

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券 投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	53
7.1 期末基金资产组合情况.....	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12	投资组合报告附注	67
8	基金份额持有人信息	69
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2	期末上市基金前十名持有人	70
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	71
9	开放式基金份额变动	72
10	重大事件揭示	72
10.1	基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4	基金投资策略的改变	72
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	73
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
10.8	其他重大事件	74
11	影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
12	备查文件目录	75
12.1	备查文件目录	75
12.2	存放地点	76
12.3	查阅方式	76

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式
场内简称	HS300ETF、沪深 300ETF 易方达
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,195,867,698.00 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	2013 年 3 月 25 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	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，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，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，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	798,741,403.60
本期利润	168,616,554.61
加权平均基金份额本期利润	0.0421

本期加权平均净值利润率	1.76%
本期基金份额净值增长率	1.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,833,201,954.78
期末可供分配基金份额利润	1.3902
期末基金资产净值	10,062,342,651.88
期末基金份额净值	2.3982
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	139.82%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.37%	0.81%	-2.02%	0.80%	0.65%	0.01%
过去三个月	4.48%	0.98%	3.48%	0.98%	1.00%	0.00%
过去六个月	1.25%	1.31%	0.24%	1.31%	1.01%	0.00%
过去一年	28.56%	1.33%	25.46%	1.33%	3.10%	0.00%
过去三年	59.40%	1.36%	48.79%	1.37%	10.61%	-0.01%
自基金合同生效起至今	139.82%	1.45%	99.18%	1.46%	40.64%	-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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
 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
 （2013 年 3 月 6 日至 2021 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 139.82%，同期业绩比较基准收益率为 99.18%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余海燕	本基金的基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达日兴资	2016-04-16	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资

<p>管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 07 月 27 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 07 月 14 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2015 年 07 月 08 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达中证全指证券公司指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2015 年 07 月 08 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达中证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2015 年 06 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达上证 50 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理 (自 2015 年 04 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日)、易方达沪深 300 非银</p>				<p>发展部产品经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理。</p>
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------

行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 15 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年中国经济稳健复苏，GDP 保持了较高的增长，增长质量也在不断上行。从趋势上看，经济已经形成稳中加固的恢复态势；从结构上看，比较能代表经济内生动能的制造业投资明显向好，即便受到了广深局部疫情的扰动，消费也维持了逐渐改善态势，这对经济后续的稳步恢复也起到了较强的支撑作用。根据国家统计局公布的数据，二季度 GDP 增长 7.9%，两年平均增长 5.5%，相比一季度加快 0.5 个百分点。工业生产运行平稳，6 月份规模以上工业增加值同比实际增长 8.3%，两年复合增速来看，则连续 4 个月保持在 6.5% 左右的区间范围，反映出工业生产仍然在较高景气区间延续平稳增长。制造业投资继续向好，上半年固定资产投资增速累计同比增长 12.6%，其中两年平均增速 4.4%。消费的修复节奏也好于市场预期，6 月份社会消费品零售总额同比增长 12.1%，两年复合增速 4.9%，较上月的复合增速抬升 0.4 个百分点。宏观政策方面，货币政策延续“温和正常化”态势，市场流动性依然保持在合理充裕的水平。资本市场方面，A 股市场在春节前延续了去年四季度以来的普涨行情，春节后经济复苏预期继续强化带动了部分价值板块反弹，A 股市场出现了较大的风格转换；后续随着美债收益率加速反弹引发了市场的担忧，投资者风险偏好明显回落，市场主要指数均出现了不同幅度的调整；二季度以来 A 股市场整体震荡上涨，市场再次出现风格切换，以创业板指为代表的成长板块大幅反弹，不同指数间表现差异明显，最终上半年上证综指以上涨 3.40% 收官。在风格方面，创业板、科创板等成长板块经过 2、3 月份的调整后大幅反弹再次显著跑赢价值板块，报告期间创业板指、科创 50 指数、上证 50 指数、沪深 300 指数收益率分别为 17.22%、14.01%、-3.90%、0.24%；行业方面，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色金属、电子等板块涨幅居前，保险、家用电器、国防军工、证券公司、房地产等板块表现相对落后。作为被动型指数基金，报告期内本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深 300 指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，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。

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 2.3982 元，本报告期份额净值增长率为 1.25%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%，年化跟踪误差 0.28%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，随着疫苗逐步落地，百年一遇的疫情渐行渐远，全球经济会进一步复苏。下半

年中国经济在全球将率先演绎“疫后复苏、政策退出”的情景，经济增长动能可能会有所回落，主要是由于受抑制需求消退、重新开放的发达市场转向服务消费导致我国出口减弱、房地产收紧调控的影响终将显现、原材料价格飙升拖累实际需求等因素导致。与此同时，宏观政策将保持“相机抉择”的态势，在经济增速回落的背景下政策可能稳中趋松。这种市场环境下资本市场的焦点可能会从此前的通胀转向更加关注增长可持续性，产业升级、消费升级所代表的“新经济”趋势可能会重回市场的主线。在当前时点，流动性推升全球多数主要国家地区的股票市场创下历史或阶段性新高，相比之下 A 股的宏观经济复苏更早、企业的盈利增速确定性更高、货币政策更早常态化，且 A 股正处于资本市场制度建设和对外开放的上升期；同时我们也看到了疫情检验了中国制造业的韧性和竞争力，中国制造业正在借助内需大市场衍生出的众多优势实现了产业升级与产业自主趋势强化；本次疫情更是一场对不同经济体的大考，中国从社会管理、社会组织、资源动员、制度等方面都经受起了考验，领先全球，这一因素理应也会在未来逐步体现到中国资产的风险溢价中。当前海外刺激政策仍持续、国内经济表现强劲的基本面环境意味着风险资产仍更受青睐。资本市场在近年持续改革之后与新经济领域正在形成相互促进的良性互动，资本市场也在进入快速发展的新阶段。改革与开放继续落地，中国资本市场正在经历新的大发展，股市流动性相对充裕。中国经济依然具有较强的内生动力，中长期乐观趋势不改。2021 年是中国“十四五”规划的开局之年，在十四五规划纲要中，强调高质量发展是新阶段的显著特征，中国经济的结构转型仍在深化，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点，A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地。通过资本市场把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业升级，改善上市公司业绩，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

目前以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的核心蓝筹板块依然具备中长期投资价值。作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场蓝筹股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。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	84,933,230.51	105,915,309.18
结算备付金		101,032,700.81	95,820,375.67
存出保证金		22,188,261.85	23,848,203.68
交易性金融资产	6.4.7.2	9,856,588,136.82	9,200,761,909.27
其中：股票投资		9,849,364,451.21	9,192,632,952.34
基金投资		-	-
债券投资		7,223,685.61	8,128,956.93
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,862,498.64	1,845,985.92
应收利息	6.4.7.5	466,547.57	342,139.50
应收股利		1,910,878.34	419.10
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,072,982,254.54	9,428,534,342.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,142,269.71	12,999,232.53
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,240,156.66	1,133,798.91
应付托管费		413,385.58	377,932.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	259,234.04	211,923.79

应交税费		177,561.28	491,358.51
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	4,406,995.39	6,548,901.94
负债合计		10,639,602.66	21,763,148.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,195,867,698.00	3,971,216,087.00
未分配利润	6.4.7.10	5,866,474,953.88	5,435,555,106.65
所有者权益合计		10,062,342,651.88	9,406,771,193.65
负债和所有者权益总计		10,072,982,254.54	9,428,534,342.32

