

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资 基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 易基、MSCIA 股 ETF 易方达
基金主代码	512090
交易代码	512090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 17 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	327,592,316.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 6 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index)收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	王玉	许俊

负责人	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510627；510623；519031	100818
法定代表人		吴欣荣	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	63,316,230.22
本期利润	64,341,189.31
加权平均基金份额本期利润	0.2021
本期加权平均净值利润率	10.10%
本期基金份额净值增长率	10.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	348,718,796.62
期末可供分配基金份额利润	1.0645
期末基金资产净值	698,038,527.81
期末基金份额净值	2.1308
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	113.08%

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

要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.77%	1.29%	11.74%	1.30%	2.03%	-0.01%
过去六个月	10.47%	1.17%	7.81%	1.18%	2.66%	-0.01%
过去一年	33.05%	1.04%	26.95%	1.04%	6.10%	0.00%
过去三年	45.10%	1.13%	27.14%	1.13%	17.96%	0.00%
过去五年	17.63%	1.11%	-5.77%	1.12%	23.40%	-0.01%
过去七年	102.41%	1.16%	37.95%	1.17%	64.46%	-0.01%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	113.08%	1.20%	34.10%	1.21%	78.98%	-0.01%

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

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018 年 5 月 17 日至 2026 年 6 月 30 日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
宋 钊 贤	本基金的基金经理，易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接、易方达中证红利 ETF 联接、易方达中证红利 ETF、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证香港证券投资主题（港股通）ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联	2020-09-05	-	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员、投资经理助理、投资经理，易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达上证 50 指数（LOF）、易方达中证石化产业 ETF、易方达中证现代农业主题 ETF、易方达中证装备产业 ETF、易方达中证全指建筑材料 ETF、易方达中证装备产

	互通 ETF 联接、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达中证红利低波动 ETF 联接发起式、易方达中证红利低波动 ETF、易方达中证港股通高股息投资 ETF 联接发起式、易方达中证港股通高股息投资 ETF、易方达中证全指红利质量 ETF 的基金经理，易方达北证 50 成份指数、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式（自 2023 年 10 月 14 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达 MSCI 美国 50ETF（QDII）、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证 A50ETF（自 2024 年 03 月 30 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证家电龙头 ETF（自 2024 年 11 月 30 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达恒生港股通创新药 ETF、易方达中证红利价值 ETF、易方达恒生港股通创新药 ETF 联接发起式、易方达中证红利价值 ETF 联接、易方达恒生港股通高股息低波动 ETF、易方达恒生生物科技 ETF、易方达恒生港股通高股息低波动 ETF 联接发起式、易方达恒生生物科技 ETF 联接发起式、易方达创业板新能源 ETF 的基金经理助理				业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。
吕方	本基金的基金经理，易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证家电龙头 ETF、易方达中证消费 50ETF、易方达中证全指食品 ETF、易方达中证畜牧养殖产业 ETF、易方达国证粮食产业 ETF、易方达中证全指可选消费指数发起式的基金经理	2025-10-18	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任兴业基金管理有限公司海外投资经理，先锋领航投资管理（上海）有限公司投资产品策略经理、高级专家、执行总监，易方达基金管理有限公司研究员。

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行业协会相关规定。

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 64 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

本基金跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，该指数旨在追踪随着时间推移部分 A 股逐渐被纳入 MSCI 新兴市场指数的过程。纳入指数的成份股来自 MSCI 中国指数中的中国 A 股成份股。标的指数编制方法基于 MSCI 全球可投资市场指数的编制方法。目前该指数涵盖了互联互通机制下 A 股市场中具有代表性的大盘和中盘上市公司。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2026 年上半年国内经济整体呈现 K 型非对称复苏格局，供给、外需与高新产业景气表现亮眼，内需及传统产业修复动力偏弱，行业、区域、产业链上下游多重分化成为上半年经济运行的特征。总量层面，国家统计局数据显示上半年国内 GDP 同比增长 4.7%，生产端新质生产力支撑作用突出，上半年规模以上高技术制造业增加值同比增长 13.3%，集成电路、工业机器人、AI 硬件等工业产品产量保持高增。需求端内外冷暖分化显著，机电、数字产品出口构成外贸核心增长动力，固定资产

投资与消费端形成明显拖累，居民消费意愿与平均消费倾向持续走弱。

政策层面，上半年政策主线聚焦培育新质生产力。财政资源重点投向“十五五”重大项目、高端制造设备更新领域；货币政策稳步由数量型调控向价格型调控转型，依托科创、民营企业专项再贷款等结构性工具，精准支持高新产业发展。

上半年资本市场由 AI 产业周期、中东地缘冲突两大核心线索主导，资产定价与市场风险偏好随地缘环境、全球流动性预期持续变动。市场结构性行情鲜明，资金持续布局算力、半导体材料等高景气赛道，地产链、传统耐用消费板块整体承压。

MSCI 中国 A 股国际通指数涵盖在上交所和深交所上市的代表性大盘股与中盘股，是投资者分散配置 A 股的有效工具。报告期内，该指数成份股中，电子、通信等行业个股贡献较高收益；银行、食品饮料等行业个股表现偏弱，对指数收益形成小幅拖累。报告期内，MSCI 中国 A 股国际通指数上涨 7.81%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.1308 元，本报告期份额净值增长率为 10.47%，同期业绩比较基准收益率为 7.81%。年化跟踪误差 0.63%，在合同约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

2026 年下半年外部环境呈现机遇与风险交织格局，全球制造业景气维持高位，AI 资本开支、全球能源重构将持续托举我国机电、算力、新能源设备外需；中东地缘扰动仍是大宗商品价格核心变量，海外央行政策调整带来全球流动性阶段性波动压力。国内经济有望整体延续“外需托底、内需渐进回暖”的 K 型修复特征。需求端结构分化延续，出口依靠 AI 硬件、储能、新能源保持韧性；消费呈现服务强、商品弱格局，促消费专项资金、延续性以旧换新政策将支撑耐用品需求，居民消费内生修复仍依赖收入改善；房地产投资拖累斜率放缓。供给端制造业投资存在滞后修复空间，利润改善与海外订单带动资金向 AI、高端装备等出口优势产业链集中。政策层面，下半年超长期特别国债、新型政策性金融工具、专项债加快落地，资金重点投向算力网、能源基建等“六网”领域。资本市场延续结构性机会，AI、能源设备等高景气出口链具备配置价值，消费板块随基本面改善存在估值修复空间；此外，需持续关注地缘能源、海外货币政策、内需修复不及预期等潜在扰动因素。

