

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
2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 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。

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§ 5	托管人报告.....	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6	审计报告.....	16
6.1	审计意见.....	17
6.2	形成审计意见的基础.....	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任.....	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
§ 7	年度财务报表.....	19
7.1	资产负债表.....	19
7.2	利润表.....	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	23
§ 8	投资组合报告.....	63
8.1	期末基金资产组合情况.....	63
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	64
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	65
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12	投资组合报告附注	70
§ 9	基金份额持有人信息	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2	期末上市基金前十名持有人	72
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 10	开放式基金份额变动	73
§ 11	重大事件揭示	73
11.1	基金份额持有人大会决议	73
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4	基金投资策略的改变	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8	其他重大事件	75
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
§ 13	备查文件目录	78
13.1	备查文件目录	78
13.2	存放地点	78
13.3	查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	易方达沪深 300 非银 ETF
场内简称	非银 ETF、非银行金融 ETF
基金主代码	512070
交易代码	512070
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2014 年 6 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	1,325,259,062.00 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	2014 年 7 月 18 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，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 非银行金融指数
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		020-85104666	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	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

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

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	301,628,235.87	186,780,840.16	-5,045,525.82
本期利润	351,796,876.41	564,625,222.85	-282,327,827.68
加权平均基金份额本期利润	0.3329	0.6687	-0.5136
本期加权平均净值利润率	13.96%	30.99%	-28.51%
本期基金份额净值增长率	12.75%	47.99%	-23.11%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	1,531,621,624.15	806,630,928.10	406,754,344.74
期末可供分配基金份额利润	1.1557	0.8984	0.5771
期末基金资产净值	3,487,381,035.15	2,095,613,334.06	1,111,524,758.74
期末基金份额净值	2.6315	2.3339	1.5771
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	163.15%	133.39%	57.71%

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

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

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

3.2 基金净值表现

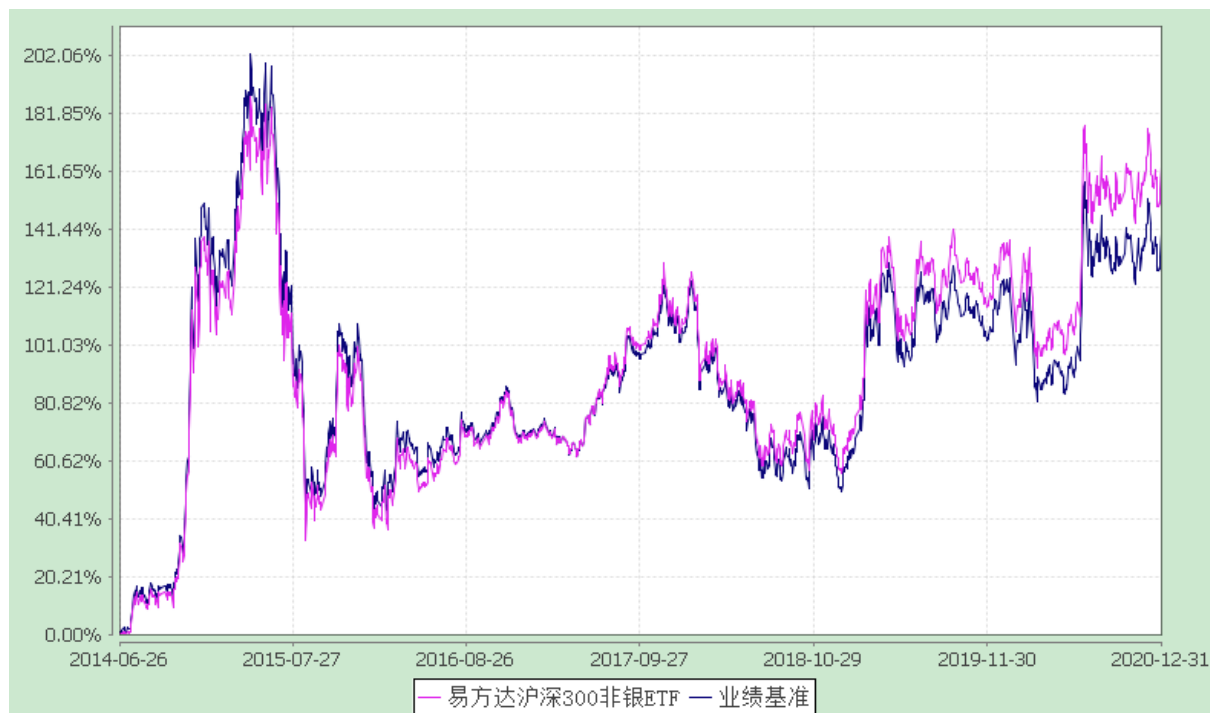
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.10%	1.48%	4.66%	1.49%	0.44%	-0.01%
过去六个月	21.97%	2.08%	19.74%	2.10%	2.23%	-0.02%
过去一年	12.75%	1.94%	8.42%	1.95%	4.33%	-0.01%
过去三年	28.29%	1.80%	18.47%	1.81%	9.82%	-0.01%
过去五年	39.94%	1.67%	22.64%	1.69%	17.30%	-0.02%
自基金合同生效起至今	163.15%	2.05%	139.41%	2.07%	23.74%	-0.02%

