

**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
2019 年半年度报告
2019 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：二〇一九年八月二十四日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末上市基金前十名持有人	46
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
9	开放式基金份额变动	47
10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	51
11	影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

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
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	747,592,316.00 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。
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	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896

负责人	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
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）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	刘连舸

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	95,912,722.03
本期利润	234,218,508.90
加权平均基金份额本期利润	0.2705
本期加权平均净值利润率	27.69%
本期基金份额净值增长率	26.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	39,406,362.55
期末可供分配基金份额利润	0.0527
期末基金资产净值	786,998,678.55
期末基金份额净值	1.0527
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)

基金份额累计净值增长率	5.27%
-------------	-------

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

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

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

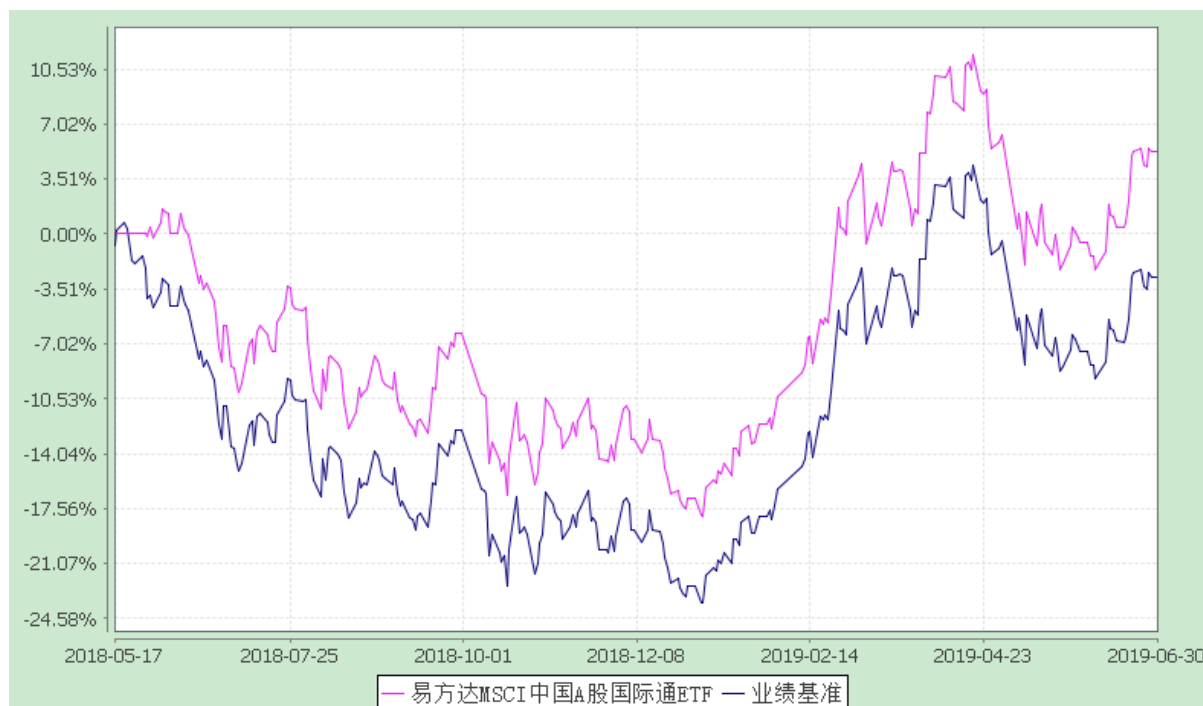
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.86%	1.13%	5.11%	1.13%	0.75%	0.00%
过去三个月	0.10%	1.47%	-1.25%	1.48%	1.35%	-0.01%
过去六个月	26.72%	1.50%	25.50%	1.51%	1.22%	-0.01%
过去一年	11.81%	1.48%	9.19%	1.51%	2.62%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.27%	1.43%	-2.79%	1.47%	8.06%	-0.04%

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 2019 年 6 月 30 日）



注：1.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十四部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为 5.27%,同期业绩比较基准收益率为 -2.79%。