MSCI 中国 A 股国际通指数旨在追踪 A 股逐步纳入 MSCI 新兴市场指数的过程，指数覆盖了大盘股和中盘股，兼顾行业均衡性与市场代表性。作为国际投资者布局中国 A 股的核心指数之一，MSCI

中国 A 股国际通指数是全球资本分散配置 A 股、分享中国经济增长红利的有效工具。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标的指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。

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程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回

价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	20,889,564.75	23,841,241.07
结算备付金		7,748,929.12	5,723,147.24
存出保证金		4,019,447.93	3,187,365.91
交易性金融资产	6.4.7.2	663,039,559.65	638,554,109.24
其中：股票投资		663,039,559.65	638,554,109.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		11,047,592.79	1,304,769.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		706,745,094.24	672,610,633.45
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		233,674.28	321,509.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		80,653.55	97,304.92
应付托管费		26,884.52	32,434.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		61,750.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	8,303,603.63	5,570,545.94
负债合计		8,706,566.43	6,021,794.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	327,592,316.00	345,592,316.00
未分配利润	6.4.7.8	370,446,211.81	320,996,522.61
净资产合计		698,038,527.81	666,588,838.61
负债和净资产总计		706,745,094.24	672,610,633.45

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.1308 元，基金份额总额 327,592,316.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		65,076,734.05	7,074,157.56
1.利息收入		74,674.40	35,159.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	74,674.40	35,159.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		62,865,598.88	3,783,315.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	54,460,759.25	-1,039,489.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	16,879.99	62,126.59
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	3,387,768.27	-103,702.82

股利收益	6.4.7.14	5,000,191.37	4,864,381.42
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,024,959.09	3,239,235.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,111,501.68	16,447.29
减：二、营业总支出		735,544.74	540,441.78
1. 管理人报酬		473,647.45	305,151.32
2. 托管费		157,882.54	101,717.09
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		12,209.24	114.53
8. 其他费用	6.4.7.18	91,805.51	133,458.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,341,189.31	6,533,715.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,341,189.31	6,533,715.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,341,189.31	6,533,715.78

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	345,592,316.00	320,996,522.61	666,588,838.61
二、本期期初净资产	345,592,316.00	320,996,522.61	666,588,838.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	49,449,689.20	31,449,689.20
（一）、综合收益总额	-	64,341,189.31	64,341,189.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-18,000,000.00	-14,891,500.11	-32,891,500.11

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	436,000,000.00	448,898,652.43	884,898,652.43
2.基金赎回款	-454,000,000.00	-463,790,152.54	-917,790,152.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	327,592,316.00	370,446,211.81	698,038,527.81
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	281,592,316.00	161,633,558.95	443,225,874.95
二、本期期初净资产	281,592,316.00	161,633,558.95	443,225,874.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	-13,915,309.95	-49,915,309.95
(一)、综合收益总额	-	6,533,715.78	6,533,715.78
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	-20,449,025.73	-56,449,025.73
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	3,114,812.43	9,114,812.43
2.基金赎回款	-42,000,000.00	-23,563,838.16	-65,563,838.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	245,592,316.00	147,718,249.00	393,310,565.00

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：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]595 号《关于准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集, 由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案, 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 17 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,743,592,316.00 份基金份额, 其中认购资金利息折合 2,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金, 存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息

红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，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。

2027 年 12 月 31 日前，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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳

税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	20,889,564.75
等于：本金	20,887,333.76
加：应计利息	2,230.99
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	20,889,564.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		623,406,547.88	-	663,039,559.65	39,633,011.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所	-	-	-	-

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		623,406,547.88	-	663,039,559.65	39,633,011.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	30,525,200.00	-	-	-
IC2609	3,292,280.00	-	-	-
IF2609	27,232,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,525,200.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	2	3,504,560.00	212,280.00
IF2609	IF2609	19	27,643,860.00	410,940.00
合计	-	-	-	623,220.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	623,220.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	65,807.87
其中：交易所市场	65,807.87
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
应付替代款	7,972,735.80
可退替代款	190,676.20
合计	8,303,603.63

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	345,592,316.00	345,592,316.00
本期申购	436,000,000.00	436,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-454,000,000.00	-454,000,000.00
本期末	327,592,316.00	327,592,316.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	298,590,251.16	22,406,271.45	320,996,522.61
本期期初	298,590,251.16	22,406,271.45	320,996,522.61
本期利润	63,316,230.22	1,024,959.09	64,341,189.31
本期基金份额交易产生的变动数	-13,187,684.76	-1,703,815.35	-14,891,500.11

其中：基金申购款	427,973,199.33	20,925,453.10	448,898,652.43
基金赎回款	-441,160,884.09	-22,629,268.45	-463,790,152.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	348,718,796.62	21,727,415.19	370,446,211.81

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,889.54
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	38,384.80
其他	400.06
合计	74,674.40

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	42,025,495.76
股票投资收益——赎回差价收入	12,435,263.49
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	54,460,759.25

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	495,452,313.23
减：卖出股票成本总额	453,019,060.60
减：交易费用	407,756.87
买卖股票差价收入	42,025,495.76

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	917,790,152.54
减：现金支付赎回款总额	390,343,561.54
减：赎回股票成本总额	515,011,327.51
减：交易费用	-

赎回差价收入	12,435,263.49
--------	---------------

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,879.99
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	16,879.99

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,341,903.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,302,280.57
减：应计利息总额	22,250.41
减：交易费用	492.16
买卖债券差价收入	16,879.99

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益**6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	3,387,768.27

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,000,191.37
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	5,000,191.37

