

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

2024 年年度报告

2024 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：二〇二五年三月三十一日

§ 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 2025 年 3 月 27 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。德勤华永会计师事务所（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 2024 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	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12	投资组合报告附注	68
§ 9	基金份额持有人信息	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末上市基金前十名持有人	70
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§ 10	开放式基金份额变动	71
§ 11	重大事件揭示	71
11.1	基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4	基金投资策略的改变	71
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8	其他重大事件	75
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1	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	76
§ 13	备查文件目录	77
13.1	备查文件目录	77
13.2	存放地点	77
13.3	查阅方式	77

§ 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	281,592,316.00 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	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; 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
邮政编码		510620; 519031	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-16,302,291.18	1,893,385.19	-18,083,001.76
本期利润	71,051,721.91	-41,387,225.37	-109,189,821.31
加权平均基金份额本期利润	0.2304	-0.1325	-0.3481
本期加权平均净值利润率	16.36%	-8.99%	-22.42%
本期基金份额净值增长率	16.86%	-9.08%	-18.06%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	161,633,558.95	112,948,079.42	151,941,386.47
期末可供分配基金份额利润	0.5740	0.3469	0.4814
期末基金资产净值	443,225,874.95	438,540,395.42	467,533,702.47
期末基金份额净值	1.5740	1.3469	1.4814
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	57.40%	34.69%	48.14%

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
过去三个月	-1.40%	1.70%	-2.47%	1.71%	1.07%	-0.01%
过去六个月	15.14%	1.65%	12.14%	1.66%	3.00%	-0.01%
过去一年	16.86%	1.36%	12.14%	1.37%	4.72%	-0.01%
过去三年	-12.93%	1.17%	-22.70%	1.18%	9.77%	-0.01%
过去五年	36.03%	1.23%	1.16%	1.23%	34.87%	0.00%
自基金合同生效起至今	57.40%	1.24%	5.97%	1.25%	51.43%	-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

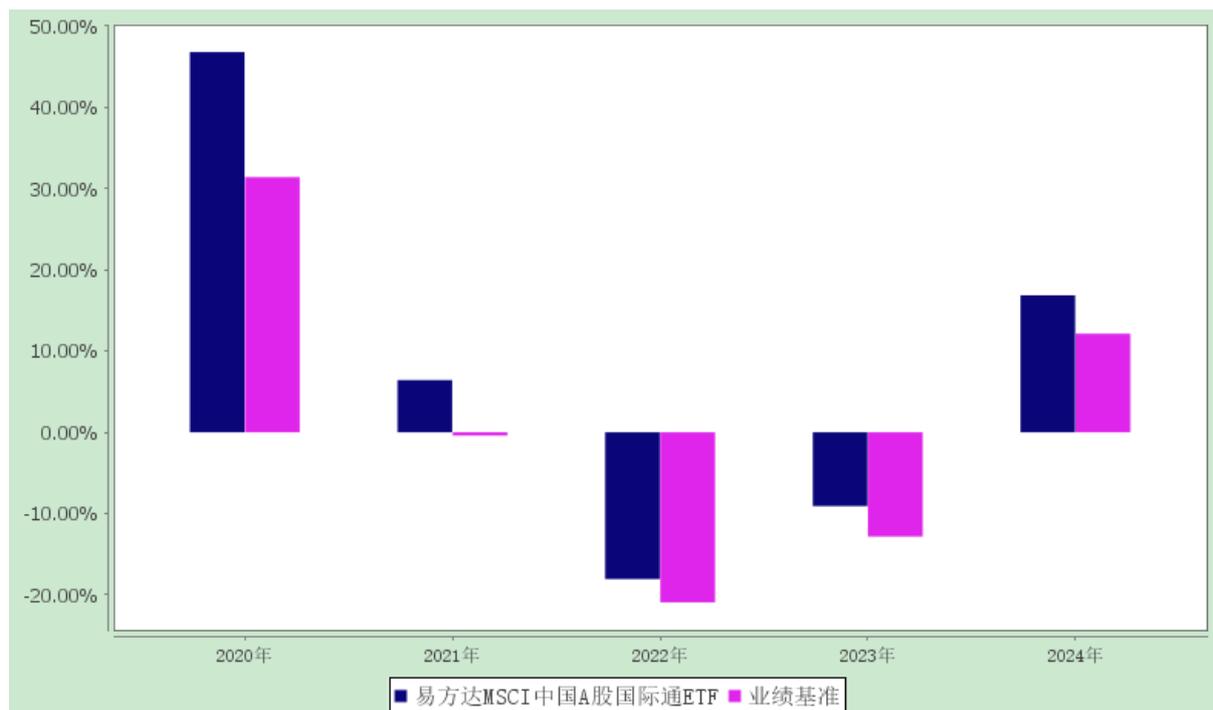
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018 年 5 月 17 日至 2024 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 57.40%，同期业绩比较基准收益率为 5.97%。

3.2.3 过去五年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
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



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。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，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		
宋钊	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、	2020-09-05	-	10 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

贤	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、易方达中证装备产业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证沪港深 300ETF (自 2021 年 09 月 18 日至 2024 年 04 月 26 日)、易方达中证龙头企业指数、易方达北证 50 成份指数、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达 MSCI 美国 50ETF (QDII)、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证 A50ETF、易方达中证家电龙头 ETF 的基金经理助理				持专员、研究员、投资经理助理、投资经理，易方达资产管理 (香港) 有限公司基金经理。
---	--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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。

4.2 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、原则和内容、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和分配机制,通过系统与人工控制相结合的方式,力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待;建立事中和事后的同向交易、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 82 次,其中 73 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,9 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 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。纳入指数的成份股来自 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。

2024 年，我国积极施策应对外部压力加大、内部困难增多的复杂严峻形势，国民经济运行保持了总体平稳、稳中有进的良好态势，产业转型升级稳步推进，高质量发展取得新的成效。中央及时部署出台的一系列增量宏观政策有效提振社会信心，推动经济明显回升。按不变价格计算，全年国内生产总值同比增长 5.0%。制造业发挥了稳定宏观经济大盘“压舱石”的作用，全年规模以上工业增加值同比增长 5.8%。服务业增加值和社会零售品销售保持增长。固定资产投资规模扩大，其中高技术产业投资增长较快。全年货物进出口总额实现较快增长，贸易结构持续优化。

资本市场方面，全面深化改革稳步推进，国务院《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（新“国九条”）和一揽子金融支持经济高质量发展政策相继推出，对资本市场提振效应显著，投资者信心得到有效修复。随着中长期资金入市配套制度逐步落地，投资周期较长的增量资金入市步伐加快，对市场稳定起到有力的支撑作用。2024 年 A 股市场整体呈现震荡上行的走势。行业方面，银行、非银金融、通信等行业表现居前，医药生物、农林牧渔、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，2024 年该指数上涨 12.14%。

