

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  
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 期末投资目标基金明细	45
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57

7.13	投资组合报告附注 .....	57
§8	基金份额持有人信息 .....	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	61
§9	开放式基金份额变动 .....	61
§10	重大事件揭示 .....	61
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4	基金投资策略的改变 .....	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8	其他重大事件 .....	66
§11	备查文件目录 .....	66
11.1	备查文件目录 .....	66
11.2	存放地点 .....	67
11.3	查阅方式 .....	67

## §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 联接基金	
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式联接	
基金主代码	110020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 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	3,473,699,681.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式 联接 A	易方达沪深 300ETF 发起 式联接 C
下属分级基金的交易代码	110020	007339
报告期末下属分级基金的份额总额	3,255,209,417.09 份	218,490,264.78 份

注：自 2019 年 4 月 25 日起,本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4% 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。本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可投资存托凭证。此外，为更好地实现投资目标，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，如期权、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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（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	北京市西城区金融大街25号

	6号105室-42891（集中办公区）	
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
本期已实现收益	225,883,928.70	17,041,966.52
本期利润	86,769,221.96	10,796,169.57
加权平均基金份额本期利润	0.0273	0.0457
本期加权平均净值利润率	1.47%	2.46%
本期基金份额净值增长率	1.40%	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
期末可供分配利润	2,434,654,685.37	161,742,591.30
期末可供分配基金份额利润	0.7479	0.7403

期末基金资产净值	6,097,535,604.24	407,470,347.27
期末基金份额净值	1.8732	1.8649
3.1.3 累计期末指标	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
基金份额累计净值增长率	87.32%	38.44%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.21%	0.76%	-1.91%	0.76%	0.70%	0.00%
过去三个月	4.41%	0.92%	3.32%	0.93%	1.09%	-0.01%
过去六个月	1.40%	1.24%	0.29%	1.25%	1.11%	-0.01%
过去一年	27.86%	1.26%	24.19%	1.27%	3.67%	-0.01%
过去三年	56.71%	1.29%	46.42%	1.30%	10.29%	-0.01%
自基金合同生效起至今	87.32%	1.35%	66.51%	1.39%	20.81%	-0.04%

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.23%	0.76%	-1.91%	0.76%	0.68%	0.00%
过去三个月	4.36%	0.93%	3.32%	0.93%	1.04%	0.00%
过去六个月	1.30%	1.24%	0.29%	1.25%	1.01%	-0.01%
过去一年	27.60%	1.26%	24.19%	1.27%	3.41%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	38.44%	1.23%	31.01%	1.24%	7.43%	-0.01%

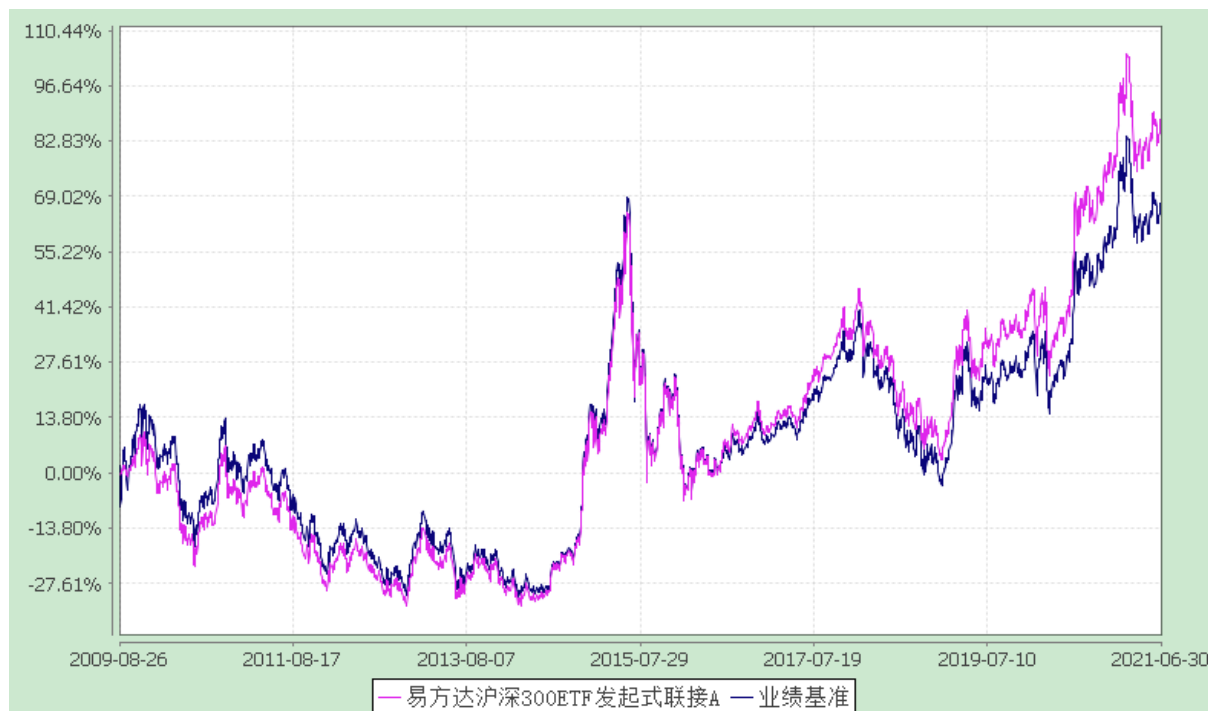
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

(2009 年 8 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

(2019 年 4 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1.自 2019 年 4 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 87.32%，同期业绩比较基准收益率为 66.51%。C 类基金份额净值增长率为 38.44%，同期业绩比较基准收益率为 31.01%。