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,318,659.09
——股票投资	1,318,659.09
——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	-293,700.00
——权证投资	-
——期货投资	-293,700.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,024,959.09

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	1,111,501.68
合计	1,111,501.68

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	17,421.75

合计	91,805.51
----	-----------

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、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	8,866,439.50	0.91%	47,264.00	0.07%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	886.77	0.91%	559.98	0.85%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	4.74	0.07%	2.14	0.08%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	473,647.45	305,151.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	25,242.54	17,593.58
应支付基金管理人的净管理费	448,404.91	287,557.74

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	157,882.54	101,717.09

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	37,425,210.00	11.4243%	46,829,410.00	13.5505%
广发证券股份有限公司	653,008.00	0.1993%	8,037,158.00	2.3256%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	20,889,564.75	35,889.54	5,147,294.31	9,573.10

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
广发证券股份有限公司	920189	康美特	新股发行	200	1,628.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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

				股/张)	
广发证券股份 有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中银国际证 券股份有限 公司	603409	汇通控股	新股发行	1,000	24,180.00

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的 A 股广发证券、托管人中国银行发行的 A 股中国银行和托管人关联方中银证券发行的 A 股中银证券。于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有广发证券发行的 A 股广发证券 74,000 股（2025 年 12 月 31 日：80,600 股），占本基金净值比例为 0.25%（2025 年 12 月 31 日：0.27%）；持有中国银行发行的 A 股中国银行 501,400 股（2025 年 12 月 31 日：544,900 股），占本基金净值比例为 0.41%（2025 年 12 月 31 日：0.47%）；持有中银证券发行的 A 股中银证券 35,500 股（2025 年 12 月 31 日：38,900 股），占本基金净值比例为 0.06%（2025 年 12 月 31 日：0.09%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
00122 0	世盟 股份	2026-0 1-27	6 个月	新股 流通 受限	28.00	27.78	57	1,596. 00	1,583. 46	-
00123 7	惠康 科技	2026-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	53.26	58.74	285	15,179 .10	16,740 .90	-
00124 8	华润 新能	2026-0 6-24	1 个月 以内	新股 流通	10.11	10.11	9,587	96,924 .57	96,924 .57	-

	源			受限						
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	22,372	226,180.92	226,180.92	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	3,737	37,818.44	103,627.01	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,046	48,199.68	484,643.18	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	622	43,328.52	99,557.32	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
30168	新广	2025-1	6 个月	新股	21.93	77.78	195	4,276.	15,167	-

7	益	2-24		流通受限				35	.10	
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	649	7,255.82	11,415.91	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,155	139,595.40	259,494.80	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	19,926	171,762.12	1,144,150.92	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,008	19,837.44	142,621.92	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月以内	新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月以内	新股流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
601088	中国神华	2026-03-31	6 个月	非公开发行流通受限	43.70	37.71	21,377	934,174.90	806,126.67	-

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	3,540	1,043,540.01	2,945,280.00	-

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 2026 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 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,889,564.75	-	-	-	20,889,564.75
结算备付金	7,748,929.12	-	-	-	7,748,929.12
存出保证金	4,019,447.93	-	-	-	4,019,447.93
交易性金融资产	-	-	-	663,039,559.65	663,039,559.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	11,047,592.79	11,047,592.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,657,941.80	-	-	674,087,152.44	706,745,094.24

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	233,674.28	233,674.28
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	80,653.55	80,653.55
应付托管费	-	-	-	26,884.52	26,884.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	61,750.45	61,750.45
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	8,303,603.63	8,303,603.63
负债总计	-	-	-	8,706,566.43	8,706,566.4 3
利率敏感度缺口	32,657,941.80	-	-	665,380,586.01	698,038,527.8 1
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	23,841,241.07	-	-	-	23,841,241.07
结算备付金	5,723,147.24	-	-	-	5,723,147.24
存出保证金	3,187,365.91	-	-	-	3,187,365.91
交易性金融资产	-	-	-	638,554,109.24	638,554,109.2 4
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,304,769.99	1,304,769.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,751,754.22	-	-	639,858,879.23	672,610,633.4

					5
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	321,509.00	321,509.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	97,304.92	97,304.92
应付托管费	-	-	-	32,434.98	32,434.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,570,545.94	5,570,545.94
负债总计	-	-	-	6,021,794.84	6,021,794.84
利率敏感度缺口	32,751,754.22	-	-	633,837,084.39	666,588,838.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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	上年度末
----	-----	------

	2026 年 6 月 30 日		2025 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	663,039,559.65	94.99	638,554,109.24	95.79
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	663,039,559.65	94.99	638,554,109.24	95.79

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	34,571,756.24	31,813,725.16
	2.业绩比较基准下降 5%	-34,571,756.24	-31,813,725.16

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
---------------	-----

	2026 年 6 月 30 日
第一层次	655,387,413.16
第二层次	3,278,353.49
第三层次	4,373,793.00
合计	663,039,559.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	663,039,559.65	93.82
	其中：股票	663,039,559.65	93.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,638,493.87	4.05
8	其他各项资产	15,067,040.72	2.13
9	合计	706,745,094.24	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,442,687.16	0.49
B	采矿业	30,174,183.38	4.32
C	制造业	421,468,311.20	60.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,236,524.36	2.90
E	建筑业	7,237,594.00	1.04
F	批发和零售业	3,596,367.80	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	15,844,699.66	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,560,959.32	5.09
J	金融业	110,985,737.40	15.90
K	房地产业	2,915,311.00	0.42
L	租赁和商务服务业	3,944,685.18	0.57
M	科学研究和技术服务业	4,542,870.75	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	407,862.22	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	966,395.22	0.14
R	文化、体育和娱乐业	404,785.00	0.06
S	综合	1,312,978.00	0.19
	合计	663,041,951.65	94.99