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3982 元，基金份额总额 4,195,867,698.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		183,124,874.43	340,226,392.12
1.利息收入		10,670,144.56	1,239,226.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	932,562.87	713,931.63
债券利息收入		3,904.07	1,440.97
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		9,733,677.62	523,854.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		798,321,395.99	522,889,287.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	707,562,154.29	433,966,381.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,760,006.25	2,183,171.25
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	15,109,537.86	4,580,504.85
股利收益	6.4.7.15	72,889,697.59	82,159,230.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-630,124,848.99	-188,400,235.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,258,182.87	4,498,113.27
减：二、费用		14,508,319.82	14,471,309.48
1. 管理人报酬		7,132,013.54	6,532,058.19
2. 托管费		2,377,337.83	2,177,352.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,365,692.99	4,327,009.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		89,443.02	18,381.15
7. 其他费用	6.4.7.19	1,543,832.44	1,416,507.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		168,616,554.61	325,755,082.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		168,616,554.61	325,755,082.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,971,216,087.00	5,435,555,106.65	9,406,771,193.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	168,616,554.61	168,616,554.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	224,651,611.00	262,303,292.62	486,954,903.62
其中：1.基金申购款	1,774,000,000.00	2,473,947,756.77	4,247,947,756.77
2.基金赎回款	-1,549,348,389.00	-2,211,644,464.15	-3,760,992,853.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,195,867,698.00	5,866,474,953.88	10,062,342,651.88
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	5,106,565,612.00	4,157,529,961.08	9,264,095,573.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	325,755,082.64	325,755,082.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-904,709,114.00	-846,882,050.52	-1,751,591,164.52
其中：1.基金申购款	2,706,326,309.00	1,911,919,381.65	4,618,245,690.65
2.基金赎回款	-3,611,035,423.00	-2,758,801,432.17	-6,369,836,855.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,201,856,498.00	3,636,402,993.20	7,838,259,491.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1762 号《关于核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 43,605.00 份基金份额。本基金为交易型开放式（ETF）、发起式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达沪深 300 交易型开放式指数发

起式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基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	84,933,230.51
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	84,933,230.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,652,045,498.13	9,849,364,451.21	1,197,318,953.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,007,871.25	7,223,685.61
	银行间市场	-	-
	合计	7,007,871.25	7,223,685.61
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	8,659,053,369.38	9,856,588,136.82	1,197,534,767.44
----	------------------	------------------	------------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	173,362,980.00	-	-	-
IF2107	38,063,160.00	-	-	-
IF2109	72,210,000.00	-	-	-
IF2112	63,089,820.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	173,362,980.00	-	-	-

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货情况如下：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IF2107	IF2107	25	38,934,000.00	870,840.00
IF2109	IF2109	47	72,846,240.00	636,240.00
IF2112	IF2112	42	64,766,520.00	1,676,700.00
总额合计				3,183,780.00
减：可抵销期货暂收款				3,183,780.00
股指期货投资净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,861.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	37,509.30
应收债券利息	546.91
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	421,223.78
其他	406.08
合计	466,547.57

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	259,234.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	259,234.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	339,178.95
应付替代款	3,310,113.73
可退替代款	33,092.80
其他应付款	724,609.91
合计	4,406,995.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,971,216,087.00	3,971,216,087.00

本期申购	1,774,000,000.00	1,774,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,549,348,389.00	-1,549,348,389.00
本期末	4,195,867,698.00	4,195,867,698.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,718,844,546.32	716,710,560.33	5,435,555,106.65
本期利润	798,741,403.60	-630,124,848.99	168,616,554.61
本期基金份额交易产生的变动数	315,616,004.86	-53,312,712.24	262,303,292.62
其中：基金申购款	2,315,359,898.27	158,587,858.50	2,473,947,756.77
基金赎回款	-1,999,743,893.41	-211,900,570.74	-2,211,644,464.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,833,201,954.78	33,272,999.10	5,866,474,953.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	165,515.97
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	759,537.41
其他	7,509.49
合计	932,562.87

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	384,778,584.25
股票投资收益——赎回差价收入	322,783,570.04
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	707,562,154.29

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,388,151,348.50
减：卖出股票成本总额	2,003,372,764.25

买卖股票差价收入	384,778,584.25
----------	----------------

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,643,418,591.49
减：现金支付赎回款总额	1,445,789,506.49
减：赎回股票成本总额	1,874,845,514.96
赎回差价收入	322,783,570.04

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	33,832,708.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	31,068,543.72
减：应收利息总额	4,158.99
买卖债券差价收入	2,760,006.25

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	15,109,537.86

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	72,889,697.59
其中：证券出借权益补偿收入	8,714,970.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	72,889,697.59

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-617,378,964.99
——股票投资	-617,594,779.35
——债券投资	215,814.36
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-12,745,884.00
——权证投资	-
——期货投资	-12,745,884.00
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	-630,124,848.99

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	176,361.39
基金申购费收入	-
替代损益收入	4,081,821.48
其他	-
合计	4,258,182.87

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,365,692.99
银行间市场交易费用	-
合计	3,365,692.99

注：交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 128,358.28 元。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	18,250.73

指数使用费	1,426,402.76
合计	1,543,832.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	573,353,459.34	11.42%	15,962,000.00	0.28%

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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	57,338.36	11.70%	54,379.71	20.98%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	1,596.20	0.32%	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,132,013.54	6,532,058.19
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,377,337.83	2,177,352.76

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	2,504,139,531.00	59.6811%	2,403,181,331.00	60.5150%

广发证券	4,812,362.00	0.1147%	18,006,618.00	0.4534%
------	--------------	---------	---------------	---------

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	84,933,230.51	165,515.97	140,836,401.32	357,835.15

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30
上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
-	-	-	-	-	-

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票建设银行。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有广发证券的 A 股的估值总额为人民币 20,588,462.08

元(2020年12月31日:22,519,668.16元),持有中国建设银行的A股的估值总额为人民币20,576,403.40元(2020年12月31日:19,761,250.88元)。

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(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

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

				受限						
30094 2	易瑞 生物	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 流通 受限	5.31	28.52	443	2,352. 33	12,634 .36	-
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	9.79	23.01	255	2,496. 45	5,867. 55	-
30094 5	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	4.56	18.88	474	2,161. 44	8,949. 12	-
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新股 流通 受限	13.00	27.42	324	2,808. 00	8,884. 08	-
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 流通 受限	8.41	39.13	219	1,841. 79	8,569. 47	-
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984. 80	9,207. 20	-
30095 3	震裕 科技	2021-0 3-11	2021-0 9-22	新股 流通 受限	28.77	99.85	240	6,904. 80	23,964 .00	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834. 96	10,688 .24	-
30095 6	英力 股份	2021-0 3-16	2021-0 9-27	新股 流通 受限	12.85	25.80	371	4,767. 35	9,571. 80	-
30095 7	贝泰 妮	2021-0 3-18	2021-0 9-27	新股 流通 受限	47.33	251.96	853	40,372 .49	214,92 1.88	-
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826. 72	5,396. 04	-
30096 1	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	新股 流通 受限	8.48	22.07	394	3,341. 12	8,695. 58	-
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958. 40	9,429. 12	-
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432. 79	6,364. 67	-
30096	共同	2021-0	2021-1	新股	8.24	31.54	286	2,356.	9,020.	-

6	药业	3-31	0-11	流通受限				64	44	
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

				受限						
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688183	生益电子	2021-02-10	2021-08-25	新股流通受限	12.42	14.19	18,394	228,453.48	261,010.86	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	新股流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	新股流通受限	2.87	4.75	135,282	388,259.34	642,589.50	-
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688656	浩欧博	2021-01-06	2021-07-13	新股流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021-06-11	2021-07-08	新发流通受限	100.00	100.00	3,000	299,998.69	299,998.69	-
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	45,160	4,515,980.20	4,515,980.20	老股东配债
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	8,720	871,992.36	871,992.36	新债网下发行
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新发流通	100.00	100.00	1,923	192,300.00	192,300.00	-

				受限						
12703 8	国微 转债	2021-0 6-10	2021-0 7-14	新发 流通 受限	100.00	100.00	4,312	431,20 0.00	431,20 0.00	-

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。

6.4.12.2 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
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项停牌	5.59	2021-07-06	6.15	1,723,956	15,510,237.47	9,636,914.04	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
1	000001	平安银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	22.62	895,600.00	20,258,472.00
2	000002	万科 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	23.81	634,000.00	15,095,540.00
3	000063	中兴通讯	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	33.23	284,900.00	9,467,227.00
4	000066	中国长城	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	14.60	161,800.00	2,362,280.00
5	000069	华侨城 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	7.44	381,900.00	2,841,336.00
6	000100	TCL 科技	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 9 日	7.65	238,200.00	1,822,230.00

