

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数

证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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遵规守信情况的说明	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	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计意见	16
6.2	形成审计意见的基础	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	56
8.1	期末基金资产组合情况	56
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3	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	58
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	72

8.6	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	73
8.7	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	73
8.8	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	73
8.9	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	73
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12	投资组合报告附注	74
§ 9	基金份额持有人信息	75
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2	期末上市基金前十名持有人	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	76
§ 10	开放式基金份额变动	76
§ 11	重大事件揭示	77
11.1	基金份额持有人大会决议	77
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4	基金投资策略的改变	77
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8	其他重大事件	80
§ 12	备查文件目录	82
12.1	备查文件目录	82
12.2	存放地点	82
12.3	查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 易基、MSCIA 股 ETF 易方达
基金主代码	512090
交易代码	512090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 17 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	319,592,316.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 6 月 1 日

2.2 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	<p>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（含存托凭证）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，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的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，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，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。在条件许可的情况下，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</p>

	法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index)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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	95,495,861.22	136,351,253.76	147,931,758.95
本期利润	40,530,437.34	187,815,599.71	290,516,204.29
加权平均基金份额本期利润	0.1152	0.5407	0.4014
本期加权平均净值利润率	6.56%	40.26%	39.36%
本期基金份额净值增长率	6.43%	46.80%	39.29%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	258,168,575.11	207,897,689.70	64,479,958.26
期末可供分配基金份额利润	0.8078	0.5420	0.1447
期末基金资产净值	577,760,891.11	651,561,632.26	515,586,653.22
期末基金份额净值	1.8078	1.6986	1.1571
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	80.78%	69.86%	15.71%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.46%	0.75%	1.57%	0.75%	0.89%	0.00%
过去六个月	-0.20%	0.98%	-3.66%	0.99%	3.46%	-0.01%
过去一年	6.43%	1.16%	-0.40%	1.16%	6.83%	0.00%
过去三年	117.62%	1.27%	77.01%	1.28%	40.61%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	80.78%	1.29%	37.10%	1.31%	43.68%	-0.02%

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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 5 月 17 日至 2021 年 12 月 31 日)

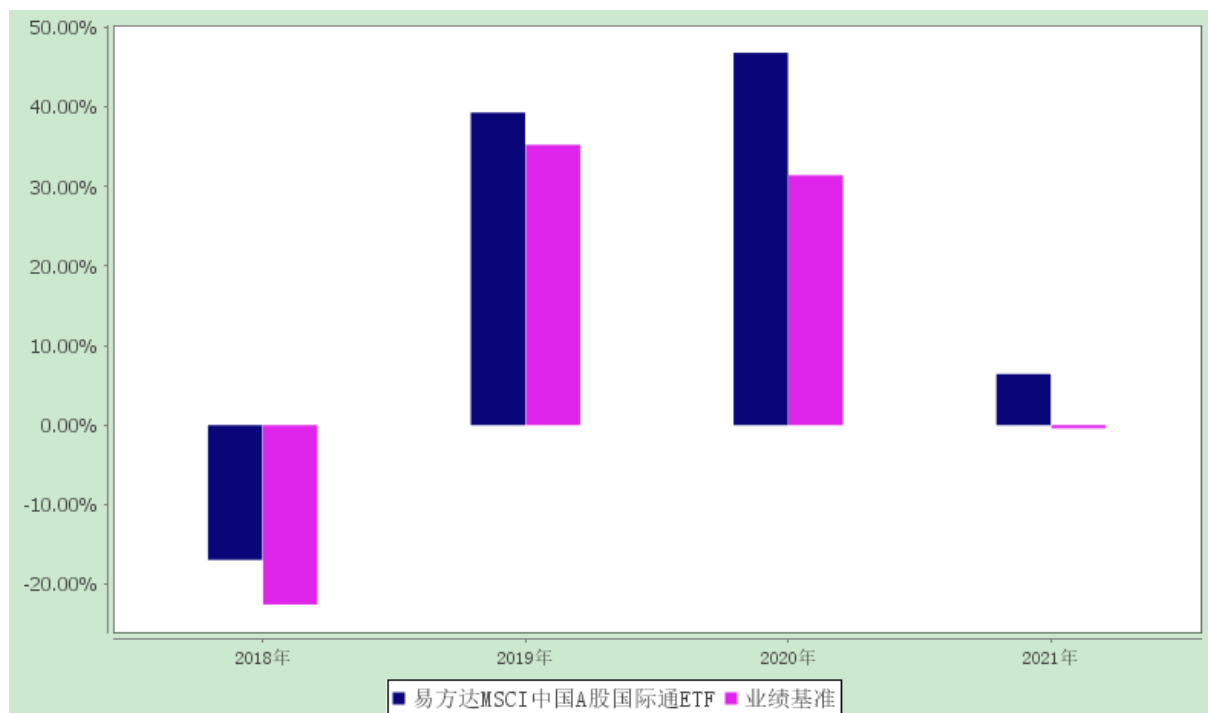


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 80.78%，同期业绩比较基准收益率为 37.10%。

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

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，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		
F A N B I N G (范 冰)	本基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2017 年 03 月 25 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2017 年 03 月 25 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达原油证券投资基金 (QDII) 的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理、指数投资决策委员会委员	2018-05-17	-	16 年	新加坡籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析师、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理，易方达基金管理有限公司易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理
宋 钊 贤	本基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证红利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、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达上证 50 指数证券投	2020-09-05	-	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员、投资经理助理、投资经理

<p>资基金（LOF）的基金经理、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证现代农业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证装备产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理</p>				
---	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、

二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 30 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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 MSCI 中国 A 股国际通指数，该指数旨在追踪随着时间推移部分 A 股逐渐被纳入 MSCI 新兴市场指数的过程。目前在每次指数审议时，纳入标的指数的成份股来自 MSCI

中国指数中的中国 A 股成份股。标的指数编制方法基于 MSCI 全球可投资市场指数的编制方法。报告期内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而进行相应调整。

回顾 2021 年，新冠肺炎疫情仍然是对全球各国经济形势和宏观政策制定构成重大影响的因素。常态化疫情防控以来，我国坚持动态清零的防疫总方针，以及“外防输入、内防反弹”的防疫策略，最大限度保护了人民生命安全和身体健康，经济发展和疫情防控保持全球领先地位，实现了“十四五”良好开局。根据国家统计局公布的数据，2021 年我国国内生产总值达到 114.4 万亿元，按不变价格计算，比上年增长 8.1%，两年平均增长 5.1%，增速在全球主要经济体中名列前茅。宏观政策方面，实施积极的财政政策和稳健的货币政策，财政政策和货币政策协调联动，强调跨周期和逆周期宏观调控政策有机结合。

资本市场方面，在国民经济持续稳定恢复、宏观政策稳健有效的背景下，2021 年 A 股市场整体表现较好，报告期内上证指数上涨 4.8%，实现连续三年上涨。从市场结构上看，不同的风格和行业板块受宏观环境和自身基本面状况影响，收益率表现差异较大。在风格方面，中小市值风格收益率高于大市值风格，成长风格收益率高于价值风格，具体来看，报告期内中证 1000 指数、中证 500 指数、创业板指涨幅居前，分别上涨 20.5%、15.6%、12.0%；上证 50 指数、沪深 300 指数跌幅居前，分别下跌 10.1%、5.2%。在行业方面，电力设备、有色金属、煤炭、基础化工、钢铁、公用事业等行业涨幅居前，家用电器、非银金融、房地产、社会服务、食品饮料、医药生物等行业跌幅居前。报告期内 MSCI 中国 A 股国际通指数下跌 0.4%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.8078 元，本报告期份额净值增长率为 6.43%，同期业绩比较基准收益率为-0.40%，年化跟踪误差 0.83%，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 2022 年，全球经济复苏进程将延续，但各国宏观政策和疫情不断演化背景下防控措施的差异，或将导致经济恢复节奏不同步、水平不均衡，从而影响不同资本市场的表现。2022 年是我国实施“十四五”规划的关键之年，在经济高质量发展稳步推进的同时，也面临着众多的内外部挑战。统筹疫情防控和社会经济发展仍是下一阶段我国社会经济工作的重中之重，以稳增长为导向的货币与财政政策将着力于增强经济发展的韧性。货币政策保持流动性合理充裕，财政发力将适度前置，为