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

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

本基金是易方达沪深 300ETF 的联接基金，主要投资于易方达沪深 300ETF。报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，依据基金申购赎回变动的情况进行日常操作，控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低水平上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.8732 元，本报告期份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；C 类基金份额净值为 1.8649 元，本报告期份额净值增长率为 1.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%，年化跟踪误差 0.33%，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

易方达沪深 300ETF 发起式联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达沪深 300ETF 发起式联接 C:本报告期内未实施利润分配。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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联接基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	200,981,129.66	180,413,553.63
结算备付金		10,339,894.65	9,248,356.58
存出保证金		2,925,613.06	3,790,991.60
交易性金融资产	6.4.7.2	6,290,530,623.54	5,974,813,702.68
其中：股票投资		134,086,555.55	130,988,099.17
基金投资		6,005,427,423.24	5,692,415,618.74
债券投资		151,016,644.75	151,409,984.77
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		5,437,555.84	15,231,962.99
应收利息	6.4.7.5	1,317,204.57	1,662,704.82
应收股利		-	-
应收申购款		13,218,362.58	12,521,503.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	8,890.40	-
<b>资产总计</b>		<b>6,524,759,274.30</b>	<b>6,197,682,775.69</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
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		-	-
应付赎回款		18,512,901.19	28,686,889.31
应付管理人报酬		61,882.96	59,034.73
应付托管费		20,627.64	19,678.24
应付销售服务费		67,240.02	87,555.66
应付交易费用	6.4.7.7	257,214.35	271,349.96
应交税费		588,675.06	169,933.86
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	244,781.57	227,502.36
负债合计		19,753,322.79	29,521,944.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,473,699,681.87	3,339,990,465.39
未分配利润	6.4.7.10	3,031,306,269.64	2,828,170,366.18
所有者权益合计		6,505,005,951.51	6,168,160,831.57
负债和所有者权益总计		6,524,759,274.30	6,197,682,775.69

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.8732 元，C 类基金份额净值 1.8649 元；



基金份额总额 3,473,699,681.87 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 3,255,209,417.09 份，C 类基金份额总额 218,490,264.78 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联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>100,193,376.62</b>	<b>222,150,986.88</b>
1.利息收入		1,848,331.30	2,972,732.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	438,398.67	849,490.55
债券利息收入		1,409,932.63	2,123,241.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		241,517,054.08	331,774,165.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,096,751.13	4,855,215.68
基金投资收益	6.4.7.13	216,490,294.09	326,420,061.94
债券投资收益	6.4.7.14	669,031.44	-450,853.48
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	1,372,147.57	351,657.45
股利收益	6.4.7.16	888,829.85	598,083.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-145,360,503.69	-117,362,625.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,188,494.93	4,766,714.74
<b>减：二、费用</b>		<b>2,627,985.09</b>	<b>6,047,068.09</b>
1. 管理人报酬		372,497.87	320,048.94
2. 托管费		124,165.96	106,682.94
3. 销售服务费		437,856.63	844,767.33
4. 交易费用	6.4.7.19	803,714.69	4,453,204.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		773,375.51	204,570.31
7. 其他费用	6.4.7.20	116,374.43	117,794.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>97,565,391.53</b>	<b>216,103,918.79</b>

列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>97,565,391.53</b>	<b>216,103,918.79</b>

### 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联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,339,990,465.39	2,828,170,366.18	6,168,160,831.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	97,565,391.53	97,565,391.53
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）	133,709,216.48	105,570,511.93	239,279,728.41
其中：1.基金申购款	1,590,254,866.29	1,390,128,951.88	2,980,383,818.17
2.基金赎回款	-1,456,545,649.81	-1,284,558,439.95	-2,741,104,089.76
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）	3,473,699,681.87	3,031,306,269.64	6,505,005,951.51
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）	4,922,561,619.28	2,086,237,176.24	7,008,798,795.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	216,103,918.79	216,103,918.79
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）	-1,098,437,827.56	-525,611,677.45	-1,624,049,505.01
其中：1.基金申购款	3,261,978,221.71	1,163,697,740.66	4,425,675,962.37
2.基金赎回款	-4,360,416,049.27	-1,689,309,418.11	-6,049,725,467.38
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）	3,824,123,791.72	1,776,729,417.58	5,600,853,209.30

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联接基金（原名易方达沪深 300 指数证券投资基金，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[2009]第 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数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 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，《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,539,280.61 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会 2013 年 9 月 17 日下发的《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2013]812 号），易方达沪深 300 指数证券投资基金自 2013 年 9 月 17 日起变更为易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金，修改基金合同中基金名称、投资范围、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会等条款。

自 2019 年 4 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日。

### 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联接基金基金合同》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	200,981,129.66
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	200,981,129.66

##### 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	121,482,037.28	134,086,555.55	12,604,518.27	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	947,492.09	951,644.75	4,152.66
	银行间市场	149,764,440.00	150,065,000.00	300,560.00
	合计	150,711,932.09	151,016,644.75	304,712.66
资产支持证券	-	-	-	
基金	4,492,612,347.26	6,005,427,423.24	1,512,815,075.98	
其他	-	-	-	
合计	4,764,806,316.63	6,290,530,623.54	1,525,724,306.91	

## 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	20,890,272.00	-	-	-
IF2109	20,890,272.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,890,272.00	-	-	-

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）
IF2109	IF2109	13	20,148,960.00	-741,312.00
总额合计				-741,312.00
减：可抵销期货暂收款				-741,312.00
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	17,389.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,500.42