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 1.5740 元，本报告期份额净值增长率为 16.86%，同期业绩比较基准收益率为 12.14%。年化跟踪误差 0.55%，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 2025 年，我国将实施更加积极有为的宏观政策，强化各项政策统筹和部门协同，深化改革开放以巩固经济发展的内生动力，以科技创新培育新质生产力，落实保障和增进民生福祉的举措，国民经济长期向好的支撑条件和基本趋势没有改变。我国正处在经济结构转型升级、新旧动能加速

换挡的关键时期，超大规模内需市场、完备的现代化产业体系、强大的研发创新能力、外贸产品国际竞争力突出等众多优势将为下一阶段的经济高质量发展构筑坚实基础。另一方面，全球经济与国际环境日趋错综复杂，我国经济运行仍将面临有效需求不足、重点领域风险隐患防范化解压力较大、外部环境变化引起的不利影响加深等挑战。

指数基金投资于一篮子指数成份公司股票，指数基金的收益与成份公司的经营业绩表现和估值水平紧密相关。作为国民经济各细分领域中体量领先和具备竞争优势的企业，A 股上市公司将充分受益于我国经济的长期成长进程。改革开放的全面深化、基础科学和应用技术创新的突破以及全国统一大市场的建设将推动经济结构进一步优化，为符合新时代发展导向的各类上市公司创造新的利润增长空间。当前 A 股市场主要宽基指数的估值整体上仍处于历史相对较低的水平，具有一定的安全边际，中长期配置价值有望逐步显现。

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发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，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情况如下：

(1) 持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续贯彻落实廉洁从业、执业操守和道德规范等规定。通过开展员工职业道德教育、合规谈话、合规培训和考试等多种形式引导员工珍惜职业声誉、依法履职、恪守职业道德，努力营造风清气正的公司及行业生态。

(2) 通过实现风控系统全面升级，进一步提升投资合规的控制效能。合规及投研交等业务部门协同完善内部制度和流程，贯彻理性投资、价值投资、长期投资的理念，提升公司投资、研究、交易制度建设和内部管理规范。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，巩固控制基础，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化各类法律文件审核流程，提升基金产品材料质效；坚持以实质风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，切实保护投资者合法权益。

(4) 贯彻落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，强化对

社交平台、自媒体账号、社群运营、公开言论等重点领域的管理，避免误导。坚持以投资者利益为核心，持续强化投资者适当性管理，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的合理性和科学性。持续结合业务实践，完善客户投诉处理制度及多元纠纷化解机制，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同中信息披露相关规定，优化完善相关制度流程，明晰各部门和信披岗位的职责分工，强化培训与交流；加强公司级信息披露平台建设，积极探索智能审核系统，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化、智能化水平和合规风险控制能力，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面贯彻反洗钱“风险为本”的工作方法，持续修订完善反洗钱内控制度，建立健全客户尽职调查工作机制，加强洗钱风险识别管控，深入开展系统建设与数据治理，稳步提升反洗钱履职能力和工作水平。

(7) 以法律法规、基金合同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、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、信息技术管理审计、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

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。

4.9 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

德师报(审)字(25)第 P00305 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持有人：

6.1 审计意见

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 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

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。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。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。

6.3 其他信息

易方达基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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。

6.5 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：

(1)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。

(2)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。

(3)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。

(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达 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。

(5)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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

汪芳 江丽雅

中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

2025 年 3 月 26 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	6,428,791.02	10,259,758.59
结算备付金		3,963,362.66	1,646,868.82
存出保证金		1,155,040.41	1,266,328.95
交易性金融资产	7.4.7.2	432,243,846.29	425,798,662.10
其中：股票投资		432,243,846.29	425,798,662.10
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	149,146.42
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		443,791,040.38	439,120,764.88
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		176,398.31	21,887.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,583.14	54,439.56
应付托管费		18,861.04	18,146.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		49,580.55	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	263,742.39	485,896.30
负债合计		565,165.43	580,369.46
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	281,592,316.00	325,592,316.00
未分配利润	7.4.7.8	161,633,558.95	112,948,079.42
净资产合计		443,225,874.95	438,540,395.42
负债和净资产总计		443,791,040.38	439,120,764.88

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5740 元，基金份额总额 281,592,316.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 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
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		72,312,561.80	-40,045,753.95
1.利息收入		76,980.63	70,085.59

其中：存款利息收入	7.4.7.9	76,980.63	70,085.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,052,647.66	3,218,039.84
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-29,153,359.42	-5,689,521.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	11,676.94	69,007.24
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	1,731,675.89	-1,550,813.95
股利收益	7.4.7.14	12,357,358.93	10,389,367.69
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	87,354,013.09	-43,280,610.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-65,784.26	-53,268.82
减：二、营业总支出		1,260,839.89	1,341,471.42
1. 管理人报酬		652,585.83	691,354.21
2. 托管费		217,528.64	230,451.53
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		6,239.53	0.09
8. 其他费用	7.4.7.18	384,485.89	419,665.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		71,051,721.91	-41,387,225.37

列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71,051,721.91	-41,387,225.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		71,051,721.91	-41,387,225.37

7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	325,592,316.00	112,948,079.42	438,540,395.42
二、本期期初净资产	325,592,316.00	112,948,079.42	438,540,395.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44,000,000.00	48,685,479.53	4,685,479.53
（一）、综合收益总额	-	71,051,721.91	71,051,721.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-44,000,000.00	-22,366,242.38	-66,366,242.38
其中：1.基金申购款	16,000,000.00	6,776,360.61	22,776,360.61
2.基金赎回款	-60,000,000.00	-29,142,602.99	-89,142,602.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	281,592,316.00	161,633,558.95	443,225,874.95
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	315,592,316.00	151,941,386.47	467,533,702.47
二、本期期初净资产	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）	10,000,000.00	-38,993,307.05	-28,993,307.05
（一）、综合收益总额	-	-41,387,225.37	-41,387,225.37
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	10,000,000.00	2,393,918.32	12,393,918.32
其中：1.基金申购款	36,000,000.00	16,263,976.43	52,263,976.43
2.基金赎回款	-26,000,000.00	-13,870,058.11	-39,870,058.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	325,592,316.00	112,948,079.42	438,540,395.42

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：王永铿

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、《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》、本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净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方

式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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在初始确认时以公允价值计量。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金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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或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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额，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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率

(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及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，以及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当期损益。

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则按直线法计算。

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。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

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，本基金确定以下以公允价

值计量且其变动计入当期损益的金融资产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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	6,428,791.02	10,259,758.59
等于：本金	6,428,173.41	10,258,805.17
加：应计利息	617.61	953.42
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	6,428,791.02	10,259,758.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	434,815,692.93	-	432,243,846.29	-2,571,846.64
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	434,815,692.93	-	432,243,846.29	-2,571,846.64
项目	上年度末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	515,905,621.83	-	425,798,662.10	-90,106,959.73
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	515,905,621.83	-	425,798,662.10	-90,106,959.73