提振内需、新基建投资和产业转型升级提供精准有力支持，推动创新驱动的新发展格局逐渐形成，经济运行有望保持在合理区间。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。另一方面，我国资本市场改革进入关键阶段，高水平双向开放的步伐不断加快，注册制改革将为多层次资本市场带来更多的优质上市公司，长期视角下 A 股市场在国内与全球资产配置中的重要性有望进一步提升。

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，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 培育合规文化、严守合规底线、防控违法违规行为是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，秉持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，树立弘扬“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，促进公司合规文化建设。加大力度持续开展员工合规风控教育培训、强化合规监督考评机制，不断提高员工合规风控意识，深入践行“受人之托、为人理财”的信义义务。

(2) 坚持“守底线、保合规、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示；认真贯彻法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 参与新产品设计、新业务拓展工作，持续督促健全公募基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，严格进行合规审查，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券基金期货经营机构投资者投诉处理工作指引（试行）》等法律法规和监管政策、自律准则，进一步完善基金销售相关业务规范，加强投资者权益保护、促进长期理性投资。持

续优化投资者适当性管理和客户投诉纠纷处理机制，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”职责义务，保障投资者合法权益。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，进一步健全信息披露管理工作机制流程，不断推进信息披露文件制作审核的系统化，持续做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

(7) 深入贯彻落实《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》等规定，不断完善业务过程中的廉洁从业管理机制，加强对员工廉洁从业、职业操守和道德规范等方面的教育宣导和培训，努力将廉洁从业、职业操守和道德规范要求渗透落实到业务活动和日常经营的各个环节。

(8) 以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，坚持不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司内控及合规管理有效性的提升。

(9) 不断检讨回顾合规管控框架和机制，促进监察稽核自身制度流程和工具手段的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

(10) 继续顺利通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 25125 号

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

基金管理人治理层负责监督易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来

可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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

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

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

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

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

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2022 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	12,869,503.56	7,248,560.81
结算备付金		3,740,014.00	4,201,979.17
存出保证金		1,858,769.05	1,030,244.12
交易性金融资产	7.4.7.2	560,137,568.13	640,332,294.77
其中：股票投资		559,011,575.29	639,573,299.34
基金投资		-	-
债券投资		1,125,992.84	758,995.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		19,166.59	3,087,166.41
应收利息	7.4.7.5	3,010.13	2,750.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		578,628,031.46	655,902,996.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		164,320.56	2,793,035.36

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,018.64	73,379.39
应付托管费		24,006.21	24,459.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	95,278.33	157,948.45
应交税费		15,976.59	16,783.45
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	495,540.02	1,275,757.46
负债合计		867,140.35	4,341,363.90
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	319,592,316.00	383,592,316.00
未分配利润	7.4.7.10	258,168,575.11	267,969,316.26
所有者权益合计		577,760,891.11	651,561,632.26
负债和所有者权益总计		578,628,031.46	655,902,996.16

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8078 元，基金份额总额 319,592,316.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		43,093,786.80	190,524,680.00
1.利息收入		107,723.94	84,590.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	104,230.47	84,349.94
债券利息收入		451.84	240.23
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		3,041.63	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		96,970,933.99	137,923,242.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	85,971,633.60	129,064,749.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	488,506.74	296,980.58
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,324,407.77	1,766,271.84
股利收益	7.4.7.15	9,186,385.88	6,795,240.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-54,965,423.88	51,464,345.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	980,552.75	1,052,501.45
减：二、费用		2,563,349.46	2,709,080.29
1. 管理人报酬		927,891.63	697,761.44
2. 托管费		309,297.16	232,587.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	809,414.30	1,281,891.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4,779.43	6,359.43
7. 其他费用	7.4.7.19	511,966.94	490,480.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,530,437.34	187,815,599.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,530,437.34	187,815,599.71

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	383,592,316.00	267,969,316.26	651,561,632.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,530,437.34	40,530,437.34
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）	-64,000,000.00	-50,331,178.49	-114,331,178.49
其中：1.基金申购款	158,000,000.00	120,070,355.26	278,070,355.26
2.基金赎回款	-222,000,000.00	-170,401,533.75	-392,401,533.75
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）	319,592,316.00	258,168,575.11	577,760,891.11
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	445,592,316.00	69,994,337.22	515,586,653.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	187,815,599.71	187,815,599.71

期利润)			
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)	-62,000,000.00	10,159,379.33	-51,840,620.67
其中：1.基金申购款	696,000,000.00	239,205,358.43	935,205,358.43
2.基金赎回款	-758,000,000.00	-229,045,979.10	-987,045,979.10
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)	383,592,316.00	267,969,316.26	651,561,632.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(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[2018]595 号《关于准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,743,592,316.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露

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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其

变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、

转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金场内份额的收益分配方式采用现金分红；

(3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配；

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号

《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	12,869,503.56	7,248,560.81
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	12,869,503.56	7,248,560.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		514,235,504.91	559,011,575.29	44,776,070.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,125,992.84	1,125,992.84	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,125,992.84	1,125,992.84	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		515,361,497.75	560,137,568.13	44,776,070.38
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		540,575,185.08	639,573,299.34	98,998,114.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	758,995.43	758,995.43	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	758,995.43	758,995.43	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		541,334,180.51	640,332,294.77	98,998,114.26

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,160,100.00	-	-	-
IC2203	2,882,000.00	-	-	-
IF2203	12,278,100.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,160,100.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,117,160.00	-	-	-
IC2103	1,211,720.00	-	-	-
IF2103	5,905,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,117,160.00	-	-	-

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IC2203	IC2203	2	2,922,320.00	40,320.00
IF2203	IF2203	8	11,881,440.00	-396,660.00
总额合计				-356,340.00
减：可抵销期货暂收款				-356,340.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IC2103	IC2103	1	1,250,280.00	38,560.00
IF2103	IF2103	4	6,253,920.00	348,480.00
总额合计				387,040.00
减：可抵销期货暂收款				387,040.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,244.82	751.47
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	1,728.71	1,894.45
应收债券利息	25.90	57.86
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	10.70	47.10
合计	3,010.13	2,750.88

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	95,278.33	157,948.45
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	95,278.33	157,948.45

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	177,000.00	180,000.00
应付替代款	166,888.33	1,021,484.71
其他应付款	151,651.69	67,675.35
可退替代款	-	6,597.40
合计	495,540.02	1,275,757.46

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	383,592,316.00	383,592,316.00
本期申购	158,000,000.00	158,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-222,000,000.00	-222,000,000.00
本期末	319,592,316.00	319,592,316.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	207,897,689.70	60,071,626.56	267,969,316.26
本期利润	95,495,861.22	-54,965,423.88	40,530,437.34
本期基金份额交易产生的变动数	-44,138,189.05	-6,192,989.44	-50,331,178.49
其中：基金申购款	106,627,899.49	13,442,455.77	120,070,355.26
基金赎回款	-150,766,088.54	-19,635,445.21	-170,401,533.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	259,255,361.87	-1,086,786.76	258,168,575.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,873.50	44,754.24
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	59,317.41	38,321.74
其他	1,039.56	1,273.96
合计	104,230.47	84,349.94

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	64,025,704.29	93,936,142.10
股票投资收益——赎回差价收入	21,945,929.31	35,128,607.53
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	85,971,633.60	129,064,749.63

