.76
其他	377.23
合计	20,041.50

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,521.00
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-340,237.55
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-341,758.55

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,586,815.00
减：卖出股票成本总额	1,588,336.00
买卖股票差价收入	-1,521.00

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	106,225,100.00
减：现金支付申购款总额	9,008,951.32
减：申购股票成本总额	97,556,386.23
申购差价收入	-340,237.55

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	36,481,598.32
减：卖出/赎回基金成本总额	31,814,114.57
基金投资收益	4,667,483.75

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,134.80

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,134.80

6.4.7.17 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	-6,436,521.27
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-6,436,521.27
——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	-6,436,521.27

6.4.7.18 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	74,636.01
其他	-
合计	74,636.01

6.4.7.19 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	89,708.50
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	2,777.43
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	2,777.43

合计	92,485.93
----	-----------

6.4.7.20 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	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,982.93
合计	73,407.29

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、基金发起人
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
广发证券股份有限公司	基金管理人股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券	-	-	61,427,691.57	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的 比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的 比例
广发证券	-	-	55,369,637.70	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	49,142.07	100.00%	12,658.62	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	7,981.58	22,980.34
其中：支付销售机构的客户维护费	42,280.50	11,445.90

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,660.62	7,660.05

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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等，支付日期顺延。

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		
	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	易方达上证 50ETF 联接 发起式 C	合计
易方达基金管理有限	-	7,311.90	7,311.90

公司			
招商银行	-	58.27	58.27
合计	-	7,370.17	7,370.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达上证50ETF联接发起式A	易方达上证50ETF联接发起式C	合计
易方达基金管理有限公司	-	19,573.50	19,573.50
合计	-	19,573.50	19,573.50

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 0.10%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

	易方达上证50ETF 联接发起式A	易方达上证50ETF联 接发起式C	易方达上证50ETF联 接发起式A	易方达上证50ETF联 接发起式C
报告期初持有的基 金份额	10,000,000.00	-	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	10,000,000.00	-	10,000,000.00	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	10.2600%	-	17.5613%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 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

易方达上证 50ETF 联接发起式 A

无。

易方达上证 50ETF 联接发起式 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	13,487,526.78	18,418.51	6,366,130.59	20,107.15

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 155,439,291 份和 102,616,191 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 44.51%和 33.73%。本基金在报告期内因赎回目标 ETF 基金份额而持有基

金托管人发行的股票招商银行。于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有广发证券的 A 股(2020 年 12 月 31 日：无)，未持有招商银行的 A 股(2020 年 12 月 31 日：无)。

6.4.11 利润分配情况

易方达上证 50ETF 联接发起式 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达上证 50ETF 联接发起式 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、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。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 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行

管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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

6.4.13.4 市场风险

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	13,487,526.78	-	-	-	13,487,526.78
结算备付金	107,170.25	-	-	-	107,170.25
存出保证金	34,450.53	-	-	-	34,450.53
交易性金融资产	-	-	-	215,438,857.33	215,438,857.33
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	-	-	-	1,262.20	1,262.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,083,179.72	5,083,179.72
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	44,814.00	44,814.00
资产总计	13,629,147.56	-	-	220,568,113.25	234,197,260.81
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	-	-	-	3,899,199.09	3,899,199.09
应付赎回款	-	-	-	2,237,865.75	2,237,865.75
应付管理人报酬	-	-	-	1,543.32	1,543.32
应付托管费	-	-	-	514.45	514.45
应付销售服务费	-	-	-	6,274.65	6,274.65
应付交易费用	-	-	-	40,693.06	40,693.06
应交税费	-	-	-	2,935.86	2,935.86
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,997.19	189,997.19
负债总计	-	-	-	6,379,023.37	6,379,023.37
利率敏感度缺口	13,629,147.56	-	-	214,189,089.88	227,818,237.44
上年度末 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	7,663,700.86	-	-	-	7,663,700.86
结算备付金	109,367.48	-	-	-	109,367.48
存出保证金	46,065.96	-	-	-	46,065.96
交易性金融资产	-	-	-	143,539,527.97	143,539,527.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	829,762.67	829,762.67
应收利息	-	-	-	1,006.76	1,006.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,532,739.53	3,532,739.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,819,134.30	-	-	147,903,036.93	155,722,171.23

					3
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	-	-	-	3,893,875.69	3,893,875.69
应付管理人报酬	-	-	-	1,159.46	1,159.46
应付托管费	-	-	-	386.47	386.47
应付销售服务费	-	-	-	5,309.76	5,309.76
应付交易费用	-	-	-	47,478.22	47,478.22
应交税费	-	-	-	39,792.23	39,792.23
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	140,811.67	140,811.67
负债总计	-	-	-	4,128,813.50	4,128,813.50
利率敏感度缺口	7,819,134.30	-	-	143,774,223.43	151,593,357.73

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 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	215,438,857.33	94.57	143,539,527.97	94.69
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	215,438,857.33	94.57	143,539,527.97	94.69

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%	10,746,822.92	7,509,211.83
	2.业绩比较基准下降 5%	-10,746,822.92	-7,509,211.83