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,易方达基金管理有限公司(简称“易方达”)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。易方达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。易方达拥有公募、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,是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一,在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产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		
成曦	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)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、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、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的基金经理	2018-05-17	-	11 年	硕士研究生，曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。
FAN BIN G(范冰)	本基金的基金经理、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、易方达原油证券投资基金(QDII)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、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)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	2018-05-17	-	14 年	新加坡籍，硕士研究生，曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团 Middle Office 中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。

<p>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、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、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的基金经理</p>				
--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的

单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 62 次，其中 61 次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；1 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数。该指数代表被纳入 MSCI 全球指数体系的 A 股。一旦个股进入该指数，全球跟踪 MSCI 全球指数体系的资金都将对其进行配置。该指数现阶段主要组成为纳入互联互通范围的大盘股。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而进行相应调整。

2019 年上半年，A 股市场先扬后抑。一季度市场情绪亢奋，一路上扬。五月及六月，受投资者获利回吐及中美贸易摩擦影响，市场风险偏好明显下降，股票市场经历了一波调整。在此过程中，市场资金的博弈性上升，对短期波动更为敏感。随着 G20 会议 6 月底在日本大阪召开，中美贸易摩擦得到缓解，市场有所企稳回升。

报告期内，国内经济增速逐步走稳，货币和财政政策持续宽松，MSCI 扩大了 A 股纳入比例，外资持续流入。此外，财政政策中降费减税的效果也开始逐渐体现，使得国内股市的中长期预期在发生转变。

市场普遍预期科创板将在 2019 年第三季度开市交易，该板块的推出将进一步提升市场对高新技术类公司的偏好，尤其是能够体现国内自主发展、自主可控的科技产业将更受资本关注。

在上述背景下，预计股票市场有可能将继续体现两类投资偏好：一种是行业竞争格局清晰、市场占比高、业绩稳定增长的龙头公司；另一种是受政策和资本青睐、具备核心技术、行业处于扩张期的成长类公司。

此外，MSCI 指数公司在 2019 年 2 月底宣布：将 A 股在 MSCI 指数中的权重因子从 5% 提升至 20%。计划分三个阶段进行：2019 年 5 月，8 月，11 月进行调整。在 5 月底，已经完成从 5% 到 10% 的权重因子调整，并且纳入少量创业板股票。上述方案的实现，将带来更多海外资金配置该指数对应的成份股。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0527 元，本报告期份额净值增长率为 26.72%，同期业绩比较基准收益率为 25.50%。

本报告期，本基金日跟踪偏离度的均值为 0.02%，年化跟踪误差 0.52%，剔除建仓期后，年化跟踪误差 0.94%，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 2019 年下半年，中美贸易谈判虽然峰回路转，从谈判破裂到重启谈判，但摩擦更多的被市场定位为长期冲击，预计市场仍将随冲击而震荡。国内经济中，房地产开发投资仍在放缓，汽车销量仍处下滑趋势中，但是国内消费表现出较强的动力，对经济拉动作用明显。整体来看，在去年下半年开始持续宽松流动性的支持下，经济逐步止住了自 2018 年三、四季度以来的下滑趋势，呈现稳中有升的态势。

在证券市场，预计市场风格将两极分化，一方面“核心资产”的概念将继续被追捧，大资金越来越向核心蓝筹集中；另一方面，伴随着科创板的三季度上市，成长股的风险偏好将有所提升。

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，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总部和核算部指定人员担任委员。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任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	10,949,069.77	22,358,614.13
结算备付金		1,353,738.39	711,362.76
存出保证金		158,574.69	661,137.83
交易性金融资产	6.4.7.2	775,613,292.53	938,805,976.15
其中：股票投资		775,613,292.53	938,632,976.91
基金投资		-	-
债券投资		-	172,999.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		240,593.42	5,384,743.07
应收利息	6.4.7.5	2,528.35	4,917.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		788,317,797.15	967,926,751.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,971,540.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		97,479.13	406,780.36
应付托管费		32,493.05	81,356.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	277,026.45	205,681.73
应交税费		-	0.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	912,119.97	1,625,683.79
负债合计		1,319,118.60	6,291,043.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	747,592,316.00	1,157,592,316.00
未分配利润	6.4.7.10	39,406,362.55	-195,956,607.73
所有者权益合计		786,998,678.55	961,635,708.27
负债和所有者权益总计		788,317,797.15	967,926,751.48

注：1.本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，2018 年度实际报告期间为 2018 年 5 月 17 日至