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

较

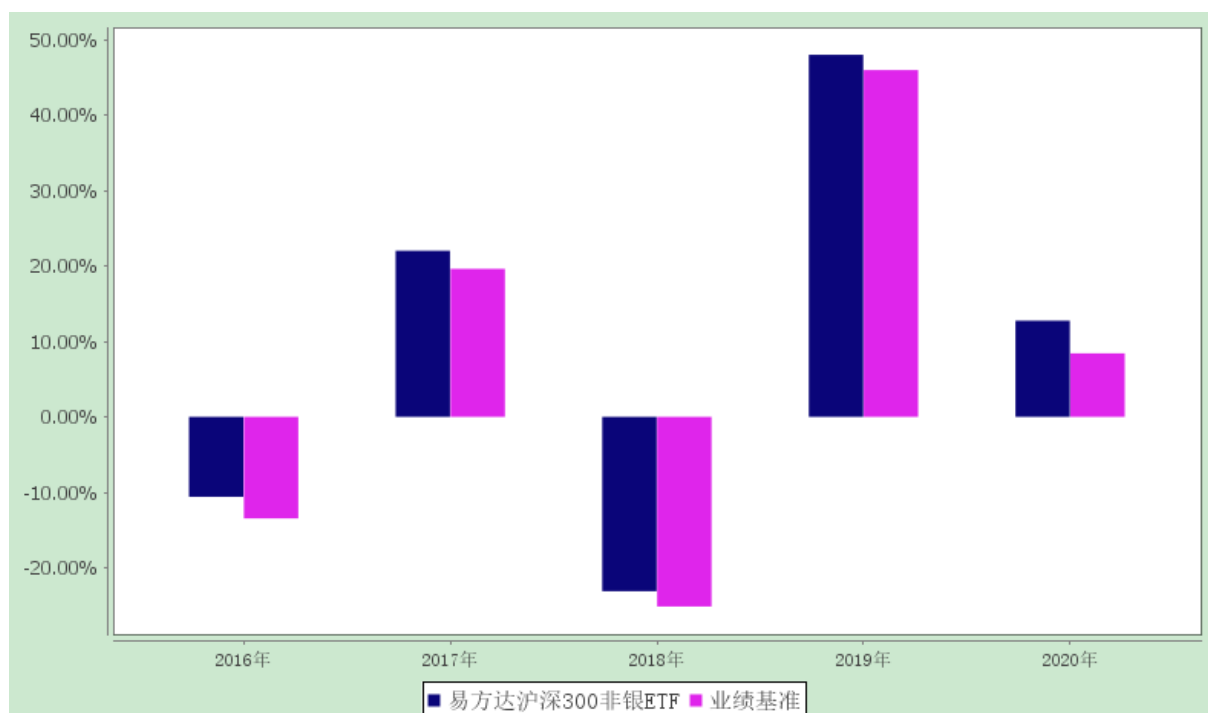
易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2014 年 6 月 26 日至 2020 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 163.15%，同期业绩比较基准收益率为 139.41%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。本基金管理人始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。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。

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、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、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、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、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、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达国企改革	2014-06-26	-	15 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。

指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、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联接基金的基金经理、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。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配

机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同反向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 99 次，均为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易。

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

2020 年国内宏观经济面临新冠疫情的明显冲击，整体经济增速受到较大挑战。自 3 月份开始国内疫情防控形势持续向好，复工复产加快推进，生产需求持续改善，自二季度开始中国经济增长超预期修复，呈现逐季走高的态势。根据国家统计局公布的数据，2020 年国内生产总值达到 101.6 万亿元，按可比价格计算，全年 GDP 实现 2.3% 的增长；2020 年一、二、三、四季度的 GDP 实际增速分别为 -6.8%、3.2%、4.9%、6.5%。面对疫情对经济信心的冲击，全球各主要经济体自一季度先后采取大力度的货币宽松政策加以对冲，疫情所带来的现实性冲击和政策性对冲的较量成为影响中国与全球宏观经济及资产价格表现的重要因素。在宏观政策方面，中国央行货币政策坚持总量政策适度，促进金融和实体经济的良性循环，强调政策对冲疫情的有效性和直达性，三季度以来央行的货币政策在经济韧性下逐步回归常态，从前瞻调整转向相机调整。资本市场方面，全球疫情的超预期发展引起了金融市场巨震，美股在 3 月份出现创纪录的 4 次熔断。虽然全年存在中美贸易协商等在内的

诸多经贸、政治和全球地缘政治的潜在冲突，但中国经济复苏的确定性和体制优势使得 A 股具备较强韧性，叠加疫苗逐步落地后可能出现的全球复苏共振，中国内外部环境对风险资产依然有利。在一季度大跌之后全球股市均陆续开启反弹行情，A 股也随之结束自 3 月初的剧烈下跌并一直延续震荡上涨势头，在年内最后一个交易日沪深 300 指数、上证指数、创业板指均录得本年度新高，沪深 300 指数也创出 2015 年下半年以来的新高。风格主题方面，结构分化显著，在科技类板块表现领先的背景下，以创业板指为代表的成长风格表现更为强劲，创业板表现显著优于主板，报告期内创业板指大幅上涨 64.96%，上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 18.85%、27.21%；行业方面，休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工、医药生物等板块表现强势，房地产、通信、建筑装饰、纺织服装、银行、采掘等板块表现落后。报告期内沪深 300 非银行金融指数上涨 8.42%。

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 2.6315 元，本报告期份额净值增长率为 12.75%，同期业绩比较基准收益率为 8.42%，年化跟踪误差 0.90%，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，复苏是 2021 年全球经济的大背景。疫情虽然可能不会完全结束，但疫情造成的外生冲击有望逐步消退，被疫情干扰的经济增长周期整体可能迈向进一步复苏。与此同时，宏观政策也逐步从疫情应对的“异常态”，向巩固经济复苏、增加就业的“常态化”转变，货币政策的节奏、财政政策的着力点将成为市场关注的因素。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；同时我们应该也看到了本次疫情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、制度等方面到目前为止都经受起了考验，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”规划的发布年，也是“双循环”新发展格局确立后的第一个执行年，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。

在宏观经济转型大背景下，金融市场从间接融资走向直接融资的大变革中，券商将是制度红利释放的最大受益者。在“人口老龄化、中产阶级崛起、消费升级”等因素的催化下，我国保险市场的长期发展空间依然广阔，在行业内生增长以及政策环境支持的推动下，未来保险行业仍有望实现持续性的高速增长。

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，为投资者提供质地优良的指数投资工具，既为短期投资者提供“高弹性、高波动”的投资工具，又为长期看好证券、保险行业投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

（1）根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《关于实施〈公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法〉的规定》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等最新法规、监管要求以及公司业务创新发展和风险应对管理的需要，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，加强各项政策法规和制度措施的落实执行，适应新的监管环境、市场环境和业务形势，保持公司良好的内控机制。

（2）培育合规文化体系、严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，加大力度开展员工合规风控教育培训，秉持“受人之托、为人理财”的信义义务、践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，促进公司合规文化建设；有针对性地根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及其配套规则的要求开展专项合规宣导与合规培训工作；根据业务实际及时健全完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等管控机制和措施，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

（3）坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监

控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(4) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询建议，严格进行合规审查。

(5) 深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及其配套规则等法律法规和监管政策，进一步加强业务规范与机构管控要求，构建以加强投资者权益保护为中心、促进长期理性投资的机制，持续优化投资者适当性管理机制流程，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”的职责义务，切实保障投资者合法权益。

(6) 持续落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套规则，进一步健全信息披露管理工作机制流程，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(7) 持续推动风险为本的反洗钱工作体系建设，全面审视公司面临的洗钱风险与控制措施的有效性，进一步建立完善与风险相适应的政策、程序和控制措施，夯实制度、人员、系统等工作基础，保障资源投入，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，推动反洗钱重点工作提质增效，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

(8) 有计划、有重点地对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(9) 不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2020 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 鉴证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。同时，本年度公司通过 ISAE3402（《国际鉴证业务准则 3402 号》）内控鉴证，鉴证日期区间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日，获得控制设计适当性及运行有效性的无保留意见报告。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和

基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 20695 号

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全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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