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 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 215,438,857.33 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 143,539,527.97 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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	215,438,857.33	91.99
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,594,697.03	5.80
8	其他各项资产	5,163,706.45	2.20
9	合计	234,197,260.81	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	215,438,857.33	94.57

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600519	贵州茅台	15,908,290.00	10.49
2	601318	中国平安	11,299,702.25	7.45
3	600276	恒瑞医药	4,787,294.67	3.16
4	601888	中国中免	4,561,322.00	3.01
5	601166	兴业银行	4,472,439.00	2.95
6	601012	隆基股份	3,916,492.00	2.58
7	600887	伊利股份	3,379,676.00	2.23
8	600030	中信证券	3,053,247.00	2.01
9	600031	三一重工	2,859,719.00	1.89
10	603259	药明康德	2,569,455.00	1.69
11	600309	万华化学	2,554,802.00	1.69
12	601398	工商银行	2,507,021.00	1.65
13	603288	海天味业	2,452,702.92	1.62
14	603501	韦尔股份	2,176,182.00	1.44
15	600000	浦发银行	1,659,701.00	1.09
16	601601	中国太保	1,644,537.00	1.08
17	600690	海尔智家	1,539,340.00	1.02
18	600585	海螺水泥	1,512,228.00	1.00
19	601668	中国建筑	1,430,616.00	0.94
20	600016	民生银行	1,424,211.00	0.94

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。

7.5.2 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	600519	贵州茅台	255,063.00	0.17
2	601318	中国平安	158,520.00	0.10
3	600036	招商银行	127,681.00	0.08
4	600276	恒瑞医药	75,229.00	0.05
5	601166	兴业银行	73,575.00	0.05
6	601888	中国中免	73,300.00	0.05
7	601012	隆基股份	59,650.00	0.04
8	600031	三一重工	50,673.00	0.03
9	600887	伊利股份	50,116.00	0.03
10	600030	中信证券	44,272.00	0.03
11	600309	万华化学	41,367.00	0.03
12	603288	海天味业	40,480.00	0.03
13	603259	药明康德	35,840.00	0.02
14	601398	工商银行	34,320.00	0.02
15	603501	韦尔股份	29,510.00	0.02
16	600690	海尔智家	23,863.00	0.02

17	600000	浦发银行	23,738.00	0.02
18	601601	中国太保	23,702.00	0.02
19	600585	海螺水泥	20,684.00	0.01
20	600016	民生银行	20,202.00	0.01

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。

7.5.3 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	97,583,591.23
卖出股票收入（成交）总额	1,586,815.00

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。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

2021 年 4 月 12 日，中华人民共和国财政部依法对江苏恒瑞医药股份有限公司处以 5 万元的罚款。处罚事由：检查发现，公司存在以下问题：一是 2018 年以非本公司发生的机票等报销专家讲课费、点评费、主持费，涉及金额 108.80 万元。二是 2018 年以非本公司发生的机票及过路费、咨询费、广告费等发票列支公司员工福利奖励支出，涉及金额 214.91 万元。三是所属连云港综合二办 2018 年以非本单位发生的过桥过路费发票报销办事处销售人员补贴、赠送客户礼品、学术活动餐费等费用，涉及金额 96.19 万元。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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。除招商银行、兴业银行、恒瑞医药外，本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金报告期末未持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库

情况。

7.13.3 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	34,450.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,262.20
5	应收申购款	5,083,179.72
6	其他应收款	44,814.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,163,706.45

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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
易方达上证 50ETF 联接发起式 A	9,908	9,837.14	10,000,000.00	10.26%	87,466,352.47	89.74%

易方达上证 50ETF 联接发起 式 C	7,044	9,774.40	0.00	0.00%	68,850,865.96	100.00 %
合计	16,952	9,811.07	10,000,000.00	6.01%	156,317,218.43	93.99%

8.2 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	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	34,908.25	0.0358%
	易方达上证 50ETF 联接发起式 C	0.00	0.0000%
	合计	34,908.25	0.0210%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	0
	易方达上证 50ETF 联接发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	0
	易方达上证 50ETF 联接发起式 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	6.0126%	10,000,000.00	6.0126%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	6.0126%	10,000,000.00	6.0126%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达上证 50ETF 联接发起式 A	易方达上证 50ETF 联接发起式 C
基金合同生效日（2019 年 9 月 9 日）基金份额总额	166,100,657.27	95,714,684.92
本报告期期初基金份额总额	68,920,634.19	40,932,473.00
本报告期基金总申购份额	88,304,059.74	113,841,001.89
减：本报告期基金总赎回份额	59,758,341.46	85,922,608.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	97,466,352.47	68,850,865.96

§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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	1	99,157,221.23	100.00%	79,326.06	100.00%	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为摩根大通证券（中国）有限公司、太平洋证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司。

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；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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	38,994,959.88	100.00%
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2021-01-11
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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	2021-03-30
7	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
8	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	2021-04-02

		电子披露网站	
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 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上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件；
- 2.《易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3.《易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 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、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