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 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	9,446,720.00	-	-	-
IC2503	1,165,280.00	-	-	-
IF2503	8,281,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	9,446,720.00	-	-	-
项目	上年度末			
	2023 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	10,320,500.00	-	-	-
IC2403	2,146,280.00	-	-	-
IF2403	8,174,220.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,320,500.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2503	IC2503	1	1,135,080.00	-30,200.00
IF2503	IF2503	7	8,269,800.00	-11,640.00
合计	-	-	-	-41,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-41,840.00
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指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。

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 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	-	-
应付交易费用	4,411.82	3,954.58
其中：交易所市场	4,411.82	3,954.58
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	170,000.00
其他应付款	109,330.57	112,459.78
应付替代款	-	199,481.94
合计	263,742.39	485,896.30

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	325,592,316.00	325,592,316.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-60,000,000.00	-60,000,000.00
本期末	281,592,316.00	281,592,316.00

7.4.7.8 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	248,393,348.74	-135,445,269.32	112,948,079.42
本期期初	248,393,348.74	-135,445,269.32	112,948,079.42
本期利润	-16,302,291.18	87,354,013.09	71,051,721.91
本期基金份额交易产生的变动数	-31,286,858.59	8,920,616.21	-22,366,242.38

其中：基金申购款	11,518,937.43	-4,742,576.82	6,776,360.61
基金赎回款	-42,805,796.02	13,663,193.03	-29,142,602.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,804,198.97	-39,170,640.02	161,633,558.95

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	28,967.30	34,250.62
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	47,795.83	35,553.33
其他	217.50	281.64
合计	76,980.63	70,085.59

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-27,217,723.82	-4,509,651.78
股票投资收益——赎回差价收入	-1,935,635.60	-1,179,869.36
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	-29,153,359.42	-5,689,521.14

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	80,474,064.00	93,345,468.66
减：卖出股票成本总额	107,627,162.84	97,680,622.87

减：交易费用	64,624.98	174,497.57
买卖股票差价收入	-27,217,723.82	-4,509,651.78

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
赎回基金份额对价总额	89,142,602.99	39,870,058.11
减：现金支付赎回款总额	31,810,010.99	15,761,799.11
减：赎回股票成本总额	59,268,227.60	25,288,128.36
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,935,635.60	-1,179,869.36

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利息收入	5.61	50.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,671.33	68,956.47
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	11,676.94	69,007.24

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,079.30	413,424.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,399.85	344,398.46
减：应计利息总额	5.76	53.11
减：交易费用	2.36	16.56
买卖债券差价收入	11,671.33	68,956.47

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	1,731,675.89	-1,550,813.95

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,357,358.93	10,389,367.69
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	12,357,358.93	10,389,367.69

7.4.7.15 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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	87,535,113.09	-43,740,250.56
——股票投资	87,535,113.09	-43,740,250.56
——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	-181,100.00	459,640.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-181,100.00	459,640.00
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	87,354,013.09	-43,280,610.56

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	2,161.89	4,089.47
替代损益收入	-67,946.15	-57,358.29
合计	-65,784.26	-53,268.82

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。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	30,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	229,268.74	244,439.38
银行汇划费	5,217.15	5,226.21
合计	384,485.89	419,665.59

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
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（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
易方达私募基金管理有限公司	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：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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	210,230.46	0.14%	-	-

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 2024年1月1日至2024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	21.00	0.14%	19.54	0.44%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本报告期内本基金的佣金协议及服务范围发生变更。2024年7月1日前，佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自2024年7月1日起，佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	652,585.83	691,354.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,789.63	5,773.91
应支付基金管理人的净管理费	646,796.20	685,580.30

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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	217,528.64	230,451.53

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

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。

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自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自有资金投资本基金。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	72,969,510.00	25.9132%	77,493,010.00	23.8006%
广发证券股份有限公司	1,958,725.00	0.6956%	1,957,302.00	0.6012%

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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023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	6,428,791.02	28,967.30	10,259,758.59	34,250.62

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					
2024 年 1 月 1 日至 2024 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
广发证券股	920008	成电光信	新股网上	300	3,000.00

份有限公司			发行		
上年度可比期间					
2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中银国际证券股份有限公司	601096	宏盛华源	新股网下发行	37,413	63,602.10

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 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 2024 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 65,800 股（2023 年 12 月 31 日:68,300 股），占本基金净值比例为 0.24%(2023 年 12 月 31 日:0.22%)；持有中银证券发行的 A 股中银证券 30,500 股（2023 年 12 月 31 日:32,600 股），占本基金净值比例为 0.08%(2023 年 12 月 31 日:0.08%)；持有中国银行发行的 A 股中国银行 389,800 股（2023 年 12 月 31 日:406,200 股），占本基金净值比例为 0.48%(2023 年 12 月 31 日:0.37%)。

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（2024 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	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
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新股流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新股流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新股流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6 个月	新股流通受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6 个月	新股流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新股流通受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	新股流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6 个月	新股流通受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和	2024-12-24	1 个月以内	新股	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-

	磁材			流通受限						
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6 个月	新股流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔康	2024-10-29	6 个月	新股流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024-08-19	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024-12-04	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-

688750	金天钛业	2024-11-12	6 个月	新股流通受限	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
920116	星图测控	2024-12-25	1 个月以内	新股流通受限	6.92	6.92	300	2,076.00	2,076.00	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	73,400	520,518.32	529,948.00	-

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 2024 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 2024 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。

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。于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023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企业发行的债券。

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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023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、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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 2024年12月31日	上年度末 2023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	上年度末

	2024年12月31日	2023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 2024 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(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。

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，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 2024年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,428,791.02	-	-	-	6,428,791.02
结算备付金	3,963,362.66	-	-	-	3,963,362.66
存出保证金	1,155,040.41	-	-	-	1,155,040.41
交易性金融资产	-	-	-	432,243,846.29	432,243,846.29
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	11,547,194.09	-	-	432,243,846.29	443,791,040.38
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	-	-	-	176,398.31	176,398.31

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,583.14	56,583.14
应付托管费	-	-	-	18,861.04	18,861.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	49,580.55	49,580.55
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	263,742.39	263,742.39
负债总计	-	-	-	565,165.43	565,165.43
利率敏感度缺口	11,547,194.09	-	-	431,678,680.86	443,225,874.95
上年度末					
2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,259,758.59	-	-	-	10,259,758.59
结算备付金	1,646,868.82	-	-	-	1,646,868.82
存出保证金	1,266,328.95	-	-	-	1,266,328.95
交易性金融资产	-	-	-	425,798,662.10	425,798,662.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	149,146.42	149,146.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,172,956.36	-	-	425,947,808.52	439,120,764.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	21,887.07	21,887.07
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	54,439.56	54,439.56
应付托管费	-	-	-	18,146.53	18,146.53
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	-	-	-	485,896.30	485,896.30
负债总计	-	-	-	580,369.46	580,369.46
利率敏感度缺口	13,172,956.36	-	-	425,367,439.06	438,540,395.42