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	350,999,953.13	493,454,540.86
减：卖出股票成本总额	286,974,248.84	399,518,398.76
买卖股票差价收入	64,025,704.29	93,936,142.10

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	392,401,533.75	987,045,979.10
减：现金支付赎回款总额	163,025,726.75	399,997,245.10
减：赎回股票成本总额	207,429,877.69	551,920,126.47
赎回差价收入	21,945,929.31	35,128,607.53

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,419,798.39	1,631,781.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,930,774.25	1,334,594.29
减：应收利息总额	517.40	206.32
买卖债券差价收入	488,506.74	296,980.58

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	1,324,407.77	1,766,271.84

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

股票投资产生的股利收益	9,186,385.88	6,795,240.38
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	9,186,385.88	6,795,240.38

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-54,222,043.88	51,147,925.95
——股票投资	-54,222,043.88	51,147,925.95
——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	-743,380.00	316,420.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-743,380.00	316,420.00
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	-54,965,423.88	51,464,345.95

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金申购费收入	-	-
其他	973,971.52	-
替代损益收入	6,581.23	1,052,501.45
合计	980,552.75	1,052,501.45

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	809,414.30	1,281,891.53
银行间市场交易费用	-	-
合计	809,414.30	1,281,891.53

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	57,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	11,199.82	19,062.50
指数使用费	323,767.12	291,418.25
合计	511,966.94	490,480.75

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公

	司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：1.广东省广晟资产经营有限公司自 2021 年 3 月 12 日起将名称变更为广东省广晟控股集团有限公司；盈峰控股集团有限公司自 2021 年 7 月 26 日起将名称变更为盈峰集团有限公司。2.以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	1,523,389.67	0.24%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 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12月31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	914.02	0.27%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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
-	-	-	-	-

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。

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	927,891.63
其中：支付销售机构的客户维护费	6,826.63	7,160.17

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	309,297.16	232,587.14

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	2,162,538.00	1,661.21	0.00	0.00

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	59,244,760.00	18.5376%	57,466,760.00	14.9812%
广发证券	2,469,878.00	0.7728%	2,374,998.00	0.6191%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	12,869,503.56	43,873.50	7,248,560.81	44,754.24

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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12月31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	301038	深水规院	新股网下 发行	2,660	17,768.80
中银国际	601728	中国电信	新股网上 发行	30,000	135,900.00
广发证券	605090	九丰能源	新股网下 发行	1,090	37,681.30
中银国际	688509	正元地信	新股网下 发行	15,433	30,403.01
中银国际	113052	兴业转债	老股东配	6,140	614,000.00

			债		
中银国际	113052	兴业转债	新债网下发行	5,030	503,000.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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
中银国际证券股份有限公司	600919	江苏银行	配股	47,623	218,589.57
中银国际证券股份有限公司	000728	国元证券	配股	13,200	71,808.00

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券、托管行发行的股票中国银行、托管行关联方中银国际证券股份有限公司发行的股票中银证券。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券的 A 股的估值总额为人民币 1,814,742.00 元(2020 年 12 月 31 日：1,455,432.00 元)，持有中国银行的 A 股的估值总额为人民币 1,332,850.00 元(2020 年 12 月 31 日：1,701,618.00 元)，持有中银证券 A 股的估值总额为人民币 312,040.00 元（2020 年 12 月 31 日：无）。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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	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

				类型							
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股 流通 受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-	
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股 流通 受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-	
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股 流通 受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股 流通 受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-	
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股 流通 受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-	
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股 流通 受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股 流通 受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股 流通 受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股 流通 受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-	
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股 流通 受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-	
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股 流通 受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-	
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股 流通 受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股 流通 受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-	
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股 流通 受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-	

301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股 流通 受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股 流通 受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股 流通 受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股 流通 受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股 流通 受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股 流通 受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股 流通 受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股 流通 受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股 流通 受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股 流通 受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股 流通 受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股 流通 受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股 流通 受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股 流通 受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股 流通	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-

				受限							
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股 流通 受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-	
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股 流通 受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-	
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股 流通 受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-	
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股 流通 受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股 流通 受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-	
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股 流通 受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股 流通 受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-	
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股 流通 受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股 流通 受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-	
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股 流通 受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股 流通 受限	33.16	24.67	630	20,890.80	15,542.10	-	
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股 流通 受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股 流通 受限	10.45	11.22	2,180	22,781.00	24,459.60	-	
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股 流通 受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-	
301093	华兰	2021-10-21	2022-05-05	新股	58.08	49.85	389	22,593.12	19,391.65	-	

	股份			流通受限						
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	79.60	78.53	197	15,681.20	15,470.41	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	510	30,936.60	49,342.50	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	86.06	94.50	236	20,310.16	22,302.00	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	377	24,949.86	21,345.74	-

301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股 流通 受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股 流通 受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股 流通 受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股 流通 受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股 流通 受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
688071	华依科技	2021-07-21	2022-02-07	新股 流通 受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-07-06	新股 流通 受限	41.98	41.98	5,327	223,627.46	223,627.46	-
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	新股 流通 受限	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
688711	宏微科技	2021-08-25	2022-03-01	新股 流通 受限	27.51	116.5 2	1,865	51,306.15	217,309.80	-
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	新股 流通 受限	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
688737	中自科技	2021-10-14	2022-04-22	新股 流通 受限	70.90	55.06	2,186	154,987.40	120,361.16	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	新股 流通 受限	30.28	258.8 6	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688799	华纳药厂	2021-07-05	2022-01-13	新股 流通 受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限	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

				类型						
113052	兴业转债	2021-12-28	2022-01-14	新发流通受限	100.00	100.00	6,140	613,997.31	613,997.31	老股东配债
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	新发流通受限	100.00	100.00	5,030	502,995.59	502,995.59	新债网下发行
113634	珀莱转债	2021-12-09	2022-01-04	新发流通受限	100.00	100.00	90	8,999.94	8,999.94	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

易部门、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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于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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.19%(2020 年 12 月 31 日：0.12%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,117,017.38	714,051.99
AAA 以下	9,001.36	45,001.30
未评级	0.00	0.00
合计	1,126,018.74	759,053.29

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,869,503.56	-	-	-	12,869,503.56
结算备付金	3,740,014.00	-	-	-	3,740,014.00
存出保证金	1,858,769.05	-	-	-	1,858,769.05
交易性金融资产	-	-	1,125,992.84	559,011,575.29	560,137,568.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	19,166.59	19,166.59
应收利息	-	-	-	3,010.13	3,010.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	18,468,286.61	-	1,125,992.84	559,033,752.01	578,628,031.46
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	-	-	-	164,320.56	164,320.56
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	72,018.64	72,018.64
应付托管费	-	-	-	24,006.21	24,006.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	95,278.33	95,278.33
应交税费	-	-	-	15,976.59	15,976.59
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	495,540.02	495,540.02
负债总计	-	-	-	867,140.35	867,140.35
利率敏感度缺口	18,468,286.61	-	1,125,992.84	558,166,611.66	577,760,891.11
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	7,248,560.81	-	-	-	7,248,560.81
结算备付金	4,201,979.17	-	-	-	4,201,979.17
存出保证金	1,030,244.12	-	-	-	1,030,244.12
交易性金融资产	-	-	758,995.43	639,573,299.34	640,332,294.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,087,166.41	3,087,166.41
应收利息	-	-	-	2,750.88	2,750.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,480,784.10	-	758,995.43	642,663,216.63	655,902,996.16
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	-	-	-	2,793,035.36	2,793,035.36
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	73,379.39	73,379.39
应付托管费	-	-	-	24,459.79	24,459.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	157,948.45	157,948.45
应交税费	-	-	-	16,783.45	16,783.45
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,275,757.46	1,275,757.46
负债总计	-	-	-	4,341,363.90	4,341,363.90
利率敏感度缺口	12,480,784.10	-	758,995.43	638,321,852.73	651,561,632.26