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

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

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

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	21,645,003.73	8,946,272.11
结算备付金		1,316,211.49	28,191.31
存出保证金		233,454.48	112,187.52
交易性金融资产	7.4.7.2	3,467,584,880.70	2,089,566,456.97
其中：股票投资		3,466,052,894.13	2,088,457,474.94
基金投资		-	-
债券投资		1,531,986.57	1,108,982.03
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		24,521,679.63	1,146,309.59
应收利息	7.4.7.5	49,962.18	1,793.98
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,515,351,192.21	2,099,801,211.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,756,070.86	2,355,930.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,289,324.75	821,000.35
应付托管费		257,864.96	164,200.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	174,062.74	73,113.87
应交税费		8,051.82	28.96
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	6,484,781.93	773,603.45
负债合计		27,970,157.06	4,187,877.42
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,325,259,062.00	897,897,445.00
未分配利润	7.4.7.10	2,162,121,973.15	1,197,715,889.06
所有者权益合计		3,487,381,035.15	2,095,613,334.06
负债和所有者权益总计		3,515,351,192.21	2,099,801,211.48

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.6315 元，基金份额总额 1,325,259,062.00 份。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至
-----	-----	-----------------------	----------------------------

		2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
一、收入		369,822,896.38	577,832,007.04
1.利息收入		892,896.56	115,092.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	92,492.87	110,410.31
债券利息收入		1,720.40	1,609.35
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		798,683.29	3,073.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		314,583,408.14	196,934,079.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	261,353,424.81	166,076,054.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,669,003.88	1,001,455.11
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	50,560,979.45	29,856,569.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	50,168,640.54	377,844,382.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,177,951.14	2,938,452.28
减：二、费用		18,026,019.97	13,206,784.19
1. 管理人报酬		12,528,899.82	9,119,473.87
2. 托管费		2,505,780.03	1,823,894.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,003,758.46	1,425,409.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,880.71	14.85
7. 其他费用	7.4.7.19	984,700.95	837,990.74

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		351,796,876.41	564,625,222.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		351,796,876.41	564,625,222.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	897,897,445.00	1,197,715,889.06	2,095,613,334.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	351,796,876.41	351,796,876.41
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）	427,361,617.00	612,609,207.68	1,039,970,824.68
其中：1.基金申购款	1,459,902,555.00	2,129,457,834.16	3,589,360,389.16
2.基金赎回款	-1,032,540,938.00	-1,516,848,626.48	-2,549,389,564.48
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）	1,325,259,062.00	2,162,121,973.15	3,487,381,035.15
项目	上年度可比期间		

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	704,770,414.00	406,754,344.74	1,111,524,758.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	564,625,222.85	564,625,222.85
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）	193,127,031.00	226,336,321.47	419,463,352.47
其中：1.基金申购款	1,054,674,460.00	1,162,288,172.06	2,216,962,632.06
2.基金赎回款	-861,547,429.00	-935,951,850.59	-1,797,499,279.59
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）	897,897,445.00	1,197,715,889.06	2,095,613,334.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]860 号《关于核准易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部函[2014]250 号《关于易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 非银行金融

交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 556,159,897.00 份基金份额。本基金为交易型开放式（ETF）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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 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 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

融资产列示。

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

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技

术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值

变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值稅后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；
- (3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；
- (4) 本基金每年收益分配最多 4 次，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；
- (5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

- (1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

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

资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	21,645,003.73	8,946,272.11
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	21,645,003.73	8,946,272.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,198,556,872.92	3,466,052,894.13	267,496,021.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,531,986.57	1,531,986.57	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,531,986.57	1,531,986.57	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,200,088,859.49	3,467,584,880.70	267,496,021.21
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,871,130,094.27	2,088,457,474.94	217,327,380.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,108,982.03	1,108,982.03	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,108,982.03	1,108,982.03	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,872,239,076.30	2,089,566,456.97	217,327,380.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,058.80	1,431.08
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	592.30	177.35
应收债券利息	120.88	135.05
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	47,085.20	-
其他	105.00	50.50
合计	49,962.18	1,793.98

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	174,062.74	73,113.87
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	174,062.74	73,113.87

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	320,000.00
应付替代款	6,015,424.31	302,931.01
可退替代款	17,834.40	-
其他应付款	231,523.22	150,672.44
合计	6,484,781.93	773,603.45

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	897,897,445.00	897,897,445.00
本期申购	1,459,902,555.00	1,459,902,555.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,032,540,938.00	-1,032,540,938.00
本期末	1,325,259,062.00	1,325,259,062.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	806,630,928.10	391,084,960.96	1,197,715,889.06
本期利润	301,628,235.87	50,168,640.54	351,796,876.41

本期基金份额交易产生的变动数	423,362,460.18	189,246,747.50	612,609,207.68
其中：基金申购款	1,485,505,531.69	643,952,302.47	2,129,457,834.16
基金赎回款	-1,062,143,071.51	-454,705,554.97	-1,516,848,626.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,531,621,624.15	630,500,349.00	2,162,121,973.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	73,611.44	91,245.60
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	16,411.07	15,920.79
其他	2,470.36	3,243.92
合计	92,492.87	110,410.31

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	130,588,961.24	35,873,438.06
股票投资收益——赎回差价收入	130,764,463.57	130,202,616.79
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	261,353,424.81	166,076,054.85

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
----	---	--

卖出股票成交总额	1,125,948,066.97	951,202,380.25
减：卖出股票成本总额	995,359,105.73	915,328,942.19
买卖股票差价收入	130,588,961.24	35,873,438.06

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	2,314,169,230.12	1,160,866,505.62
减：现金支付赎回款总额	357,595,169.12	117,232,230.62
减：赎回股票成本总额	1,825,809,597.43	913,431,658.21
赎回差价收入	130,764,463.57	130,202,616.79

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,790,779.69	13,974,978.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,119,923.39	12,971,934.36
减：应收利息总额	1,852.42	1,589.28
买卖债券差价收入	2,669,003.88	1,001,455.11

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	50,560,979.45	29,856,569.31
其中：证券出借权益补偿收入	1,719,640.83	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	50,560,979.45	29,856,569.31

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	50,168,640.54	377,844,382.69
——股票投资	50,168,640.54	377,844,382.69
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
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	50,168,640.54	377,844,382.69

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	352,830.48	954,949.16
基金申购费收入	77,461.27	301,849.05
替代损益收入	3,747,659.39	1,681,654.07
其他	-	-
合计	4,177,951.14	2,938,452.28

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

交易所市场交易费用	2,003,758.46	1,425,409.96
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,003,758.46	1,425,409.96

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	12,967.01	10,822.34
指数使用费	751,733.94	547,168.40
其他	-	-
上市费	-	60,000.00
合计	984,700.95	837,990.74