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，因此无重大外汇风险。

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	432,243,846.29	97.52	425,798,662.10	97.09
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	432,243,846.29	97.52	425,798,662.10	97.09

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	21,595,150.00	21,253,730.07
	2.业绩比较基准下降 5%	-21,595,150.00	-21,253,730.07

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	431,262,136.73	424,810,868.16
第二层次	559,760.50	-
第三层次	421,949.06	987,793.94
合计	432,243,846.29	425,798,662.10

7.4.14.2.2 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和债券，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和债券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，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	987,793.94	987,793.94
当期购买	-	416,075.62	416,075.62
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,267,747.92	1,267,747.92
当期利得或损失总额	-	285,827.42	285,827.42
其中：计入损益的利得或损失	-	285,827.42	285,827.42
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	421,949.06	421,949.06
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	231,759.11	231,759.11
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	840,981.43	840,981.43
当期购买	-	1,645,679.03	1,645,679.03
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,088,084.88	2,088,084.88
当期利得或损失总额	-	589,218.36	589,218.36
其中：计入损益的利得或损失	-	589,218.36	589,218.36

计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	987,793.94	987,793.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	171,017.15	171,017.15

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	421,949.06	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423—4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	987,793.94	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962—2.1988	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§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	432,243,846.29	97.40
	其中：股票	432,243,846.29	97.40
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	10,392,153.68	2.34
8	其他各项资产	1,155,040.41	0.26
9	合计	443,791,040.38	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	3,842,679.76	0.87
B	采矿业	22,644,321.90	5.11
C	制造业	227,995,416.32	51.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,531,643.95	4.63
E	建筑业	8,061,556.20	1.82
F	批发和零售业	2,213,116.44	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	16,738,692.00	3.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,614,450.57	3.97
J	金融业	100,354,539.16	22.64
K	房地产业	4,195,258.00	0.95
L	租赁和商务服务业	3,739,587.58	0.84
M	科学研究和技术服务业	2,203,264.56	0.50

N	水利、环境和公共设施管理业	411,402.60	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,371,335.25	0.31
R	文化、体育和娱乐业	326,582.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	432,243,846.29	97.52

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	13,900	21,183,600.00	4.78
2	300750	宁德时代	48,900	13,007,400.00	2.93
3	600036	招商银行	229,187	9,007,049.10	2.03
4	600900	长江电力	271,821	8,032,310.55	1.81
5	601318	中国平安	119,509	6,292,148.85	1.42
6	000858	五粮液	43,100	6,035,724.00	1.36
7	002594	比亚迪	20,100	5,681,466.00	1.28
8	601288	农业银行	944,800	5,045,232.00	1.14
9	601398	工商银行	698,400	4,832,928.00	1.09
10	300059	东方财富	175,225	4,524,309.50	1.02
11	601166	兴业银行	230,757	4,421,304.12	1.00
12	600030	中信证券	135,865	3,963,182.05	0.89
13	688041	海光信息	25,795	3,863,833.05	0.87
14	601899	紫金矿业	228,700	3,457,944.00	0.78
15	300760	迈瑞医疗	13,477	3,436,635.00	0.78
16	601328	交通银行	435,749	3,385,769.73	0.76
17	601816	京沪高铁	545,000	3,357,200.00	0.76
18	600000	浦发银行	325,847	3,352,965.63	0.76
19	002475	立讯精密	80,286	3,272,457.36	0.74
20	600276	恒瑞医药	70,873	3,253,070.70	0.73
21	601088	中国神华	73,300	3,187,084.00	0.72
22	601138	工业富联	147,000	3,160,500.00	0.71
23	688256	寒武纪	4,633	3,048,514.00	0.69
24	000333	美的集团	38,800	2,918,536.00	0.66
25	601668	中国建筑	462,180	2,773,080.00	0.63
26	601601	中国太保	76,057	2,592,022.56	0.58
27	000001	平安银行	215,400	2,520,180.00	0.57

28	601225	陕西煤业	107,600	2,502,776.00	0.56
29	600809	山西汾酒	13,572	2,500,098.12	0.56
30	600309	万华化学	34,900	2,490,115.00	0.56
31	600028	中国石化	360,500	2,408,140.00	0.54
32	603288	海天味业	51,456	2,361,830.40	0.53
33	002714	牧原股份	60,624	2,330,386.56	0.53
34	002371	北方华创	5,900	2,306,900.00	0.52
35	601766	中国中车	270,200	2,264,276.00	0.51
36	600406	国电南瑞	89,137	2,248,035.14	0.51
37	601127	赛力斯	16,800	2,240,952.00	0.51
38	601919	中远海控	141,720	2,196,660.00	0.50
39	601985	中国核电	209,600	2,186,128.00	0.49
40	002352	顺丰控股	53,400	2,152,020.00	0.49
41	601988	中国银行	389,800	2,147,798.00	0.48
42	601857	中国石油	239,851	2,144,267.94	0.48
43	600887	伊利股份	70,678	2,133,062.04	0.48
44	000568	泸州老窖	16,400	2,053,280.00	0.46
45	600919	江苏银行	203,766	2,000,982.12	0.45
46	601818	光大银行	515,500	1,994,985.00	0.45
47	600690	海尔智家	69,453	1,977,326.91	0.45
48	600050	中国联通	353,200	1,875,492.00	0.42
49	601658	邮储银行	322,800	1,833,504.00	0.41
50	000063	中兴通讯	44,700	1,805,880.00	0.41
51	000725	京东方 A	410,500	1,802,095.00	0.41
52	600150	中国船舶	49,700	1,787,212.00	0.40
53	002142	宁波银行	73,320	1,782,409.20	0.40
54	600104	上汽集团	85,700	1,779,132.00	0.40
55	300033	同花顺	6,000	1,725,000.00	0.39
56	600019	宝钢股份	244,200	1,709,400.00	0.39
57	300274	阳光电源	23,060	1,702,519.80	0.38
58	600016	民生银行	393,880	1,626,724.40	0.37
59	600999	招商证券	82,447	1,579,684.52	0.36
60	601211	国泰君安	83,400	1,555,410.00	0.35
61	600031	三一重工	94,100	1,550,768.00	0.35
62	603259	药明康德	28,075	1,545,248.00	0.35
63	300308	中际旭创	12,440	1,536,464.40	0.35
64	688111	金山办公	5,133	1,470,039.87	0.33
65	601390	中国中铁	228,200	1,458,198.00	0.33
66	601888	中国中免	21,658	1,451,302.58	0.33
67	600436	片仔癀	6,753	1,448,518.50	0.33
68	601169	北京银行	234,900	1,444,635.00	0.33
69	601229	上海银行	157,842	1,444,254.30	0.33
70	601688	华泰证券	81,200	1,428,308.00	0.32
71	000651	格力电器	31,300	1,422,585.00	0.32

