

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

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

§ 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60

7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	60
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12	投资组合报告附注.....	60
§ 8	基金份额持有人信息.....	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	63
§ 9	开放式基金份额变动.....	63
§ 10	重大事件揭示.....	63
10.1	基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4	基金投资策略的改变.....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件.....	67
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	68
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	68
§ 12	备查文件目录.....	68
12.1	备查文件目录.....	68
12.2	存放地点.....	69
12.3	查阅方式.....	69

§ 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	307,592,316.00 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。</p> <p>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。</p>
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	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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 40-43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	351,177.56
本期利润	-3,515,293.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0113

本期加权平均净值利润率	-0.74%
本期基金份额净值增长率	-0.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	144,103,679.62
期末可供分配基金份额利润	0.4685
期末基金资产净值	451,695,995.62
期末基金份额净值	1.4685
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	46.85%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

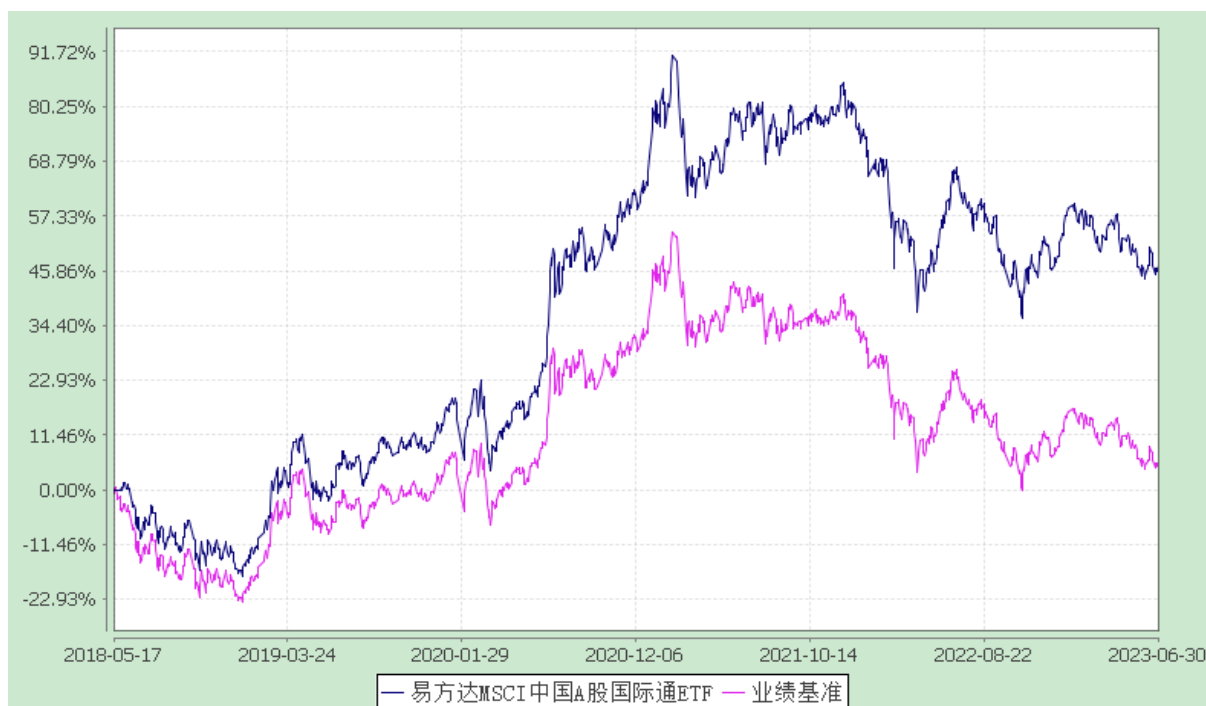
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.39%	0.86%	0.44%	0.86%	0.95%	0.00%
过去三个月	-4.77%	0.78%	-6.34%	0.79%	1.57%	-0.01%
过去六个月	-0.87%	0.79%	-2.71%	0.79%	1.84%	0.00%
过去一年	-12.00%	0.94%	-15.40%	0.95%	3.40%	-0.01%
过去三年	14.91%	1.18%	-4.83%	1.19%	19.74%	-0.01%
自基金合同生效起至今	46.85%	1.25%	5.47%	1.26%	41.38%	-0.01%

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 2023 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 46.85%，同期业绩比较基准收益率为 5.47%。

§ 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、另类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		
FAN BIN	本基金的基金经理，易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达原油	2018-05-17	-	18 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

G (范 冰)	(QDII-LOF-FOF)(自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 03 月 03 日)、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式、易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)、易方达中证香港证券投资主题 ETF、易方达中证龙头企业指数、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理, 指数投资决策委员会委员, 易方达资产管理(香港)有限公司首席投资官(国际指数)、投资决策委员会委员				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消费品指数增强 (QDII)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达恒生科技 ETF (QDII) 的基金经理, 易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、国际指数部部门总监。
宋 钊 贤	本基金的基金经理, 易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证国有企业改革指数 (LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证香港证券投资主题 ETF、易方达中证石化产业 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证现代农业主题 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达中证装备产业 ETF、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达中证全指建筑材料 ETF 的基金经理, 易方达中证沪港深 300ETF、易方达中证龙头企业指数、易方达北证 50 成份指数的基金经理助理, 易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2020-09-05	-	9 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。

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行业协会相关规定。

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.根据 2023 年 8 月 19 日《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经理变更公告》，自 2023 年 8 月 19 日起，FAN BING（范冰）不再担任本基金的基金经理，宋钊贤仍担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制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 23 次，其中 20 次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，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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪 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进行相应调整。

2023 年上半年，随着我国有序实现疫情防控平稳转段，经济社会全面恢复常态化运行，以稳增长、稳就业、稳物价为导向的宏观经济政策协同发力取得成效，国民经济总体上保持了回升向好的趋势，产业转型升级持续推进，高技术产业保持较快增长势头。各地积极出台促进消费政策，有效提振居民消费，消费新业态、新模式发展速度加快。经济修复动能的持续释放带动国民经济企稳回升，根据国家统计局发布的 2023 年上半年经济数据，我国国内生产总值按不变价格计算同比增长 5.5%，全国规模以上工业增加值同比增长 3.8%，服务业增加值同比增长 6.4%，社会消费品同比增长 8.2%。另一方面，受全球经济增速放缓、国内房地产市场走弱、居民消费信心仍有待修复等因素影响，经济增长动能的进一步巩固面临多方面挑战。外部环境仍然复杂严峻，地缘政治冲突持续，海外主要经济体实施紧缩货币政策应对通胀引发的金融风险及外溢影响也值得关注。报告期内 A 股市场整体呈现震荡格局，各行业板块表现分化的特征较为突出。行业方面，通信、传媒、计算机等行业表现居前，商贸零售、房地产、美容护理等行业表现相对落后。

MSCI 中国 A 股国际通指数成份股涵盖了互联互通机制下 A 股市场中具有代表性的大盘和中盘上市公司，行业分布较为均衡，本报告期内下跌 2.71%。报告期内，资本市场关键制度建设持续推进，互联互通机制不断发展完善，未来国际投资者投资中国市场的渠道和资产类别将更加丰富。长期视角下，随着我国资本市场高水平双向开放有序推进，A 股上市企业高质量发展不断取得成效，A 股在 MSCI 等国际主流指数体系中的重要性将逐步提升，国际资本对于 A 股的配置比例也有望增加。

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 1.4685 元，本报告期份额净值增长率为-0.87%，同期业绩比较基准收益率为-2.71%，年化跟踪误差 0.49%，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，我国国民经济在经历了上半年的整体复苏后，继续稳步推进高质量发展，通过改革和创新培育新的增长动能，加快建设以实体经济为支撑的现代化产业体系的大方向保持不变。中央与地方政府把稳增长放在更加突出的位置，陆续出台的一系列以优化营商环境、增强制造业核