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，

监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	559,011,575.29	96.75	639,573,299.34	98.16
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	559,011,575.29	96.75	639,573,299.34	98.16

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	27,910,803.86	31,829,380.07
2.业绩比较基准下降 5%	-27,910,803.86	-31,829,380.07	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 557,821,457.91 元,属于第二层次的余额为 2,316,110.22 元,无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日:第一层次 628,096,479.29 元,第二层次 12,235,815.48 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 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

1	权益投资	559,011,575.29	96.61
	其中：股票	559,011,575.29	96.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,125,992.84	0.19
	其中：债券	1,125,992.84	0.19
	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	16,609,517.56	2.87
8	其他各项资产	1,880,945.77	0.33
9	合计	578,628,031.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	6,487,357.84	1.12
B	采矿业	14,071,180.29	2.44
C	制造业	339,911,364.50	58.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,803,283.70	2.39
E	建筑业	8,948,899.69	1.55
F	批发和零售业	5,297,876.18	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	15,345,917.00	2.66
H	住宿和餐饮业	678,508.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,104,564.16	3.65
J	金融业	100,003,090.10	17.31
K	房地产业	9,429,814.51	1.63
L	租赁和商务服务业	7,557,473.78	1.31
M	科学研究和技术服务业	6,952,498.54	1.20

N	水利、环境和公共设施管理业	1,419,417.04	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,696,132.00	0.81
R	文化、体育和娱乐业	2,300,236.44	0.40
S	综合	1,003,961.52	0.17
	合计	559,011,575.29	96.75

8.3 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	600519	贵州茅台	15,700	32,185,000.00	5.57
2	300750	宁德时代	29,100	17,110,800.00	2.96
3	600036	招商银行	257,687	12,551,933.77	2.17
4	000858	五粮液	48,500	10,799,010.00	1.87
5	601318	中国平安	135,409	6,825,967.69	1.18
6	600900	长江电力	283,821	6,442,736.70	1.12
7	002594	比亚迪	22,600	6,059,512.00	1.05
8	601012	隆基股份	67,563	5,823,930.60	1.01
9	300760	迈瑞医疗	15,177	5,779,401.60	1.00
10	601888	中国中免	24,658	5,410,211.78	0.94
11	601166	兴业银行	258,757	4,926,733.28	0.85
12	600809	山西汾酒	15,272	4,822,592.16	0.83
13	300059	东方财富	128,984	4,786,596.24	0.83
14	000568	泸州老窖	18,300	4,645,821.00	0.80
15	603288	海天味业	43,779	4,601,610.69	0.80
16	002475	立讯精密	87,786	4,319,071.20	0.75
17	002352	顺丰控股	61,100	4,211,012.00	0.73
18	600276	恒瑞医药	79,573	4,035,146.83	0.70
19	000001	平安银行	241,800	3,984,864.00	0.69
20	600309	万华化学	39,400	3,979,400.00	0.69
21	603259	药明康德	31,875	3,779,737.50	0.65
22	601398	工商银行	782,800	3,624,364.00	0.63
23	600030	中信证券	132,800	3,507,248.00	0.61
24	002714	牧原股份	65,724	3,507,032.64	0.61
25	600436	片仔癀	7,853	3,432,938.95	0.59
26	603501	韦尔股份	11,000	3,418,470.00	0.59
27	600887	伊利股份	79,878	3,311,741.88	0.57

28	002142	宁波银行	82,520	3,158,865.60	0.55
29	600000	浦发银行	365,547	3,118,115.91	0.54
30	002304	洋河股份	18,844	3,104,172.12	0.54
31	601919	中远海控	157,420	2,942,179.80	0.51
32	300015	爱尔眼科	67,454	2,851,955.12	0.49
33	002812	恩捷股份	11,300	2,829,520.00	0.49
34	300014	亿纬锂能	23,891	2,823,438.38	0.49
35	600406	国电南瑞	69,220	2,770,876.60	0.48
36	601288	农业银行	927,100	2,725,674.00	0.47
37	300274	阳光电源	18,200	2,653,560.00	0.46
38	601668	中国建筑	522,180	2,610,900.00	0.45
39	600438	通威股份	56,300	2,531,248.00	0.44
40	300122	智飞生物	20,000	2,492,000.00	0.43
41	601899	紫金矿业	256,500	2,488,050.00	0.43
42	601816	京沪高铁	509,400	2,460,402.00	0.43
43	600031	三一重工	105,800	2,412,240.00	0.42
44	002371	北方华创	6,900	2,394,438.00	0.41
45	000002	万科 A	121,100	2,392,936.00	0.41
46	000725	京东方 A	466,800	2,357,340.00	0.41
47	600690	海尔智家	78,453	2,344,960.17	0.41
48	600048	保利发展	149,200	2,331,996.00	0.40
49	002241	歌尔股份	42,700	2,310,070.00	0.40
50	601601	中国太保	85,057	2,306,745.84	0.40
51	002493	荣盛石化	125,950	2,287,252.00	0.40
52	601328	交通银行	488,349	2,251,288.89	0.39
53	300124	汇川技术	32,600	2,236,360.00	0.39
54	600893	航发动力	33,136	2,102,810.56	0.36
55	600111	北方稀土	45,300	2,074,740.00	0.36
56	002460	赣锋锂业	14,300	2,042,755.00	0.35
57	600745	闻泰科技	15,500	2,004,150.00	0.35
58	600585	海螺水泥	49,600	1,998,880.00	0.35
59	600104	上汽集团	96,800	1,996,984.00	0.35
60	600019	宝钢股份	277,200	1,984,752.00	0.34
61	601766	中国中车	303,000	1,845,270.00	0.32
62	002459	晶澳科技	19,900	1,844,730.00	0.32
63	601088	中国神华	81,900	1,844,388.00	0.32
64	000776	广发证券	73,800	1,814,742.00	0.31
65	002049	紫光国微	7,900	1,777,500.00	0.31
66	600016	民生银行	441,180	1,720,602.00	0.30
67	601818	光大银行	514,500	1,708,140.00	0.30
68	002129	中环股份	40,500	1,690,875.00	0.29
69	601658	邮储银行	330,700	1,686,570.00	0.29
70	600346	恒力石化	73,200	1,681,404.00	0.29
71	600028	中国石化	396,700	1,678,041.00	0.29