应收债券利息	1,295,190.66
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	124.02
合计	1,317,204.57

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	8,890.40
待摊费用	-
合计	8,890.40

## 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	256,939.35
银行间市场应付交易费用	275.00
合计	257,214.35

## 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	45,438.41
应付证券出借违约金	-
预提费用	199,343.16
合计	244,781.57

## 6.4.7.9 实收基金

## 易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,047,944,319.55	3,047,944,319.55

本期申购	1,278,339,880.31	1,278,339,880.31
本期赎回（以“-”号填列）	-1,071,074,782.77	-1,071,074,782.77
本期末	3,255,209,417.09	3,255,209,417.09

## 易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	292,046,145.84	292,046,145.84
本期申购	311,914,985.98	311,914,985.98
本期赎回（以“-”号填列）	-385,470,867.04	-385,470,867.04
本期末	218,490,264.78	218,490,264.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,060,525,434.18	522,029,202.38	2,582,554,636.56
本期利润	225,883,928.70	-139,114,706.74	86,769,221.96
本期基金份额交易产生的变动数	148,245,322.49	24,757,006.14	173,002,328.63
其中：基金申购款	910,515,040.12	211,894,078.35	1,122,409,118.47
基金赎回款	-762,269,717.63	-187,137,072.21	-949,406,789.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,434,654,685.37	407,671,501.78	2,842,326,187.15

## 易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	195,817,832.28	49,797,897.34	245,615,729.62
本期利润	17,041,966.52	-6,245,796.95	10,796,169.57
本期基金份额交易产生的变动数	-51,117,207.50	-16,314,609.20	-67,431,816.70
其中：基金申购款	221,272,695.62	46,447,137.79	267,719,833.41
基金赎回款	-272,389,903.12	-62,761,746.99	-335,151,650.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	161,742,591.30	27,237,491.19	188,980,082.49

## 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	356,078.17
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	79,225.09
其他	3,095.41
合计	438,398.67

**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	20,226,128.03
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	1,870,623.10
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	22,096,751.13

**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	77,916,913.43
减：卖出股票成本总额	57,690,785.40
买卖股票差价收入	20,226,128.03

**6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	1,034,419,800.00
减：现金支付申购款总额	410,737,241.01
减：申购股票成本总额	621,811,935.89
申购差价收入	1,870,623.10

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	801,759,897.82
减：卖出/赎回基金成本总额	585,269,603.73

基金投资收益	216,490,294.09
--------	----------------

## 6.4.7.14 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	159,295,365.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	156,345,328.13
减：应收利息总额	2,281,006.37
买卖债券差价收入	669,031.44

## 6.4.7.15 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	1,372,147.57

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	888,829.85
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	888,829.85

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-143,140,731.69
——股票投资	-3,970,736.48
——债券投资	200,512.66
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-139,370,507.87
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-2,219,772.00
——权证投资	-
——期货投资	-2,219,772.00
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	-145,360,503.69

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	2,188,494.93
其他	-
合计	2,188,494.93

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	757,270.52
银行间市场交易费用	825.00
交易基金产生的费用	45,619.17
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	45,619.17
合计	803,714.69

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	18,431.27
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	116,374.43

## 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、基金销售机构
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	372,497.87	320,048.94
其中：支付销售机构的客户维护费	1,490,461.01	1,032,216.67

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理人的管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金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，基金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，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,165.96	106,682.94

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金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，基金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，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	196,592.32	196,592.32
广发证券	-	161.81	161.81
合计	-	196,754.13	196,754.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达沪深300ETF 发起式联接A	易方达沪深300ETF发起式联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	745,971.32	745,971.32

合计	-	745,971.32	745,971.32
----	---	------------	------------

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

###### 易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

无。

###### 易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	200,981,129.66	356,078.17	191,466,436.67	781,990.78

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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 2,504,139,531 份和 2,403,181,331 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 59.68% 和 60.51%。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 易方达沪深 300ETF 发起式联接 A

本报告期内未发生利润分配。

##### 易方达沪深 300ETF 发起式联接 C

本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

<b>6.4.12.1.1 受限证券类别：股票</b>
-----------------------------

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	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
30094	冠中	2021-0	2021-0	新股	13.00	27.42	324	2,808.	8,884.	-



8	生态	2-18	8-25	流通受限				00	08	
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
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	-

30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696. 16	6,410. 76	-
30097 8	东箭 科技	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993. 06	8,064. 80	-
30097 9	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	33.22	87.50	925	30,728 .50	80,937 .50	-
30098 2	苏文 电能	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通 受限	15.83	45.29	317	5,018. 11	14,356 .93	-
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345. 50	7,318. 95	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043. 79	8,069. 81	-
30099 1	创益 通	2021-0 5-12	2021-1 1-22	新股 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317. 24	6,733. 54	-
30099 2	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872. 00	4,064. 00	-
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811. 52	4,454. 12	-
30099 7	欢乐 家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584. 32	12,110 .40	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210. 02	4,285. 32	-
30100 2	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760. 71	11,581 .62	-
30100 4	嘉益 股份	2021-0 6-18	2021-1 2-27	新股 流通 受限	7.81	21.94	312	2,436. 72	6,845. 28	-
30100 7	德迈 仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股 流通	5.29	14.44	303	1,602. 87	4,375. 32	-

				受限						
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	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-12-22	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股流通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
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	-
68822	威腾	2021-0	2021-0	新股	6.42	6.42	2,693	17,289	17,289	-

6	电气	6-28	7-07	流通受限				.06	.06	
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	-
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	40	3,999.98	3,999.98	-
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	570	56,999.75	56,999.75	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	新发流通受限	100.00	100.00	4	400.00	400.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新发流通受限	100.00	100.00	7	700.00	700.00	-