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	300750	宁德时代	55,700	21,890,657.00	3.14
2	600519	贵州茅台	15,600	18,493,644.00	2.65
3	300308	中际旭创	13,640	17,322,800.00	2.48
4	688256	寒武纪	7,834	12,499,538.70	1.79
5	688041	海光信息	28,797	10,663,529.10	1.53
6	300502	新易盛	16,732	10,156,324.00	1.45
7	601138	工业富联	134,400	9,696,960.00	1.39
8	600036	招商银行	257,787	9,151,438.50	1.31
9	600900	长江电力	306,121	8,103,022.87	1.16
10	002371	北方华创	9,120	8,067,187.20	1.16
11	603986	兆易创新	8,040	6,552,600.00	0.94
12	601288	农业银行	1,075,300	6,527,071.00	0.94
13	002475	立讯精密	91,086	6,412,454.40	0.92
14	601899	紫金矿业	255,000	6,410,700.00	0.92
15	601318	中国平安	130,709	6,240,047.66	0.89
16	002384	东山精密	22,900	6,007,815.00	0.86
17	601398	工商银行	787,200	5,565,504.00	0.80
18	002594	比亚迪	69,100	5,507,270.00	0.79
19	688012	中微公司	11,294	5,291,239.00	0.76
20	600183	生益科技	30,200	5,236,680.00	0.75
21	601166	兴业银行	263,557	4,364,503.92	0.63
22	600030	中信证券	151,665	4,357,335.45	0.62
23	601328	交通银行	667,549	4,292,340.07	0.61
24	688008	澜起科技	13,730	4,254,927.00	0.61
25	300274	阳光电源	26,260	4,175,865.20	0.60
26	600276	恒瑞医药	79,273	4,125,366.92	0.59
27	300394	天孚通信	13,498	4,085,574.64	0.59
28	300408	三环集团	24,000	4,005,600.00	0.57
29	300059	东方财富	195,582	3,985,961.16	0.57
30	002916	深南电路	8,686	3,977,319.40	0.57
31	000725	京东方 A	441,900	3,835,692.00	0.55
32	603993	洛阳钼业	218,265	3,830,550.75	0.55
33	300476	胜宏科技	10,900	3,776,087.00	0.54
34	603259	药明康德	30,275	3,769,540.25	0.54
35	002463	沪电股份	24,110	3,684,008.00	0.53
36	301308	江波龙	5,200	3,659,760.00	0.52
37	600176	中国巨石	49,479	3,606,029.52	0.52
38	600000	浦发银行	418,647	3,604,550.67	0.52

39	000858	五粮液	48,400	3,581,600.00	0.51
40	600487	亨通光电	32,000	3,498,880.00	0.50
41	300433	蓝思科技	62,500	3,353,750.00	0.48
42	601211	国泰海通	175,868	3,200,797.60	0.46
43	600150	中国船舶	93,700	3,166,123.00	0.45
44	000333	美的集团	41,200	3,111,836.00	0.45
45	688525	佰维存储	6,102	3,018,842.46	0.43
46	688072	拓荆科技	3,540	2,945,280.00	0.42
47	601988	中国银行	501,400	2,868,008.00	0.41
48	688498	源杰科技	1,498	2,825,228.00	0.40
49	300604	长川科技	8,200	2,799,644.00	0.40
50	601816	京沪高铁	613,100	2,777,343.00	0.40
51	002281	光迅科技	10,700	2,749,258.00	0.39
52	000657	中钨高新	28,700	2,747,164.00	0.39
53	001309	德明利	2,900	2,734,410.00	0.39
54	600309	万华化学	39,900	2,729,559.00	0.39
55	601088	中国神华	70,377	2,719,086.67	0.39
56	601857	中国石油	310,751	2,697,318.68	0.39
57	002938	鹏鼎控股	24,800	2,613,424.00	0.37
58	600522	中天科技	42,370	2,571,011.60	0.37
59	601939	建设银行	266,300	2,564,469.00	0.37
60	601225	陕西煤业	121,800	2,478,630.00	0.36
61	600919	江苏银行	228,666	2,465,019.48	0.35
62	601601	中国太保	86,157	2,457,197.64	0.35
63	002142	宁波银行	82,520	2,450,018.80	0.35
64	000001	平安银行	242,500	2,437,125.00	0.35
65	002714	牧原股份	69,124	2,418,648.76	0.35
66	688521	芯原股份	6,402	2,376,038.28	0.34
67	601985	中国核电	258,500	2,334,255.00	0.33
68	300033	同花顺	9,580	2,308,780.00	0.33
69	600406	国电南瑞	101,037	2,308,695.45	0.33
70	600584	长电科技	22,200	2,298,810.00	0.33
71	601869	长飞光纤	4,200	2,292,780.00	0.33
72	000338	潍柴动力	84,000	2,289,000.00	0.33
73	000988	华工科技	12,300	2,270,703.00	0.33
74	601668	中国建筑	517,080	2,244,127.20	0.32
75	600111	北方稀土	45,200	2,171,860.00	0.31
76	300857	协创数据	6,280	2,134,572.00	0.31
77	601919	中远海控	157,020	2,082,085.20	0.30
78	300760	迈瑞医疗	15,177	2,061,491.91	0.30
79	688120	华海清科	6,294	2,027,800.92	0.29
80	000792	盐湖股份	65,500	1,977,445.00	0.28
81	002353	杰瑞股份	12,900	1,967,250.00	0.28
82	002080	中材科技	21,700	1,953,000.00	0.28