72	601211	国泰君安	93,500	1,672,715.00	0.29
73	603799	华友钴业	15,144	1,670,534.64	0.29
74	000538	云南白药	15,900	1,663,935.00	0.29
75	600999	招商证券	92,347	1,629,924.55	0.28
76	601688	华泰证券	91,600	1,626,816.00	0.28
77	000063	中兴通讯	48,200	1,614,700.00	0.28
78	600010	包钢股份	567,500	1,583,325.00	0.27
79	603806	福斯特	12,010	1,567,905.50	0.27
80	601066	中信建投	53,600	1,567,800.00	0.27
81	601669	中国电建	190,200	1,536,816.00	0.27
82	300498	温氏股份	79,220	1,525,777.20	0.26
83	002311	海大集团	20,700	1,517,310.00	0.26
84	600050	中国联通	386,000	1,516,980.00	0.26
85	002230	科大讯飞	28,700	1,507,037.00	0.26
86	000338	潍柴动力	84,200	1,506,338.00	0.26
87	601985	中国核电	181,200	1,503,960.00	0.26
88	603986	兆易创新	8,540	1,501,759.00	0.26
89	002027	分众传媒	182,800	1,497,132.00	0.26
90	600837	海通证券	120,300	1,474,878.00	0.26
91	601225	陕西煤业	120,800	1,473,760.00	0.26
92	600588	用友网络	40,922	1,468,281.36	0.25
93	601390	中国中铁	253,200	1,466,028.00	0.25
94	601877	正泰电器	26,900	1,449,641.00	0.25
95	300896	爱美客	2,700	1,447,497.00	0.25
96	000166	申万宏源	280,400	1,435,648.00	0.25
97	603659	璞泰来	8,880	1,426,216.80	0.25
98	300433	蓝思科技	61,900	1,422,462.00	0.25
99	600150	中国船舶	55,900	1,385,761.00	0.24
100	000661	长春高新	5,100	1,384,140.00	0.24
101	002709	天赐材料	11,950	1,370,067.50	0.24
102	300782	卓胜微	4,160	1,359,488.00	0.24
103	601633	长城汽车	28,000	1,359,120.00	0.24
104	300413	芒果超媒	23,610	1,350,964.20	0.23
105	601988	中国银行	437,000	1,332,850.00	0.23
106	601100	恒立液压	16,232	1,327,777.60	0.23
107	600989	宝丰能源	76,100	1,321,096.00	0.23
108	601857	中国石油	268,451	1,318,094.41	0.23
109	688036	传音控股	8,392	1,316,704.80	0.23
110	001979	招商蛇口	98,400	1,312,656.00	0.23
111	002821	凯莱英	3,000	1,305,000.00	0.23
112	688111	金山办公	4,850	1,285,250.00	0.22
113	601229	上海银行	176,542	1,258,744.46	0.22
114	000596	古井贡酒	5,100	1,244,400.00	0.22
115	600196	复星医药	25,300	1,238,182.00	0.21

116	603993	洛阳钼业	219,700	1,225,926.00	0.21
117	300759	康龙化成	8,500	1,200,795.00	0.21
118	000625	长安汽车	78,960	1,199,402.40	0.21
119	600660	福耀玻璃	25,135	1,184,863.90	0.21
120	601169	北京银行	263,100	1,168,164.00	0.20
121	000895	双汇发展	36,000	1,135,800.00	0.20
122	002050	三花智控	44,800	1,133,440.00	0.20
123	603392	万泰生物	5,100	1,129,650.00	0.20
124	300999	金龙鱼	17,908	1,126,950.44	0.20
125	600570	恒生电子	18,082	1,123,796.30	0.19
126	601360	三六零	88,289	1,123,036.08	0.19
127	601009	南京银行	124,500	1,115,520.00	0.19
128	300316	晶盛机电	16,000	1,112,000.00	0.19
129	600741	华域汽车	39,200	1,109,360.00	0.19
130	600958	东方证券	74,400	1,096,656.00	0.19
131	300142	沃森生物	19,500	1,095,900.00	0.19
132	601138	工业富联	90,700	1,081,144.00	0.19
133	000100	TCL 科技	174,500	1,076,665.00	0.19
134	600919	江苏银行	183,866	1,071,938.78	0.19
135	300408	三环集团	24,000	1,070,400.00	0.19
136	002074	国轩高科	20,800	1,066,000.00	0.18
137	600886	国投电力	92,700	1,063,269.00	0.18
138	601628	中国人寿	34,379	1,034,464.11	0.18
139	601865	福莱特	17,700	1,025,538.00	0.18
140	300033	同花顺	7,000	1,012,060.00	0.18
141	601336	新华保险	25,900	1,006,992.00	0.17
142	002001	新和成	32,080	998,329.60	0.17
143	300454	深信服	5,200	993,200.00	0.17
144	601600	中国铝业	162,700	990,843.00	0.17
145	603833	欧派家居	6,664	982,940.00	0.17
146	600089	特变电工	46,250	979,112.50	0.17
147	688012	中微公司	7,700	974,820.00	0.17
148	600132	重庆啤酒	6,400	968,448.00	0.17
149	603486	科沃斯	6,300	950,985.00	0.16
150	600926	杭州银行	73,960	948,167.20	0.16
151	300628	亿联网络	11,300	920,385.00	0.16
152	002736	国信证券	79,700	914,956.00	0.16
153	601117	中国化学	75,400	904,800.00	0.16
154	600176	中国巨石	49,679	904,157.80	0.16
155	600600	青岛啤酒	9,127	903,573.00	0.16
156	300661	圣邦股份	2,900	896,100.00	0.16
157	300207	欣旺达	21,200	893,792.00	0.15
158	600011	华能国际	91,300	884,697.00	0.15
159	600029	南方航空	129,900	884,619.00	0.15

160	600015	华夏银行	157,882	884,139.20	0.15
161	600460	士兰微	16,300	883,460.00	0.15
162	002013	中航机电	48,300	878,094.00	0.15
163	002236	大华股份	37,300	875,804.00	0.15
164	000799	酒鬼酒	4,100	871,250.00	0.15
165	000963	华东医药	21,640	869,928.00	0.15
166	300601	康泰生物	8,800	867,152.00	0.15
167	000723	美锦能源	52,900	858,567.00	0.15
168	300223	北京君正	6,400	857,600.00	0.15
169	002648	卫星化学	21,240	850,237.20	0.15
170	002601	龙佰集团	29,700	849,123.00	0.15
171	000876	新希望	55,800	848,718.00	0.15
172	000733	振华科技	6,800	845,104.00	0.15
173	600845	宝信软件	13,870	843,712.10	0.15
174	603369	今世缘	15,500	843,200.00	0.15
175	601618	中国中冶	219,900	842,217.00	0.15
176	600547	山东黄金	44,584	839,070.88	0.15
177	002180	纳思达	17,500	835,800.00	0.14
178	300751	迈为股份	1,300	834,990.00	0.14
179	600426	华鲁恒升	26,286	822,751.80	0.14
180	601377	兴业证券	83,100	821,028.00	0.14
181	002938	鹏鼎控股	19,300	818,899.00	0.14
182	601155	新城控股	27,960	814,474.80	0.14
183	000938	紫光股份	35,638	814,328.30	0.14
184	002920	德赛西威	5,700	806,607.00	0.14
185	603290	斯达半导	2,100	800,100.00	0.14
186	601901	方正证券	101,700	797,328.00	0.14
187	600763	通策医疗	4,000	796,000.00	0.14
188	688008	澜起科技	9,412	789,384.44	0.14
189	002916	深南电路	6,420	782,084.40	0.14
190	000301	东方盛虹	40,400	781,336.00	0.14
191	002602	世纪华通	92,760	778,256.40	0.13
192	601727	上海电气	158,900	772,254.00	0.13
193	600779	水井坊	6,400	767,936.00	0.13
194	002756	永兴材料	5,100	754,902.00	0.13
195	603899	晨光文具	11,600	748,316.00	0.13
196	000786	北新建材	20,800	745,264.00	0.13
197	601111	中国国航	81,500	744,095.00	0.13
198	002555	三七互娱	27,500	743,050.00	0.13
199	600875	东方电气	34,400	736,848.00	0.13
200	601799	星宇股份	3,600	735,300.00	0.13
201	300496	中科创达	5,300	733,626.00	0.13
202	300450	先导智能	9,840	731,800.80	0.13
203	002120	韵达股份	35,670	729,808.20	0.13