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、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、申赎代办券商
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
盈峰控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	62,388,973.35	2.66%	179,186,133.56	9.26%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	26,908.81	5.20%	5,282.75	3.03%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	77,281.57	28.55%	10,417.05	14.25%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,528,899.82	9,119,473.87
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,505,780.03	1,823,894.77

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金	735,799,125.00	55.5212%	701,303,141.00	78.1050%
广发证券	5,019,405.00	0.3787%	2,697,697.00	0.3004%

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	21,645,003.73	73,611.44	8,946,272.11	91,245.60

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有广发证券的 A 股的估值总额为人民币 59,009,709.00 元(2019 年 12 月 31 日：22,013,187.00 元)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	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
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股流通受限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新股流通	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-

				受限						
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股流通受限	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	新股流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	新股流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	新股流通受限	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股流通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300880	迦南智能	2020-08-25	2021-03-01	新股流通受限	9.73	34.73	3,732	36,312.36	129,612.36	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新股流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克	2020-09-09	2021-03-16	新股	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-

	股份			流通受限						
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	新股流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股流通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300900	广联航空	2020-10-19	2021-04-29	新股流通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	新股流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新股流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股流通受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-

300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股 流通 受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新股 流通 受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股 流通 受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股 流通 受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股 流通 受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股 流通 受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股 流通 受限	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
601995	中金公司	2020-10-22	2021-05-06	新股 流通 受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股 流通 受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688060	云涌科技	2020-07-03	2021-01-11	新股 流通 受限	44.47	81.69	2,400	106,728.00	196,056.00	-
688069	德林海	2020-07-15	2021-01-22	新股 流通 受限	67.20	62.45	2,253	151,401.60	140,699.85	-
688221	前沿生物	2020-10-20	2021-04-28	新股 流通 受限	20.50	17.15	16,148	331,034.00	276,938.20	-
688286	敏芯股份	2020-07-31	2021-02-10	新股 流通 受限	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
688301	奕瑞科技	2020-09-09	2021-03-18	新股 流通 受限	119.60	162.72	2,427	290,269.20	394,921.44	-
688336	三生国健	2020-07-15	2021-01-22	新股 流通	28.18	24.29	14,352	404,439.36	348,610.08	-

				受限						
688408	中信博	2020-08-20	2021-03-01	新股流通受限	42.19	160.54	4,450	187,745.50	714,403.00	-
688529	豪森股份	2020-10-30	2021-05-10	新股流通受限	20.20	27.10	6,125	123,725.00	165,987.50	-
688556	高测股份	2020-07-29	2021-02-08	新股流通受限	14.41	26.93	6,896	99,371.36	185,709.28	-
688561	奇安信	2020-07-16	2021-01-22	新股流通受限	56.10	122.83	23,563	1,321,884.30	2,894,243.29	-
688585	上纬新材	2020-09-21	2021-03-29	新股流通受限	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
688608	恒玄科技	2020-12-07	2021-06-16	新股流通受限	162.07	272.00	4,179	677,290.53	1,136,688.00	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688699	明微电子	2020-12-10	2021-06-18	新股流通受限	38.43	45.27	1,869	71,825.67	84,609.63	-
601066	中信建投	2020-12-30	2021-06-28	非公开发行流通受限	35.21	38.92	144,845	5,099,992.45	5,637,367.40	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	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
113044	大秦转债	2020-12-16	2021-01-15	新发流通受限	100.00	100.00	15,320	1,531,986.57	1,531,986.57	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
2020121800002234	601990	南京证券	2020-12-18	2021-01-01	12.27	10,000.00	122,700.00
2020121800005713	601318	中国平安	2020-12-18	2021-01-01	86.98	105,500.00	9,176,390.00
2020121800005715	601318	中国平安	2020-12-18	2021-01-01	86.98	203,400.00	17,691,732.00
2020121800005723	601319	中国人保	2020-12-18	2021-01-01	6.57	10,800.00	70,956.00
2020121800006667	000627	天茂集团	2020-12-18	2021-01-01	4.87	62,600.00	304,862.00
2020121800006669	000627	天茂集团	2020-12-18	2021-01-01	4.87	64,600.00	314,602.00
2020121800006741	601236	红塔证券	2020-12-18	2021-01-01	18.59	11,800.00	219,362.00
2020121800	000166	申万宏源	2020-12-18	2021-01-01	5.28	10,100.00	53,328.00

00754 9							
20201 21800 00755 9	601788	光大证券	2020-12-18	2021-01-01	18.52	26,100.00	483,372.00
20201 21800 00762 3	601198	东兴证券	2020-12-18	2021-01-01	13.32	13,000.00	173,160.00
20201 21800 00763 7	600390	五矿资本	2020-12-18	2021-01-01	6.98	32,000.00	223,360.00
20201 21800 00764 1	601377	兴业证券	2020-12-18	2021-01-01	8.68	65,800.00	571,144.00
20201 21800 00764 3	601788	光大证券	2020-12-18	2021-01-01	18.52	17,800.00	329,656.00
20201 22100 00082 4	000166	申万宏源	2020-12-21	2021-01-04	5.28	17,500.00	92,400.00
20201 22100 00094 7	000776	广发证券	2020-12-21	2021-01-04	16.28	12,500.00	203,500.00
20201 22100 00402 5	600030	中信证券	2020-12-21	2021-01-04	29.40	22,900.00	673,260.00
20201 22100 00463 9	601108	财通证券	2020-12-21	2021-01-04	12.65	259,400.00	3,281,410.00
20201 22100 00464 1	601198	东兴证券	2020-12-21	2021-01-04	13.32	60,000.00	799,200.00
20201 22100 00464	002736	国信证券	2020-12-21	2021-01-04	13.64	35,700.00	486,948.00

7							
20201 22100 00465 1	002673	西部证券	2020-12-21	2021-01-04	10.14	180,800.00	1,833,312.00
20201 22100 00465 3	600369	西南证券	2020-12-21	2021-01-04	5.38	120,600.00	648,828.00
20201 22100 00485 7	000776	广发证券	2020-12-21	2021-01-04	16.28	10,700.00	174,196.00
20201 22100 00494 3	600061	国投资本	2020-12-21	2021-01-04	13.83	57,900.00	800,757.00
20201 22200 00253 1	002673	西部证券	2020-12-22	2021-01-05	10.14	10,400.00	105,456.00
20201 22200 00302 1	600061	国投资本	2020-12-22	2021-01-05	13.83	10,000.00	138,300.00
20201 22200 00304 1	601198	东兴证券	2020-12-22	2021-01-05	13.32	16,500.00	219,780.00
20201 22200 00381 8	601788	光大证券	2020-12-22	2021-01-05	18.52	28,500.00	527,820.00
20201 22200 00397 2	601336	新华保险	2020-12-22	2021-01-05	57.97	23,200.00	1,344,904.00
20201 22200 00854 3	600369	西南证券	2020-12-22	2021-01-05	5.38	17,600.00	94,688.00
20201 22200 00864 3	000776	广发证券	2020-12-22	2021-01-05	16.28	10,000.00	162,800.00