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	30,700	289,631.18	171,613.00	-

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本金属股票基金，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。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 0.01%(2020 年 12 月 31 日：0.03%)。

#### 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	151,360,123.29	151,271,260.28
合计	151,360,123.29	151,271,260.28

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	933,057.62	1,770,124.47
AAA 以下	18,654.50	10,000.14
未评级	0.00	0.00
合计	951,712.12	1,780,124.61

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	200,981,129.66	-	-	-	200,981,129.66
结算备付金	10,339,894.65	-	-	-	10,339,894.65
存出保证金	2,925,613.06	-	-	-	2,925,613.06
交易性金融资产	150,065,000.00	-	951,644.75	6,139,513,978.79	6,290,530,623.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,437,555.84	5,437,555.84
应收利息	-	-	-	1,317,204.57	1,317,204.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,218,362.58	13,218,362.58
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	8,890.40	8,890.40
资产总计	364,311,637.37	-	951,644.75	6,159,495,992.18	6,524,759,274.30
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	18,512,901.19	18,512,901.19
应付管理人报酬	-	-	-	61,882.96	61,882.96
应付托管费	-	-	-	20,627.64	20,627.64
应付销售服务费	-	-	-	67,240.02	67,240.02
应付交易费用	-	-	-	257,214.35	257,214.35
应交税费	-	-	-	588,675.06	588,675.06
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	244,781.57	244,781.57
负债总计	-	-	-	19,753,322.79	19,753,322.79



					79
利率敏感度缺口	364,311,637.37	-	951,644.75	6,139,742,669.39	6,505,005,951.51
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	180,413,553.63	-	-	-	180,413,553.63
结算备付金	9,248,356.58	-	-	-	9,248,356.58
存出保证金	3,790,991.60	-	-	-	3,790,991.60
交易性金融资产	149,630,000.00	-	1,779,984.77	5,823,403,717.91	5,974,813,702.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,231,962.99	15,231,962.99
应收利息	-	-	-	1,662,704.82	1,662,704.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	12,521,503.39	12,521,503.39
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	343,082,901.81	-	1,779,984.77	5,852,819,889.11	6,197,682,775.69
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	28,686,889.31	28,686,889.31
应付管理人报酬	-	-	-	59,034.73	59,034.73
应付托管费	-	-	-	19,678.24	19,678.24
应付销售服务费	-	-	-	87,555.66	87,555.66
应付交易费用	-	-	-	271,349.96	271,349.96
应交税费	-	-	-	169,933.86	169,933.86
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	227,502.36	227,502.36
负债总计	-	-	-	29,521,944.12	29,521,944.12
利率敏感度缺口	343,082,901.81	-	1,779,984.77	5,823,297,944.99	6,168,160,831.57

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

假设	除市场利率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.市场利率下降25个基点	240,827.78	107,589.26
	2.市场利率上升25个基点	-240,037.22	-107,427.21

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	134,086,555.55	2.06	130,988,099.17	2.12

交易性金融资产—基金投资	6,005,427,423.24	92.32	5,692,415,618.74	92.29
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>6,139,513,978.79</b>	<b>94.38</b>	<b>5,823,403,717.91</b>	<b>94.41</b>

#### 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%	304,150,340.50	303,934,055.66
	2.业绩比较基准下降 5%	-304,150,340.50	-303,934,055.66

#### 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 6,132,960,212.19 元，属于第二层次的余额为 157,570,411.35 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 5,819,021,682.90 元，第二层次 155,792,019.78 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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	134,086,555.55	2.06
	其中：股票	134,086,555.55	2.06
2	基金投资	6,005,427,423.24	92.04
3	固定收益投资	151,016,644.75	2.31
	其中：债券	151,016,644.75	2.31
	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	211,321,024.31	3.24

	计		
8	其他各项资产	22,907,626.45	0.35
9	合计	6,524,759,274.30	100.00

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）、发起式	易方达基金管理有限公司	6,005,427,423.24	92.32

## 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,669,597.90	0.03
B	采矿业	2,326,377.60	0.04
C	制造业	71,913,935.60	1.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,767,171.21	0.10
E	建筑业	1,195,266.37	0.02
F	批发和零售业	975,337.34	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	7,547,541.64	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,798,337.21	0.06
J	金融业	26,579,800.35	0.41
K	房地产业	3,245,554.00	0.05
L	租赁和商务服务业	2,933,485.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,275,772.80	0.02
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	131,607.00	0.00
Q	卫生和社会工作	2,908,949.20	0.04
R	文化、体育和娱乐业	781,550.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	134,086,555.55	2.06

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.08
2	000858	五粮液	17,100	5,093,919.00	0.08
3	600519	贵州茅台	2,449	5,036,858.30	0.08
4	601816	京沪高铁	927,836	4,908,252.44	0.08
5	601318	中国平安	56,200	3,612,536.00	0.06
6	000333	美的集团	41,800	2,983,266.00	0.05
7	600036	招商银行	54,769	2,967,932.11	0.05
8	002415	海康威视	33,800	2,180,100.00	0.03
9	000651	格力电器	41,400	2,156,940.00	0.03
10	300059	东方财富	65,400	2,144,466.00	0.03
11	601888	中国中免	7,000	2,100,700.00	0.03
12	002594	比亚迪	7,600	1,907,600.00	0.03
13	000001	平安银行	83,200	1,881,984.00	0.03
14	601012	隆基股份	20,060	1,782,130.40	0.03
15	002475	立讯精密	36,360	1,672,560.00	0.03
16	300015	爱尔眼科	22,690	1,610,536.20	0.02
17	000568	泸州老窖	6,800	1,604,392.00	0.02
18	300122	智飞生物	8,400	1,568,532.00	0.02
19	600276	恒瑞医药	22,201	1,509,001.97	0.02
20	601166	兴业银行	71,900	1,477,545.00	0.02
21	000725	京东方 A	230,600	1,438,944.00	0.02
22	000002	万科 A	58,300	1,388,123.00	0.02
23	002304	洋河股份	6,100	1,263,920.00	0.02
24	603259	药明康德	7,920	1,240,192.80	0.02
25	000661	长春高新	3,200	1,238,400.00	0.02
26	603501	韦尔股份	3,800	1,223,600.00	0.02
27	603288	海天味业	9,015	1,162,484.25	0.02
28	002714	牧原股份	18,620	1,132,468.40	0.02