7	000157	中联重科	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 9 日	9.24	388,500.00	3,589,740.0 0
8	000166	申万宏源	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	4.68	851,400.00	3,984,552.0 0
9	000333	美的集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	71.37	454,400.00	32,430,528. 00
10	000338	潍柴动力	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 14 日	17.87	438,200.00	7,830,634.0 0
11	000425	徐工机械	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	6.37	262,400.00	1,671,488.0 0
12	000538	云南白药	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 9 日	115.7 2	37,400.00	4,327,928.0 0
13	000568	泸州老窖	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	235.9 4	44,700.00	10,546,518. 00
14	000625	长安汽车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	26.28	209,100.00	5,495,148.0 0
15	000651	格力电器	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	52.10	444,200.00	23,142,820. 00
16	000656	金科股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.79	251,600.00	1,456,764.0 0
17	000703	恒逸石化	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	11.95	203,900.00	2,436,605.0 0
18	000708	中信特钢	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日	20.84	90,000.00	1,875,600.0 0
19	000725	京东方 A	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	6.24	3,127,700.0 0	19,516,848. 00
20	000728	国元证券	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 9 日	7.97	281,300.00	2,241,961.0 0
21	000768	中航西飞	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	26.28	129,000.00	3,390,120.0 0
22	000776	广发证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	15.14	275,700.00	4,174,098.0 0
23	000783	长江证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	7.32	361,300.00	2,644,716.0 0
24	000786	北新建材	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	39.25	34,400.00	1,350,200.0 0
25	000800	一汽解放	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 14 日	10.82	86,700.00	938,094.00
26	000858	五粮液	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	297.8 9	162,000.00	48,258,180. 00
27	000860	顺鑫农业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	42.18	40,000.00	1,687,200.0 0
28	000876	新希望	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	14.67	200,800.00	2,945,736.0 0

29	000895	双汇发展	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	31.80	128,000.00	4,070,400.00
30	000938	紫光股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	21.88	73,900.00	1,616,932.00
31	000963	华东医药	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	46.01	78,900.00	3,630,189.00
32	000977	浪潮信息	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	28.13	90,200.00	2,537,326.00
33	001979	招商蛇口	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	10.95	110,300.00	1,207,785.00
34	002001	新和成	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	28.68	144,300.00	4,138,524.00
35	002007	华兰生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	36.68	102,100.00	3,745,028.00
36	002008	大族激光	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	40.39	75,200.00	3,037,328.00
37	002024	苏宁易购	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	5.59	283,800.00	1,586,442.00
38	002027	分众传媒	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	9.41	16,200.00	152,442.00
39	002044	美年健康	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	9.11	255,200.00	2,324,872.00
40	002049	紫光国微	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	154.19	23,000.00	3,546,370.00
41	002050	三花智控	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	23.98	68,000.00	1,630,640.00
42	002120	韵达股份	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 9 日	13.53	76,600.00	1,036,398.00
43	002129	中环股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	38.60	148,200.00	5,720,520.00
44	002142	宁波银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	38.97	332,800.00	12,969,216.00
45	002157	正邦科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 7 日	11.95	124,900.00	1,492,555.00
46	002179	中航光电	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 8 日	79.02	42,800.00	3,382,056.00
47	002202	金风科技	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	12.16	114,400.00	1,391,104.00
48	002230	科大讯飞	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	67.58	164,200.00	11,096,636.00
49	002236	大华股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	21.10	123,900.00	2,614,290.00
50	002241	歌尔股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 12 日	42.74	221,000.00	9,445,540.00

51	002252	上海莱士	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	7.49	310,100.00	2,322,649.00
52	002271	东方雨虹	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	55.32	164,500.00	9,100,140.00
53	002304	洋河股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	207.20	56,000.00	11,603,200.00
54	002311	海大集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	81.60	77,400.00	6,315,840.00
55	002352	顺丰控股	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	67.70	170,100.00	11,515,770.00
56	002384	东山精密	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	20.84	60,900.00	1,269,156.00
57	002410	广联达	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	68.20	45,200.00	3,082,640.00
58	002414	高德红外	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	27.58	87,400.00	2,410,492.00
59	002415	海康威视	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	64.50	360,700.00	23,265,150.00
60	002456	欧菲光	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	8.88	198,400.00	1,761,792.00
61	002460	赣锋锂业	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 14 日	121.09	71,600.00	8,670,044.00
62	002463	沪电股份	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	15.47	75,800.00	1,172,626.00
63	002475	立讯精密	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	46.00	456,300.00	20,989,800.00
64	002493	荣盛石化	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	17.27	218,800.00	3,778,676.00
65	002508	老板电器	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	46.50	20,500.00	953,250.00
66	002555	三七互娱	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	24.02	124,000.00	2,978,480.00
67	002558	巨人网络	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	13.30	111,500.00	1,482,950.00
68	002594	比亚迪	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	251.00	84,400.00	21,184,400.00
69	002600	领益智造	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.19	260,200.00	2,391,238.00
70	002601	龙麟佰利	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	34.58	98,700.00	3,413,046.00
71	002602	世纪华通	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	6.42	278,200.00	1,786,044.00
72	002607	中公教育	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	20.89	170,400.00	3,559,656.00

73	002624	完美世界	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	23.91	90,400.00	2,161,464.0 0
74	002673	西部证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	8.25	164,800.00	1,359,600.0 0
75	002714	牧原股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	60.82	242,500.00	14,748,850. 00
76	002736	国信证券	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	10.75	219,500.00	2,359,625.0 0
77	002739	万达电影	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	15.79	45,000.00	710,550.00
78	002773	康弘药业	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	23.13	24,100.00	557,433.00
79	002812	恩捷股份	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日	234.1 0	39,000.00	9,129,900.0 0
80	002841	视源股份	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	124.2 9	10,000.00	1,242,900.0 0
81	002939	长城证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	11.13	86,900.00	967,197.00
82	300003	乐普医疗	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	32.12	74,100.00	2,380,092.0 0
83	300014	亿纬锂能	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 12 日	103.9 3	70,800.00	7,358,244.0 0
84	300015	爱尔眼科	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 12 日	70.98	170,567.00	12,106,845. 66
85	300059	东方财富	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	32.79	398,800.00	13,076,652. 00
86	300122	智飞生物	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	186.7 3	7,000.00	1,307,110.0 0
87	300124	汇川技术	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	74.26	102,400.00	7,604,224.0 0
88	300136	信维通信	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	30.88	90,000.00	2,779,200.0 0
89	300142	沃森生物	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 12 日	61.70	7,900.00	487,430.00
90	300144	宋城演艺	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	16.80	104,500.00	1,755,600.0 0
91	300274	阳光电源	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	115.0 6	94,900.00	10,919,194. 00
92	300347	泰格医药	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	193.3 0	16,700.00	3,228,110.0 0
93	300408	三环集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	42.42	56,200.00	2,384,004.0 0
94	300413	芒果超媒	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	68.60	28,400.00	1,948,240.0 0

95	300433	蓝思科技	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	29.41	137,700.00	4,049,757.0 0
96	300450	先导智能	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	60.14	56,800.00	3,415,952.0 0
97	300498	温氏股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	14.37	413,000.00	5,934,810.0 0
98	300529	健帆生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	86.36	30,500.00	2,633,980.0 0
99	300595	欧普康视	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	103.5 5	47,200.00	4,887,560.0 0
100	300601	康泰生物	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	149.0 0	6,200.00	923,800.00
101	300676	华大基因	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	118.6 0	7,000.00	830,200.00
102	600000	浦发银行	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	10.00	183,500.00	1,835,000.0 0
103	600009	上海机场	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 12 日	48.13	95,300.00	4,586,789.0 0
104	600010	包钢股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	1.55	2,110,200.0 0	3,270,810.0 0
105	600011	华能国际	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	4.22	405,000.00	1,709,100.0 0
106	600015	华夏银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	6.19	291,900.00	1,806,861.0 0
107	600016	民生银行	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 6 日	4.41	236,800.00	1,044,288.0 0
108	600018	上港集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	4.77	253,000.00	1,206,810.0 0
109	600019	宝钢股份	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	7.64	410,000.00	3,132,400.0 0
110	600025	华能水电	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	5.79	165,800.00	959,982.00
111	600028	中国石化	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	4.36	124,600.00	543,256.00
112	600029	南方航空	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 7 日	6.02	102,100.00	614,642.00
113	600030	中信证券	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	24.94	459,900.00	11,469,906. 00
114	600031	三一重工	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	29.07	78,400.00	2,279,088.0 0
115	600036	招商银行	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	54.19	240,400.00	13,027,276. 00
116	600050	中国联通	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 9 日	4.32	1,038,900.0 0	4,488,048.0 0