72	603501	韦尔股份	13,500	1,409,535.00	0.32
73	002304	洋河股份	16,744	1,398,626.32	0.32
74	600905	三峡能源	317,900	1,389,223.00	0.31
75	600660	福耀玻璃	22,235	1,387,464.00	0.31
76	600886	国投电力	82,800	1,376,136.00	0.31
77	601006	大秦铁路	202,600	1,373,628.00	0.31
78	300015	爱尔眼科	103,497	1,371,335.25	0.31
79	600989	宝丰能源	81,400	1,370,776.00	0.31
80	000166	申万宏源	250,100	1,338,035.00	0.30
81	601012	隆基绿能	84,108	1,321,336.68	0.30
82	688012	中微公司	6,895	1,304,258.20	0.29
83	603993	洛阳钼业	196,100	1,304,065.00	0.29
84	601628	中国人寿	30,879	1,294,447.68	0.29
85	601009	南京银行	117,700	1,253,505.00	0.28
86	002230	科大讯飞	25,700	1,241,824.00	0.28
87	601066	中信建投	48,100	1,238,575.00	0.28
88	000625	长安汽车	91,888	1,227,623.68	0.28
89	601881	中国银河	80,400	1,224,492.00	0.28
90	600893	航发动力	29,536	1,224,267.20	0.28
91	300498	温氏股份	73,820	1,218,768.20	0.27
92	300433	蓝思科技	55,300	1,211,070.00	0.27
93	600346	恒力石化	78,100	1,198,835.00	0.27
94	605499	东鹏饮料	4,800	1,192,896.00	0.27
95	600837	海通证券	107,200	1,192,064.00	0.27
96	688036	传音控股	12,532	1,190,540.00	0.27
97	000538	云南白药	19,780	1,185,811.00	0.27
98	600015	华夏银行	147,282	1,179,728.82	0.27
99	600048	保利发展	132,800	1,176,608.00	0.27
100	688271	联影医疗	9,146	1,156,054.40	0.26
101	601336	新华保险	23,200	1,153,040.00	0.26
102	002625	光启技术	23,900	1,142,420.00	0.26
103	601727	上海电气	140,600	1,140,266.00	0.26
104	002027	分众传媒	160,400	1,127,612.00	0.25
105	600438	通威股份	50,000	1,105,500.00	0.25
106	601111	中国国航	138,600	1,096,326.00	0.25
107	601995	中金公司	32,400	1,091,556.00	0.25
108	601600	中国铝业	146,800	1,078,980.00	0.24
109	000776	广发证券	65,800	1,066,618.00	0.24
110	300014	亿纬锂能	22,691	1,060,577.34	0.24
111	600585	海螺水泥	44,400	1,055,832.00	0.24
112	000100	TCL 科技	208,620	1,049,358.60	0.24
113	601669	中国电建	191,400	1,045,044.00	0.24
114	000425	徐工机械	131,100	1,039,623.00	0.23
115	000338	潍柴动力	75,400	1,032,980.00	0.23

116	001979	招商蛇口	100,600	1,030,144.00	0.23
117	002493	荣盛石化	112,450	1,017,672.50	0.23
118	000895	双汇发展	38,500	999,460.00	0.23
119	000792	盐湖股份	60,300	992,538.00	0.22
120	002241	歌尔股份	38,000	980,780.00	0.22
121	600926	杭州银行	65,860	962,214.60	0.22
122	002938	鹏鼎控股	25,800	941,184.00	0.21
123	600010	包钢股份	504,400	938,184.00	0.21
124	601939	建设银行	106,500	936,135.00	0.21
125	600674	川投能源	54,100	933,225.00	0.21
126	601689	拓普集团	18,685	915,565.00	0.21
127	300502	新易盛	7,900	913,082.00	0.21
128	601825	沪农商行	107,100	911,421.00	0.21
129	600418	江淮汽车	24,300	911,250.00	0.21
130	600547	山东黄金	40,184	909,363.92	0.21
131	002311	海大集团	18,500	907,425.00	0.20
132	600795	国电电力	198,100	907,298.00	0.20
133	000938	紫光股份	31,738	883,268.54	0.20
134	001965	招商公路	63,100	880,245.00	0.20
135	600958	东方证券	82,952	875,973.12	0.20
136	300124	汇川技术	14,900	872,842.00	0.20
137	688008	澜起科技	12,680	860,972.00	0.19
138	600111	北方稀土	40,200	853,044.00	0.19
139	000977	浪潮信息	16,328	847,096.64	0.19
140	002463	沪电股份	21,210	840,976.50	0.19
141	603392	万泰生物	11,750	827,905.00	0.19
142	300442	润泽科技	15,900	826,164.00	0.19
143	601868	中国能建	360,200	824,858.00	0.19
144	601360	三六零	79,389	821,676.15	0.19
145	300408	三环集团	21,300	820,263.00	0.19
146	600584	长电科技	20,000	817,200.00	0.18
147	600415	小商品城	60,900	816,669.00	0.18
148	600029	南方航空	124,800	809,952.00	0.18
149	601319	中国人保	105,100	800,862.00	0.18
150	603986	兆易创新	7,440	794,592.00	0.18
151	002736	国信证券	70,800	792,960.00	0.18
152	688223	晶科能源	111,140	790,205.40	0.18
153	601100	恒立液压	14,932	787,961.64	0.18
154	601788	光大证券	43,340	784,887.40	0.18
155	000002	万科 A	108,000	784,080.00	0.18
156	600188	兖矿能源	55,170	781,758.90	0.18
157	000596	古井贡酒	4,500	779,850.00	0.18
158	601901	方正证券	91,400	761,362.00	0.17
159	600115	中国东航	190,100	760,400.00	0.17