83	600999	招商证券	92,547	1,952,741.70	0.28
84	603288	海天味业	58,506	1,940,058.96	0.28
85	688361	中科飞测	4,477	1,925,110.00	0.28
86	600989	宝丰能源	92,900	1,888,657.00	0.27
87	002352	顺丰控股	60,100	1,878,726.00	0.27
88	601688	华泰证券	90,900	1,874,358.00	0.27
89	601658	邮储银行	378,900	1,867,977.00	0.27
90	600887	伊利股份	77,578	1,858,768.88	0.27
91	600031	三一重工	105,900	1,829,952.00	0.26
92	601100	恒立液压	16,832	1,810,449.92	0.26
93	000063	中兴通讯	49,800	1,802,262.00	0.26
94	300475	香农芯创	6,000	1,800,000.00	0.26
95	601872	招商轮船	101,500	1,783,355.00	0.26
96	600160	巨化股份	32,900	1,744,029.00	0.25
97	688347	华虹宏力	5,158	1,734,635.40	0.25
98	000776	广发证券	74,000	1,731,600.00	0.25
99	300014	亿纬锂能	26,461	1,720,758.83	0.25
100	605117	德业股份	15,959	1,694,526.62	0.24
101	688082	盛美上海	3,909	1,688,688.00	0.24
102	300442	润泽科技	20,300	1,686,321.00	0.24
103	600809	山西汾酒	15,372	1,681,235.64	0.24
104	688126	沪硅产业	41,793	1,667,122.77	0.24
105	600549	厦门钨业	19,500	1,661,400.00	0.24
106	601818	光大银行	574,500	1,660,305.00	0.24
107	600028	中国石化	365,300	1,629,238.00	0.23
108	688396	华润微	16,687	1,627,816.85	0.23
109	600690	海尔智家	77,853	1,588,979.73	0.23
110	601336	新华保险	26,600	1,586,956.00	0.23
111	601066	中信建投	54,500	1,584,315.00	0.23
112	601766	中国中车	304,200	1,581,840.00	0.23
113	600050	中国联通	391,700	1,566,800.00	0.22
114	002600	领益智造	89,829	1,557,634.86	0.22
115	601229	上海银行	178,042	1,545,404.56	0.22
116	300223	北京君正	6,200	1,543,180.00	0.22
117	688249	晶合集成	25,851	1,525,984.53	0.22
118	601009	南京银行	154,130	1,524,345.70	0.22
119	300136	信维通信	12,500	1,490,625.00	0.21
120	002156	通富微电	19,600	1,487,052.00	0.21
121	600019	宝钢股份	273,800	1,486,734.00	0.21
122	000100	TCL 科技	246,979	1,437,417.78	0.21
123	603501	豪威集团	15,100	1,432,235.00	0.21
124	600016	民生银行	443,480	1,428,005.60	0.20
125	000568	泸州老窖	18,300	1,418,616.00	0.20
126	600089	特变电工	61,735	1,389,037.50	0.20

127	600703	三安光电	64,600	1,370,812.00	0.20
128	601600	中国铝业	165,300	1,358,766.00	0.19
129	000408	藏格矿业	19,600	1,358,672.00	0.19
130	601888	中国中免	24,858	1,335,123.18	0.19
131	002709	天赐材料	25,886	1,331,316.98	0.19
132	600905	三峡能源	358,000	1,328,180.00	0.19
133	601995	中金公司	36,700	1,326,705.00	0.19
134	600673	东阳光	39,100	1,312,978.00	0.19
135	600926	杭州银行	90,660	1,310,037.00	0.19
136	601169	北京银行	265,500	1,300,950.00	0.19
137	300757	罗博特科	2,100	1,299,900.00	0.19
138	688702	盛科通信	3,329	1,298,276.71	0.19
139	600346	恒力石化	73,100	1,294,601.00	0.19
140	600660	福耀玻璃	25,635	1,293,029.40	0.19
141	002602	世纪华通	91,700	1,292,970.00	0.19
142	002460	赣锋锂业	19,760	1,292,304.00	0.19
143	600893	航发动力	33,236	1,274,268.24	0.18
144	600498	烽火通信	17,300	1,273,280.00	0.18
145	600010	包钢股份	568,800	1,268,424.00	0.18
146	002837	英维克	15,877	1,263,174.12	0.18
147	000977	浪潮信息	18,028	1,261,960.00	0.18
148	600105	永鼎股份	18,600	1,255,128.00	0.18
149	000166	申万宏源	283,300	1,246,520.00	0.18
150	002493	荣盛石化	115,750	1,244,312.50	0.18
151	601127	赛力斯	20,300	1,243,375.00	0.18
152	002851	麦格米特	7,400	1,237,132.00	0.18
153	601012	隆基绿能	94,208	1,236,008.96	0.18
154	600886	国投电力	92,700	1,233,837.00	0.18
155	688111	金山办公	5,781	1,231,642.05	0.18
156	600188	兖矿能源	69,270	1,230,927.90	0.18
157	601689	拓普集团	21,685	1,223,467.70	0.18
158	300620	光库科技	3,200	1,210,240.00	0.17
159	000651	格力电器	32,200	1,207,500.00	0.17
160	000425	徐工机械	147,400	1,192,466.00	0.17
161	688777	中控技术	10,062	1,182,285.00	0.17
162	688048	长光华芯	2,341	1,175,182.00	0.17
163	601868	中国能建	439,700	1,173,999.00	0.17
164	688110	东芯股份	5,732	1,167,608.40	0.17
165	601006	大秦铁路	252,500	1,164,025.00	0.17
166	002230	科大讯飞	28,200	1,151,688.00	0.16
167	600362	江西铜业	26,500	1,147,450.00	0.16
168	688183	生益电子	8,661	1,146,716.40	0.16
169	603799	华友钴业	23,740	1,145,692.40	0.16
170	688469	芯联集成	107,964	1,145,498.04	0.16