心竞争力以及恢复和促进居民消费为目标的政策举措将逐步落地显效，将助力经济循环畅通和供应链稳定，为市场主体开展生产经营和创新发展提供有力支持。我国同时具备全门类工业产业链和超大规模市场的优势，在精准施策的支持下企业投资和居民消费信心将得到提振，经济的韧性和活力不断展现，为实现全年经济社会发展预期目标奠定基础。另一方面，我国社会经济发展也面临着一些内外部挑战因素，国内市场需求不足导致经济内生增长动能偏弱，全球经济增速下行背景下外需持续承压，国际环境在未来一段时期内仍将错综复杂。

资本市场方面，A 股市场经历了今年上半年的震荡行情，收益率表现落后于全球主要资本市场，当前大盘蓝筹指数整体估值仍处于历史较低水平，具备修复空间。下一阶段在企业经营业绩复苏延续、市场流动性环境改善和资本市场改革不断深化的支持下，A 股市场优质资产的中长期配置价值将进一步凸显。

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 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 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,284,496.52	10,731,413.46
结算备付金		2,267,205.07	2,141,777.67
存出保证金		1,402,390.29	1,478,421.62
交易性金融资产	6.4.7.2	438,187,055.94	453,794,004.89
其中：股票投资		438,187,055.94	453,794,004.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		7,418.49	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		452,148,566.31	468,145,617.64
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		148,404.60	263,097.69
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		55,694.08	59,882.33
应付托管费		18,564.67	19,960.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	229,907.34	268,974.32
负债合计		452,570.69	611,915.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	307,592,316.00	315,592,316.00
未分配利润	6.4.7.8	144,103,679.62	151,941,386.47
净资产合计		451,695,995.62	467,533,702.47

负债和净资产总计		452,148,566.31	468,145,617.64
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4685 元，基金份额总额 307,592,316.00 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,829,754.43	-49,459,485.11
1.利息收入		37,516.25	39,959.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	37,516.25	39,959.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,006,097.61	-14,832,817.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,647,367.28	-16,778,395.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	39,695.53	335,831.29
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-536,221.80	-2,650,207.90
股利收益	6.4.7.14	5,149,991.16	4,259,954.61
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-3,866,470.72	-35,167,687.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,897.57	501,060.77
减：二、营业总支出		685,538.73	728,595.17
1. 管理人报酬		353,975.22	372,711.06
2. 托管费		117,991.75	124,237.00
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.08	0.35

8. 其他费用	6.4.7.18	213,571.68	231,646.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,515,293.16	-50,188,080.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,515,293.16	-50,188,080.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,515,293.16	-50,188,080.28

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	315,592,316.00	151,941,386.47	467,533,702.47
二、本期期初净资产（基金净值）	315,592,316.00	151,941,386.47	467,533,702.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,000,000.00	-7,837,706.85	-15,837,706.85
（一）、综合收益总额	-	-3,515,293.16	-3,515,293.16
（二）、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）	-8,000,000.00	-4,322,413.69	-12,322,413.69
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	5,390,827.00	15,390,827.00
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-9,713,240.69	-27,713,240.69
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	307,592,316.00	144,103,679.62	451,695,995.62

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	319,592,316.00	258,168,575.11	577,760,891.11
二、本期期初净资产(基金净值)	319,592,316.00	258,168,575.11	577,760,891.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,000,000.00	-60,478,281.16	-84,478,281.16
(一)、综合收益总额	-	-50,188,080.28	-50,188,080.28
(二)、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)	-24,000,000.00	-10,290,200.88	-34,290,200.88
其中：1.基金申购款	110,000,000.00	63,001,033.07	173,001,033.07
2.基金赎回款	-134,000,000.00	-73,291,233.95	-207,291,233.95
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	295,592,316.00	197,690,293.95	493,282,609.95

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：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券基金业协会(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。

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净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	10,284,496.52
等于：本金	10,283,659.66
加：应计利息	836.86
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	10,284,496.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	488,976,935.83	-	438,187,055.94	-50,789,879.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	-	-	-
	市场	-	-	-
	银行间	-	-	-
	市场	-	-	-
合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	488,976,935.83	-	438,187,055.94	-50,789,879.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	11,366,640.00	-	-	-
IC2312	2,339,760.00	-	-	-
IF2312	9,026,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,366,640.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2312	IC2312	2	2,369,680.00	29,920.00
IF2312	IF2312	8	9,233,280.00	206,400.00
合计	-	-	-	236,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	236,320.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	-
应付交易费用	36,018.05
其中：交易所市场	36,018.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	135,798.50
其他应付款	58,090.79
合计	229,907.34

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	315,592,316.00	315,592,316.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-18,000,000.00	-18,000,000.00
本期末	307,592,316.00	307,592,316.00

6.4.7.8 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	238,782,487.19	-86,841,100.72	151,941,386.47
本期利润	351,177.56	-3,866,470.72	-3,515,293.16
本期基金份额交易产生的变动数	-6,091,786.22	1,769,372.53	-4,322,413.69
其中：基金申购款	7,537,347.05	-2,146,520.05	5,390,827.00
基金赎回款	-13,629,133.27	3,915,892.58	-9,713,240.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,041,878.53	-88,938,198.91	144,103,679.62

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,834.26
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	20,505.04
其他	176.95
合计	37,516.25

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,894,550.66
股票投资收益——赎回差价收入	-752,816.62
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	-3,647,367.28

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	55,701,997.89
减：卖出股票成本总额	58,479,662.74
减：交易费用	116,885.81
买卖股票差价收入	-2,894,550.66

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	27,713,240.69
减：现金支付赎回款总额	11,140,999.69
减：赎回股票成本总额	17,325,057.62
减：交易费用	-
赎回差价收入	-752,816.62

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	35.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	39,660.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	39,695.53

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	227,905.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	188,198.65
减：应计利息总额	37.43
减：交易费用	9.13
买卖债券差价收入	39,660.07

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-536,221.80

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,149,991.16
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	5,149,991.16

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-4,423,170.72
——股票投资	-4,423,170.72
——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	556,700.00
——权证投资	-
——期货投资	556,700.00
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	-3,866,470.72

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	1,206.63
替代损益收入	-8,104.20
合计	-6,897.57

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。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	25,291.13
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	125,978.92
银行汇划费	2,794.26
合计	213,571.68

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
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
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	353,975.22	372,711.06
其中：支付销售机构的客户维护费	3,339.38	3,186.88

注：1.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。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	117,991.75	124,237.00

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。

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

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份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	69,800,760.00	22.6926%	68,060,760.00	21.5660%
广发证券股份有	1,556,064.00	0.5059%	2,254,513.00	0.7144%

限公司				
-----	--	--	--	--

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。

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	10,284,496.52	16,834.26	11,789,736.69	19,502.65

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
中银国际证券股份有限公司	301397	溯联股份	新股网下发行	3,487	185,752.49
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02
中银国际证券股份有限公司	600938	中国海油	新股网上发行	3,000	32,400.00
广发证券股份有限公司	600958	东方证券	配股	19,852	167,947.92
中银国际证	113055	成银转债	老股东配	980	98,000.00