160	002001	新和成	34,176	750,846.72	0.17
161	600221	海航控股	439,600	747,320.00	0.17
162	601633	长城汽车	27,500	724,075.00	0.16
163	601838	成都银行	42,300	723,753.00	0.16
164	600160	巨化股份	30,000	723,600.00	0.16
165	003816	中国广核	173,900	718,207.00	0.16
166	002916	深南电路	5,720	715,000.00	0.16
167	600089	特变电工	56,035	713,885.90	0.16
168	002648	卫星化学	37,469	704,042.51	0.16
169	600845	宝信软件	24,033	703,205.58	0.16
170	600023	浙能电力	124,000	701,840.00	0.16
171	300122	智飞生物	26,550	698,265.00	0.16
172	688396	华润微	14,688	693,126.72	0.16
173	601916	浙商银行	238,080	692,812.80	0.16
174	600011	华能国际	101,300	685,801.00	0.15
175	002920	德赛西威	6,200	682,682.00	0.15
176	600703	三安光电	55,400	674,218.00	0.15
177	000963	华东医药	19,340	669,164.00	0.15
178	603296	华勤技术	9,400	666,930.00	0.15
179	601618	中国中冶	198,300	654,390.00	0.15
180	600183	生益科技	27,000	649,350.00	0.15
181	600066	宇通客车	24,600	648,948.00	0.15
182	601607	上海医药	30,900	648,900.00	0.15
183	000617	中油资本	93,600	644,904.00	0.15
184	600489	中金黄金	53,400	642,402.00	0.14
185	000999	华润三九	14,290	633,618.60	0.14
186	600600	青岛啤酒	7,827	633,360.84	0.14
187	002460	赣锋锂业	17,960	628,779.60	0.14
188	603369	今世缘	13,900	628,697.00	0.14
189	601021	春秋航空	10,900	628,603.00	0.14
190	002028	思源电气	8,600	625,220.00	0.14
191	002600	领益智造	77,800	622,400.00	0.14
192	300896	爱美客	3,400	620,500.00	0.14
193	301236	软通动力	10,550	619,390.50	0.14
194	600803	新奥股份	28,500	617,880.00	0.14
195	600085	同仁堂	15,200	616,968.00	0.14
196	300832	新产业	8,700	616,395.00	0.14
197	600741	华域汽车	35,000	616,350.00	0.14
198	605117	德业股份	7,228	612,934.40	0.14
199	002049	紫光国微	9,480	610,227.60	0.14
200	301269	华大九天	5,000	605,500.00	0.14
201	000301	东方盛虹	73,400	602,614.00	0.14
202	601377	兴业证券	95,430	597,391.80	0.13
203	601077	渝农商行	97,700	591,085.00	0.13

204	300999	金龙鱼	18,108	590,501.88	0.13
205	600570	恒生电子	20,987	587,426.13	0.13
206	002236	大华股份	36,600	585,600.00	0.13
207	600196	复星医药	23,500	583,975.00	0.13
208	601872	招商轮船	90,500	580,105.00	0.13
209	300866	安克创新	5,910	577,052.40	0.13
210	688126	沪硅产业	30,488	573,784.16	0.13
211	000786	北新建材	18,800	569,828.00	0.13
212	600025	华能水电	59,700	567,747.00	0.13
213	000157	中联重科	78,200	565,386.00	0.13
214	601117	中国化学	67,900	562,891.00	0.13
215	300394	天孚通信	6,140	560,950.40	0.13
216	300413	芒果超媒	20,810	559,580.90	0.13
217	601877	正泰电器	23,900	559,499.00	0.13
218	002384	东山精密	19,100	557,720.00	0.13
219	603799	华友钴业	18,937	554,096.62	0.13
220	600233	圆通速递	38,300	543,477.00	0.12
221	300628	亿联网络	14,060	542,716.00	0.12
222	300782	卓胜微	6,016	539,635.20	0.12
223	600522	中天科技	37,600	538,432.00	0.12
224	002466	天齐锂业	16,300	537,900.00	0.12
225	600061	国投资本	71,008	533,980.16	0.12
226	002422	科伦药业	17,800	532,754.00	0.12
227	600745	闻泰科技	13,700	531,286.00	0.12
228	002252	上海莱士	73,400	529,948.00	0.12
229	600027	华电国际	94,100	527,901.00	0.12
230	601878	浙商证券	43,100	527,544.00	0.12
231	300418	昆仑万维	13,600	523,328.00	0.12
232	601058	赛轮轮胎	36,200	518,746.00	0.12
233	000066	中国长城	35,500	517,235.00	0.12
234	000983	山西焦煤	62,740	516,977.60	0.12
235	000807	云铝股份	38,200	516,846.00	0.12
236	600642	申能股份	54,100	513,409.00	0.12
237	601238	广汽集团	54,700	510,898.00	0.12
238	603893	瑞芯微	4,600	506,276.00	0.11
239	600219	南山铝业	129,400	505,954.00	0.11
240	603195	公牛集团	7,195	505,376.80	0.11
241	600426	华鲁恒升	23,386	505,371.46	0.11
242	600176	中国巨石	44,279	504,337.81	0.11
243	600918	中泰证券	76,700	503,919.00	0.11
244	002459	晶澳科技	36,416	500,720.00	0.11
245	688009	中国通号	79,396	497,018.96	0.11
246	002156	通富微电	16,800	496,440.00	0.11
247	600733	北汽蓝谷	61,900	495,200.00	0.11

248	688047	龙芯中科	3,715	491,420.20	0.11
249	002050	三花智控	20,900	491,359.00	0.11
250	600875	东方电气	30,900	491,001.00	0.11
251	601216	君正集团	93,300	490,758.00	0.11
252	603260	合盛硅业	8,800	488,928.00	0.11
253	600256	广汇能源	72,588	488,517.24	0.11
254	000408	藏格矿业	17,500	485,275.00	0.11
255	002128	电投能源	24,700	483,626.00	0.11
256	601567	三星医疗	15,700	482,932.00	0.11
257	600460	士兰微	18,500	481,370.00	0.11
258	000988	华工科技	11,100	480,630.00	0.11
259	600515	海南机场	126,800	479,304.00	0.11
260	688303	大全能源	19,855	479,299.70	0.11
261	600362	江西铜业	23,100	476,784.00	0.11
262	000975	山金国际	30,840	474,010.80	0.11
263	601699	潞安环能	33,000	473,880.00	0.11
264	688072	拓荆科技	3,071	471,920.57	0.11
265	600487	亨通光电	27,400	471,828.00	0.11
266	600009	上海机场	13,800	471,270.00	0.11
267	600039	四川路桥	64,440	469,123.20	0.11
268	002601	龙佰集团	26,400	466,488.00	0.11
269	300207	欣旺达	20,900	466,279.00	0.11
270	688599	天合光能	23,986	462,929.80	0.10
271	300316	晶盛机电	14,500	462,550.00	0.10
272	688187	时代电气	9,643	462,092.56	0.10
273	002281	光迅科技	8,800	459,096.00	0.10
274	000630	铜陵有色	142,000	458,660.00	0.10
275	600895	张江高科	17,100	458,280.00	0.10
276	600096	云天化	20,500	457,150.00	0.10
277	600177	雅戈尔	51,300	456,570.00	0.10
278	002078	太阳纸业	30,700	456,509.00	0.10
279	688188	柏楚电子	2,348	456,099.00	0.10
280	002064	华峰化学	55,100	450,718.00	0.10
281	000876	新希望	50,000	449,000.00	0.10
282	000661	长春高新	4,500	447,480.00	0.10
283	600161	天坛生物	21,780	446,490.00	0.10
284	000423	东阿阿胶	7,100	445,312.00	0.10
285	600026	中远海能	38,300	444,280.00	0.10
286	600332	白云山	15,632	444,261.44	0.10
287	688169	石头科技	2,024	443,842.96	0.10
288	002085	万丰奥威	23,400	443,430.00	0.10
289	600536	中国软件	9,490	443,088.10	0.10
290	601136	首创证券	20,100	442,200.00	0.10
291	002595	豪迈科技	8,800	441,672.00	0.10