117	600061	国投资本	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	8.49	90,992.00	772,522.08
118	600085	同仁堂	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	40.85	22,700.00	927,295.00
119	600104	上汽集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	21.97	137,500.00	3,020,875.00
120	600109	国金证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	12.69	223,300.00	2,833,677.00
121	600111	北方稀土	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	20.70	200,600.00	4,152,420.00
122	600115	中国东航	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.08	411,800.00	2,091,944.00
123	600118	中国卫星	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 9 日	29.26	45,100.00	1,319,626.00
124	600143	金发科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	20.86	137,900.00	2,876,594.00
125	600150	中国船舶	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	16.51	166,500.00	2,748,915.00
126	600161	天坛生物	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	34.25	10,000.00	342,500.00
127	600176	中国巨石	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	15.51	87,800.00	1,361,778.00
128	600183	生益科技	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	23.41	10,000.00	234,100.00
129	600196	复星医药	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	72.13	109,100.00	7,869,383.00
130	600233	圆通速递	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	10.01	116,300.00	1,164,163.00
131	600276	恒瑞医药	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	67.97	96,600.00	6,565,902.00
132	600299	安迪苏	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 13 日	11.96	28,700.00	343,252.00
133	600309	万华化学	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 9 日	108.82	143,700.00	15,637,434.00
134	600340	华夏幸福	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	5.24	182,500.00	956,300.00
135	600346	恒力石化	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 12 日	26.24	195,100.00	5,119,424.00
136	600352	浙江龙盛	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	13.74	242,300.00	3,329,202.00
137	600362	江西铜业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	22.38	96,700.00	2,164,146.00
138	600383	金地集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	10.24	210,100.00	2,151,424.00

139	600406	国电南瑞	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	23.24	146,420.00	3,402,800.8 0
140	600438	通威股份	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	43.27	251,400.00	10,878,078. 00
141	600482	中国动力	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 14 日	17.42	60,400.00	1,052,168.0 0
142	600489	中金黄金	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.62	180,800.00	1,558,496.0 0
143	600519	贵州茅台	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	2,056. 70	12,500.00	25,708,750. 00
144	600521	华海药业	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	20.88	81,400.00	1,699,632.0 0
145	600522	中天科技	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	10.00	226,400.00	2,264,000.0 0
146	600547	山东黄金	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	19.22	166,400.00	3,198,208.0 0
147	600570	恒生电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	93.25	27,900.00	2,601,675.0 0
148	600584	长电科技	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	37.68	110,000.00	4,144,800.0 0
149	600585	海螺水泥	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 9 日	41.05	194,400.00	7,980,120.0 0
150	600588	用友网络	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	33.26	52,900.00	1,759,454.0 0
151	600600	青岛啤酒	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	115.6 5	20,000.00	2,313,000.0 0
152	600606	绿地控股	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.45	296,800.00	1,617,560.0 0
153	600655	豫园股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	11.59	144,900.00	1,679,391.0 0
154	600660	福耀玻璃	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	55.85	101,800.00	5,685,530.0 0
155	600690	海尔智家	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	25.91	128,400.00	3,326,844.0 0
156	600703	三安光电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	32.05	247,600.00	7,935,580.0 0
157	600705	中航资本	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	3.87	493,100.00	1,908,297.0 0
158	600741	华域汽车	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	26.27	42,700.00	1,121,729.0 0
159	600745	闻泰科技	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 8 日	96.90	56,000.00	5,426,400.0 0
160	600760	中航沈飞	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	60.30	47,980.00	2,893,194.0 0

161	600795	国电电力	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	2.43	1,086,500.0 0	2,640,195.0 0
162	600837	海通证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	11.50	311,300.00	3,579,950.0 0
163	600848	上海临港	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 8 日	17.90	81,800.00	1,464,220.0 0
164	600872	中炬高新	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	42.02	51,400.00	2,159,828.0 0
165	600886	国投电力	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.61	150,300.00	1,444,383.0 0
166	600887	伊利股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	36.83	560,200.00	20,632,166. 00
167	600893	航发动力	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	53.19	99,400.00	5,287,086.0 0
168	600900	长江电力	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	20.64	53,400.00	1,102,176.0 0
169	600918	中泰证券	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	10.82	58,500.00	632,970.00
170	600919	江苏银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	7.10	332,900.00	2,363,590.0 0
171	600926	杭州银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 7 日	14.75	266,800.00	3,935,300.0 0
172	600958	东方证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	9.99	376,300.00	3,759,237.0 0
173	600999	招商证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	19.02	138,200.00	2,628,564.0 0
174	601006	大秦铁路	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	6.58	321,400.00	2,114,812.0 0
175	601009	南京银行	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 2 日	10.52	466,800.00	4,910,736.0 0
176	601012	隆基股份	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	88.84	393,820.00	34,986,968. 80
177	601021	春秋航空	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 9 日	56.90	20,100.00	1,143,690.0 0
178	601088	中国神华	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 13 日	19.52	24,400.00	476,288.00
179	601100	恒立液压	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	85.92	18,200.00	1,563,744.0 0
180	601108	财通证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	10.49	92,000.00	965,080.00
181	601111	中国国航	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	7.78	275,000.00	2,139,500.0 0
182	601138	工业富联	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	12.41	91,800.00	1,139,238.0 0

183	601155	新城控股	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	41.60	66,200.00	2,753,920.0 0
184	601162	天风证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	4.86	398,900.00	1,938,654.0 0
185	601166	兴业银行	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 9 日	20.55	1,030,900.0 0	21,184,995. 00
186	601169	北京银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	4.87	110,900.00	540,083.00
187	601211	国泰君安	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	17.14	33,900.00	581,046.00
188	601216	君正集团	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 12 日	5.09	312,200.00	1,589,098.0 0
189	601225	陕西煤业	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	11.85	257,100.00	3,046,635.0 0
190	601229	上海银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.20	192,400.00	1,577,680.0 0
191	601231	环旭电子	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	16.81	54,400.00	914,464.00
192	601236	红塔证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	13.56	32,700.00	443,412.00
193	601238	广汽集团	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	12.95	115,800.00	1,499,610.0 0
194	601318	中国平安	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	64.28	291,200.00	18,718,336. 00
195	601319	中国人保	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.93	77,100.00	457,203.00
196	601328	交通银行	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	4.90	1,332,300.0 0	6,528,270.0 0
197	601336	新华保险	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	45.91	20,000.00	918,200.00
198	601360	三六零	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	12.21	199,600.00	2,437,116.0 0
199	601377	兴业证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	9.66	357,500.00	3,453,450.0 0
200	601390	中国中铁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	5.24	561,200.00	2,940,688.0 0
201	601398	工商银行	2021 年 7 月 12 日 -2021 年 7 月 14 日	5.17	1,628,000.0 0	8,416,760.0 0
202	601555	东吴证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.34	204,900.00	1,708,866.0 0
203	601600	中国铝业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.30	619,000.00	3,280,700.0 0
204	601601	中国太保	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 8 日	28.97	160,400.00	4,646,788.0 0

205	601607	上海医药	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	21.13	49,800.00	1,052,274.0 0
206	601618	中国中冶	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	2.98	658,000.00	1,960,840.0 0
207	601628	中国人寿	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	33.89	57,900.00	1,962,231.0 0
208	601633	长城汽车	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	43.59	106,700.00	4,651,053.0 0
209	601658	邮储银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.02	533,200.00	2,676,664.0 0
210	601668	中国建筑	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 14 日	4.65	930,600.00	4,327,290.0 0
211	601669	中国电建	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	3.87	494,600.00	1,914,102.0 0
212	601688	华泰证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	15.80	42,500.00	671,500.00
213	601696	中银证券	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 9 日	20.59	77,600.00	1,597,784.0 0
214	601698	中国卫通	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 9 日	16.19	40,500.00	655,695.00
215	601727	上海电气	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	4.24	244,400.00	1,036,256.0 0
216	601766	中国中车	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	6.08	1,132,500.0 0	6,885,600.0 0
217	601788	光大证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	17.89	180,100.00	3,221,989.0 0
218	601800	中国交建	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 9 日	6.48	133,200.00	863,136.00
219	601808	中海油服	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 13 日	14.36	55,200.00	792,672.00
220	601816	京沪高铁	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.29	1,520,600.0 0	8,043,974.0 0
221	601818	光大银行	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	3.78	282,500.00	1,067,850.0 0
222	601838	成都银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	12.64	156,900.00	1,983,216.0 0
223	601857	中国石油	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.29	899,000.00	4,755,710.0 0
224	601872	招商轮船	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	4.62	332,540.00	1,536,334.8 0
225	601877	正泰电器	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	33.38	99,200.00	3,311,296.0 0
226	601878	浙商证券	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	13.08	137,800.00	1,802,424.0 0