20201 22200 00865 3	600030	中信证券	2020-12-22	2021-01-05	29.40	11,000.00	323,400.00
20201 22200 00867 7	600999	招商证券	2020-12-22	2021-01-05	23.34	29,400.00	686,196.00
20201 22200 00869 9	601318	中国平安	2020-12-22	2021-01-05	86.98	60,000.00	5,218,800.00
20201 22200 00891 1	600061	国投资本	2020-12-22	2021-01-05	13.83	11,000.00	152,130.00
20201 22200 00891 3	000166	申万宏源	2020-12-22	2021-01-05	5.28	26,000.00	137,280.00
20201 22200 00891 7	002939	长城证券	2020-12-22	2021-01-05	12.87	53,000.00	682,110.00
20201 22200 00891 9	601881	中国银河	2020-12-22	2021-01-05	12.51	61,000.00	763,110.00
20201 22200 00915 7	600999	招商证券	2020-12-22	2021-01-05	23.34	85,600.00	1,997,904.00
20201 22300 00115 8	000166	申万宏源	2020-12-23	2021-01-06	5.28	16,800.00	88,704.00
20201 22300 00220 8	601628	中国人寿	2020-12-23	2021-01-06	38.39	10,700.00	410,773.00
20201 22300 00293 7	600999	招商证券	2020-12-23	2021-01-06	23.34	61,900.00	1,444,746.00
20201	601555	东吴证券	2020-12-23	2021-01-	9.86	14,800.00	145,928.00

22300 00644 4				06			
20201 22300 00662 4	601162	天风证券	2020-12-23	2021-01-06	6.10	22,200.00	135,420.00
20201 22300 00682 6	601788	光大证券	2020-12-23	2021-01-06	18.52	21,800.00	403,736.00
20201 22300 00706 4	601236	红塔证券	2020-12-23	2021-01-06	18.59	15,100.00	280,709.00
20201 22400 00127 4	300059	东方财富	2020-12-24	2021-01-07	31.00	21,000.00	651,000.00
20201 22400 00127 6	300059	东方财富	2020-12-24	2021-01-07	31.00	10,000.00	310,000.00
20201 22400 00385 5	601377	兴业证券	2020-12-24	2021-01-07	8.68	50,200.00	435,736.00
20201 22400 00407 0	600369	西南证券	2020-12-24	2021-01-07	5.38	37,200.00	200,136.00
20201 22400 00409 3	601628	中国人寿	2020-12-24	2021-01-07	38.39	10,000.00	383,900.00
20201 22400 00461 7	601990	南京证券	2020-12-24	2021-01-07	12.27	10,000.00	122,700.00
20201 22400 00463 5	601990	南京证券	2020-12-24	2021-01-07	12.27	18,100.00	222,087.00
20201 22400	601319	中国人保	2020-12-24	2021-01-07	6.57	13,000.00	85,410.00

00468 7							
20201 22400 00594 7	600390	五矿资本	2020-12-24	2021-01-07	6.98	11,400.00	79,572.00
20201 22400 00654 3	600030	中信证券	2020-12-24	2021-01-07	29.40	10,000.00	294,000.00
20201 22400 01243 7	600109	国金证券	2020-12-24	2021-01-07	16.27	14,300.00	232,661.00
20201 22400 01244 7	000166	申万宏源	2020-12-24	2021-01-07	5.28	19,400.00	102,432.00
20201 22400 01259 9	601198	东兴证券	2020-12-24	2021-01-07	13.32	16,500.00	219,780.00
20201 22500 00600 3	601318	中国平安	2020-12-25	2021-01-08	86.98	228,100.00	19,840,138.00
20201 22500 00615 7	002736	国信证券	2020-12-25	2021-01-08	13.64	262,400.00	3,579,136.00
20201 22500 00637 1	600030	中信证券	2020-12-25	2021-01-08	29.40	19,100.00	561,540.00
20201 22500 00641 3	601878	浙商证券	2020-12-25	2021-01-08	15.30	11,200.00	171,360.00
20201 22800 00071 3	000166	申万宏源	2020-12-28	2021-01-11	5.28	33,600.00	177,408.00
20201 22800 00123	002736	国信证券	2020-12-28	2021-01-11	13.64	20,100.00	274,164.00

7							
20201 22800 00126 0	002939	长城证券	2020-12-28	2021-01-11	12.87	12,400.00	159,588.00
20201 22800 00181 8	601878	浙商证券	2020-12-28	2021-01-11	15.30	13,700.00	209,610.00
20201 22800 00196 7	600030	中信证券	2020-12-28	2021-01-11	29.40	54,700.00	1,608,180.00
20201 22800 00390 7	601628	中国人寿	2020-12-28	2021-01-11	38.39	121,900.00	4,679,741.00
20201 22800 00393 9	600918	中泰证券	2020-12-28	2021-01-11	18.50	33,100.00	612,350.00
20201 22800 00394 3	601318	中国平安	2020-12-28	2021-01-11	86.98	66,400.00	5,775,472.00
20201 22800 00598 5	601878	浙商证券	2020-12-28	2021-01-11	15.30	182,100.00	2,786,130.00
20201 22800 00716 1	601696	中银证券	2020-12-28	2021-01-11	27.68	32,700.00	905,136.00
20201 22800 00716 5	601377	兴业证券	2020-12-28	2021-01-11	8.68	42,100.00	365,428.00
20201 22800 00716 7	601319	中国人保	2020-12-28	2021-01-11	6.57	12,000.00	78,840.00
20201 22800 00717 1	601211	国泰君安	2020-12-28	2021-01-11	17.53	112,000.00	1,963,360.00

20201 22800 00717 3	601236	红塔证券	2020-12-28	2021-01-11	18.59	40,900.00	760,331.00
20201 22800 00717 9	601108	财通证券	2020-12-28	2021-01-11	12.65	10,700.00	135,355.00
20201 22800 00718 1	600958	东方证券	2020-12-28	2021-01-11	11.63	182,000.00	2,116,660.00
20201 22800 00718 3	600705	中航资本	2020-12-28	2021-01-11	4.38	468,000.00	2,049,840.00
20201 22800 00718 5	600109	国金证券	2020-12-28	2021-01-11	16.27	243,600.00	3,963,372.00
20201 22800 00719 1	000627	天茂集团	2020-12-28	2021-01-11	4.87	63,700.00	310,219.00
20201 22800 00719 3	000728	国元证券	2020-12-28	2021-01-11	8.96	220,000.00	1,971,200.00
20201 22800 00723 5	000166	申万宏源	2020-12-28	2021-01-11	5.28	907,100.00	4,789,488.00
20201 22900 00076 6	000627	天茂集团	2020-12-29	2021-01-12	4.87	27,900.00	135,873.00
20201 22900 00162 9	601555	东吴证券	2020-12-29	2021-01-12	9.86	28,200.00	278,052.00
20201 22900 00240 7	601788	光大证券	2020-12-29	2021-01-12	18.52	27,800.00	514,856.00
20201	600705	中航资本	2020-12-29	2021-01-	4.38	61,300.00	268,494.00