292	002180	纳思达	15,600	439,452.00	0.10
293	002456	欧菲光	36,400	436,072.00	0.10
294	688777	中控技术	8,774	435,804.58	0.10
295	002444	巨星科技	13,400	433,490.00	0.10
296	601179	中国西电	56,600	429,594.00	0.10
297	601555	东吴证券	54,959	428,680.20	0.10
298	601162	天风证券	95,600	428,288.00	0.10
299	688120	华海清科	2,627	428,174.73	0.10
300	300661	圣邦股份	5,235	428,118.30	0.10
301	603806	福斯特	28,871	427,290.80	0.10
302	601799	星宇股份	3,200	427,136.00	0.10
303	000708	中信特钢	37,200	424,452.00	0.10
304	002074	国轩高科	20,000	424,400.00	0.10
305	601168	西部矿业	26,400	424,248.00	0.10
306	600079	人福医药	18,100	423,178.00	0.10
307	601108	财通证券	51,550	421,163.50	0.10
308	600985	淮北矿业	29,900	420,693.00	0.09
309	300759	康龙化成	16,350	420,195.00	0.09
310	000933	神火股份	24,800	419,120.00	0.09
311	603160	汇顶科技	5,200	418,808.00	0.09
312	000783	长江证券	61,400	418,748.00	0.09
313	002353	杰瑞股份	11,300	417,987.00	0.09
314	002709	天赐材料	21,100	416,092.00	0.09
315	601865	福莱特	20,900	411,521.00	0.09
316	603568	伟明环保	19,020	411,402.60	0.09
317	300765	新诺威	15,460	411,081.40	0.09
318	002185	华天科技	35,300	409,833.00	0.09
319	002532	天山铝业	51,700	406,879.00	0.09
320	600588	用友网络	37,622	403,684.06	0.09
321	000728	国元证券	48,100	402,116.00	0.09
322	002223	鱼跃医疗	11,000	401,390.00	0.09
323	002673	西部证券	49,200	400,980.00	0.09
324	300476	胜宏科技	9,500	399,855.00	0.09
325	603606	东方电缆	7,600	399,380.00	0.09
326	603198	迎驾贡酒	7,400	399,156.00	0.09
327	600398	海澜之家	53,100	398,250.00	0.09
328	002129	TCL 中环	44,875	398,041.25	0.09
329	601577	长沙银行	44,700	397,383.00	0.09
330	002202	金风科技	38,346	396,114.18	0.09
331	601198	东兴证券	35,600	391,956.00	0.09
332	603833	欧派家居	5,664	390,476.16	0.09
333	601991	大唐发电	137,000	390,450.00	0.09
334	002555	三七互娱	24,500	383,180.00	0.09
335	002294	信立泰	12,300	380,439.00	0.09

336	603659	璞泰来	23,512	374,075.92	0.08
337	000729	燕京啤酒	31,000	373,240.00	0.08
338	300919	中伟股份	10,320	372,758.40	0.08
339	600352	浙江龙盛	36,000	370,440.00	0.08
340	002340	格林美	56,700	370,251.00	0.08
341	002939	长城证券	44,800	367,360.00	0.08
342	300223	北京君正	5,300	361,460.00	0.08
343	603338	浙江鼎力	5,600	361,312.00	0.08
344	601880	辽港股份	208,200	360,186.00	0.08
345	600157	永泰能源	210,000	359,100.00	0.08
346	600109	国金证券	41,000	357,930.00	0.08
347	601958	金铂股份	35,500	357,130.00	0.08
348	601456	国联证券	26,400	356,928.00	0.08
349	601990	南京证券	40,700	352,462.00	0.08
350	002414	高德红外	47,003	349,232.29	0.08
351	600038	中直股份	9,000	347,040.00	0.08
352	002007	华兰生物	20,490	345,256.50	0.08
353	600369	西南证券	73,800	344,646.00	0.08
354	600153	建发股份	32,700	344,004.00	0.08
355	600298	安琪酵母	9,500	342,475.00	0.08
356	002812	恩捷股份	10,700	342,293.00	0.08
357	000027	深圳能源	52,580	340,718.40	0.08
358	601696	中银证券	30,500	340,380.00	0.08
359	600132	重庆啤酒	5,400	340,308.00	0.08
360	601231	环旭电子	20,600	339,900.00	0.08
361	600549	厦门钨业	17,600	339,152.00	0.08
362	603885	吉祥航空	24,600	337,020.00	0.08
363	002966	苏州银行	40,600	329,266.00	0.07
364	300751	迈为股份	3,128	328,909.20	0.07
365	000831	中国稀土	11,700	328,185.00	0.07
366	601928	凤凰传媒	28,300	326,582.00	0.07
367	603939	益丰药房	13,444	324,403.72	0.07
368	688082	盛美上海	3,227	322,700.00	0.07
369	000738	航发控制	14,500	322,480.00	0.07
370	002152	广电运通	27,600	321,816.00	0.07
371	688728	格科微	23,851	320,557.44	0.07
372	688099	晶晨股份	4,644	318,949.92	0.07
373	600282	南钢股份	67,900	318,451.00	0.07
374	603156	养元饮品	13,900	317,476.00	0.07
375	600968	海油发展	74,200	316,834.00	0.07
376	000932	华菱钢铁	75,700	316,426.00	0.07
377	300699	光威复材	9,120	316,008.00	0.07
378	600873	梅花生物	31,500	315,945.00	0.07
379	002032	苏泊尔	5,900	313,939.00	0.07

380	601233	桐昆股份	26,600	313,880.00	0.07
381	600497	驰宏锌锗	56,300	313,591.00	0.07
382	300037	新宙邦	8,280	310,003.20	0.07
383	688122	西部超导	7,210	308,732.20	0.07
384	603899	晨光股份	10,200	308,550.00	0.07
385	002409	雅克科技	5,300	307,135.00	0.07
386	002465	海格通信	27,600	303,048.00	0.07
387	002603	以岭药业	18,640	298,426.40	0.07
388	000800	一汽解放	36,300	297,660.00	0.07
389	000629	钒钛股份	103,300	297,504.00	0.07
390	688538	和辉光电	128,041	297,055.12	0.07
391	603486	科沃斯	6,300	296,100.00	0.07
392	000921	海信家电	10,200	294,780.00	0.07
393	603596	伯特利	6,600	294,294.00	0.07
394	600566	济川药业	10,100	293,708.00	0.07
395	601966	玲珑轮胎	16,275	293,601.00	0.07
396	600598	北大荒	19,900	293,525.00	0.07
397	002821	凯莱英	3,820	290,663.80	0.07
398	600521	华海药业	16,170	288,957.90	0.07
399	600988	赤峰黄金	18,500	288,785.00	0.07
400	600998	九州通	55,981	286,622.72	0.06
401	600021	上海电力	31,000	284,270.00	0.06
402	600511	国药股份	8,300	284,026.00	0.06
403	603658	安图生物	6,500	283,660.00	0.06
404	600348	华阳股份	39,850	282,536.50	0.06
405	600582	天地科技	45,400	280,572.00	0.06
406	601666	平煤股份	27,400	274,548.00	0.06
407	600970	中材国际	28,900	273,972.00	0.06
408	688363	华熙生物	5,346	272,859.84	0.06
409	002262	恩华药业	11,200	272,720.00	0.06
410	603345	安井食品	3,300	268,884.00	0.06
411	300763	锦浪科技	4,400	268,708.00	0.06
412	600848	上海临港	26,420	266,842.00	0.06
413	600546	山煤国际	21,800	257,894.00	0.06
414	000960	锡业股份	18,300	256,749.00	0.06
415	688065	凯赛生物	6,474	251,191.20	0.06
416	603979	金诚信	6,800	246,840.00	0.06
417	300347	泰格医药	4,150	226,673.00	0.05
418	002271	东方雨虹	13,500	175,230.00	0.04
419	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
420	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.01
421	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.01
422	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
423	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01