227	601881	中国银河	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	10.78	108,900.00	1,173,942.0 0
228	601888	中国中免	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 8 日	300.1 0	10,000.00	3,001,000.0 0
229	601899	紫金矿业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	9.69	269,000.00	2,606,610.0 0
230	601901	方正证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	9.36	383,800.00	3,592,368.0 0
231	601919	中远海控	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	30.54	450,400.00	13,755,216. 00
232	601933	永辉超市	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	4.73	350,400.00	1,657,392.0 0
233	601939	建设银行	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	6.65	519,300.00	3,453,345.0 0
234	601985	中国核电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.06	482,300.00	2,440,438.0 0
235	601988	中国银行	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	3.08	1,942,900.0 0	5,984,132.0 0
236	601989	中国重工	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 13 日	4.12	20,000.00	82,400.00
237	601990	南京证券	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	10.52	169,900.00	1,787,348.0 0
238	601998	中信银行	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 1 日	5.10	15,600.00	79,560.00
239	603019	中科曙光	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	27.61	94,800.00	2,617,428.0 0
240	603259	药明康德	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	156.5 9	64,300.00	10,068,737. 00
241	603288	海天味业	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	128.9 5	74,800.00	9,645,460.0 0
242	603369	今世缘	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 14 日	54.16	58,500.00	3,168,360.0 0
243	603501	韦尔股份	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	322.0 0	48,000.00	15,456,000. 00
244	603799	华友钴业	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	114.2 0	58,800.00	6,714,960.0 0
245	603806	福斯特	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 13 日	105.1 3	20,700.00	2,176,191.0 0
246	603833	欧派家居	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 13 日	141.9 6	4,300.00	610,428.00
247	603899	晨光文具	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	84.56	27,400.00	2,316,944.0 0
248	603939	益丰药房	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 6 日	56.09	10,000.00	560,900.00

249	603986	兆易创新	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	187.9 0	34,600.00	6,501,340.0 0
250	603993	洛阳钼业	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	5.16	155,200.00	800,832.00
251	688009	中国通号	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	5.69	238,300.00	1,355,927.0 0
252	688012	中微公司	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 5 日	165.9 2	7,100.00	1,178,032.0 0
253	688036	传音控股	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日	209.5 0	5,800.00	1,215,100.0 0
254	688396	华润微	2021 年 7 月 5 日 -2021 年 7 月 5 日	91.02	1,100.00	100,122.00
合计	-	-	-	-	59,482,919. 00	1,160,039,6 56.14

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策

性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.07%(2020 年 12 月 31 日: 0.09%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注: 1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	5,688,376.77	7,682,565.03
AAA 以下	1,535,855.75	447,005.88
未评级	0.00	0.00
合计	7,224,232.52	8,129,570.91

注: 1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	84,933,230.51	-	-	-	84,933,230.51
结算备付金	101,032,700.81	-	-	-	101,032,700.81
存出保证金	22,188,261.85	-	-	-	22,188,261.85
交易性金融资产	-	-	7,223,685.61	9,849,364,451.21	9,856,588,136.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,862,498.64	5,862,498.64
应收利息	-	-	-	466,547.57	466,547.57
应收股利	-	-	-	1,910,878.34	1,910,878.34
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	208,154,193.17	-	7,223,685.61	9,857,604,375.76	10,072,982,254.54
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,142,269.71	4,142,269.71
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,240,156.66	1,240,156.66

应付托管费	-	-	-	413,385.58	413,385.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	259,234.04	259,234.04
应交税费	-	-	-	177,561.28	177,561.28
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,406,995.39	4,406,995.39
负债总计	-	-	-	10,639,602.66	10,639,602.66
利率敏感度缺口	208,154,193.17	-	7,223,685.61	9,846,964,773.10	10,062,342,651.88
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	105,915,309.18	-	-	-	105,915,309.18
结算备付金	95,820,375.67	-	-	-	95,820,375.67
存出保证金	23,848,203.68	-	-	-	23,848,203.68
交易性金融资产	-	-	8,128,956.93	9,192,632,952.34	9,200,761,909.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,845,985.92	1,845,985.92
应收利息	-	-	-	342,139.50	342,139.50
应收股利	-	-	-	419.10	419.10
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	225,583,888.53	-	8,128,956.93	9,194,821,496.86	9,428,534,342.32
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	12,999,232.53	12,999,232.53
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,133,798.91	1,133,798.91
应付托管费	-	-	-	377,932.99	377,932.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	211,923.79	211,923.79
应交税费	-	-	-	491,358.51	491,358.51
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,548,901.94	6,548,901.94
负债总计	-	-	-	21,763,148.67	21,763,148.67
利率敏感度缺口	225,583,888.53	-	8,128,956.93	9,173,058,348.19	9,406,771,193.65

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

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

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,849,364,451.21	97.88	9,192,632,952.34	97.72
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	9,849,364,451.21	97.88	9,192,632,952.34	97.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	492,400,792.02	459,615,284.40
	2.业绩比较基准下降 5%	-492,400,792.02	-459,615,284.40

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 9,839,393,532.00 元，属于第二层次的余额为 17,194,604.82 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 9,179,151,946.84 元，第二层次 21,609,962.43 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影 响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,849,364,451.21	97.78
	其中：股票	9,849,364,451.21	97.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,223,685.61	0.07
	其中：债券	7,223,685.61	0.07
	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	185,965,931.32	1.85
8	其他各项资产	30,428,186.40	0.30
9	合计	10,072,982,254.54	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 1,160,039,656.14 元，占净值比例 11.53%。

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	103,061,742.96	1.02
B	采矿业	207,800,115.17	2.07
C	制造业	5,447,766,992.00	54.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	178,640,881.37	1.78
E	建筑业	119,039,070.01	1.18
F	批发和零售业	70,823,482.34	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	288,108,002.37	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	323,098,090.98	3.21
J	金融业	2,320,397,563.57	23.06
K	房地产业	202,714,849.80	2.01
L	租赁和商务服务业	179,391,998.34	1.78
M	科学研究和技术服务业	140,601,503.04	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,782,236.48	0.18
Q	卫生和社会工作	209,075,398.80	2.08
R	文化、体育和娱乐业	41,026,251.65	0.41
S	综合	-	-
	合计	9,849,364,451.21	97.88

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	290,166	596,784,412.20	5.93
2	601318	中国平安	4,983,857	320,362,327.96	3.18
3	600036	招商银行	5,690,597	308,373,451.43	3.06
4	000858	五粮液	893,600	266,194,504.00	2.65
5	601012	隆基股份	1,990,910	176,872,444.40	1.76
6	000333	美的集团	2,267,846	161,856,169.02	1.61
7	600276	恒瑞医药	2,059,330	139,972,660.10	1.39
8	002415	海康威视	2,149,628	138,651,006.00	1.38
9	601166	兴业银行	6,685,441	137,385,812.55	1.37
10	601888	中国中免	449,629	134,933,662.90	1.34
11	603259	药明康德	824,656	129,132,883.04	1.28
12	300059	东方财富	3,800,696	124,624,821.84	1.24
13	000651	格力电器	2,212,269	115,259,214.90	1.15
14	600900	长江电力	5,231,763	107,983,588.32	1.07
15	002594	比亚迪	417,035	104,675,785.00	1.04
16	002475	立讯精密	2,247,797	103,398,662.00	1.03
17	600887	伊利股份	2,795,853	102,971,265.99	1.02
18	000001	平安银行	4,460,846	100,904,336.52	1.00
19	600030	中信证券	3,917,460	97,701,452.40	0.97
20	000725	京东方 A	15,570,323	97,158,815.52	0.97
21	300015	爱尔眼科	1,241,893	88,149,565.14	0.88
22	601398	工商银行	16,123,925	83,360,692.25	0.83
23	600031	三一重工	2,733,186	79,453,717.02	0.79
24	000568	泸州老窖	336,447	79,381,305.18	0.79
25	600309	万华化学	721,214	78,482,507.48	0.78
26	603501	韦尔股份	240,100	77,312,200.00	0.77
27	603288	海天味业	580,674	74,877,912.30	0.74
28	000002	万科 A	3,130,800	74,544,348.00	0.74
29	002714	牧原股份	1,209,733	73,575,961.06	0.73
30	600809	山西汾酒	160,189	71,764,672.00	0.71
31	300122	智飞生物	367,620	68,645,682.60	0.68
32	601919	中远海控	2,224,900	67,948,446.00	0.68
33	002142	宁波银行	1,657,849	64,606,375.53	0.64
34	600436	片仔癀	138,556	62,114,654.80	0.62
35	601328	交通银行	12,637,457	61,923,539.30	0.62
36	601899	紫金矿业	6,352,531	61,556,025.39	0.61
37	002304	洋河股份	278,300	57,663,760.00	0.57
38	002812	恩捷股份	245,000	57,354,500.00	0.57
39	002352	顺丰控股	838,403	56,759,883.10	0.56
40	002230	科大讯飞	818,206	55,294,361.48	0.55
41	300014	亿纬锂能	520,535	54,099,202.55	0.54