券股份有限 公司			债		
-------------	--	--	---	--	--

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券、托管人关联方中银证券发行的 A 股中银证券和托管人中国银行发行的 A 股中国银行。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 65,700 股（2022 年 12 月 31 日:71,600 股），占本基金净值比例为 0.21%(2022 年 12 月 31 日:0.24%)；持有中银证券发行的 A 股中银证券 30,800 股（2022 年 12 月 31 日:33,700 股），占本基金净值比例为 0.07%(2022 年 12 月 31 日:0.08%)；持有中国银行发行的 A 股中国银行 394,700 股（2022 年 12 月 31 日:424,500 股），占本基金净值比例为 0.34%(2022 年 12 月 31 日:0.29%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	627	7,448.76	13,179.54	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	642	24,479.46	19,921.26	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股流通	25.25	19.69	723	18,255.75	14,235.87	-

				受限						
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	673	21,764.82	21,441.78	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,064	15,757.84	14,608.72	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	206	15,130.70	9,607.84	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	615	14,618.55	26,377.35	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	349	18,591.23	14,029.80	-
30139	英特	2023-0	6 个月	新股	43.99	51.57	293	12,889	15,110	-

9	科技	5-16		流通受限				.07	.01	
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	658	13,153.42	11,120.20	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	2,879	166,003.14	166,003.14	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	320	18,451.20	18,451.20	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月以内	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,441	9,481.78	10,922.78	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	606	6,278.16	7,175.04	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	462	5,386.92	5,664.12	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	159	4,130.82	3,900.27	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	479	8,526.20	8,569.31	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

60317 2	万丰 股份	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	14.58	16.13	122	1,778. 76	1,967. 86	-
68814 6	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	486	17,568 .90	18,531 .18	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	2,987	59,321 .82	53,945 .22	-
68833 4	西高 院	2023-0 6-09	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	888	12,574 .08	14,394 .48	-
68835 2	硕中 科技	2023-0 4-11	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	1,425	17,242 .50	17,199 .75	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	452	10,667 .20	29,230 .84	-
68842 9	时创 能源	2023-0 6-20	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643. 20	8,833. 38	-
68843 3	华曙 高科	2023-0 4-07	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143 .88	13,167 .00	-
68844 3	智翔 金泰	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	1,014	38,410 .32	29,902 .86	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	5,589	31,801 .41	30,236 .49	-
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	1,844	20,468 .40	31,421 .76	-
68847 8	晶升 股份	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	32.52	42.37	402	13,073 .04	17,032 .74	-
68847 9	友车 科技	2023-0 5-04	6 个月	新股 流通 受限	33.99	29.49	332	11,284 .68	9,790. 68	-
68850 7	索辰 科技	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	245.56	122.11	121	20,135 .92	14,775 .31	-
68852 3	航天 环宇	2023-0 5-26	6 个月	新股 流通	21.86	23.85	472	10,317 .92	11,257 .20	-

				受限						
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	168	25,599.84	22,842.96	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	707	14,967.19	16,614.50	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	573	17,338.98	14,514.09	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	117	14,718.60	13,809.51	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	501	13,396.74	20,380.68	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	135	16,993.80	11,716.65	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
601916	浙商银行	2023-06-27	1 个月以内	配股流通受限	2.02	2.64	55,680	112,473.60	146,995.20	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2023 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。

6.4.13.2 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。于 2023 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%(2022 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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023 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(净资产)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。

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，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。

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 2023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	10,284,496.52	-	-	-	10,284,496.52
结算备付金	2,267,205.07	-	-	-	2,267,205.07
存出保证金	1,402,390.29	-	-	-	1,402,390.29
交易性金融资产	-	-	-	438,187,055.94	438,187,055.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,418.49	7,418.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,954,091.88	-	-	438,194,474.43	452,148,566.31

					1
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	148,404.60	148,404.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	55,694.08	55,694.08
应付托管费	-	-	-	18,564.67	18,564.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	229,907.34	229,907.34
负债总计	-	-	-	452,570.69	452,570.69
利率敏感度缺口	13,954,091.88	-	-	437,741,903.74	451,695,995.62
上年度末 2022 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	10,731,413.46	-	-	-	10,731,413.46
结算备付金	2,141,777.67	-	-	-	2,141,777.67
存出保证金	1,478,421.62	-	-	-	1,478,421.62
交易性金融资产	-	-	-	453,794,004.89	453,794,004.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,351,612.75	-	-	453,794,004.89	468,145,617.6

					4
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	263,097.69	263,097.69
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	59,882.33	59,882.33
应付托管费	-	-	-	19,960.78	19,960.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	268,974.32	268,974.32
负债总计	-	-	-	611,915.17	611,915.17
利率敏感度缺口	14,351,612.75	-	-	453,182,089.72	467,533,702.47

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	438,187,055.94	97.01	453,794,004.89	97.06
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	438,187,055.94	97.01	453,794,004.89	97.06

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	21,848,897.15	22,614,367.19
	2.业绩比较基准下降 5%	-21,848,897.15	-22,614,367.19

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	436,713,158.25

第二层次	514,602.78
第三层次	959,294.91
合计	438,187,055.94

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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、债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	438,187,055.94	96.91
	其中：股票	438,187,055.94	96.91
2	基金投资	-	-
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	12,551,701.59	2.78
8	其他各项资产	1,409,808.78	0.31
9	合计	452,148,566.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,686,714.60	1.04
B	采矿业	19,299,161.47	4.27
C	制造业	247,793,795.73	54.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,905,799.63	3.74
E	建筑业	9,865,028.23	2.18
F	批发和零售业	4,800,227.13	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	14,691,610.20	3.25
H	住宿和餐饮业	666,848.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,568,717.38	4.78
J	金融业	78,116,294.63	17.29
K	房地产业	6,648,058.43	1.47
L	租赁和商务服务业	4,038,137.74	0.89
M	科学研究和技术服务业	2,966,404.53	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	589,922.07	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	321,950.00	0.07
Q	卫生和社会工作	3,008,136.07	0.67
R	文化、体育和娱乐业	1,634,234.10	0.36
S	综合	586,016.00	0.13
	合计	438,187,055.94	97.01

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	600519	贵州茅台	14,100	23,843,100.00	5.28
2	300750	宁德时代	49,400	11,302,226.00	2.50
3	600036	招商银行	231,787	7,593,342.12	1.68
4	000858	五粮液	43,600	7,131,652.00	1.58
5	600900	长江电力	265,921	5,866,217.26	1.30
6	601318	中国平安	121,709	5,647,297.60	1.25
7	002594	比亚迪	20,400	5,268,708.00	1.17
8	300760	迈瑞医疗	13,577	4,070,384.60	0.90
9	601166	兴业银行	233,457	3,653,602.05	0.81
10	000568	泸州老窖	16,500	3,457,905.00	0.77
11	600276	恒瑞医药	71,373	3,418,766.70	0.76
12	601398	工商银行	704,000	3,393,280.00	0.75
13	601288	农业银行	952,600	3,362,678.00	0.74
14	600309	万华化学	35,300	3,100,752.00	0.69
15	601138	工业富联	111,300	2,804,760.00	0.62
16	600030	中信证券	137,265	2,715,101.70	0.60
17	601668	中国建筑	469,980	2,697,685.20	0.60
18	601899	紫金矿业	230,700	2,623,059.00	0.58
19	002475	立讯精密	79,886	2,592,300.70	0.57
20	002714	牧原股份	61,324	2,584,806.60	0.57
21	601328	交通银行	439,849	2,551,124.20	0.56
22	600809	山西汾酒	13,672	2,530,277.04	0.56
23	300059	东方财富	177,725	2,523,695.00	0.56
24	002352	顺丰控股	55,000	2,479,950.00	0.55
25	000001	平安银行	217,500	2,442,525.00	0.54
26	601012	隆基绿能	85,008	2,437,179.36	0.54
27	603288	海天味业	51,956	2,434,138.60	0.54
28	601888	中国中免	21,958	2,427,017.74	0.54
29	688111	金山办公	5,085	2,401,238.70	0.53
30	600000	浦发银行	328,947	2,381,576.28	0.53
31	601088	中国神华	74,100	2,278,575.00	0.50
32	600028	中国石化	356,300	2,266,068.00	0.50
33	002304	洋河股份	16,844	2,212,459.40	0.49
34	600406	国电南瑞	90,237	2,084,474.70	0.46
35	000063	中兴通讯	44,400	2,021,976.00	0.45
36	600887	伊利股份	71,378	2,021,424.96	0.45
37	601601	中国太保	76,957	1,999,342.86	0.44