29	600887	伊利股份	30,500	1,123,315.00	0.02
30	600030	中信证券	43,900	1,094,866.00	0.02
31	300124	汇川技术	14,400	1,069,344.00	0.02
32	002142	宁波银行	26,600	1,036,602.00	0.02
33	600900	长江电力	46,000	949,440.00	0.01
34	601398	工商银行	178,000	920,260.00	0.01
35	600436	片仔癀	2,000	896,600.00	0.01
36	600309	万华化学	8,200	892,324.00	0.01
37	600809	山西汾酒	1,989	891,072.00	0.01
38	600031	三一重工	30,600	889,542.00	0.01
39	000100	TCL 科技	115,900	886,635.00	0.01
40	002230	科大讯飞	13,100	885,298.00	0.01
41	002460	赣锋锂业	7,000	847,630.00	0.01
42	002241	歌尔股份	19,500	833,430.00	0.01
43	002027	分众传媒	88,500	832,785.00	0.01
44	002271	东方雨虹	15,050	832,566.00	0.01
45	300142	沃森生物	13,300	820,610.00	0.01
46	601919	中远海控	26,700	815,418.00	0.01
47	002371	北方华创	2,900	804,402.00	0.01
48	300347	泰格医药	4,100	792,530.00	0.01
49	300014	亿纬锂能	7,600	789,868.00	0.01
50	000063	中兴通讯	23,600	784,228.00	0.01
51	600690	海尔智家	29,100	753,981.00	0.01
52	000338	潍柴动力	41,200	736,244.00	0.01
53	002352	顺丰控股	10,500	710,850.00	0.01
54	601328	交通银行	140,300	687,470.00	0.01
55	601899	紫金矿业	70,500	683,145.00	0.01
56	002129	中环股份	16,800	648,480.00	0.01
57	688425	铁建重工	135,282	642,589.50	0.01
58	601288	农业银行	200,900	608,727.00	0.01
59	600000	浦发银行	60,400	604,000.00	0.01
60	600999	招商证券	31,310	595,516.20	0.01
61	600438	通威股份	13,600	588,472.00	0.01
62	600570	恒生电子	6,000	559,500.00	0.01
63	600837	海通证券	48,600	558,900.00	0.01
64	002311	海大集团	6,800	554,880.00	0.01
65	600016	民生银行	123,900	546,399.00	0.01
66	300498	温氏股份	37,000	531,690.00	0.01
67	000538	云南白药	4,400	509,168.00	0.01
68	600585	海螺水泥	12,300	504,915.00	0.01
69	603986	兆易创新	2,680	503,572.00	0.01
70	300601	康泰生物	3,300	491,700.00	0.01
71	002410	广联达	7,200	491,040.00	0.01
72	601688	华泰证券	30,000	474,000.00	0.01

73	601601	中国太保	15,500	449,035.00	0.01
74	601668	中国建筑	96,000	446,400.00	0.01
75	300413	芒果超媒	6,500	445,900.00	0.01
76	600048	保利地产	36,700	441,868.00	0.01
77	600660	福耀玻璃	7,900	441,215.00	0.01
78	002493	荣盛石化	25,050	432,613.50	0.01
79	000625	长安汽车	16,300	428,364.00	0.01
80	603799	华友钴业	3,700	422,540.00	0.01
81	601229	上海银行	50,592	414,854.40	0.01
82	300408	三环集团	9,600	407,232.00	0.01
83	000157	中联重科	43,500	401,940.00	0.01
84	600104	上汽集团	17,600	386,672.00	0.01
85	002050	三花智控	16,000	383,680.00	0.01
86	600703	三安光电	11,900	381,395.00	0.01
87	600606	绿地控股	68,500	373,325.00	0.01
88	002001	新和成	12,720	364,809.60	0.01
89	601766	中国中车	59,600	362,368.00	0.01
90	601211	国泰君安	21,100	361,654.00	0.01
91	600196	复星医药	5,000	360,650.00	0.01
92	002007	华兰生物	9,800	359,464.00	0.01
93	000166	申万宏源	75,900	355,212.00	0.01
94	601169	北京银行	72,400	352,588.00	0.01
95	000963	华东医药	7,400	340,474.00	0.01
96	002179	中航光电	4,300	339,786.00	0.01
97	002236	大华股份	16,000	337,600.00	0.01
98	300003	乐普医疗	10,500	337,260.00	0.01
99	600919	江苏银行	46,310	328,801.00	0.01
100	002601	龙鳞佰利	9,300	321,594.00	0.00
101	300433	蓝思科技	10,800	317,628.00	0.00
102	601988	中国银行	103,100	317,548.00	0.00
103	600406	国电南瑞	13,560	315,134.40	0.00
104	000895	双汇发展	9,800	311,640.00	0.00
105	601088	中国神华	15,900	310,368.00	0.00
106	600346	恒力石化	11,700	307,008.00	0.00
107	000768	中航西飞	11,500	302,220.00	0.00
108	601009	南京银行	28,500	299,820.00	0.00
109	600019	宝钢股份	39,100	298,724.00	0.00
110	601818	光大银行	78,700	297,486.00	0.00
111	002624	完美世界	12,400	296,484.00	0.00
112	300033	同花顺	2,600	293,228.00	0.00
113	001979	招商蛇口	26,700	292,365.00	0.00
114	000938	紫光股份	13,140	287,503.20	0.00
115	002008	大族激光	7,100	286,769.00	0.00
116	600028	中国石化	65,400	285,144.00	0.00