42	300274	阳光电源	469,900	54,066,694.00	0.54
43	600000	浦发银行	5,401,715	54,017,150.00	0.54
44	600438	通威股份	1,242,200	53,749,994.00	0.53
45	300124	汇川技术	713,150	52,958,519.00	0.53
46	600837	海通证券	4,438,363	51,041,174.50	0.51
47	000661	长春高新	130,078	50,340,186.00	0.50
48	000100	TCL 科技	6,453,104	49,366,245.60	0.49
49	601816	京沪高铁	9,035,636	47,798,514.44	0.48
50	000063	中兴通讯	1,419,006	47,153,569.38	0.47
51	002241	歌尔股份	1,100,773	47,047,038.02	0.47
52	300347	泰格医药	241,801	46,740,133.30	0.46
53	603986	兆易创新	245,016	46,038,506.40	0.46
54	601601	中国太保	1,572,794	45,563,842.18	0.45
55	600585	海螺水泥	1,105,078	45,363,451.90	0.45
56	600690	海尔智家	1,742,548	45,149,418.68	0.45
57	002271	东方雨虹	812,153	44,928,303.96	0.45
58	601668	中国建筑	9,644,390	44,846,413.50	0.45
59	002460	赣锋锂业	369,600	44,754,864.00	0.44
60	603799	华友钴业	390,110	44,550,562.00	0.44
61	002027	分众传媒	4,724,584	44,458,335.44	0.44
62	300142	沃森生物	719,500	44,393,150.00	0.44
63	600016	民生银行	9,782,764	43,141,989.24	0.43
64	600763	通策医疗	103,000	42,333,000.00	0.42
65	601288	农业银行	13,217,793	40,049,912.79	0.40
66	600196	复星医药	554,345	39,984,904.85	0.40
67	600048	保利地产	3,303,860	39,778,474.40	0.40
68	600703	三安光电	1,235,900	39,610,595.00	0.39
69	000338	潍柴动力	2,182,419	38,999,827.53	0.39
70	600919	江苏银行	5,436,270	38,597,517.00	0.38
71	002129	中环股份	975,500	37,654,300.00	0.37
72	601229	上海银行	4,575,376	37,518,083.20	0.37
73	601688	华泰证券	2,367,800	37,411,240.00	0.37
74	600050	中国联通	8,555,046	36,957,798.72	0.37
75	600660	福耀玻璃	645,436	36,047,600.60	0.36
76	600570	恒生电子	383,843	35,793,359.75	0.36
77	601211	国泰君安	2,074,903	35,563,837.42	0.35
78	600104	上汽集团	1,611,324	35,400,788.28	0.35
79	688111	金山办公	86,222	34,040,445.60	0.34
80	601766	中国中车	5,596,120	34,024,409.60	0.34
81	601169	北京银行	6,808,496	33,157,375.52	0.33
82	600999	招商证券	1,707,997	32,486,102.94	0.32
83	002371	北方华创	114,000	31,621,320.00	0.31
84	600019	宝钢股份	4,095,721	31,291,308.44	0.31
85	002311	海大集团	381,700	31,146,720.00	0.31

86	002049	紫光国微	195,250	30,105,597.50	0.30
87	601988	中国银行	9,695,848	29,863,211.84	0.30
88	002410	广联达	437,100	29,810,220.00	0.30
89	600406	国电南瑞	1,276,222	29,659,399.28	0.29
90	601088	中国神华	1,518,316	29,637,528.32	0.29
91	300498	温氏股份	2,051,520	29,480,342.40	0.29
92	601818	光大银行	7,606,283	28,751,749.74	0.29
93	300601	康泰生物	189,300	28,205,700.00	0.28
94	600745	闻泰科技	287,600	27,868,440.00	0.28
95	000625	长安汽车	1,043,602	27,425,860.56	0.27
96	000538	云南白药	235,452	27,246,505.44	0.27
97	600028	中国石化	6,151,491	26,820,500.76	0.27
98	300450	先导智能	441,260	26,537,376.40	0.26
99	600893	航发动力	491,626	26,149,586.94	0.26
100	601628	中国人寿	765,389	25,939,033.21	0.26
101	600346	恒力石化	970,254	25,459,464.96	0.25
102	002821	凯莱英	68,000	25,336,800.00	0.25
103	601658	邮储银行	5,005,500	25,127,610.00	0.25
104	600588	用友网络	751,326	24,989,102.76	0.25
105	601390	中国中铁	4,681,312	24,530,074.88	0.24
106	601633	长城汽车	560,497	24,432,064.23	0.24
107	300595	欧普康视	235,200	24,354,960.00	0.24
108	601009	南京银行	2,302,300	24,220,196.00	0.24
109	002493	荣盛石化	1,396,200	24,112,374.00	0.24
110	601377	兴业证券	2,463,456	23,796,984.96	0.24
111	601857	中国石油	4,466,632	23,628,483.28	0.23
112	688036	传音控股	112,159	23,497,310.50	0.23
113	300413	芒果超媒	327,100	22,439,060.00	0.22
114	600132	重庆啤酒	111,100	21,992,245.00	0.22
115	600009	上海机场	453,213	21,813,141.69	0.22
116	601225	陕西煤业	1,839,262	21,795,254.70	0.22
117	600584	长电科技	572,375	21,567,090.00	0.21
118	002601	龙蟠佰利	618,000	21,370,440.00	0.21
119	300408	三环集团	502,800	21,328,776.00	0.21
120	600426	华鲁恒升	681,700	21,098,615.00	0.21
121	600111	北方稀土	1,001,988	20,741,151.60	0.21
122	688012	中微公司	124,956	20,732,699.52	0.21
123	601100	恒立液压	240,709	20,681,717.28	0.21
124	000776	广发证券	1,359,872	20,588,462.08	0.20
125	601939	建设银行	3,094,196	20,576,403.40	0.20
126	002001	新和成	713,000	20,448,840.00	0.20
127	603882	金域医学	127,500	20,370,675.00	0.20
128	000895	双汇发展	637,600	20,275,680.00	0.20
129	300433	蓝思科技	687,190	20,210,257.90	0.20

130	600926	杭州银行	1,362,368	20,094,928.00	0.20
131	002179	中航光电	253,710	20,048,164.20	0.20
132	002050	三花智控	825,880	19,804,602.40	0.20
133	000166	申万宏源	4,145,657	19,401,674.76	0.19
134	600958	东方证券	1,922,329	19,204,066.71	0.19
135	002841	视源股份	153,458	19,073,294.82	0.19
136	600741	华域汽车	724,171	19,023,972.17	0.19
137	600600	青岛啤酒	162,954	18,845,630.10	0.19
138	300003	乐普医疗	580,400	18,642,448.00	0.19
139	002007	华兰生物	504,882	18,519,071.76	0.18
140	000963	华东医药	402,232	18,506,694.32	0.18
141	000786	北新建材	467,000	18,329,750.00	0.18
142	000157	中联重科	1,949,902	18,017,094.48	0.18
143	601006	大秦铁路	2,736,454	18,005,867.32	0.18
144	603806	福斯特	169,720	17,842,663.60	0.18
145	002607	中公教育	851,232	17,782,236.48	0.18
146	601901	方正证券	1,894,059	17,728,392.24	0.18
147	601336	新华保险	383,259	17,595,420.69	0.17
148	600029	南方航空	2,911,664	17,528,217.28	0.17
149	600015	华夏银行	2,829,528	17,514,778.32	0.17
150	002236	大华股份	826,600	17,441,260.00	0.17
151	601155	新城控股	415,925	17,302,480.00	0.17
152	601989	中国重工	4,196,861	17,291,067.32	0.17
153	600143	金发科技	828,507	17,282,656.02	0.17
154	600176	中国巨石	1,106,014	17,154,277.14	0.17
155	601138	工业富联	1,369,500	16,995,495.00	0.17
156	603993	洛阳钼业	3,248,822	16,763,921.52	0.17
157	000768	中航西飞	636,905	16,737,863.40	0.17
158	601877	正泰电器	495,690	16,546,132.20	0.16
159	600352	浙江龙盛	1,196,300	16,437,162.00	0.16
160	600760	中航沈飞	270,360	16,302,708.00	0.16
161	600010	宝钢股份	10,484,780	16,251,409.00	0.16
162	601788	光大证券	899,678	16,095,239.42	0.16
163	600547	山东黄金	831,192	15,975,510.24	0.16
164	300529	健帆生物	184,940	15,971,418.40	0.16
165	001979	招商蛇口	1,457,489	15,959,504.55	0.16
166	601600	中国铝业	3,005,928	15,931,418.40	0.16
167	002008	大族激光	392,300	15,844,997.00	0.16
168	688169	石头科技	12,521	15,788,981.00	0.16
169	601186	中国铁建	2,117,577	15,733,597.11	0.16
170	603369	今世缘	289,763	15,693,564.08	0.16
171	002202	金风科技	1,270,293	15,446,762.88	0.15
172	601916	浙商银行	3,842,100	15,253,137.00	0.15
173	000876	新希望	1,035,990	15,197,973.30	0.15