38	601225	陕西煤业	108,200	1,968,158.00	0.44
39	300015	爱尔眼科	104,797	1,943,984.35	0.43
40	300274	阳光电源	16,600	1,936,058.00	0.43
41	600436	片仔癀	6,753	1,933,789.08	0.43
42	601816	京沪高铁	365,300	1,921,478.00	0.43
43	002371	北方华创	5,900	1,874,135.00	0.41
44	002142	宁波银行	73,920	1,870,176.00	0.41
45	601857	中国石油	240,851	1,799,156.97	0.40
46	603259	药明康德	28,575	1,780,508.25	0.39
47	002230	科大讯飞	26,100	1,773,756.00	0.39
48	601766	中国中车	271,400	1,764,100.00	0.39
49	600048	保利发展	133,600	1,740,808.00	0.39
50	601390	中国中铁	229,200	1,737,336.00	0.38
51	600438	通威股份	50,400	1,729,224.00	0.38
52	600905	三峡能源	320,800	1,722,696.00	0.38
53	000725	京东方 A	420,300	1,719,027.00	0.38
54	600050	中国联通	356,400	1,710,720.00	0.38
55	600690	海尔智家	70,853	1,663,628.44	0.37
56	600150	中国船舶	50,100	1,648,791.00	0.37
57	601818	光大银行	520,100	1,596,707.00	0.35
58	601658	邮储银行	325,900	1,593,651.00	0.35
59	600031	三一重工	95,400	1,586,502.00	0.35
60	002459	晶澳科技	37,016	1,543,567.20	0.34
61	601988	中国银行	394,700	1,543,277.00	0.34
62	000002	万科 A	109,000	1,528,180.00	0.34
63	002129	TCL 中环	45,375	1,506,450.00	0.33
64	601985	中国核电	212,000	1,494,600.00	0.33
65	600016	民生银行	398,480	1,494,300.00	0.33
66	600019	宝钢股份	250,100	1,405,562.00	0.31
67	300014	亿纬锂能	22,891	1,384,905.50	0.31
68	300498	温氏股份	73,620	1,350,927.00	0.30
69	601919	中远海控	143,120	1,345,328.00	0.30
70	688036	传音控股	9,063	1,332,261.00	0.29
71	300308	中际旭创	8,900	1,312,305.00	0.29
72	002493	荣盛石化	112,450	1,308,918.00	0.29
73	603501	韦尔股份	13,200	1,294,128.00	0.29
74	600893	航发动力	29,636	1,252,417.36	0.28
75	601006	大秦铁路	167,100	1,241,553.00	0.27
76	600104	上汽集团	86,500	1,225,705.00	0.27
77	600919	江苏银行	163,966	1,205,150.10	0.27
78	000625	长安汽车	93,088	1,203,627.84	0.27
79	300122	智飞生物	26,950	1,191,190.00	0.26
80	601066	中信建投	48,700	1,178,540.00	0.26
81	601211	国泰君安	83,400	1,166,766.00	0.26

82	000792	盐湖股份	60,300	1,155,951.00	0.26
83	000166	申万宏源	250,100	1,155,462.00	0.26
84	002466	天齐锂业	16,400	1,146,524.00	0.25
85	000651	格力电器	31,200	1,139,112.00	0.25
86	000596	古井贡酒	4,600	1,137,948.00	0.25
87	601688	华泰证券	81,700	1,125,009.00	0.25
88	001979	招商蛇口	85,900	1,119,277.00	0.25
89	600346	恒力石化	78,100	1,119,173.00	0.25
90	600999	招商证券	82,447	1,118,805.79	0.25
91	002460	赣锋锂业	18,160	1,107,033.60	0.25
92	601669	中国电建	191,200	1,097,488.00	0.24
93	688012	中微公司	7,003	1,095,619.35	0.24
94	002027	分众传媒	160,300	1,091,643.00	0.24
95	601169	北京银行	234,700	1,086,661.00	0.24
96	601628	中国人寿	30,779	1,076,033.84	0.24
97	300896	爱美客	2,400	1,067,880.00	0.24
98	000538	云南白药	20,180	1,059,046.40	0.23
99	600585	海螺水泥	44,400	1,054,056.00	0.23
100	300033	同花顺	6,000	1,051,680.00	0.23
101	002812	恩捷股份	10,900	1,050,215.00	0.23
102	600886	国投电力	82,800	1,047,420.00	0.23
103	603993	洛阳钼业	196,100	1,045,213.00	0.23
104	688223	晶科能源	73,996	1,040,383.76	0.23
105	688599	天合光能	24,159	1,029,414.99	0.23
106	300316	晶盛机电	14,500	1,028,050.00	0.23
107	600989	宝丰能源	81,300	1,025,193.00	0.23
108	000938	紫光股份	31,738	1,010,855.30	0.22
109	600845	宝信软件	19,861	1,009,137.41	0.22
110	601689	拓普集团	12,400	1,000,680.00	0.22
111	601360	三六零	79,289	994,284.06	0.22
112	600837	海通证券	107,100	987,462.00	0.22
113	000776	广发证券	65,700	966,447.00	0.21
114	002920	德赛西威	6,200	966,022.00	0.21
115	600111	北方稀土	40,200	963,996.00	0.21
116	600089	特变电工	43,150	961,813.50	0.21
117	600703	三安光电	55,400	955,096.00	0.21
118	601100	恒立液压	14,832	954,142.56	0.21
119	300124	汇川技术	14,800	950,308.00	0.21
120	600547	山东黄金	40,184	943,520.32	0.21
121	000895	双汇发展	38,500	942,865.00	0.21
122	600011	华能国际	101,700	941,742.00	0.21
123	000338	潍柴动力	75,300	938,238.00	0.21
124	600570	恒生电子	21,087	933,943.23	0.21
125	601009	南京银行	114,800	918,400.00	0.20