117	002202	金风科技	23,300	283,328.00	0.00
118	601628	中国人寿	8,000	271,120.00	0.00
119	000786	北新建材	6,900	270,825.00	0.00
120	601216	君正集团	52,000	264,680.00	0.00
121	601633	长城汽车	5,900	257,181.00	0.00
122	000977	浪潮信息	9,100	255,983.00	0.00
123	002555	三七互娱	10,600	254,612.00	0.00
124	601857	中国石油	48,100	254,449.00	0.00
125	000069	华侨城 A	33,900	252,216.00	0.00
126	300628	亿联网络	3,000	251,400.00	0.00
127	600588	用友网络	7,500	249,450.00	0.00
128	000876	新希望	17,000	249,390.00	0.00
129	002841	视源股份	2,000	248,580.00	0.00
130	600763	通策医疗	600	246,600.00	0.00
131	000425	徐工机械	38,500	245,245.00	0.00
132	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
133	600547	山东黄金	12,180	234,099.60	0.00
134	600745	闻泰科技	2,400	232,560.00	0.00
135	601225	陕西煤业	19,200	227,520.00	0.00
136	300144	宋城演艺	13,400	225,120.00	0.00
137	603160	汇顶科技	1,700	220,371.00	0.00
138	600111	北方稀土	10,600	219,420.00	0.00
139	600050	中国联通	50,600	218,592.00	0.00
140	601390	中国中铁	41,700	218,508.00	0.00
141	000783	长江证券	29,700	217,404.00	0.00
142	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
143	300136	信维通信	6,900	213,072.00	0.00
144	603833	欧派家居	1,500	212,940.00	0.00
145	002736	国信证券	19,800	212,850.00	0.00
146	002044	美年健康	23,200	211,352.00	0.00
147	000066	中国长城	14,200	207,320.00	0.00
148	600741	华域汽车	7,800	204,906.00	0.00
149	601100	恒立液压	2,300	197,616.00	0.00
150	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.00
151	000703	恒逸石化	16,200	193,590.00	0.00
152	601006	大秦铁路	29,200	192,136.00	0.00
153	000728	国元证券	24,090	191,997.30	0.00
154	000596	古井贡酒	800	191,600.00	0.00
155	600760	中航沈飞	3,162	190,668.60	0.00
156	601377	兴业证券	19,700	190,302.00	0.00
157	600015	华夏银行	30,500	188,795.00	0.00
158	601877	正泰电器	5,600	186,928.00	0.00
159	600352	浙江龙盛	13,500	185,490.00	0.00
160	603369	今世缘	3,400	184,144.00	0.00

161	601336	新华保险	4,000	183,640.00	0.00
162	601901	方正证券	19,600	183,456.00	0.00
163	600926	杭州银行	12,400	182,900.00	0.00
164	601989	中国重工	44,300	182,516.00	0.00
165	002508	老板电器	3,900	181,350.00	0.00
166	600958	东方证券	18,100	180,819.00	0.00
167	601155	新城控股	4,330	180,128.00	0.00
168	603993	洛阳钼业	34,600	178,536.00	0.00
169	000860	顺鑫农业	4,100	172,938.00	0.00
170	601788	光大证券	9,600	171,744.00	0.00
171	002024	苏宁易购	30,700	171,613.00	0.00
172	601600	中国铝业	32,300	171,190.00	0.00
173	601186	中国铁建	23,000	170,890.00	0.00
174	603899	晨光文具	2,000	169,120.00	0.00
175	601607	上海医药	7,900	166,927.00	0.00
176	603019	中科曙光	6,000	165,660.00	0.00
177	600886	国投电力	16,800	161,448.00	0.00
178	002463	沪电股份	10,300	159,341.00	0.00
179	601985	中国核电	30,400	153,824.00	0.00
180	002602	世纪华通	23,140	148,558.80	0.00
181	601838	成都银行	11,405	144,159.20	0.00
182	002456	欧菲光	16,100	142,968.00	0.00
183	601669	中国电建	36,700	142,029.00	0.00
184	600705	中航资本	36,600	141,642.00	0.00
185	601727	上海电气	33,300	141,192.00	0.00
186	600795	国电电力	57,500	139,725.00	0.00
187	600183	生益科技	5,800	135,778.00	0.00
188	002120	韵达股份	10,000	135,300.00	0.00
189	600009	上海机场	2,800	134,764.00	0.00
190	600118	中国卫星	4,600	134,596.00	0.00
191	601108	财通证券	12,700	133,223.00	0.00
192	002607	中公教育	6,300	131,607.00	0.00
193	600010	包钢股份	83,400	129,270.00	0.00
194	601555	东吴证券	15,300	127,602.00	0.00
195	600109	国金证券	10,000	126,900.00	0.00
196	002157	正邦科技	10,600	126,670.00	0.00
197	601138	工业富联	10,200	126,582.00	0.00
198	002252	上海莱士	16,700	125,083.00	0.00
199	600029	南方航空	20,000	120,400.00	0.00
200	601111	中国国航	15,400	119,812.00	0.00
201	600383	金地集团	11,700	119,808.00	0.00
202	002673	西部证券	14,100	116,325.00	0.00
203	601021	春秋航空	2,000	113,800.00	0.00
204	600522	中天科技	11,200	112,000.00	0.00