22900 00250 2				12			
20201 22900 00260 4	600390	五矿资本	2020-12-29	2021-01-12	6.98	21,600.00	150,768.00
20201 22900 00267 3	600109	国金证券	2020-12-29	2021-01-12	16.27	18,000.00	292,860.00
20201 22900 00587 5	601601	中国太保	2020-12-29	2021-01-12	38.40	62,200.00	2,388,480.00
20201 22900 00594 5	601788	光大证券	2020-12-29	2021-01-12	18.52	29,200.00	540,784.00
20201 22900 00594 7	600030	中信证券	2020-12-29	2021-01-12	29.40	857,400.00	25,207,560.00
20201 22900 00632 9	601336	新华保险	2020-12-29	2021-01-12	57.97	67,700.00	3,924,569.00
20201 22900 00654 1	601881	中国银河	2020-12-29	2021-01-12	12.51	34,800.00	435,348.00
20201 22900 00654 9	600918	中泰证券	2020-12-29	2021-01-12	18.50	48,300.00	893,550.00
20201 22900 00655 3	600390	五矿资本	2020-12-29	2021-01-12	6.98	174,400.00	1,217,312.00
20201 22900 00664 7	600369	西南证券	2020-12-29	2021-01-12	5.38	56,000.00	301,280.00
20201 22900	300033	同花顺	2020-12-29	2021-01-12	123.98	1,400.00	173,572.00

007389							
202012300000589	300033	同花顺	2020-12-30	2021-01-13	123.98	3,000.00	371,940.00
202012300000591	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01-13	31.00	415,500.00	12,880,500.00
202012300000593	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01-13	31.00	50,000.00	1,550,000.00
2020123000002793	002736	国信证券	2020-12-30	2021-01-13	13.64	12,000.00	163,680.00
2020123000003054	601990	南京证券	2020-12-30	2021-01-13	12.27	10,000.00	122,700.00
2020123000003327	601788	光大证券	2020-12-30	2021-01-13	18.52	26,100.00	483,372.00
2020123000003398	600837	海通证券	2020-12-30	2021-01-13	12.86	816,000.00	10,493,760.00
2020123000003542	601881	中国银河	2020-12-30	2021-01-13	12.51	30,000.00	375,300.00
2020123000006447	601236	红塔证券	2020-12-30	2021-01-13	18.59	10,000.00	185,900.00
2020123000007633	000783	长江证券	2020-12-30	2021-01-13	8.40	15,800.00	132,720.00
202012300000775	600958	东方证券	2020-12-30	2021-01-13	11.63	75,400.00	876,902.00

3							
20201 23000 00800 1	601555	东吴证券	2020-12-30	2021-01-13	9.86	311,000.00	3,066,460.00
20201 23000 00800 3	601319	中国人保	2020-12-30	2021-01-13	6.57	73,000.00	479,610.00
20201 23000 00800 5	601162	天风证券	2020-12-30	2021-01-13	6.10	298,700.00	1,822,070.00
20201 23100 00051 7	002673	西部证券	2020-12-31	2021-01-14	10.14	18,400.00	186,576.00
20201 23100 00060 6	601901	方正证券	2020-12-31	2021-01-14	10.37	478,000.00	4,956,860.00
20201 23100 00074 4	600837	海通证券	2020-12-31	2021-01-14	12.86	96,500.00	1,240,990.00
20201 23100 00079 4	600109	国金证券	2020-12-31	2021-01-14	16.27	10,100.00	164,327.00
20201 23100 00236 2	601788	光大证券	2020-12-31	2021-01-14	18.52	10,000.00	185,200.00
20201 23100 00258 8	002939	长城证券	2020-12-31	2021-01-14	12.87	41,300.00	531,531.00
20201 23100 00259 0	600061	国投资本	2020-12-31	2021-01-14	13.83	10,000.00	138,300.00
20201 23100 00259 2	000728	国元证券	2020-12-31	2021-01-14	8.96	30,700.00	275,072.00

20201 23100 00259 4	000776	广发证券	2020-12-31	2021-01-14	16.28	24,700.00	402,116.00
20201 23100 00701 8	600061	国投资本	2020-12-31	2021-01-14	13.83	26,200.00	362,346.00
合计	-	-	-	-	-	10,071,300.00	195,548,179.00

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 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 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%(2019 年 12 月 31 日：0.05%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	1,532,107.45	168,005.16
AAA 以下	0.00	941,111.92
未评级	0.00	0.00
合计	1,532,107.45	1,109,117.08

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固

定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	21,645,003.73	-	-	-	21,645,003.73
结算备付金	1,316,211.49	-	-	-	1,316,211.49
存出保证金	233,454.48	-	-	-	233,454.48
交易性金融资产	-	-	1,531,986.57	3,466,052,894.13	3,467,584,880.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	24,521,679.63	24,521,679.63
应收利息	-	-	-	49,962.18	49,962.18
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,194,669.70	-	1,531,986.57	3,490,624,535.94	3,515,351,192.21
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	-	-	-	19,756,070.86	19,756,070.86
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,289,324.75	1,289,324.75
应付托管费	-	-	-	257,864.96	257,864.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	174,062.74	174,062.74
应交税费	-	-	-	8,051.82	8,051.82
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,484,781.93	6,484,781.93
负债总计	-	-	-	27,970,157.06	27,970,157.06
利率敏感度缺口	23,194,669.70	-	1,531,986.57	3,462,654,378.88	3,487,381,035.15
上年度末 2019 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	8,946,272.11	-	-	-	8,946,272.11
结算备付金	28,191.31	-	-	-	28,191.31
存出保证金	112,187.52	-	-	-	112,187.52
交易性金融资产	-	-	1,108,982.03	2,088,457,474.94	2,089,566,456.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	1,146,309.59	1,146,309.59
应收利息	-	-	-	1,793.98	1,793.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,086,650.94	-	1,108,982.03	2,089,605,578.51	2,099,801,211.48
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,355,930.76	2,355,930.76
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	821,000.35	821,000.35
应付托管费	-	-	-	164,200.03	164,200.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	73,113.87	73,113.87
应交税费	-	-	-	28.96	28.96
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	773,603.45	773,603.45
负债总计	-	-	-	4,187,877.42	4,187,877.42
利率敏感度缺口	9,086,650.94	-	1,108,982.03	2,085,417,701.09	2,095,613,334.06