126	601229	上海银行	157,742	907,016.50	0.20
127	600010	包钢股份	506,000	905,740.00	0.20
128	000425	徐工机械	131,200	888,224.00	0.20
129	002049	紫光国微	9,480	884,010.00	0.20
130	002709	天赐材料	21,300	877,347.00	0.19
131	600085	同仁堂	15,200	874,912.00	0.19
132	002311	海大集团	18,400	861,856.00	0.19
133	002555	三七互娱	24,700	861,536.00	0.19
134	688256	寒武纪	4,571	859,348.00	0.19
135	603659	璞泰来	22,412	856,586.64	0.19
136	601336	新华保险	23,200	853,064.00	0.19
137	600188	兖矿能源	28,200	843,744.00	0.19
138	000963	华东医药	19,440	843,112.80	0.19
139	601868	中国能建	359,900	842,166.00	0.19
140	600600	青岛啤酒	7,927	821,475.01	0.18
141	000100	TCL 科技	208,420	821,174.80	0.18
142	000301	东方盛虹	69,000	815,580.00	0.18
143	603799	华友钴业	17,737	814,305.67	0.18
144	601600	中国铝业	146,700	805,383.00	0.18
145	600958	东方证券	82,952	804,634.40	0.18
146	688303	大全能源	19,836	802,366.20	0.18
147	600660	福耀玻璃	22,235	797,124.75	0.18
148	600015	华夏银行	147,182	796,254.62	0.18
149	600039	四川路桥	80,640	791,078.40	0.18
150	603986	兆易创新	7,440	790,500.00	0.18
151	000977	浪潮信息	16,228	787,058.00	0.17
152	601618	中国中冶	198,100	786,457.00	0.17
153	600588	用友网络	38,122	781,501.00	0.17
154	600926	杭州银行	65,760	772,680.00	0.17
155	601995	中金公司	21,600	767,232.00	0.17
156	603806	福斯特	20,608	766,411.52	0.17
157	688396	华润微	14,553	762,722.73	0.17
158	600795	国电电力	197,900	757,957.00	0.17
159	600221	海航控股	475,600	751,448.00	0.17
160	600029	南方航空	124,600	751,338.00	0.17
161	600674	川投能源	49,500	744,975.00	0.16
162	603369	今世缘	13,900	733,920.00	0.16
163	600196	复星医药	23,600	729,240.00	0.16
164	002236	大华股份	36,900	728,775.00	0.16
165	601865	福莱特	18,800	723,988.00	0.16
166	600426	华鲁恒升	23,586	722,439.18	0.16
167	688008	澜起科技	12,525	719,185.50	0.16
168	601111	中国国航	86,100	709,464.00	0.16
169	300413	芒果超媒	20,710	708,489.10	0.16

170	605117	德业股份	4,720	705,876.00	0.16
171	601607	上海医药	30,800	690,228.00	0.15
172	601633	长城汽车	27,400	689,658.00	0.15
173	601788	光大证券	43,340	688,672.60	0.15
174	600745	闻泰科技	13,800	674,820.00	0.15
175	002241	歌尔股份	38,000	674,500.00	0.15
176	000999	华润三九	11,000	667,260.00	0.15
177	601939	建设银行	106,500	666,690.00	0.15
178	601877	正泰电器	23,900	660,835.00	0.15
179	300433	蓝思科技	55,200	649,152.00	0.14
180	600741	华域汽车	35,000	646,100.00	0.14
181	601727	上海电气	140,400	641,628.00	0.14
182	300999	金龙鱼	16,008	640,159.92	0.14
183	601916	浙商银行	241,280	636,979.20	0.14
184	688126	沪硅产业	30,315	633,583.50	0.14
185	603392	万泰生物	9,450	630,976.50	0.14
186	600176	中国巨石	44,479	629,822.64	0.14
187	600023	浙能电力	124,000	628,680.00	0.14
188	002602	世纪华通	82,760	628,148.40	0.14
189	600009	上海机场	13,800	626,796.00	0.14
190	601021	春秋航空	10,900	626,423.00	0.14
191	600732	爱旭股份	20,300	624,225.00	0.14
192	300408	三环集团	21,200	622,220.00	0.14
193	002736	国信证券	71,100	620,703.00	0.14
194	603260	合盛硅业	8,800	616,176.00	0.14
195	600584	长电科技	19,700	614,049.00	0.14
196	601319	中国人保	105,100	613,784.00	0.14
197	000661	长春高新	4,500	613,350.00	0.14
198	601127	赛力斯	16,600	610,382.00	0.14
199	600027	华电国际	90,700	606,783.00	0.13
200	600115	中国东航	126,700	603,092.00	0.13
201	600522	中天科技	37,900	602,989.00	0.13
202	002050	三花智控	19,900	602,174.00	0.13
203	601901	方正证券	91,400	597,756.00	0.13
204	000876	新希望	50,300	587,504.00	0.13
205	601377	兴业证券	95,830	586,479.60	0.13
206	601825	沪农商行	107,000	583,150.00	0.13
207	300782	卓胜微	6,016	581,326.08	0.13
208	600875	东方电气	30,800	574,420.00	0.13
209	000983	山西焦煤	62,940	572,754.00	0.13
210	601238	广汽集团	54,700	569,974.00	0.13
211	601117	中国化学	67,900	562,212.00	0.12
212	002252	上海莱士	74,800	561,748.00	0.12
213	002648	卫星化学	37,469	560,536.24	0.12

214	600233	圆通速递	38,200	556,192.00	0.12
215	000733	振华科技	5,800	555,930.00	0.12
216	600489	中金黄金	53,800	555,754.00	0.12
217	601881	中国银河	47,700	553,797.00	0.12
218	600803	新奥股份	28,700	544,726.00	0.12
219	002074	国轩高科	19,700	544,114.00	0.12
220	603833	欧派家居	5,664	542,611.20	0.12
221	601699	潞安环能	33,200	541,824.00	0.12
222	002600	领益智造	78,100	539,671.00	0.12
223	002180	纳思达	15,700	537,725.00	0.12
224	300418	昆仑万维	13,300	535,724.00	0.12
225	600918	中泰证券	77,300	534,143.00	0.12
226	000157	中联重科	78,700	531,225.00	0.12
227	300751	迈为股份	3,128	529,820.64	0.12
228	002001	新和成	34,276	527,850.40	0.12
229	601872	招商轮船	90,200	522,258.00	0.12
230	002841	视源股份	7,800	521,352.00	0.12
231	300454	深信服	4,600	520,950.00	0.12
232	002938	鹏鼎控股	21,400	519,806.00	0.12
233	600415	小商品城	60,900	519,477.00	0.12
234	300832	新产业	8,800	519,200.00	0.11
235	600515	海南机场	126,900	515,214.00	0.11
236	600061	国投资本	71,308	507,712.96	0.11
237	601838	成都银行	41,500	506,715.00	0.11
238	688777	中控技术	7,985	501,298.30	0.11
239	600256	广汇能源	72,888	500,011.68	0.11
240	600332	白云山	15,632	498,348.16	0.11
241	603486	科沃斯	6,400	497,728.00	0.11
242	600161	天坛生物	18,300	496,845.00	0.11
243	000066	中国长城	35,800	495,114.00	0.11
244	002384	东山精密	19,000	492,100.00	0.11
245	688363	华熙生物	5,504	490,736.64	0.11
246	000807	云铝股份	38,500	490,105.00	0.11
247	300628	亿联网络	13,960	489,577.20	0.11
248	600132	重庆啤酒	5,300	488,448.00	0.11
249	600026	中远海能	38,600	487,904.00	0.11
250	600079	人福医药	18,100	487,614.00	0.11
251	603345	安井食品	3,300	484,440.00	0.11
252	002422	科伦药业	16,300	483,784.00	0.11
253	300496	中科创达	5,000	481,750.00	0.11
254	002603	以岭药业	18,540	476,292.60	0.11
255	600460	士兰微	15,700	475,239.00	0.11
256	603198	迎驾贡酒	7,400	472,120.00	0.10
257	300142	沃森生物	17,800	470,810.00	0.10