171	688783	西安奕材	19,926	1,144,150.92	0.16
172	002001	新和成	39,376	1,119,065.92	0.16
173	601727	上海电气	159,700	1,117,900.00	0.16
174	600875	东方电气	38,800	1,116,276.00	0.16
175	688629	华丰科技	5,920	1,110,059.20	0.16
176	002466	天齐锂业	18,100	1,109,892.00	0.16
177	600460	士兰微	20,300	1,109,598.00	0.16
178	300661	圣邦股份	7,725	1,108,383.00	0.16
179	603296	华勤技术	14,820	1,100,681.40	0.16
180	600489	中金黄金	60,600	1,093,830.00	0.16
181	601958	金钼股份	38,300	1,076,613.00	0.15
182	601390	中国中铁	256,400	1,069,188.00	0.15
183	001389	广合科技	4,500	1,067,625.00	0.15
184	000630	铜陵有色	167,500	1,065,300.00	0.15
185	000538	云南白药	22,480	1,064,877.60	0.15
186	688313	仕佳光子	5,763	1,064,137.95	0.15
187	601998	中信银行	153,300	1,062,369.00	0.15
188	601881	中国银河	84,400	1,060,908.00	0.15
189	300124	汇川技术	15,900	1,054,647.00	0.15
190	600547	山东黄金	45,284	1,045,607.56	0.15
191	605499	东鹏饮料	8,470	1,045,452.10	0.15
192	600795	国电电力	223,400	1,043,278.00	0.15
193	600015	华夏银行	162,982	1,041,454.98	0.15
194	688271	联影医疗	10,200	1,032,546.00	0.15
195	300548	长芯博创	3,700	1,028,600.00	0.15
196	300498	温氏股份	83,120	1,024,038.40	0.15
197	300751	迈为股份	3,600	1,016,856.00	0.15
198	601669	中国电建	215,200	1,011,440.00	0.14
199	300390	天华新能	10,800	1,009,908.00	0.14
200	600104	上汽集团	102,500	1,000,400.00	0.14
201	002241	歌尔股份	44,400	1,000,332.00	0.14
202	603893	瑞芯微	5,300	998,308.00	0.14
203	002202	金风科技	41,746	997,729.40	0.14
204	002648	卫星化学	42,369	995,247.81	0.14
205	000938	紫光股份	34,338	990,994.68	0.14
206	300316	晶盛机电	16,300	984,520.00	0.14
207	688019	安集科技	2,893	982,057.78	0.14
208	601628	中国人寿	27,779	981,987.65	0.14
209	002050	三花智控	22,400	981,792.00	0.14
210	601179	中国西电	65,600	978,752.00	0.14
211	300015	爱尔眼科	116,997	966,395.22	0.14
212	000807	云铝股份	43,600	965,304.00	0.14
213	000301	东方盛虹	83,300	953,785.00	0.14
214	600026	中远海能	52,800	947,232.00	0.14

215	601838	成都银行	53,500	946,950.00	0.14
216	601991	大唐发电	132,800	940,224.00	0.13
217	002049	紫光国微	10,480	930,100.00	0.13
218	603228	景旺电子	12,822	928,441.02	0.13
219	002185	华天科技	41,500	925,865.00	0.13
220	002311	海大集团	20,700	923,427.00	0.13
221	688506	百利天恒	3,137	922,372.11	0.13
222	688002	睿创微纳	5,900	912,671.00	0.13
223	000895	双汇发展	40,400	904,960.00	0.13
224	601825	沪农商行	120,600	903,294.00	0.13
225	000960	锡业股份	21,000	896,490.00	0.13
226	300395	菲利华	6,700	895,991.00	0.13
227	600958	东方证券	93,052	878,410.88	0.13
228	002027	分众传媒	180,600	874,104.00	0.13
229	688387	信科移动	43,876	870,499.84	0.12
230	600674	川投能源	61,300	868,621.00	0.12
231	600011	华能国际	112,500	853,875.00	0.12
232	002812	恩捷股份	12,700	849,757.00	0.12
233	688036	传音控股	14,354	846,168.30	0.12
234	601231	环旭电子	25,874	838,317.60	0.12
235	601168	西部矿业	30,800	835,912.00	0.12
236	301358	湖南裕能	11,000	834,570.00	0.12
237	600585	海螺水泥	49,100	832,245.00	0.12
238	600436	片仔癀	7,553	825,391.84	0.12
239	301269	华大九天	6,900	823,998.00	0.12
240	300782	卓胜微	7,516	823,603.28	0.12
241	002625	光启技术	27,000	818,640.00	0.12
242	600115	中国东航	213,000	811,530.00	0.12
243	601319	中国人保	119,400	807,144.00	0.12
244	000066	中国长城	42,000	800,100.00	0.11
245	603659	璞泰来	27,512	795,922.16	0.11
246	688047	龙芯中科	5,002	773,659.34	0.11
247	002653	海思科	11,500	762,910.00	0.11
248	601360	三六零	87,789	762,886.41	0.11
249	000426	兴业银锡	23,100	761,376.00	0.11
250	601111	中国国航	125,500	759,275.00	0.11
251	600601	方正科技	54,700	757,048.00	0.11
252	600418	江淮汽车	29,300	756,819.00	0.11
253	002422	科伦药业	19,600	754,992.00	0.11
254	600066	宇通客车	28,000	750,680.00	0.11
255	000831	中国稀土	13,500	749,115.00	0.11
256	600895	张江高科	20,000	745,000.00	0.11
257	000625	长安汽车	103,688	743,442.96	0.11
258	601901	方正证券	103,200	743,040.00	0.11

259	002736	国信证券	73,700	736,263.00	0.11
260	600221	海航控股	542,100	731,835.00	0.10
261	001979	招商蛇口	113,500	729,805.00	0.10
262	002414	高德红外	54,703	725,361.78	0.10
263	600029	南方航空	139,900	724,682.00	0.10
264	600096	云天化	23,800	723,520.00	0.10
265	002304	洋河股份	18,944	722,713.60	0.10
266	300866	安克创新	6,810	711,645.00	0.10
267	601916	浙商银行	269,680	709,258.40	0.10
268	600415	小商品城	69,400	705,104.00	0.10
269	601788	光大证券	48,740	703,318.20	0.10
270	002595	豪迈科技	15,065	702,029.00	0.10
271	300803	指南针	7,600	696,692.00	0.10
272	600048	保利发展	149,800	693,574.00	0.10
273	000783	长江证券	70,800	690,300.00	0.10
274	600438	通威股份	56,800	687,848.00	0.10
275	002236	大华股份	41,600	685,984.00	0.10
276	601877	正泰电器	27,300	684,411.00	0.10
277	600233	圆通速递	43,000	677,250.00	0.10
278	002850	科达利	3,559	673,718.70	0.10
279	002128	电投能源	29,100	672,792.00	0.10
280	601077	渝农商行	109,500	669,045.00	0.10
281	600580	卧龙电驱	20,200	668,620.00	0.10
282	002558	巨人网络	23,800	655,928.00	0.09
283	000617	中油资本	98,800	651,092.00	0.09
284	601377	兴业证券	107,730	650,689.20	0.09
285	002920	德赛西威	7,900	643,850.00	0.09
286	002074	国轩高科	23,300	640,983.00	0.09
287	600039	四川路桥	81,440	636,860.80	0.09
288	600023	浙能电力	121,000	636,460.00	0.09
289	600426	华鲁恒升	26,586	635,937.12	0.09
290	300418	昆仑万维	15,600	629,616.00	0.09
291	002129	TCL 中环	52,375	629,547.50	0.09
292	688578	艾力斯	5,751	628,009.20	0.09
293	688187	时代电气	9,120	626,179.20	0.09
294	300058	蓝色光标	45,400	624,704.00	0.09
295	002532	天山铝业	58,200	624,486.00	0.09
296	688027	国盾量子	1,237	623,460.37	0.09
297	000157	中联重科	88,900	619,633.00	0.09
298	000933	神火股份	29,200	619,040.00	0.09
299	600741	华域汽车	39,800	617,696.00	0.09
300	000963	华东医药	21,840	614,140.80	0.09
301	688223	晶科能源	128,793	611,766.75	0.09
302	600196	复星医药	26,900	604,443.00	0.09