174	002555	三七互娱	611,857	14,696,805.14	0.15
175	601799	星宇股份	64,500	14,558,940.00	0.14
176	003816	中国广核	5,427,500	14,491,425.00	0.14
177	603899	晨光文具	170,531	14,420,101.36	0.14
178	000938	紫光股份	658,232	14,402,116.16	0.14
179	002736	国信证券	1,327,523	14,270,872.25	0.14
180	600109	国金证券	1,114,213	14,139,362.97	0.14
181	601066	中信建投	448,745	14,104,055.35	0.14
182	000069	华侨城 A	1,886,341	14,034,377.04	0.14
183	600989	宝丰能源	1,011,400	13,835,952.00	0.14
184	000425	徐工机械	2,159,826	13,758,091.62	0.14
185	300136	信维通信	445,500	13,757,040.00	0.14
186	601669	中国电建	3,519,247	13,619,485.89	0.14
187	603160	汇顶科技	105,056	13,618,409.28	0.14
188	600150	中国船舶	822,700	13,582,777.00	0.13
189	603659	璞泰来	97,300	13,291,180.00	0.13
190	000977	浪潮信息	468,856	13,188,919.28	0.13
191	600795	国电电力	5,424,777	13,182,208.11	0.13
192	002384	东山精密	629,210	13,112,736.40	0.13
193	000783	长江证券	1,778,981	13,022,140.92	0.13
194	601238	广汽集团	1,000,220	12,952,849.00	0.13
195	688008	澜起科技	207,578	12,948,715.64	0.13
196	603019	中科曙光	467,932	12,919,602.52	0.13
197	600085	同仁堂	314,990	12,867,341.50	0.13
198	000596	古井贡酒	53,724	12,866,898.00	0.13
199	002624	完美世界	534,730	12,785,394.30	0.13
200	600079	人福医药	451,200	12,755,424.00	0.13
201	601838	成都银行	996,200	12,591,968.00	0.13
202	300677	英科医疗	99,800	12,455,040.00	0.12
203	600886	国投电力	1,282,423	12,324,085.03	0.12
204	600183	生益科技	526,300	12,320,683.00	0.12
205	300558	贝达药业	113,800	12,317,712.00	0.12
206	601985	中国核电	2,407,195	12,180,406.70	0.12
207	000703	恒逸石化	1,015,610	12,136,539.50	0.12
208	300144	宋城演艺	720,752	12,108,633.60	0.12
209	601108	财通证券	1,154,300	12,108,607.00	0.12
210	601360	三六零	985,090	12,027,948.90	0.12
211	603833	欧派家居	84,693	12,023,018.28	0.12
212	002600	领益智造	1,298,935	11,937,212.65	0.12
213	002414	高德红外	432,000	11,914,560.00	0.12
214	601555	东吴证券	1,427,423	11,904,707.82	0.12
215	603517	绝味食品	141,100	11,893,319.00	0.12
216	000066	中国长城	807,700	11,792,420.00	0.12
217	002252	上海莱士	1,548,557	11,598,691.93	0.12

218	002044	美年健康	1,260,376	11,482,025.36	0.11
219	300676	华大基因	96,700	11,468,620.00	0.11
220	002938	鹏鼎控股	318,500	11,427,780.00	0.11
221	601077	渝农商行	2,846,200	11,356,338.00	0.11
222	600522	中天科技	1,129,400	11,294,000.00	0.11
223	688396	华润微	123,364	11,228,591.28	0.11
224	601607	上海医药	530,061	11,200,188.93	0.11
225	000728	国元证券	1,404,173	11,191,258.81	0.11
226	300033	同花顺	98,700	11,131,386.00	0.11
227	002602	世纪华通	1,714,572	11,007,552.24	0.11
228	600332	白云山	322,897	10,930,063.45	0.11
229	600872	中炬高新	257,244	10,809,392.88	0.11
230	600161	天坛生物	315,400	10,802,450.00	0.11
231	600362	江西铜业	478,268	10,703,637.84	0.11
232	601111	中国国航	1,373,303	10,684,297.34	0.11
233	600383	金地集团	1,038,212	10,631,290.88	0.11
234	601800	中国交建	1,620,198	10,498,883.04	0.10
235	600115	中国东航	2,060,679	10,468,249.32	0.10
236	600845	宝信软件	205,340	10,451,806.00	0.10
237	300628	亿联网络	124,450	10,428,910.00	0.10
238	600061	国投资本	1,208,732	10,262,134.68	0.10
239	002916	深南电路	91,415	10,158,948.95	0.10
240	002508	老板电器	218,400	10,155,600.00	0.10
241	000860	顺鑫农业	239,300	10,093,674.00	0.10
242	601727	上海电气	2,353,129	9,977,266.96	0.10
243	601618	中国中冶	3,283,639	9,785,244.22	0.10
244	000708	中信特钢	465,000	9,690,600.00	0.10
245	601162	天风证券	1,991,510	9,678,738.60	0.10
246	002024	苏宁易购	1,723,956	9,636,914.04	0.10
247	601021	春秋航空	168,427	9,583,496.30	0.10
248	600705	中航资本	2,460,961	9,523,919.07	0.09
249	688363	华熙生物	33,666	9,354,434.76	0.09
250	601878	浙商证券	715,000	9,352,200.00	0.09
251	603939	益丰药房	165,140	9,262,702.60	0.09
252	600606	绿地控股	1,679,746	9,154,615.70	0.09
253	601990	南京证券	848,320	8,924,326.40	0.09
254	002456	欧菲光	990,848	8,798,730.24	0.09
255	002157	正邦科技	723,100	8,641,045.00	0.09
256	002463	沪电股份	554,600	8,579,662.00	0.09
257	600011	华能国际	2,022,400	8,534,528.00	0.08
258	000656	金科股份	1,473,753	8,533,029.87	0.08
259	600521	华海药业	401,200	8,377,056.00	0.08
260	600655	豫园股份	716,000	8,298,440.00	0.08
261	601933	永辉超市	1,748,887	8,272,235.51	0.08

262	603392	万泰生物	31,240	8,096,783.20	0.08
263	600848	上海临港	449,920	8,053,568.00	0.08
264	600118	中国卫星	272,991	7,987,716.66	0.08
265	601216	君正集团	1,550,774	7,893,439.66	0.08
266	601696	中银证券	382,900	7,883,911.00	0.08
267	600489	中金黄金	892,908	7,696,866.96	0.08
268	600018	上港集团	1,597,768	7,621,353.36	0.08
269	601995	中金公司	120,800	7,429,200.00	0.07
270	002558	巨人网络	558,100	7,422,730.00	0.07
271	603195	公牛集团	36,500	7,373,000.00	0.07
272	002120	韵达股份	532,783	7,208,553.99	0.07
273	601998	中信银行	1,408,922	7,185,502.20	0.07
274	601872	招商轮船	1,487,936	6,874,264.32	0.07
275	002673	西部证券	822,142	6,782,671.50	0.07
276	601319	中国人保	1,141,700	6,770,281.00	0.07
277	688009	中国通号	1,188,605	6,763,162.45	0.07
278	688126	沪硅产业	227,659	6,643,089.62	0.07
279	603338	浙江鼎力	111,400	6,538,066.00	0.06
280	002739	万达电影	410,295	6,478,558.05	0.06
281	601881	中国银河	592,582	6,388,033.96	0.06
282	603658	安图生物	82,096	6,220,413.92	0.06
283	600233	圆通速递	580,791	5,813,717.91	0.06
284	603233	大参林	108,860	5,563,834.60	0.06
285	600482	中国动力	299,552	5,218,195.84	0.05
286	601231	环旭电子	306,400	5,150,584.00	0.05
287	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.05
288	002032	苏泊尔	76,501	4,879,998.79	0.05
289	002153	石基信息	206,960	4,865,629.60	0.05
290	600025	华能水电	827,800	4,792,962.00	0.05
291	002939	长城证券	428,400	4,768,092.00	0.05
292	600340	华夏幸福	901,322	4,722,927.28	0.05
293	000800	一汽解放	428,000	4,630,960.00	0.05
294	601236	红塔证券	333,800	4,526,328.00	0.04
295	601808	中海油服	273,400	3,926,024.00	0.04
296	002773	康弘药业	169,020	3,909,432.60	0.04
297	600918	中泰证券	352,200	3,810,804.00	0.04
298	601698	中国卫通	202,300	3,275,237.00	0.03
299	603087	甘李药业	28,873	3,077,284.34	0.03
300	600299	安迪苏	184,900	2,211,404.00	0.02
301	002945	华林证券	124,000	1,713,680.00	0.02
302	688425	铁建重工	135,282	642,589.50	0.01
303	688183	生益电子	18,394	261,010.86	0.00
304	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
305	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00