258	300003	乐普医疗	20,800	470,288.00	0.10
259	300223	北京君正	5,300	468,043.00	0.10
260	688009	中国通号	79,702	462,271.60	0.10
261	603899	晨光股份	10,300	459,792.00	0.10
262	600702	舍得酒业	3,700	458,615.00	0.10
263	000786	北新建材	18,700	458,337.00	0.10
264	300763	锦浪科技	4,400	458,040.00	0.10
265	603688	石英股份	4,000	455,360.00	0.10
266	002007	华兰生物	20,190	452,457.90	0.10
267	300146	汤臣倍健	18,800	450,824.00	0.10
268	600536	中国软件	9,590	449,579.20	0.10
269	002601	龙佰集团	26,600	438,900.00	0.10
270	002821	凯莱英	3,720	438,439.20	0.10
271	600362	江西铜业	23,100	438,438.00	0.10
272	300724	捷佳伟创	3,900	438,165.00	0.10
273	002463	沪电股份	20,910	437,855.40	0.10
274	600754	锦江酒店	10,200	431,868.00	0.10
275	002916	深南电路	5,720	431,116.40	0.10
276	300037	新宙邦	8,280	429,649.20	0.10
277	601878	浙商证券	43,100	425,828.00	0.09
278	000988	华工科技	11,200	425,712.00	0.09
279	601615	明阳智能	25,200	425,376.00	0.09
280	002568	百润股份	11,628	422,677.80	0.09
281	300661	圣邦股份	5,135	421,737.55	0.09
282	300759	康龙化成	11,000	421,080.00	0.09
283	603939	益丰药房	11,337	419,469.00	0.09
284	300957	贝泰妮	4,700	417,736.00	0.09
285	600160	巨化股份	30,000	413,400.00	0.09
286	603290	斯达半导	1,900	408,880.00	0.09
287	002202	金风科技	38,346	407,234.52	0.09
288	600018	上港集团	77,500	406,875.00	0.09
289	002738	中矿资源	7,936	404,259.84	0.09
290	002223	鱼跃医疗	11,200	403,088.00	0.09
291	002028	思源电气	8,600	401,792.00	0.09
292	000069	华侨城 A	91,000	400,400.00	0.09
293	002558	巨人网络	22,300	399,839.00	0.09
294	601958	金铂股份	35,800	399,170.00	0.09
295	688122	西部超导	7,162	399,138.26	0.09
296	600487	亨通光电	27,200	398,752.00	0.09
297	688521	芯原股份	5,496	395,272.32	0.09
298	000408	藏格矿业	17,500	394,975.00	0.09
299	002340	格林美	57,000	393,870.00	0.09
300	603444	吉比特	800	392,888.00	0.09
301	600219	南山铝业	130,000	392,600.00	0.09

301	603882	金域医学	5,200	392,600.00	0.09
303	000729	燕京啤酒	31,300	390,311.00	0.09
304	688561	奇安信	7,533	390,284.73	0.09
305	000423	东阿阿胶	7,300	390,185.00	0.09
306	601058	赛轮轮胎	34,000	387,260.00	0.09
307	002294	信立泰	12,400	386,756.00	0.09
308	688099	晶晨股份	4,578	386,016.96	0.09
309	601555	东吴证券	55,559	385,579.46	0.09
310	601216	君正集团	93,600	383,760.00	0.08
311	601799	星宇股份	3,100	383,160.00	0.08
312	002080	中材科技	18,600	381,672.00	0.08
313	600884	杉杉股份	25,200	381,528.00	0.08
314	600642	申能股份	54,500	380,955.00	0.08
315	002156	通富微电	16,800	379,680.00	0.08
316	603885	吉祥航空	24,600	379,578.00	0.08
317	002409	雅克科技	5,200	378,976.00	0.08
318	002064	华峰化学	55,100	377,986.00	0.08
319	002430	杭氧股份	11,000	377,960.00	0.08
320	603606	东方电缆	7,700	377,531.00	0.08
321	603737	三棵树	5,768	377,342.56	0.08
322	600004	白云机场	26,300	377,142.00	0.08
323	600705	中航产融	98,100	375,723.00	0.08
324	688063	派能科技	1,893	375,287.25	0.08
325	002756	永兴材料	5,970	373,781.70	0.08
326	600970	中材国际	29,300	373,575.00	0.08
327	300919	中伟股份	6,200	373,550.00	0.08
328	000629	钒钛股份	95,400	373,014.00	0.08
329	601108	财通证券	51,450	372,498.00	0.08
330	600183	生益科技	26,000	369,200.00	0.08
331	002414	高德红外	47,303	367,544.31	0.08
332	002625	光启技术	24,000	366,240.00	0.08
333	000932	华菱钢铁	76,700	365,859.00	0.08
334	002939	长城证券	44,800	364,224.00	0.08
335	601966	玲珑轮胎	16,375	363,852.50	0.08
336	002372	伟星新材	17,700	363,558.00	0.08
337	600153	建发股份	33,300	363,303.00	0.08
338	002624	完美世界	21,450	362,290.50	0.08
339	000723	美锦能源	48,000	361,920.00	0.08
340	601155	新城控股	25,060	361,114.60	0.08
341	000975	银泰黄金	30,840	360,828.00	0.08
342	600383	金地集团	50,023	360,665.83	0.08
343	300144	宋城演艺	28,980	359,352.00	0.08
344	600109	国金证券	41,400	358,938.00	0.08
345	600606	绿地控股	130,000	357,500.00	0.08

346	603596	伯特利	4,500	356,670.00	0.08
347	603233	大参林	12,720	356,287.20	0.08
348	000738	航发控制	14,600	356,240.00	0.08
349	000783	长江证券	61,400	356,120.00	0.08
350	601233	桐昆股份	26,800	355,100.00	0.08
351	002153	石基信息	25,256	353,584.00	0.08
352	601077	渝农商行	98,200	352,538.00	0.08
353	600298	安琪酵母	9,700	351,237.00	0.08
354	600157	永泰能源	246,600	350,172.00	0.08
355	000027	深圳能源	52,880	348,479.20	0.08
356	603816	顾家家居	9,130	348,309.50	0.08
357	603156	养元饮品	14,100	348,270.00	0.08
358	688220	翱捷科技	4,612	347,698.68	0.08
359	600096	云天化	20,300	346,521.00	0.08
360	300487	蓝晓科技	5,550	346,431.00	0.08
361	601577	长沙银行	44,600	346,096.00	0.08
362	000021	深科技	17,300	345,827.00	0.08
363	000032	深桑达 A	10,500	345,450.00	0.08
364	000009	中国宝安	28,600	345,202.00	0.08
365	002850	科达利	2,600	343,850.00	0.08
366	600563	法拉电子	2,500	343,250.00	0.08
367	688516	奥特维	1,818	342,511.20	0.08
368	300769	德方纳米	3,100	341,713.00	0.08
369	603658	安图生物	6,600	341,418.00	0.08
370	600763	通策医疗	3,500	339,010.00	0.08
371	603185	弘元绿能	4,540	338,457.00	0.07
372	688301	奕瑞科技	1,197	338,068.71	0.07
373	000630	铜陵有色	116,800	337,552.00	0.07
374	600352	浙江龙盛	36,100	337,535.00	0.07
375	600021	上海电力	31,300	337,101.00	0.07
376	601990	南京证券	40,900	334,562.00	0.07
377	300207	欣旺达	20,500	334,560.00	0.07
378	688187	时代电气	7,983	334,168.38	0.07
379	300390	天华新能	9,280	332,224.00	0.07
380	002078	太阳纸业	31,000	331,390.00	0.07
381	688169	石头科技	1,033	331,262.44	0.07
382	603589	口子窖	6,700	330,645.00	0.07
383	603568	伟明环保	18,820	329,538.20	0.07
384	002128	电投能源	24,900	329,178.00	0.07
385	601696	中银证券	30,800	328,328.00	0.07
386	002056	横店东磁	18,000	327,780.00	0.07
387	002185	华天科技	35,500	326,600.00	0.07
388	688032	禾迈股份	919	326,382.85	0.07
389	600511	国药股份	8,400	326,340.00	0.07