205	002739	万达电影	7,000	110,530.00	0.00
206	600085	同仁堂	2,700	110,295.00	0.00
207	003816	中国广核	41,200	110,004.00	0.00
208	600115	中国东航	21,400	108,712.00	0.00
209	600018	上港集团	22,700	108,279.00	0.00
210	600362	江西铜业	4,800	107,424.00	0.00
211	600061	国投资本	12,496	106,091.04	0.00
212	002153	石基信息	4,480	105,324.80	0.00
213	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.00
214	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
215	601800	中国交建	15,200	98,496.00	0.00
216	002938	鹏鼎控股	2,700	96,876.00	0.00
217	000656	金科股份	16,700	96,693.00	0.00
218	601618	中国中冶	31,400	93,572.00	0.00
219	600332	白云山	2,700	91,395.00	0.00
220	601933	永辉超市	19,300	91,289.00	0.00
221	002558	巨人网络	6,800	90,440.00	0.00
222	600655	豫园股份	7,800	90,402.00	0.00
223	600848	上海临港	5,000	89,500.00	0.00
224	002916	深南电路	800	88,904.00	0.00
225	603658	安图生物	1,140	86,377.80	0.00
226	601658	邮储银行	17,200	86,344.00	0.00
227	600893	航发动力	1,600	85,104.00	0.00
228	002939	长城证券	7,600	84,588.00	0.00
229	601231	环旭电子	5,000	84,050.00	0.00
230	688036	传音控股	400	83,800.00	0.00
231	600489	中金黄金	9,600	82,752.00	0.00
232	601360	三六零	6,700	81,807.00	0.00
233	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
234	601998	中信银行	15,700	80,070.00	0.00
235	601878	浙商证券	6,000	78,480.00	0.00
236	601162	天风证券	16,000	77,760.00	0.00
237	600176	中国巨石	4,858	75,347.58	0.00
238	688012	中微公司	427	70,847.84	0.00
239	601808	中海油服	4,900	70,364.00	0.00
240	002812	恩捷股份	300	70,230.00	0.00
241	002032	苏泊尔	1,100	70,169.00	0.00
242	600600	青岛啤酒	600	69,390.00	0.00
243	600584	长电科技	1,800	67,824.00	0.00
244	002773	康弘药业	2,900	67,077.00	0.00
245	601881	中国银河	6,200	66,836.00	0.00
246	688008	澜起科技	1,015	63,315.70	0.00
247	600482	中国动力	3,600	62,712.00	0.00
248	603392	万泰生物	240	62,203.20	0.00

249	600989	宝丰能源	4,500	61,560.00	0.00
250	600233	圆通速递	6,100	61,061.00	0.00
251	601319	中国人保	10,200	60,486.00	0.00
252	000708	中信特钢	2,900	60,436.00	0.00
253	600132	重庆啤酒	300	59,385.00	0.00
254	601916	浙商银行	14,800	58,756.00	0.00
255	601238	广汽集团	4,400	56,980.00	0.00
256	600025	华能水电	9,800	56,742.00	0.00
257	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
258	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
259	603882	金域医学	300	47,931.00	0.00
260	002049	紫光国微	300	46,257.00	0.00
261	600011	华能国际	10,500	44,310.00	0.00
262	601698	中国卫通	2,600	42,094.00	0.00
263	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
264	002945	华林证券	3,000	41,460.00	0.00
265	600161	天坛生物	1,200	41,100.00	0.00
266	603195	公牛集团	200	40,400.00	0.00
267	600845	宝信软件	780	39,702.00	0.00
268	300676	华大基因	300	35,580.00	0.00
269	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
270	601077	渝农商行	8,700	34,713.00	0.00
271	603806	福斯特	300	31,539.00	0.00
272	601236	红塔证券	2,300	31,188.00	0.00
273	600299	安迪苏	2,600	31,096.00	0.00
274	600872	中炬高新	700	29,414.00	0.00
275	600150	中国船舶	1,700	28,067.00	0.00
276	600426	华鲁恒升	900	27,855.00	0.00
277	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
278	300529	健帆生物	300	25,908.00	0.00
279	603517	绝味食品	300	25,287.00	0.00
280	600143	金发科技	1,200	25,032.00	0.00
281	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
282	002414	高德红外	840	23,167.20	0.00
283	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
284	601990	南京证券	2,100	22,092.00	0.00
285	601066	中信建投	700	22,001.00	0.00
286	603087	甘李药业	200	21,316.00	0.00
287	688009	中国通号	3,625	20,626.25	0.00
288	002600	领益智造	2,100	19,299.00	0.00
289	601872	招商轮船	4,060	18,757.20	0.00
290	002384	东山精密	900	18,756.00	0.00
291	601995	中金公司	300	18,450.00	0.00
292	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00