424	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.01
425	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
426	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
427	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
428	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
429	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
430	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
431	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
432	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
433	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
434	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
435	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
436	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
437	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
438	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
439	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
440	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
441	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
442	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
443	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
444	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
445	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
446	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
447	920116	星图测控	300	2,076.00	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	000333	美的集团	2,981,519.00	0.68
2	600519	贵州茅台	2,302,543.00	0.53
3	300750	宁德时代	1,407,057.40	0.32
4	000858	五粮液	967,456.00	0.22
5	002371	北方华创	905,677.00	0.21
6	600036	招商银行	903,800.00	0.21
7	001965	招商公路	824,660.22	0.19
8	600221	海航控股	817,789.00	0.19
9	600900	长江电力	802,344.00	0.18
10	600025	华能水电	720,264.00	0.16
11	300760	迈瑞医疗	658,723.00	0.15

12	000708	中信特钢	630,188.00	0.14
13	601318	中国平安	603,355.00	0.14
14	688041	海光信息	582,193.28	0.13
15	603296	华勤技术	578,480.00	0.13
16	002594	比亚迪	569,364.00	0.13
17	688047	龙芯中科	546,465.50	0.12
18	002475	立讯精密	508,921.00	0.12
19	601567	三星医疗	489,724.00	0.11
20	601881	中国银河	475,737.00	0.11

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,090,528.00	0.48
2	000858	五粮液	1,314,589.05	0.30
3	002371	北方华创	1,070,446.00	0.24
4	002594	比亚迪	860,860.00	0.20
5	300760	迈瑞医疗	852,469.78	0.19
6	688449	联芸科技	788,400.56	0.18
7	300059	东方财富	712,559.00	0.16
8	301522	上大股份	625,165.65	0.14
9	002475	立讯精密	619,621.73	0.14
10	000333	美的集团	575,547.00	0.13
11	300033	同花顺	570,962.00	0.13
12	600221	海航控股	546,453.00	0.12
13	002714	牧原股份	521,687.00	0.12
14	688605	先锋精科	505,179.04	0.12
15	688708	佳驰科技	500,745.34	0.11
16	000001	平安银行	486,097.00	0.11
17	002352	顺丰控股	483,168.00	0.11
18	000568	泸州老窖	475,633.00	0.11
19	002602	ST 华通	470,586.00	0.11
20	300308	中际旭创	455,906.00	0.10

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	71,557,193.70
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	80,474,064.00
--------------	---------------

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

8.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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 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

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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国家金融监督管理总局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

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	1,155,040.41
2	应收清算款	-
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	1,155,040.41

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	
		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
2,915	96,601.14	164,113,086.00	58.28%	117,479,230.00	41.72%	72,969,510.00	25.91%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“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	12.20%
2	竞技世界（北京）网络技术有限公司	20,923,200.00	7.43%
3	陈建敏	10,000,000.00	3.55%
4	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	3.55%
5	韩静兰	4,261,800.00	1.51%
6	招商证券股份有限公司	3,772,899.00	1.34%
7	邓德权	3,174,900.00	1.13%
8	东方证券股份有限公司	3,025,803.00	1.07%
9	邓天明	2,280,000.00	0.81%
10	俞国华	2,218,400.00	0.79%
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	72,969,510.00	25.91%

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	325,592,316.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	60,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	281,592,316.00

§ 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 2024 年 8 月 28 日发布公告，自 2024 年 8 月 26 日起陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员；本基金管理人于 2024 年 10 月 21 日发布公告，自 2024 年 10 月 20 日起关秀霞女士不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金首次聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务，本报告年度的审计费用为 30,000.00 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

11.6.1 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	管理人；高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-26
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	责令改正并暂停受理 ETF 公募基金产品注册申请三个月；出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度机制不完善，规定执行不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成并恢复 ETF 基金产品注册
其他	/

11.6.2 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。

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	
财通证券	2	-	-	-	-	-
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	2	15,701,822.89	10.58%	1,570.79	10.58%	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	210,230.46	0.14%	21.00	0.14%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	43,353,576.40	29.20%	4,336.48	29.20%	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	23,987,996.62	16.16%	2,398.83	16.15%	-
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	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	1,143,042.92	0.77%	114.25	0.77%	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	28,152,389.05	18.96%	2,815.25	18.96%	-
招商证券	2	2,799,694.94	1.89%	280.00	1.89%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	32,647,634.39	21.99%	3,264.81	21.99%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	483,423.00	0.33%	48.32	0.33%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为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、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为财通证券股份有限公司、华源证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、西部证券股份有限公司。

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。本报告期内基金交易单元的选择标准有调整，调整后的标准如下：

1) 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，采取规范化的方式提供专业化的服务，在业内具有良好的声誉；

2) 具有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力；

3) 具有较突出的综合及专项服务能力和服务意愿；

4) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内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。

d) 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》

的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，报告的主要内容为报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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
财通证券	-	-	-	-	-	-
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	28,080.00	47.53%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	30,999.30	52.47%	-	-	-	-
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基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储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	2024-03-11
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤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	2024-04-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
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	2024-04-23
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源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	2024-04-30
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-07-18
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加民生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	2024-07-23
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华鑫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	2024-08-07
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	2024-08-23
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	2024-08-28

		金电子披露网站	
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证券报	2024-08-30
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加爱建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	2024-09-06
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	2024-10-21
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-10-25
17	易方达基金管理有限公司关于易方达私募基金管理有限公司股东变更的公告	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	2024-11-02
18	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加大同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	2024-11-25
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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	2024-12-04
20	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国新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	2024-12-06
21	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中原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	2024-12-06

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2024 年 01 月 01 日~2024 年 12 月 31 日	77,493,010.00	15,490,700.00	20,014,200.00	72,969,510.00	25.91%
产品特有风险							
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。

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二五年三月三十一日