390	601880	辽港股份	209,000	326,040.00	0.07
391	688390	固德威	1,953	325,877.58	0.07
392	688180	君实生物	8,449	325,624.46	0.07
393	300118	东方日升	12,700	325,501.00	0.07
394	002240	盛新锂能	10,200	325,074.00	0.07
395	000933	神火股份	25,000	325,000.00	0.07
396	000799	酒鬼酒	3,600	324,540.00	0.07
397	600779	水井坊	5,500	324,445.00	0.07
398	600177	雅戈尔	51,300	323,703.00	0.07
399	002152	广电运通	27,600	323,472.00	0.07
400	300604	长川科技	6,800	322,932.00	0.07
401	000831	中国稀土	10,900	322,640.00	0.07
402	002607	中公教育	68,500	321,950.00	0.07
403	600998	九州通	30,992	321,696.96	0.07
404	600872	中炬高新	8,700	320,073.00	0.07
405	600378	昊华科技	8,500	319,940.00	0.07
406	603338	浙江鼎力	5,700	319,257.00	0.07
407	600546	山煤国际	22,000	318,340.00	0.07
408	600848	上海临港	26,620	318,109.00	0.07
409	600985	淮北矿业	27,600	317,952.00	0.07
410	600348	华阳股份	40,050	316,795.50	0.07
411	688188	柏楚电子	1,677	316,215.12	0.07
412	000728	国元证券	48,400	315,568.00	0.07
413	300601	康泰生物	12,420	315,343.80	0.07
414	601933	永辉超市	100,700	315,191.00	0.07
415	002673	西部证券	49,600	314,960.00	0.07
416	002532	天山铝业	51,600	309,084.00	0.07
417	002044	美年健康	43,426	308,758.86	0.07
418	002120	韵达股份	32,170	307,545.20	0.07
419	688536	思瑞浦	1,409	307,162.00	0.07
420	002405	四维图新	26,400	305,712.00	0.07
421	601231	环旭电子	20,400	305,184.00	0.07
422	002531	天顺风能	20,000	304,600.00	0.07
423	002244	滨江集团	34,500	304,290.00	0.07
424	601991	大唐发电	91,700	303,527.00	0.07
425	002739	万达电影	24,200	303,468.00	0.07
426	600521	华海药业	16,470	303,212.70	0.07
427	002385	大北农	45,900	302,940.00	0.07
428	002032	苏泊尔	6,000	300,000.00	0.07
429	300595	欧普康视	9,930	299,786.70	0.07
430	600566	济川药业	10,300	299,112.00	0.07
431	600549	厦门钨业	15,700	298,771.00	0.07
432	600486	扬农化工	3,400	297,228.00	0.07
433	600655	豫园股份	43,300	297,038.00	0.07

434	000987	越秀资本	46,393	294,595.55	0.07
435	000591	太阳能	43,400	294,252.00	0.07
436	688385	复旦微电	5,869	294,036.90	0.07
437	603613	国联股份	7,960	293,962.80	0.07
438	688728	格科微	18,566	293,714.12	0.07
439	600873	梅花生物	32,600	291,118.00	0.06
440	300395	菲利华	5,900	290,280.00	0.06
441	301236	软通动力	10,650	289,786.50	0.06
442	600481	双良节能	20,700	289,386.00	0.06
443	000683	远兴能源	40,200	289,038.00	0.06
444	000800	一汽解放	34,400	287,928.00	0.06
445	601198	东兴证券	35,800	287,116.00	0.06
446	300073	当升科技	5,700	286,881.00	0.06
447	600583	海油工程	49,000	286,650.00	0.06
448	002353	杰瑞股份	11,400	286,482.00	0.06
449	600704	物产中大	57,700	285,038.00	0.06
450	300699	光威复材	9,220	284,437.00	0.06
451	000960	锡业股份	18,200	283,010.00	0.06
452	000519	中兵红箭	15,500	280,395.00	0.06
453	605358	立昂微	7,600	279,148.00	0.06
454	601168	西部矿业	26,500	278,515.00	0.06
455	603893	瑞芯微	3,800	276,830.00	0.06
456	000513	丽珠集团	7,100	276,261.00	0.06
457	300676	华大基因	4,600	275,954.00	0.06
458	000703	恒逸石化	40,680	275,810.40	0.06
459	600141	兴发集团	12,400	275,528.00	0.06
460	603456	九洲药业	10,000	273,800.00	0.06
461	601866	中远海发	109,800	271,206.00	0.06
462	600380	健康元	21,300	270,723.00	0.06
463	688005	容百科技	4,988	269,451.76	0.06
464	600369	西南证券	73,800	269,370.00	0.06
465	600699	均胜电子	15,200	268,128.00	0.06
466	002508	老板电器	10,600	268,074.00	0.06
467	300347	泰格医药	4,150	267,841.00	0.06
468	002966	苏州银行	40,700	266,585.00	0.06
469	002797	第一创业	46,600	266,552.00	0.06
470	600170	上海建工	98,900	266,041.00	0.06
471	002465	海格通信	25,600	264,704.00	0.06
472	002299	圣农发展	13,800	264,270.00	0.06
473	601016	节能风电	71,910	263,909.70	0.06
474	603517	绝味食品	7,100	263,765.00	0.06
475	300251	光线传媒	32,500	262,925.00	0.06
476	600038	中直股份	6,600	262,812.00	0.06
477	600598	北大荒	19,700	262,601.00	0.06

478	600516	方大炭素	42,306	262,297.20	0.06
479	002268	电科网安	9,400	261,978.00	0.06
480	002518	科士达	6,500	260,065.00	0.06
481	603712	七一二	8,600	259,806.00	0.06
482	000709	河钢股份	114,800	259,448.00	0.06
483	603529	爱玛科技	8,000	257,760.00	0.06
484	601636	旗滨集团	29,800	256,876.00	0.06
485	002831	裕同科技	10,400	253,656.00	0.06
486	002145	中核钛白	42,955	253,004.95	0.06
487	600688	上海石化	81,300	252,843.00	0.06
488	603858	步长制药	12,257	252,371.63	0.06
489	000937	冀中能源	39,300	250,734.00	0.06
490	002065	东华软件	35,500	250,630.00	0.06
491	000050	深天马 A	27,300	250,614.00	0.06
492	600559	老白干酒	10,200	250,002.00	0.06
493	600392	盛和资源	19,400	249,678.00	0.06
494	600988	赤峰黄金	18,400	247,664.00	0.05
495	002266	浙富控股	59,600	246,148.00	0.05
496	000825	太钢不锈	63,600	246,132.00	0.05
497	300212	易华录	7,400	245,902.00	0.05
498	600499	科达制造	21,600	245,376.00	0.05
499	300438	鹏辉能源	5,100	245,004.00	0.05
500	300568	星源材质	14,185	243,840.15	0.05
501	688779	长远锂科	21,468	241,944.36	0.05
502	002926	华西证券	29,100	241,821.00	0.05
503	603707	健友股份	17,885	241,447.50	0.05
504	601456	国联证券	26,500	241,150.00	0.05
505	600673	东阳光	33,400	240,814.00	0.05
506	300373	扬杰科技	5,900	239,363.00	0.05
507	603077	和邦生物	98,100	238,383.00	0.05
508	000893	亚钾国际	10,300	236,282.00	0.05
509	000155	川能动力	16,400	236,160.00	0.05
510	002407	多氟多	11,880	235,936.80	0.05
511	002507	涪陵榨菜	12,870	235,649.70	0.05
512	600258	首旅酒店	12,400	234,980.00	0.05
513	002791	坚朗五金	3,600	232,956.00	0.05
514	000739	普洛药业	13,100	232,394.00	0.05
515	002497	雅化集团	12,800	227,584.00	0.05
516	002176	江特电机	18,900	225,288.00	0.05
517	002541	鸿路钢构	7,810	225,006.10	0.05
518	000830	鲁西化工	21,300	224,928.00	0.05
519	000998	隆平高科	14,600	224,110.00	0.05
520	002500	山西证券	39,890	222,586.20	0.05
521	300558	贝达药业	4,618	221,802.54	0.05