306	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.00
307	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
308	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
309	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
310	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
311	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
312	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
313	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
314	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
315	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
316	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
317	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
318	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
319	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
320	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
321	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
322	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
323	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
324	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
325	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
326	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
327	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
328	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
329	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
330	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
331	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
332	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
333	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
334	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
335	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
336	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
337	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
338	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
339	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
340	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
341	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
342	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
343	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
344	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
345	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
346	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
347	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
348	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
349	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00

350	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
351	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
352	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
353	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
354	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
355	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
356	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
357	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
358	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
359	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
360	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
361	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
362	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
363	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
364	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
365	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
366	600208	新湖中宝	77	234.08	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	128,029,342.58	1.36
2	600519	贵州茅台	103,536,460.28	1.10
3	000333	美的集团	93,986,876.53	1.00
4	002415	海康威视	66,286,528.97	0.70
5	000651	格力电器	63,638,971.65	0.68
6	000725	京东方 A	50,787,819.47	0.54
7	300059	东方财富	49,584,730.47	0.53
8	002714	牧原股份	46,971,735.86	0.50
9	000001	平安银行	46,765,662.23	0.50
10	002475	立讯精密	45,912,886.12	0.49
11	300274	阳光电源	45,340,651.70	0.48
12	000568	泸州老窖	43,941,037.01	0.47
13	601816	京沪高铁	43,008,807.00	0.46
14	000002	万科 A	42,254,161.93	0.45
15	000661	长春高新	41,006,840.09	0.44
16	300122	智飞生物	40,211,350.32	0.43
17	300015	爱尔眼科	38,133,260.18	0.41
18	688111	金山办公	36,122,241.27	0.38

19	002594	比亚迪	36,037,847.57	0.38
20	002142	宁波银行	32,547,468.73	0.35

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	136,529,722.76	1.45
2	000333	美的集团	97,232,702.94	1.03
3	000651	格力电器	65,408,482.67	0.70
4	300059	东方财富	53,610,308.64	0.57
5	000001	平安银行	47,907,109.43	0.51
6	002714	牧原股份	46,742,154.98	0.50
7	000568	泸州老窖	46,451,857.86	0.49
8	000002	万科 A	42,857,295.53	0.46
9	002415	海康威视	42,149,870.85	0.45
10	000661	长春高新	41,985,359.05	0.45
11	002594	比亚迪	40,132,231.80	0.43
12	002475	立讯精密	36,265,991.95	0.39
13	002352	顺丰控股	33,362,607.42	0.35
14	601318	中国平安	32,751,754.00	0.35
15	000725	京东方 A	32,415,018.00	0.34
16	600036	招商银行	29,121,111.89	0.31
17	000100	TCL 科技	26,901,764.31	0.29
18	300014	亿纬锂能	26,870,328.41	0.29
19	300122	智飞生物	26,842,168.16	0.29
20	002027	分众传媒	24,403,339.32	0.26

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	2,644,005,308.70
卖出股票收入（成交）总额	2,388,151,348.50

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

			(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,223,685.61	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,223,685.61	0.07

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	53,880	5,387,972.56	0.05
2	127036	三花转债	6,964	912,214.36	0.01
3	127038	国微转债	4,312	431,200.00	0.00
4	113049	长汽转债	3,000	299,998.69	0.00
5	123117	健帆转债	1,923	192,300.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2107	IF2107	25	38,934,000.00	870,840.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
IF2109	IF2109	47	72,846,240.00	636,240.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
IF2112	IF2112	42	64,766,520.00	1,676,700.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					3,183,780.00
股指期货投资本期收益(元)					15,109,537.86
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-12,745,884.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,按照相关法律法规的有关规定,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理,本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时,通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求。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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定：1、2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

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

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

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 7170 万元的行政处罚决定：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。

2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营

运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。

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

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

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

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

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行、兴业银行、恒瑞医药外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	22,188,261.85
2	应收证券清算款	5,862,498.64

3	应收股利	1,910,878.34
4	应收利息	466,547.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,428,186.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	000858	五粮液	48,258,180.00	0.48	转融通流通受限
2	601012	隆基股份	34,986,968.80	0.35	转融通流通受限
3	000333	美的集团	32,430,528.00	0.32	转融通流通受限
4	600519	贵州茅台	25,708,750.00	0.26	转融通流通受限
5	002415	海康威视	23,265,150.00	0.23	转融通流通受限
6	601166	兴业银行	21,184,995.00	0.21	转融通流通受限
7	601318	中国平安	18,718,336.00	0.19	转融通流通受限
8	600036	招商银行	13,027,276.00	0.13	转融通流通受限
9	600276	恒瑞医药	6,565,902.00	0.07	转融通流通受限
10	601888	中国中免	3,001,000.00	0.03	转融通流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	中国建设银行一易方达 沪深 300 交易型开放式 指数发起式证券投资基

						金联接基金	
		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
35,201	119,197.4 0	3,548,989,0 22.00	84.58%	646,878,67 6.00	15.42%	2,504,139,5 31.00	59.68%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行—易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金”的“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	易方达基金—中央汇金资产管理有限责任公司—易方达基金—汇金资管单一资产管理计划	360,000,000.00	8.87%
2	日兴资产管理公司—日兴人民币沪深 300 指数母基金	79,700,000.00	1.96%
3	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品（财富管家）委托专户	58,344,500.00	1.44%
4	友邦人寿保险有限公司—传统	42,524,000.00	1.05%
5	中国银河证券股份有限公司融券专用证券账户	38,490,700.00	0.95%
6	韩国产业银行—自有资金（交易所）	34,751,920.00	0.86%
7	国泰君安证券股份有限公司	29,502,315.00	0.73%
8	交通银行股份有限公司—浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF	28,131,100.00	0.69%
9	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品（万能险（金诚利））	25,758,500.00	0.63%
10	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品（寿自营）委托专户	21,939,283.00	0.54%
11	中国建设银行—易方达沪深 300 交易型	2,504,139,531.00	61.67%

开放式指数发起式证券投资基金联接基金		
--------------------	--	--

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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	10,002,600.00	0.2384%	不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,002,600.00	0.2384%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,104,307,415.00
本报告期期初基金份额总额	3,971,216,087.00
本报告期基金总申购份额	1,774,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,549,348,389.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,195,867,698.00

注：期初基金总份额包含场外份额 182,908,672 份；期末基金总份额包含场外份额 135,560,283 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 47,348,389 份。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	3,287,683,323.53	65.50%	317,001.00	64.67%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	573,353,459.34	11.42%	57,338.36	11.70%	-
华创证券	2	1,158,327,971.58	23.08%	115,832.95	23.63%	-

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	10,349,477.16	30.59%	-	-	-	-
华创证券	23,483,231.80	69.41%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加南京证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-20
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第四季度报告提示性公告	证券时报	2021-01-21
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
5	易方达基金管理有限公司关于部分基金变更申赎简称的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加第一创业证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30

8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报	2021-03-30
9	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-19
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加安信证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-17

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
中国建设银行—易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	1	2021 年 01 月 01 日~2021 年 06 月 30 日	2,403,181,331.00	804,885,000.00	703,926,800.00	2,504,139,531.00	59.68%
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；如场外个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；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. 中国证监会核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式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

二〇二一年八月二十八日