303	002064	华峰化学	63,500	602,615.00	0.09
304	688331	荣昌生物	4,560	593,985.60	0.09
305	001203	大中矿业	19,700	590,015.00	0.08
306	001965	招商公路	64,100	587,156.00	0.08
307	002379	宏桥控股	39,700	586,369.00	0.08
308	000975	山金国际	34,340	583,780.00	0.08
309	601456	国联民生	64,900	573,716.00	0.08
310	600219	南山铝业	143,700	573,363.00	0.08
311	601021	春秋航空	12,400	565,192.00	0.08
312	601198	东兴证券	41,400	562,626.00	0.08
313	603806	福斯特	33,471	561,978.09	0.08
314	603260	合盛硅业	11,600	559,816.00	0.08
315	688375	国博电子	5,354	558,422.20	0.08
316	601117	中国化学	75,700	556,395.00	0.08
317	301236	软通动力	13,050	553,972.50	0.08
318	688188	柏楚电子	5,191	553,879.70	0.08
319	600027	华电国际	124,300	553,135.00	0.08
320	601699	潞安环能	38,700	552,636.00	0.08
321	600988	赤峰黄金	20,900	550,088.00	0.08
322	000559	万向钱潮	42,500	549,525.00	0.08
323	688099	晶晨股份	5,329	548,354.10	0.08
324	600642	申能股份	62,800	548,244.00	0.08
325	601878	浙商证券	57,600	547,200.00	0.08
326	601618	中国中冶	223,600	545,584.00	0.08
327	300759	康龙化成	18,850	545,330.50	0.08
328	600021	上海电力	36,100	544,027.00	0.08
329	002555	三七互娱	28,700	541,569.00	0.08
330	300628	亿联网络	15,960	539,767.20	0.08
331	601607	上海医药	35,000	539,000.00	0.08
332	002738	中矿资源	9,100	536,809.00	0.08
333	300919	中伟新材	12,120	530,250.00	0.08
334	300454	深信服	5,493	528,426.60	0.08
335	000688	国城矿业	15,400	527,142.00	0.08
336	600061	国投资本	79,908	523,397.40	0.07
337	688122	西部超导	8,283	520,255.23	0.07
338	600143	金发科技	33,400	516,030.00	0.07
339	601108	财通证券	59,150	511,647.50	0.07
340	600352	浙江龙盛	41,500	502,565.00	0.07
341	002601	龙佰集团	30,300	499,344.00	0.07
342	601555	东吴证券	62,959	498,635.28	0.07
343	600570	恒生电子	23,487	497,689.53	0.07
344	002487	大金重工	8,500	492,745.00	0.07
345	688472	阿特斯	45,520	492,526.40	0.07
346	600918	中泰证券	91,495	486,753.40	0.07

347	301666	大普微	1,046	484,643.18	0.07
348	601216	君正集团	108,100	482,126.00	0.07
349	600803	新奥股份	30,500	481,900.00	0.07
350	300115	长盈精密	17,200	480,568.00	0.07
351	601777	千里科技	58,400	476,544.00	0.07
352	601058	赛轮轮胎	40,900	471,577.00	0.07
353	000999	华润三九	20,887	469,748.63	0.07
354	002195	岩山科技	71,400	466,956.00	0.07
355	600600	青岛啤酒	8,927	466,257.21	0.07
356	002294	信立泰	14,500	462,405.00	0.07
357	600845	宝信软件	27,333	454,547.79	0.07
358	300207	欣旺达	23,900	453,861.00	0.07
359	300748	金力永磁	14,600	450,410.00	0.06
360	601696	中银证券	35,500	449,075.00	0.06
361	601577	长沙银行	51,300	446,823.00	0.06
362	002078	太阳纸业	35,700	445,893.00	0.06
363	600157	永泰能源	276,000	444,360.00	0.06
364	601212	白银有色	87,100	442,468.00	0.06
365	603606	东方电缆	10,640	441,666.40	0.06
366	002517	恺英网络	27,100	440,375.00	0.06
367	688303	大全能源	25,256	440,212.08	0.06
368	600711	盛屯矿业	39,400	432,218.00	0.06
369	002939	长城证券	51,800	432,012.00	0.06
370	601162	天风证券	127,600	430,012.00	0.06
371	688568	中科星图	10,352	429,297.44	0.06
372	000708	中信特钢	34,000	429,080.00	0.06
373	002340	格林美	64,200	424,362.00	0.06
374	688599	天合光能	29,733	419,829.96	0.06
375	000983	山西焦煤	72,340	419,572.00	0.06
376	000728	国元证券	55,900	418,691.00	0.06
377	300832	新产业	9,900	415,800.00	0.06
378	600839	四川长虹	59,400	414,612.00	0.06
379	300765	石药创新	15,160	412,806.80	0.06
380	603568	伟明环保	26,519	407,862.22	0.06
381	000596	古井贡酒	5,100	406,980.00	0.06
382	002131	利欧股份	85,400	405,650.00	0.06
383	600298	安琪酵母	11,200	405,440.00	0.06
384	300251	光线传媒	36,500	404,785.00	0.06
385	002465	海格通信	31,500	402,255.00	0.06
386	600515	海南机场	143,400	392,916.00	0.06
387	600085	同仁堂	17,000	392,870.00	0.06
388	002966	苏州银行	56,400	392,544.00	0.06
389	600733	北汽蓝谷	80,600	392,522.00	0.06
390	000786	北新建材	21,600	390,744.00	0.06