522	688002	睿创微纳	4,931	220,908.80	0.05
523	002487	大金重工	7,100	218,964.00	0.05
524	603218	日月股份	11,500	218,385.00	0.05
525	000401	冀东水泥	29,500	217,415.00	0.05
526	600056	中国医药	16,620	215,727.60	0.05
527	002138	顺络电子	9,000	215,190.00	0.05
528	300529	健帆生物	9,050	209,779.00	0.05
529	603127	昭衍新药	5,052	206,626.80	0.05
530	601992	金隅集团	92,500	201,650.00	0.04
531	002408	齐翔腾达	31,500	200,655.00	0.04
532	300357	我武生物	5,800	195,054.00	0.04
533	002192	融捷股份	2,900	193,807.00	0.04
534	601666	平煤股份	25,700	193,778.00	0.04
535	600801	华新水泥	15,100	186,485.00	0.04
536	002092	中泰化学	28,900	186,405.00	0.04
537	600338	西藏珠峰	10,200	186,252.00	0.04
538	600885	宏发股份	5,843	186,099.55	0.04
539	301486	致尚科技	3,199	184,454.34	0.04
540	300363	博腾股份	6,100	180,499.00	0.04
541	603866	桃李面包	17,742	179,549.04	0.04
542	002030	达安基因	15,596	155,492.12	0.03
543	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
544	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
545	688249	晶合集成	2,987	53,945.22	0.01
546	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
547	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
548	688472	阿特斯	1,844	31,421.76	0.01
549	688469	中芯集成	5,589	30,236.49	0.01
550	688443	智翔金泰	1,014	29,902.86	0.01
551	688361	中科飞测	452	29,230.84	0.01
552	301358	湖南裕能	615	26,377.35	0.01
553	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
554	688531	日联科技	168	22,842.96	0.01
555	301307	美利信	673	21,441.78	0.00
556	688582	芯动联科	501	20,380.68	0.00
557	301291	明阳电气	642	19,921.26	0.00
558	688146	中船特气	486	18,531.18	0.00
559	688352	顾中科技	1,425	17,199.75	0.00
560	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
561	688552	航天南湖	707	16,614.50	0.00
562	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
563	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
564	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
565	688507	索辰科技	121	14,775.31	0.00

566	301332	德尔玛	1,064	14,608.72	0.00
567	688570	天玛智控	573	14,514.09	0.00
568	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
569	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
570	301305	朗坤环境	723	14,235.87	0.00
571	301397	溯联股份	349	14,029.80	0.00
572	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
573	688581	安杰思	117	13,809.51	0.00
574	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
575	001287	中电港	627	13,179.54	0.00
576	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
577	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
578	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
579	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
580	688623	二元科技	135	11,716.65	0.00
581	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
582	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
583	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
584	301439	泓淋电力	658	11,120.20	0.00
585	601061	中信金属	1,441	10,922.78	0.00
586	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
587	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
588	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
589	301345	涛涛车业	206	9,607.84	0.00
590	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
591	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
592	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
593	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
594	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
595	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
596	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
597	603135	中重科技	479	8,569.31	0.00
598	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
599	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
600	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
601	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
602	601065	江盐集团	606	7,175.04	0.00
603	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
604	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
605	601133	柏诚股份	462	5,664.12	0.00
606	603125	常青科技	159	3,900.27	0.00
607	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
608	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
609	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00

610	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
611	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
612	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
613	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值 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	601816	京沪高铁	2,077,098.00	0.44
2	688256	寒武纪	1,121,047.02	0.24
3	600886	国投电力	1,071,155.00	0.23
4	600703	三安光电	1,060,717.00	0.23
5	688223	晶科能源	918,108.81	0.20
6	688303	大全能源	825,084.91	0.18
7	600221	海航控股	792,964.00	0.17
8	300418	昆仑万维	750,664.00	0.16
9	600519	贵州茅台	712,616.00	0.15
10	300750	宁德时代	671,797.00	0.14
11	688126	沪硅产业	660,522.39	0.14
12	600023	浙能电力	632,518.00	0.14
13	601901	方正证券	622,524.00	0.13
14	601021	春秋航空	608,542.00	0.13
15	603688	石英股份	602,039.00	0.13
16	688249	晶合集成	593,079.18	0.13
17	600489	中金黄金	592,128.00	0.13
18	600702	舍得酒业	573,820.00	0.12
19	600515	海南机场	545,255.00	0.12
20	600732	爱旭股份	545,016.00	0.12

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	1,859,763.00	0.40
2	300750	宁德时代	1,576,022.40	0.34
3	300124	汇川技术	1,093,628.00	0.23
4	000858	五粮液	1,078,428.00	0.23
5	002594	比亚迪	701,386.00	0.15

6	600036	招商银行	621,194.00	0.13
7	300760	迈瑞医疗	592,571.00	0.13
8	688249	晶合集成	585,504.76	0.13
9	002013	中航机电	515,148.00	0.11
10	000568	泸州老窖	511,264.00	0.11
11	688475	萤石网络	489,551.78	0.10
12	001286	陕西能源	469,979.00	0.10
13	601318	中国平安	446,586.00	0.10
14	300059	东方财富	392,752.00	0.08
15	002352	顺丰控股	378,123.00	0.08
16	000001	平安银行	371,853.00	0.08
17	002371	北方华创	331,784.00	0.07
18	002304	洋河股份	330,406.00	0.07
19	688443	智翔金泰	328,342.08	0.07
20	688469	中芯集成	317,883.36	0.07

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	55,604,064.13
卖出股票收入（成交）总额	55,701,997.89

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业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、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。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、中国人民银行的处罚。中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,402,390.29
2	应收清算款	7,418.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,409,808.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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
3,726	82,552.96	157,613,486 .00	51.24%	149,978,83 0.00	48.76%	69,800,760. 00	22.69%

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一易方达 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。

8.2 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一兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	34,364,700.00	11.17%
2	竞技世界（北京）网络技术有限公司	20,923,200.00	6.80%
3	陈建敏	10,000,000.00	3.25%
4	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	3.25%
5	招商银行股份有限公司一兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）	3,806,900.00	1.24%
6	韩静兰	3,521,700.00	1.14%
7	贾文琳	3,000,000.00	0.98%
8	罗月中	2,759,400.00	0.90%
9	中国平安财产保险股份有限公司一传统一普通保险产品	2,705,200.00	0.88%
10	东方证券股份有限公司	2,658,355.00	0.86%
11	中国银行股份有限公司一易方达 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	69,800,760.00	22.69%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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%
------------------	------	---------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

§ 9 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	315,592,316.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	307,592,316.00

§ 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 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

长江证券	2	-	-	-	-	-
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	17,247,175.24	17.02%	8,624.67	17.02%	-
高盛高华	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	27,712,747.14	27.34%	13,857.51	27.34%	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	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	2	-	-	-	-	-
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	56,156,971.35	55.41%	28,078.69	55.40%	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	236,855.00	0.23%	118.43	0.23%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能

力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	36,882.52	16.18%	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
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	191,022.76	83.82%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东海证券为一级交易商的公告	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	2023-03-01
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中金财富为一级交易商的公告	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	2023-03-17
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为一级交易商的公告	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	2023-03-29
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
8	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	2023-04-22
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	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	2023-05-26
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	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	2023-06-06

11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-06-15
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	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	2023-06-16

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
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	1	2023 年 01 月 01 日~2023 年 06 月 30 日	68,060,760.00	7,160,000.00	5,420,000.00	69,800,760.00	22.69%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 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

二〇二三年八月三十日