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	3,466,052,894.13	99.39	2,088,457,474.94	99.66
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	3,466,052,894.13	99.39	2,088,457,474.94	99.66

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	172,883,150.52	104,261,346.49
	2.业绩比较基准下降 5%	-172,883,150.52	-104,261,346.49

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,451,008,403.71 元，属于第二层次的余额为 16,576,476.99 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 2,083,230,918.68 元，第二层次 6,335,538.29 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 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,466,052,894.13	98.60
	其中：股票	3,466,052,894.13	98.60

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,531,986.57	0.04
	其中：债券	1,531,986.57	0.04
	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	22,961,215.22	0.65
8	其他各项资产	24,805,096.29	0.71
9	合计	3,515,351,192.21	100.00

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 195,548,179.00 元，占净值比例 5.61%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,734,268.63	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,252,581.19	0.09
J	金融业	3,456,697,893.09	99.12
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	203,672.01	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,465,997,622.13	99.39

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	13,236,560	1,151,315,988.80	33.01
2	600030	中信证券	10,402,627	305,837,233.80	8.77
3	300059	东方财富	8,428,002	261,268,062.00	7.49
4	601601	中国太保	4,179,784	160,503,705.60	4.60
5	601688	华泰证券	7,196,923	129,616,583.23	3.72
6	600837	海通证券	9,434,962	121,333,611.32	3.48
7	600999	招商证券	4,536,796	105,888,818.64	3.04
8	601211	国泰君安	5,508,910	96,571,192.30	2.77
9	601628	中国人寿	2,037,514	78,220,162.46	2.24
10	600958	东方证券	5,102,543	59,342,575.09	1.70
11	601336	新华保险	1,021,056	59,190,616.32	1.70
12	000776	广发证券	3,624,675	59,009,709.00	1.69
13	000166	申万宏源	11,028,134	58,228,547.52	1.67
14	601377	兴业证券	6,544,876	56,809,523.68	1.63
15	601901	方正证券	4,788,380	49,655,500.60	1.42
16	601066	中信建投	1,176,308	48,958,813.40	1.40
17	600109	国金证券	2,959,547	48,151,829.69	1.38
18	002736	国信证券	3,529,115	48,137,128.60	1.38
19	601788	光大证券	2,384,335	44,157,884.20	1.27
20	000783	长江证券	4,734,784	39,772,185.60	1.14
21	601108	财通证券	3,065,300	38,776,045.00	1.11
22	601555	东吴证券	3,789,880	37,368,216.80	1.07
23	601878	浙商证券	2,208,800	33,794,640.00	0.97
24	300033	同花顺	263,135	32,623,477.30	0.94
25	000728	国元证券	3,199,604	28,668,451.84	0.82
26	600705	中航资本	6,533,793	28,618,013.34	0.82
27	600061	国投资本	2,066,000	28,572,780.00	0.82

28	601162	天风证券	4,070,820	24,832,002.00	0.71
29	601198	东兴证券	1,686,322	22,461,809.04	0.64
30	601990	南京证券	1,803,520	22,129,190.40	0.63
31	600369	西南证券	4,058,947	21,837,134.86	0.63
32	002673	西部证券	2,140,065	21,700,259.10	0.62
33	601881	中国银河	1,576,000	19,715,760.00	0.57
34	600390	五矿资本	2,749,740	19,193,185.20	0.55
35	600918	中泰证券	932,700	17,254,950.00	0.49
36	601319	中国人保	2,597,100	17,062,947.00	0.49
37	601236	红塔证券	889,698	16,539,485.82	0.47
38	002939	长城证券	1,142,000	14,697,540.00	0.42
39	000627	天茂集团	2,414,459	11,758,415.33	0.34
40	601696	中银证券	373,500	10,338,480.00	0.30
41	002945	华林证券	336,500	5,071,055.00	0.15
42	688561	奇安信	23,563	2,894,243.29	0.08
43	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.05
44	688608	恒玄科技	4,179	1,136,688.00	0.03
45	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.03
46	688408	中信博	4,450	714,403.00	0.02
47	688301	奕瑞科技	2,427	394,921.44	0.01
48	688336	三生国健	14,352	348,610.08	0.01
49	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
50	688221	前沿生物	16,148	276,938.20	0.01
51	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.01
52	688060	云涌科技	2,400	196,056.00	0.01
53	688556	高测股份	6,896	185,709.28	0.01
54	688529	豪森股份	6,125	165,987.50	0.00
55	688069	德林海	2,253	140,699.85	0.00
56	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.00
57	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
58	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
59	688699	明微电子	1,869	84,609.63	0.00
60	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.00
61	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
62	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
63	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
64	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
65	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
66	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
67	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
68	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
69	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
70	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
71	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00

72	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
73	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
74	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
75	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
76	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
77	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
78	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
79	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
80	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
81	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
82	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
83	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
84	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
85	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
86	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
87	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
88	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
89	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
90	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
91	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
92	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
93	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
94	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
95	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
96	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
97	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
98	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
99	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
100	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
101	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	227,710,562.99	10.87
2	601318	中国平安	106,244,219.27	5.07
3	000776	广发证券	84,436,648.07	4.03
4	600570	恒生电子	81,367,731.09	3.88
5	000166	申万宏源	70,249,419.10	3.35

6	300033	同花顺	57,344,398.31	2.74
7	002736	国信证券	56,589,311.77	2.70
8	600030	中信证券	45,185,411.22	2.16
9	000783	长江证券	43,980,116.22	2.10
10	600837	海通证券	39,551,569.54	1.89
11	601601	中国太保	36,734,047.20	1.75
12	601688	华泰证券	33,835,645.77	1.61
13	000728	国元证券	33,055,943.68	1.58
14	601066	中信建投	31,733,564.65	1.51
15	002673	西部证券	23,490,175.08	1.12
16	002939	长城证券	21,953,070.10	1.05
17	600999	招商证券	21,434,009.14	1.02
18	601990	南京证券	19,965,605.60	0.95
19	601162	天风证券	17,557,574.07	0.84
20	000627	天茂集团	15,726,015.13	0.75