204	601916	浙商银行	207,800	727,300.00	0.13
205	600188	兖矿能源	30,900	727,077.00	0.13
206	002791	坚朗五金	4,000	726,360.00	0.13
207	601689	拓普集团	13,700	726,100.00	0.13
208	600383	金地集团	55,923	725,321.31	0.13
209	601788	光大证券	48,540	724,702.20	0.13
210	000069	华侨城 A	102,300	720,192.00	0.12
211	300763	锦浪科技	3,100	717,805.00	0.12
212	600039	四川路桥	59,500	716,380.00	0.12
213	600918	中泰证券	71,800	715,846.00	0.12
214	603260	合盛硅业	5,400	712,638.00	0.12
215	002202	金风科技	43,046	708,967.62	0.12
216	002414	高德红外	29,262	708,433.02	0.12
217	600233	圆通速递	42,400	707,232.00	0.12
218	688169	石头科技	868	705,684.00	0.12
219	002080	中材科技	20,700	704,214.00	0.12
220	600885	宏发股份	9,416	702,810.24	0.12
221	600795	国电电力	221,000	700,570.00	0.12
222	600219	南山铝业	147,600	695,196.00	0.12
223	601939	建设银行	118,500	694,410.00	0.12
224	002841	视源股份	8,500	691,900.00	0.12
225	600584	长电科技	21,900	679,338.00	0.12
226	600754	锦江酒店	11,500	673,900.00	0.12
227	600183	生益科技	28,500	671,175.00	0.12
228	688126	沪硅产业	25,687	663,238.34	0.11
229	002007	华兰生物	22,690	661,186.60	0.11
230	603737	三棵树	4,720	656,788.00	0.11
231	600061	国投资本	79,832	656,219.04	0.11
232	601995	中金公司	13,300	652,099.00	0.11
233	600563	法拉电子	2,800	650,720.00	0.11
234	002600	领益智造	88,100	648,416.00	0.11
235	002625	光启技术	27,000	648,270.00	0.11
236	603882	金域医学	5,800	645,946.00	0.11
237	600522	中天科技	37,900	642,784.00	0.11
238	000977	浪潮信息	17,828	638,777.24	0.11
239	601878	浙商证券	48,200	635,276.00	0.11
240	601615	明阳智能	24,300	634,230.00	0.11
241	600298	安琪酵母	10,500	633,780.00	0.11
242	600018	上港集团	115,600	633,488.00	0.11
243	002240	盛新锂能	10,900	631,655.00	0.11
244	603707	健友股份	15,035	631,470.00	0.11
245	601233	桐昆股份	29,800	631,164.00	0.11
246	000157	中联重科	87,900	630,243.00	0.11
247	603816	顾家家居	8,100	624,996.00	0.11

248	601966	玲珑轮胎	17,075	624,091.25	0.11
249	002340	格林美	59,600	616,860.00	0.11
250	300390	天华超净	7,600	615,600.00	0.11
251	603160	汇顶科技	5,700	614,289.00	0.11
252	600038	中直股份	7,600	610,280.00	0.11
253	300595	欧普康视	10,630	609,843.10	0.11
254	002064	华峰化学	57,800	603,432.00	0.10
255	600332	白云山	17,532	599,594.40	0.10
256	002268	卫士通	10,700	598,558.00	0.10
257	601881	中国银河	53,200	595,308.00	0.10
258	300347	泰格医药	4,650	594,270.00	0.10
259	603456	九洲药业	10,500	590,730.00	0.10
260	603198	迎驾贡酒	8,500	590,325.00	0.10
261	600115	中国东航	113,400	585,144.00	0.10
262	300073	当升科技	6,700	582,029.00	0.10
263	300037	新宙邦	5,100	576,300.00	0.10
264	600362	江西铜业	25,800	576,114.00	0.10
265	000425	徐工机械	95,900	574,441.00	0.10
266	688180	君实生物	8,560	573,348.80	0.10
267	002252	上海莱士	83,900	572,198.00	0.10
268	002384	东山精密	21,100	571,810.00	0.10
269	600674	川投能源	45,700	571,250.00	0.10
270	603568	伟明环保	15,600	569,868.00	0.10
271	002568	百润股份	9,520	569,581.60	0.10
272	601636	旗滨集团	33,300	569,430.00	0.10
273	002326	永太科技	11,100	568,431.00	0.10
274	603185	上机数控	3,400	567,732.00	0.10
275	300146	汤臣倍健	21,000	566,160.00	0.10
276	300699	光威复材	6,700	566,016.00	0.10
277	601058	赛轮轮胎	38,200	564,978.00	0.10
278	600009	上海机场	12,000	560,280.00	0.10
279	601216	君正集团	105,100	549,673.00	0.10
280	600256	广汇能源	83,788	547,973.52	0.09
281	300529	健帆生物	10,250	546,325.00	0.09
282	603589	口子窖	7,700	545,699.00	0.09
283	002385	大北农	51,900	544,431.00	0.09
284	600803	新奥股份	29,600	543,456.00	0.09
285	601838	成都银行	45,000	540,000.00	0.09
286	603517	绝味食品	7,900	539,807.00	0.09
287	688006	杭可科技	4,991	536,931.78	0.09
288	688122	西部超导	5,479	531,134.26	0.09
289	601555	东吴证券	59,859	530,350.74	0.09
290	603338	浙江鼎力	6,600	529,716.00	0.09
291	603345	安井食品	3,100	529,418.00	0.09

292	600141	兴发集团	13,800	522,744.00	0.09
293	000066	中国长城	36,800	521,088.00	0.09
294	603605	珀莱雅	2,500	520,775.00	0.09
295	603267	鸿远电子	2,900	520,376.00	0.09
296	000783	长江证券	68,900	519,506.00	0.09
297	000739	普洛药业	14,700	515,823.00	0.09
298	600516	方大炭素	47,306	511,850.92	0.09
299	002185	华天科技	40,100	509,671.00	0.09
300	600352	浙江龙盛	40,300	508,989.00	0.09
301	300003	乐普医疗	22,300	504,649.00	0.09
302	603019	中科曙光	18,200	501,774.00	0.09
303	603939	益丰药房	9,098	501,390.78	0.09
304	300726	宏达电子	5,000	500,300.00	0.09
305	600486	扬农化工	3,800	498,560.00	0.09
306	000825	太钢不锈	70,700	497,728.00	0.09
307	601108	财通证券	44,700	497,064.00	0.09
308	300724	捷佳伟创	4,300	491,490.00	0.09
309	002624	完美世界	24,150	490,486.50	0.08
310	002372	伟星新材	20,100	488,832.00	0.08
311	000738	航发控制	16,100	487,508.00	0.08
312	600161	天坛生物	16,780	485,948.80	0.08
313	000703	恒逸石化	45,680	485,121.60	0.08
314	002353	杰瑞股份	12,100	484,000.00	0.08
315	000807	云铝股份	43,200	482,544.00	0.08
316	000831	五矿稀土	12,300	479,946.00	0.08
317	002266	浙富控股	67,200	478,464.00	0.08
318	002024	苏宁易购	116,000	477,920.00	0.08
319	601607	上海医药	24,000	476,880.00	0.08
320	300251	光线传媒	36,800	472,880.00	0.08
321	002028	思源电气	9,600	472,416.00	0.08
322	002223	鱼跃医疗	12,400	468,720.00	0.08
323	002532	天山铝业	57,500	468,625.00	0.08
324	300144	宋城演艺	32,680	467,977.60	0.08
325	601198	东兴证券	40,100	466,363.00	0.08
326	002850	科达利	2,900	464,986.00	0.08
327	002409	雅克科技	5,700	462,669.00	0.08
328	000519	中兵红箭	17,300	461,391.00	0.08
329	600606	绿地控股	106,055	460,278.70	0.08
330	603127	昭衍新药	3,980	459,411.40	0.08
331	601933	永辉超市	112,800	456,840.00	0.08
332	300676	华大基因	5,200	456,560.00	0.08
333	000630	铜陵有色	131,100	456,228.00	0.08
334	000009	中国宝安	31,600	455,988.00	0.08
335	601990	南京证券	45,900	454,869.00	0.08