293	603338	浙江鼎力	300	17,607.00	0.00
294	688126	沪硅产业	600	17,508.00	0.00
295	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
296	600079	人福医药	600	16,962.00	0.00
297	603939	益丰药房	300	16,827.00	0.00
298	601696	中银证券	800	16,472.00	0.00
299	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
300	603233	大参林	300	15,333.00	0.00
301	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
302	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
303	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
304	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
305	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
306	600918	中泰证券	1,200	12,984.00	0.00
307	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
308	600521	华海药业	600	12,528.00	0.00
309	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
310	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
311	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
312	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
313	600340	华夏幸福	2,200	11,528.00	0.00
314	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
315	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
316	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
317	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
318	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
319	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
320	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
321	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
322	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
323	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
324	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
325	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
326	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
327	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
328	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
329	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
330	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
331	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
332	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
333	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
334	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
335	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
336	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

337	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
338	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
339	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
340	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
341	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
342	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
343	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
344	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
345	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
346	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
347	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	47,312,220.86	0.77
2	601318	中国平安	46,388,547.39	0.75
3	600036	招商银行	35,953,036.56	0.58
4	600276	恒瑞医药	18,988,235.80	0.31
5	601166	兴业银行	18,440,926.75	0.30
6	600887	伊利股份	14,080,653.94	0.23
7	601888	中国中免	13,839,615.00	0.22
8	601012	隆基股份	13,432,048.91	0.22
9	600030	中信证券	12,199,661.00	0.20
10	600031	三一重工	11,347,352.00	0.18
11	603259	药明康德	10,320,818.04	0.17
12	600309	万华化学	10,202,731.03	0.17
13	601398	工商银行	10,191,341.96	0.17
14	600900	长江电力	10,172,394.50	0.16
15	600809	山西汾酒	8,484,981.30	0.14
16	601899	紫金矿业	8,223,182.37	0.13
17	603288	海天味业	8,121,716.38	0.13
18	600436	片仔癀	7,232,202.40	0.12
19	601328	交通银行	7,079,195.42	0.11
20	600585	海螺水泥	6,949,331.86	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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	2,280,832.00	0.04
2	601318	中国平安	2,156,332.00	0.03
3	688819	天能股份	1,917,121.26	0.03
4	688538	和辉光电	1,837,636.55	0.03
5	600905	三峡能源	1,734,700.52	0.03
6	600036	招商银行	1,655,148.00	0.03
7	000858	五粮液	1,269,514.00	0.02
8	300957	贝泰妮	1,235,091.00	0.02
9	601995	中金公司	1,180,253.74	0.02
10	000333	美的集团	961,933.00	0.02
11	600276	恒瑞医药	907,449.00	0.01
12	300999	金龙鱼	890,181.92	0.01
13	601166	兴业银行	814,596.00	0.01
14	688083	中望软件	779,314.72	0.01
15	688408	中信博	739,560.56	0.01
16	601012	隆基股份	699,468.00	0.01
17	600887	伊利股份	679,776.00	0.01
18	300979	华利集团	640,742.00	0.01
19	601888	中国中免	630,637.00	0.01
20	000651	格力电器	628,295.04	0.01

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

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	678,256,466.15
卖出股票收入（成交）总额	77,916,913.43

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

### 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	150,065,000.00	2.31

	其中：政策性金融债	150,065,000.00	2.31
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）	951,644.75	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	151,016,644.75	2.32

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	210201	21 国开 01	1,000,000	100,060,000.00	1.54
2	210206	21 国开 06	500,000	50,005,000.00	0.77
3	113050	南银转债	9,290	928,992.11	0.01
4	127036	三花转债	134	17,552.66	0.00
5	113049	长汽转债	40	3,999.98	0.00

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。



## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 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
IF2109	IF2109	13	20,148,960.00	-741,312.00	在本报告期内,基金利用股指期货进行套期保值操作,以应对基金由于大额净申赎等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,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。
公允价值变动总额合计(元)					-741,312.00
股指期货投资本期收益(元)					1,372,147.57
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-2,219,772.00

### 7.11.2 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。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时,通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内,本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 2020 年 7 月 28 日,中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定: 1、2019 年 7

月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

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

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

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

2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定：同业投

资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。

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

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

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

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

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,925,613.06
2	应收证券清算款	5,437,555.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,317,204.57

5	应收申购款	13,218,362.58
6	其他应收款	8,890.40
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,907,626.45

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.08	新股流通受限

### §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

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
易方达沪深 300ETF 发起式联 接 A	339,441	9,589.91	91,915,214.81	2.82%	3,163,294,202. 28	97.18%
易方达沪深 300ETF 发起式联 接 C	21,963	9,948.11	63,903,769.48	29.25%	154,586,495.30	70.75%
合计	361,404	9,611.68	155,818,984.29	4.49%	3,317,880,697. 58	95.51%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	480,592.11	0.0148%
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	11,129.33	0.0051%
	合计	491,721.44	0.0142%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	0
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	0
	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达沪深 300ETF 发起式联接 A	易方达沪深 300ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（2009 年 8 月 26 日）基金份额总额	16,746,252,366.35	-
本报告期初基金份额总额	3,047,944,319.55	292,046,145.84
本报告期基金总申购份额	1,278,339,880.31	311,914,985.98
减：本报告期基金总赎回份额	1,071,074,782.77	385,470,867.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,255,209,417.09	218,490,264.78

## §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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

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

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	702,520,863.83	94.50%	562,016.61	96.49%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	40,860,613.00	5.50%	20,431.50	3.51%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司,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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	6,286,921.70	89.62%	-	-	-	-	798,080,638.32	100.00%
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部	-	-	-	-	-	-	-	-



证券									
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	728,444.2 4	10.38 %	-	-	-	-	-	-	-
南京 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 华南	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-11
2	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
5	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加万得基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-01
6	易方达基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
7	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加诺亚正行为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-09
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
10	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-04-19

## §11 备查文件目录

## 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3.《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基金合同》；
- 4.《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托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

## 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日