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	182,521,459.41	8.71
2	300059	东方财富	161,602,449.62	7.71
3	600570	恒生电子	100,172,204.46	4.78
4	600030	中信证券	65,078,286.69	3.11
5	000166	申万宏源	52,589,976.51	2.51
6	000776	广发证券	50,654,262.57	2.42
7	600837	海通证券	48,771,648.24	2.33
8	002736	国信证券	38,101,118.46	1.82
9	000783	长江证券	33,983,232.29	1.62
10	601601	中国太保	28,297,771.30	1.35
11	300033	同花顺	24,056,646.42	1.15
12	000728	国元证券	22,610,320.09	1.08
13	601211	国泰君安	17,846,674.89	0.85
14	002673	西部证券	17,826,084.52	0.85
15	601688	华泰证券	16,601,614.00	0.79
16	000627	天茂集团	12,114,022.50	0.58
17	601628	中国人寿	12,012,986.34	0.57
18	002939	长城证券	11,211,928.60	0.54
19	600999	招商证券	10,541,466.40	0.50
20	601066	中信建投	9,844,177.00	0.47

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,288,151,693.33
卖出股票收入（成交）总额	1,125,948,066.97

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,531,986.57	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,531,986.57	0.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	15,320	1,531,986.57	0.04

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2020 年 2 月 10 日，中国人民银行针对华泰证券股份有限公司如下违法事实：1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定报送可疑交易报告；3、与身份不明的客户进行交易，处以责令改正，并处罚款 1010 万元的行政处罚。

2020 年 4 月 8 日，中国人民银行长春中心支行对招商证券股份有限公司长春人民大街证券营业部未按规定履行客户身份识别义务的违法违规事实，责令整改并处罚款 22 万元的行政处罚。

2020 年 4 月 29 日，国家税务总局潍坊市税务局稽查局对国泰君安证券股份有限公司税务违规问题，处以罚款 3,566.50 元。2020 年 6 月 3 日，国家税务总局邯郸市税务局稽查局对国泰君安证券股份有限公司税务违规问题，处以罚款 2308.26 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。除华泰证券、招商证券、国泰君安外，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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	233,454.48
2	应收证券清算款	24,521,679.63
3	应收股利	-
4	应收利息	49,962.18
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,805,096.29

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601318	中国平安	57,702,532.00	1.65	转融通流通受限
2	600030	中信证券	28,667,940.00	0.82	转融通流通受限
3	300059	东方财富	15,391,500.00	0.44	转融通流通受限
4	600837	海通证券	11,734,750.00	0.34	转融通流通受限
5	601628	中国人寿	5,474,414.00	0.16	转融通流通受限
6	600999	招商证券	4,128,846.00	0.12	转融通流通受限
7	600958	东方证券	2,993,562.00	0.09	转融通流通受限
8	601601	中国太保	2,388,480.00	0.07	转融通流通受限
9	601211	国泰君安	1,963,360.00	0.06	转融通流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有限公司-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	
		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

14,138	93,737.38	1,095,310,171.00	82.65%	229,948,891.00	17.35%	735,799,125.00	55.52%
--------	-----------	------------------	--------	----------------	--------	----------------	--------

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“中国建设银行股份有限公司-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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	友邦人寿保险有限公司—传统	79,060,600.00	5.98%
2	友邦人寿保险有限公司—分红	46,227,800.00	3.49%
3	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	40,000,000.00	3.02%
4	友邦人寿保险有限公司—传统—普通保险产品	28,827,300.00	2.18%
5	中金公司—中国银行—中金丰裕 7 号集合资产管理计划	27,510,700.00	2.08%
6	华夏基金—华夏银行—华夏银行股份有限公司	24,051,100.00	1.82%
7	平安基金—中国平安财产保险股份有限公司（传统普通保险产品）—平安产险—平安基金	15,644,300.00	1.18%
8	国信证券股份有限公司	14,346,400.00	1.08%
9	鹏扬基金—平安银行—鹏扬基金多利集合资产管理计划	8,739,600.00	0.66%
10	刘颖	6,423,400.00	0.49%
11	中国建设银行股份有限公司-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	735,799,125.00	55.61%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014 年 6 月 26 日)基金份额总额	556,159,897.00
本报告期期初基金份额总额	897,897,445.00
本报告期基金总申购份额	1,459,902,555.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,032,540,938.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,325,259,062.00

注：期初基金总份额包含场外份额 30,737,548 份；期末基金总份额包含场外份额 2,099,165 份；总申购份额包含场外总申购份额 63,902,555 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 92,540,938 份。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 6 月 22 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起聘任张坤先生、陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 7 月 24 日发布公告，自 2020 年 7 月 24 日起聘任胡剑先生、张清华先生担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 9 月 19 日发布公告，自 2020 年 9 月 19 日起聘任冯波先生、陈皓先生担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 9 月 30 日发布公告，自 2020 年 9 月 28 日起张优造先生不再担任公司副总经理。

本基金管理人于 2020 年 12 月 12 日发布公告，自 2020 年 12 月 10 日起汪兰英女士不再担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 7 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	62,388,973.35	2.66%	26,908.81	5.20%	-
华创证券	2	907,138,994.20	38.73%	90,713.95	17.54%	-
平安证券	2	70,441,603.87	3.01%	7,044.88	1.36%	-
申万宏源	4	1,302,498,276.39	55.60%	392,636.35	75.90%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增招商证券股份有限公司一个交易单元。

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务。

和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	7,512,502.70	47.58%	-	-	-	-
平安证券	8,278,276.99	52.42%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国联证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-01-13
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中金公司为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-01-13
3	易方达基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式相关业务规则并修订部分基金基金合同的公告	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	2020-01-18
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2020-01-18
5	易方达基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 1 月 31 日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告	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	2020-01-30
6	易方达基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	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	2020-02-04
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东吴证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-02-28

		金电子披露网站	
8	易方达基金管理有限公司关于部分沪市上市基金增加扩位证券简称的公告	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	2020-03-13
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	上海证券报	2020-03-31
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	2020-04-10
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加浙商证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-04-15
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2020-04-21
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加湘财证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-04-28
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中信证券华南为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-04-28
15	易方达基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	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	2020-05-20
16	易方达基金管理有限公司关于修订旗下部分 A 股 ETF 基金合同、托管协议的公告	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	2020-05-29
17	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	2020-06-22
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2020-07-21
19	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	2020-07-24
20	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	上海证券报	2020-08-28
21	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	2020-09-19
22	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	2020-09-30
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2020-10-14

		金电子披露网站	
24	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东方证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-10-19
25	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华创证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-10-23
26	易方达基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	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	2020-10-28
27	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2020-10-28
28	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2020-12-10
29	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加方正证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2020-12-10
30	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	2020-12-12
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配中信建投（601066）非公开发行 A 股的公告	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	2020-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司—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	1	2020 年 01 月 01 日~2020 年 12 月 31 日	701,303,141.00	1,266,455,700.00	1,231,959,716.00	735,799,125.00	55.52 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如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。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 13备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《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基金合同》；
- 3.《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托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日