336	600027	华电国际	84,500	452,075.00	0.08
337	603613	国联股份	4,200	451,500.00	0.08
338	002405	四维图新	28,300	450,536.00	0.08
339	600079	人福医药	20,000	450,400.00	0.08
340	300253	卫宁健康	26,790	449,000.40	0.08
341	002673	西部证券	55,400	447,078.00	0.08
342	688009	中国通号	89,544	445,929.12	0.08
343	688208	道通科技	5,583	443,290.20	0.08
344	002032	苏泊尔	7,100	441,904.00	0.08
345	600487	亨通光电	29,200	441,504.00	0.08
346	000932	华菱钢铁	86,200	440,482.00	0.08
347	600705	中航产融	110,900	440,273.00	0.08
348	601162	天风证券	107,900	436,995.00	0.08
349	002407	多氟多	9,700	436,403.00	0.08
350	002531	天顺风能	22,500	436,275.00	0.08
351	600160	巨化股份	33,700	435,067.00	0.08
352	688002	睿创微纳	5,524	434,020.68	0.08
353	002444	巨星科技	14,200	433,242.00	0.07
354	600338	西藏珠峰	11,500	433,090.00	0.07
355	600369	西南证券	81,600	431,664.00	0.07
356	002557	洽洽食品	7,000	429,520.00	0.07
357	300308	中际旭创	10,100	429,250.00	0.07
358	688185	康希诺	1,430	428,356.50	0.07
359	600109	国金证券	37,700	427,141.00	0.07
360	002508	老板电器	11,800	425,036.00	0.07
361	603712	七一二	9,800	424,340.00	0.07
362	600392	盛和资源	21,600	423,792.00	0.07
363	601077	渝农商行	109,900	423,115.00	0.07
364	603233	大参林	10,000	421,100.00	0.07
365	002507	涪陵榨菜	11,100	419,580.00	0.07
366	000591	太阳能	37,400	418,880.00	0.07
367	002939	长城证券	32,300	418,285.00	0.07
368	000999	华润三九	12,200	417,728.00	0.07
369	000728	国元证券	54,100	416,570.00	0.07
370	000155	川能动力	15,700	416,521.00	0.07
371	002192	融捷股份	3,200	416,480.00	0.07
372	300677	英科医疗	7,200	416,448.00	0.07
373	000629	攀钢钒钛	107,000	416,230.00	0.07
374	601319	中国人保	88,500	415,950.00	0.07
375	603658	安图生物	7,550	415,703.00	0.07
376	000983	山西焦煤	50,240	415,484.80	0.07
377	601699	潞安环能	36,600	413,946.00	0.07
378	600655	豫园股份	40,100	413,030.00	0.07
379	002497	雅化集团	14,300	409,838.00	0.07

380	300558	贝达药业	5,118	408,569.94	0.07
381	688188	柏楚电子	1,055	406,660.30	0.07
382	000960	锡业股份	20,800	406,224.00	0.07
383	000423	东阿阿胶	8,300	404,625.00	0.07
384	002603	以岭药业	20,640	404,544.00	0.07
385	601016	节能风电	62,100	404,271.00	0.07
386	600143	金发科技	32,000	402,560.00	0.07
387	601866	中远海发	123,700	402,025.00	0.07
388	603218	日月股份	12,200	401,990.00	0.07
389	000027	深圳能源	49,580	401,598.00	0.07
390	600170	上海建工	111,100	399,960.00	0.07
391	000050	深天马 A	30,700	399,714.00	0.07
392	300088	长信科技	30,000	398,400.00	0.07
393	000800	一汽解放	38,600	397,194.00	0.07
394	600177	雅戈尔	57,500	396,175.00	0.07
395	002456	欧菲光	40,800	395,760.00	0.07
396	600521	华海药业	18,270	395,728.20	0.07
397	600549	厦门钨业	17,300	391,499.00	0.07
398	002463	沪电股份	23,510	389,795.80	0.07
399	601577	长沙银行	49,900	389,719.00	0.07
400	300357	我武生物	6,800	389,640.00	0.07
401	002138	顺络电子	10,200	389,436.00	0.07
402	600704	物产中大	64,900	384,208.00	0.07
403	002044	美年健康	48,926	384,069.10	0.07
404	000998	隆平高科	16,500	383,790.00	0.07
405	688202	美迪西	783	380,216.97	0.07
406	603444	吉比特	900	379,665.00	0.07
407	002797	第一创业	51,600	377,712.00	0.07
408	002078	太阳纸业	32,800	376,872.00	0.07
409	600872	中炬高新	9,900	375,903.00	0.07
410	002157	正邦科技	38,900	375,774.00	0.07
411	603077	和邦生物	109,400	373,054.00	0.06
412	002294	信立泰	13,600	371,552.00	0.06
413	300832	新产业	8,400	370,020.00	0.06
414	002299	圣农发展	15,200	367,384.00	0.06
415	600699	均胜电子	16,700	366,899.00	0.06
416	002408	齐翔腾达	34,900	366,450.00	0.06
417	000830	鲁西化工	24,000	366,240.00	0.06
418	600711	盛屯矿业	34,100	365,893.00	0.06
419	002152	广电运通	30,700	365,330.00	0.06
420	002541	鸿路钢构	6,800	364,072.00	0.06
421	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.06
422	002430	杭氧股份	12,000	360,120.00	0.06
423	002153	石基信息	12,520	359,824.80	0.06

424	000860	顺鑫农业	9,400	358,892.00	0.06
425	300850	新强联	2,000	357,020.00	0.06
426	300568	星源材质	9,700	356,281.00	0.06
427	300725	药石科技	2,500	355,425.00	0.06
428	002030	达安基因	17,596	352,975.76	0.06
429	600315	上海家化	8,700	351,567.00	0.06
430	000988	华工科技	12,600	351,036.00	0.06
431	601456	国联证券	24,600	343,662.00	0.06
432	600998	九州通	23,200	341,504.00	0.06
433	603638	艾迪精密	10,680	340,905.60	0.06
434	002422	科伦药业	17,900	338,847.00	0.06
435	002925	盈趣科技	9,920	337,577.60	0.06
436	603866	桃李面包	11,880	337,392.00	0.06
437	300418	昆仑万维	14,400	333,360.00	0.06
438	000683	远兴能源	45,500	332,150.00	0.06
439	000987	越秀金控	38,065	331,165.50	0.06
440	600801	华新水泥	17,100	330,030.00	0.06
441	000547	航天发展	19,700	328,990.00	0.06
442	600598	北大荒	22,500	327,600.00	0.06
443	002010	传化智联	37,600	327,120.00	0.06
444	300070	碧水源	45,400	326,426.00	0.06
445	600153	建发股份	35,900	325,613.00	0.06
446	300296	利亚德	31,727	325,201.75	0.06
447	000709	河钢股份	132,000	324,720.00	0.06
448	002156	通富微电	16,700	324,481.00	0.06
449	002926	华西证券	32,800	323,080.00	0.06
450	600415	小商品城	66,600	323,010.00	0.06
451	002690	美亚光电	8,600	322,156.00	0.06
452	000513	丽珠集团	8,000	321,680.00	0.06
453	002145	中核钛白	25,300	318,527.00	0.06
454	600688	上海石化	76,100	317,337.00	0.05
455	600380	健康元	24,600	315,864.00	0.05
456	002465	海格通信	28,700	313,404.00	0.05
457	600988	赤峰黄金	21,000	312,900.00	0.05
458	000021	深科技	19,700	312,048.00	0.05
459	601696	中银证券	23,200	312,040.00	0.05
460	000975	银泰黄金	34,840	305,895.20	0.05
461	002065	东华软件	39,100	304,980.00	0.05
462	002092	中泰化学	31,900	304,326.00	0.05
463	600511	国药股份	9,600	302,688.00	0.05
464	300136	信维通信	11,900	301,308.00	0.05
465	000656	金科股份	66,800	299,264.00	0.05
466	600848	上海临港	20,120	299,184.40	0.05
467	300212	易华录	8,460	299,061.00	0.05