391	600588	用友网络	42,422	389,433.96	0.06
392	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.06
393	603486	科沃斯	7,500	380,625.00	0.05
394	002252	上海莱士	84,500	366,730.00	0.05
395	000876	新希望	58,100	364,287.00	0.05
396	000002	万科 A	119,600	354,016.00	0.05
397	600009	上海机场	15,300	353,430.00	0.05
398	300122	智飞生物	29,950	350,115.50	0.05
399	300413	芒果超媒	23,910	349,803.30	0.05
400	002459	晶澳科技	42,816	346,809.60	0.05
401	000661	长春高新	5,200	346,320.00	0.05
402	600536	中国软件	12,090	339,970.80	0.05
403	601799	星宇股份	3,700	335,294.00	0.05
404	601933	永辉超市	117,700	334,268.00	0.05
405	300896	爱美客	3,800	331,360.00	0.05
406	001248	华润新能源	31,959	323,105.49	0.05
407	688617	惠泰医疗	1,726	313,372.56	0.04
408	603392	万泰生物	11,550	311,503.50	0.04
409	601238	广汽集团	60,900	309,372.00	0.04
410	000564	供销大集	232,300	308,959.00	0.04
411	000932	华菱钢铁	87,300	302,931.00	0.04
412	300255	常山药业	12,000	281,040.00	0.04
413	601567	三星电气	17,800	265,932.00	0.04
414	688781	视涯科技	6,155	259,494.80	0.04
415	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
416	300347	泰格医药	4,750	228,000.00	0.03
417	688820	盛合晶微	1,008	142,621.92	0.02
418	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
419	001399	惠科股份	3,737	103,627.01	0.01
420	301682	宏明电子	622	99,557.32	0.01
421	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
422	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
423	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
424	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
425	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
426	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
427	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
428	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
429	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
430	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
431	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
432	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
433	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
434	001393	维通利	387	15,089.13	0.00

435	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
436	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
437	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
438	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
439	601112	振石股份	649	11,415.91	0.00
440	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
441	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
442	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
443	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
444	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
445	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
446	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
447	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
448	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
449	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
450	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	36,623,700.06	5.49
2	300308	中际旭创	21,418,265.00	3.21
3	002371	北方华创	13,790,326.24	2.07
4	300502	新易盛	12,675,253.00	1.90
5	002594	比亚迪	9,411,074.38	1.41
6	002475	立讯精密	8,554,943.00	1.28
7	300394	天孚通信	7,921,793.00	1.19
8	002916	深南电路	7,798,493.00	1.17
9	300476	胜宏科技	7,569,370.44	1.14
10	300274	阳光电源	7,039,716.00	1.06
11	002384	东山精密	6,885,728.00	1.03
12	300014	亿纬锂能	6,588,136.50	0.99
13	300033	同花顺	6,466,586.58	0.97
14	000858	五粮液	6,094,167.50	0.91
15	300059	东方财富	5,918,473.00	0.89
16	688019	安集科技	5,645,869.87	0.85
17	000333	美的集团	5,602,115.40	0.84
18	002463	沪电股份	4,942,097.00	0.74
19	300857	协创数据	4,596,649.80	0.69
20	000657	中钨高新	4,443,626.00	0.67

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	38,013,021.00	5.70
2	300308	中际旭创	21,411,838.00	3.21
3	002371	北方华创	13,543,693.00	2.03
4	300502	新易盛	13,020,928.00	1.95
5	002594	比亚迪	9,826,662.95	1.47
6	002475	立讯精密	8,944,040.00	1.34
7	300394	天孚通信	8,097,543.13	1.21
8	002916	深南电路	7,685,443.00	1.15
9	300476	胜宏科技	7,566,468.00	1.14
10	300274	阳光电源	7,103,562.00	1.07
11	000858	五粮液	6,771,716.00	1.02
12	002384	东山精密	6,734,371.00	1.01
13	300014	亿纬锂能	6,619,120.19	0.99
14	300033	同花顺	6,510,729.30	0.98
15	300059	东方财富	6,457,603.00	0.97
16	000333	美的集团	6,000,763.30	0.90
17	688019	安集科技	5,052,306.09	0.76
18	002463	沪电股份	4,916,674.00	0.74
19	300857	协创数据	4,736,063.12	0.71
20	002714	牧原股份	4,435,510.00	0.67

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	495,498,794.06
卖出股票收入（成交）总额	495,452,313.23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,019,447.93
2	应收清算款	11,047,592.79
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,067,040.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司 —易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式 指数证券投资基金发起 式联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,180	150,271.70	240,689,938.00	73.47%	86,902,378.00	26.53%	37,425,210.00	11.42%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 5 月 17 日）基金份额总额	1,743,592,316.00
本报告期期初基金份额总额	345,592,316.00
本报告期基金总申购份额	436,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	454,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	327,592,316.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
北京证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	8,866,439.50	0.91%	886.77	0.91%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	1	85,356,804.69	8.76%	8,535.83	8.76%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	117,013,587.12	12.01%	11,701.40	12.01%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	763,406,452.15	78.33%	76,346.29	78.33%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为国新证券股份有限公司，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。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 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 基金租用或者通过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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	4,711,785.29	38.23%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	7,612,745.69	61.77%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
----	------	--------	-------

			期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-01-22
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加金融街证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
4	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报	2026-03-31
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配中国神华（601088）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-02
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-04-22
8	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日