468	002373	千方科技	19,900	297,505.00	0.05
469	601231	环旭电子	18,500	297,110.00	0.05
470	002558	巨人网络	24,643	294,976.71	0.05
471	002500	山西证券	44,690	294,954.00	0.05
472	601992	金隅集团	103,700	294,508.00	0.05
473	600895	张江高科	19,500	293,670.00	0.05
474	603858	步长制药	13,857	292,244.13	0.05
475	300383	光环新网	19,400	287,896.00	0.05
476	002212	天融信	15,000	287,550.00	0.05
477	300773	拉卡拉	9,900	287,298.00	0.05
478	000750	国海证券	68,810	282,809.10	0.05
479	300432	富临精工	9,500	279,300.00	0.05
480	002506	协鑫集成	72,800	276,640.00	0.05
481	002151	北斗星通	7,000	274,750.00	0.05
482	002429	兆驰股份	56,200	273,132.00	0.05
483	002511	中顺洁柔	16,100	269,031.00	0.05
484	002958	青农商行	67,900	262,094.00	0.05
485	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.04
486	002563	森马服饰	33,000	255,090.00	0.04
487	603883	老百姓	5,140	253,813.20	0.04
488	000686	东北证券	28,500	250,230.00	0.04
489	600026	中远海能	42,000	248,640.00	0.04
490	600498	烽火通信	13,700	246,326.00	0.04
491	600583	海油工程	53,400	246,174.00	0.04
492	002146	荣盛发展	55,200	240,120.00	0.04
493	601598	中国外运	52,900	236,992.00	0.04
494	688262	国芯科技	5,327	223,627.46	0.04
495	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.04
496	688737	中自科技	2,186	120,361.16	0.02
497	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.01
498	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
499	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
500	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
501	301155	海力风电	510	49,342.50	0.01
502	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
503	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
504	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.01
505	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
506	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
507	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
508	301090	华润材料	2,180	24,459.60	0.00
509	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
510	301166	优宁维	236	22,302.00	0.00
511	301189	奥尼电子	377	21,345.74	0.00

512	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
513	301093	华兰股份	389	19,391.65	0.00
514	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
515	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
516	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
517	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
518	301088	戎美股份	630	15,542.10	0.00
519	301096	百诚医药	197	15,470.41	0.00
520	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
521	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
522	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
523	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
524	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
525	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
526	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
527	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
528	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
529	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
530	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
531	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
532	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
533	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
534	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
535	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
536	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
537	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
538	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
539	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
540	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
541	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
542	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
543	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
544	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
545	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
546	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
547	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
548	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
549	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
550	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
551	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
552	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
553	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
554	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
555	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00

556	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
557	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
558	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
559	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
560	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
561	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
562	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
563	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	9,676,026.90	1.49
2	000858	五粮液	8,502,036.00	1.30
3	000333	美的集团	5,800,950.00	0.89
4	300760	迈瑞医疗	4,799,063.00	0.74
5	600519	贵州茅台	4,348,033.00	0.67
6	002594	比亚迪	4,210,086.00	0.65
7	002352	顺丰控股	4,021,577.00	0.62
8	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.53
9	000001	平安银行	3,408,038.32	0.52
10	300059	东方财富	2,951,614.00	0.45
11	002475	立讯精密	2,804,946.00	0.43
12	002371	北方华创	2,768,815.91	0.42
13	300759	康龙化成	2,708,458.00	0.42
14	000568	泸州老窖	2,636,751.44	0.40
15	002714	牧原股份	2,567,081.00	0.39
16	601816	京沪高铁	2,564,078.00	0.39
17	300015	爱尔眼科	2,489,288.00	0.38
18	002304	洋河股份	2,409,435.60	0.37
19	600036	招商银行	2,330,524.00	0.36
20	002142	宁波银行	2,303,138.17	0.35

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。

8.4.2 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
----	------	------	----------	---------

				产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	13,319,818.60	2.04
2	000858	五粮液	11,274,666.38	1.73
3	600905	三峡能源	7,843,139.49	1.20
4	002415	海康威视	7,787,660.44	1.20
5	689009	九号公司	6,891,804.32	1.06
6	002594	比亚迪	5,753,472.00	0.88
7	600519	贵州茅台	5,227,213.50	0.80
8	300760	迈瑞医疗	5,079,349.00	0.78
9	000333	美的集团	4,552,919.98	0.70
10	000001	平安银行	4,478,426.00	0.69
11	300059	东方财富	3,673,870.20	0.56
12	002475	立讯精密	3,597,743.43	0.55
13	002352	顺丰控股	3,463,065.00	0.53
14	000568	泸州老窖	3,376,227.00	0.52
15	002714	牧原股份	3,255,259.00	0.50
16	300015	爱尔眼科	3,097,622.00	0.48
17	002371	北方华创	3,021,467.12	0.46
18	002304	洋河股份	2,917,216.24	0.45
19	000002	万科 A	2,770,369.00	0.43
20	002142	宁波银行	2,748,065.00	0.42

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。

8.4.3 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	313,897,290.16
卖出股票收入（成交）总额	350,999,953.13

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。

8.5 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）	1,125,992.84	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,125,992.84	0.19

8.6 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	113052	兴业转债	11,170	1,116,992.90	0.19
2	113634	珀莱转债	90	8,999.94	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2203	IC2203	2	2,922,320.00	40,320.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理，降低现金拖累，减少交易成本，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

IF2203	IF2203	8	11,881,440.00	-396,660.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理，降低现金拖累，减少交易成本，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					-356,340.00
股指期货投资本期收益（元）					1,324,407.77
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-743,380.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,858,769.05
2	应收证券清算款	19,166.59
3	应收股利	-

4	应收利息	3,010.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,880,945.77

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
4,150	77,010.20	177,493,82 3.00	55.54%	142,098,493 .00	44.46%	59,244,760 .00	18.54%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国工商银行股份有限公司—兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	44,194,400.00	13.83%
2	竞技世界（北京）网络技术有限公司	20,923,200.00	6.55%
3	招商银行股份有限公司—兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）	11,371,100.00	3.56%
4	陈建敏	10,000,000.00	3.13%
5	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	3.13%
6	华泰证券股份有限公司	7,423,875.00	2.32%
7	国泰君安证券股份有限公司	6,036,676.00	1.89%
8	中航安盟财产保险有限公司—自有资金	3,217,600.00	1.01%
9	贾文琳	3,000,000.00	0.94%
10	韩静兰	2,950,800.00	0.92%
11	中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	59,244,760.00	18.54%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年5月17日)基金份额总额	1,743,592,316.00
本报告期期初基金份额总额	383,592,316.00
本报告期基金总申购份额	158,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	222,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	319,592,316.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 57,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比 例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
长江证券	2	2,181,387.32	0.34%	1,511.52	0.44%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	277,622,104.62	43.29%	138,827.22	40.47%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	1,523,389.67	0.24%	914.02	0.27%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	134,910,669.28	21.04%	72,800.28	21.22%	-
国信证券	1	16,779,842.72	2.62%	13,423.82	3.91%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	198,854,653.91	31.01%	110,907.12	32.33%	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	9,379,566.43	1.46%	4,690.14	1.37%	-
中银国际	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长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、

华创证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	1,056,203.39	23.90%	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	3,363,595.00	76.10%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加南京证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
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	中国证券报	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加第一创业证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
5	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
6	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	中国证券报	2021-03-30
7	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2021-04-02

		金电子披露网站	
8	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	中国证券报	2021-04-19
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-17
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-07-20
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
12	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
13	易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购正元地理信息集团股份有限公司首次公开发行股票的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
15	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证券报	2021-08-28
17	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方财富证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-15
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-10-27
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-15
20	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17
21	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加开源证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-27
22	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资兴业银行股份有限公司公开发行可转换公司债券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-30

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日