2018 年 12 月 31 日。

2. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0527 元，基金份额总额 747,592,316.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 5 月 17 日（基 金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		237,505,570.53	-54,765,102.70
1. 利息收入		42,866.00	762,617.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,808.41	762,617.78
债券利息收入		57.59	-
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）		98,062,690.45	8,394,566.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	89,917,229.44	510,688.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	44,852.89	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,100,608.12	7,883,877.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	138,305,786.87	-64,422,105.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,094,227.21	499,819.09
减：二、费用		3,287,061.63	3,167,909.39
1. 管理人报酬		1,591,222.22	807,647.55
2. 托管费		347,867.70	161,529.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,006,087.81	2,058,598.26
5. 利息支出	6.4.7.18	-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.19	-
7. 其他费用	6.4.7.19	341,883.71	140,134.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		234,218,508.90	-57,933,012.09

列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		234,218,508.90	-57,933,012.09

注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，上年度可比期间为 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,157,592,316.00	-195,956,607.73	961,635,708.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	234,218,508.90	234,218,508.90
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）	-410,000,000.00	1,144,461.38	-408,855,538.62
其中：1.基金申购款	946,000,000.00	3,206,085.85	949,206,085.85
2.基金赎回款	-1,356,000,000.00	-2,061,624.47	-1,358,061,624.47
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）	747,592,316.00	39,406,362.55	786,998,678.55
项目	上年度可比期间 2018 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,743,592,316.00	-	1,743,592,316.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-57,933,012.09	-57,933,012.09
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）	-668,000,000.00	-4,946,292.35	-672,946,292.35
其中：1.基金申购款	152,000,000.00	-4,058,740.54	147,941,259.46

2.基金赎回款	-820,000,000.00	-887,551.81	-820,887,551.81
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）	1,075,592,316.00	-62,879,304.44	1,012,713,011.56

注：本基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日，上年度可比期间为 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达 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<年度报告和半年度报告>》、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 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》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	10,949,069.77
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	10,949,069.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	731,971,142.69	775,613,292.53	43,642,149.84
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	731,971,142.69	775,613,292.53	43,642,149.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,915.90
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	548.28
应收债券利息	-
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	-
其他	64.17
合计	2,528.35

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	277,026.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	277,026.45

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	176,206.31
应付替代款	184,515.64
可退替代款	9,267.00

其他应付款	542,131.02
合计	912,119.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,157,592,316.00	1,157,592,316.00
本期申购	946,000,000.00	946,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,356,000,000.00	-1,356,000,000.00
本期末	747,592,316.00	747,592,316.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-80,725,362.37	-115,231,245.36	-195,956,607.73
本期利润	95,912,722.03	138,305,786.87	234,218,508.90
本期基金份额交易产生的变动数	27,033,738.97	-25,889,277.59	1,144,461.38
其中：基金申购款	-2,546,276.98	5,752,362.83	3,206,085.85
基金赎回款	29,580,015.95	-31,641,640.42	-2,061,624.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,221,098.63	-2,814,736.08	39,406,362.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	36,231.26
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	5,358.05
其他	1,219.10
合计	42,808.41

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	27,424,016.24
股票投资收益——赎回差价收入	62,493,213.20
股票投资收益——申购差价收入	-

合计	89,917,229.44
----	---------------

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	444,752,663.71
减：卖出股票成本总额	417,328,647.47
买卖股票差价收入	27,424,016.24

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,358,061,624.47
减：现金支付赎回款总额	379,245,602.47
减：赎回股票成本总额	916,322,808.80
赎回差价收入	62,493,213.20

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	217,921.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	172,999.24
减：应收利息总额	69.77
买卖债券差价收入	44,852.89

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,100,608.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,100,608.12

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	138,305,786.87
——股票投资	138,305,786.87
——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	138,305,786.87

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	1,094,227.21
基金申购费收入	-
其他	-
合计	1,094,227.21

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)被替代股票的实际买入成本(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股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	1,006,087.81
银行间市场交易费用	-
合计	1,006,087.81

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78

信息披露费	58,700.75
银行汇划费	12,714.46
上市费	29,752.78
指数使用费	210,962.94
其他	-
合计	341,883.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申赎代办券商
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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年1月1日至2019年6月 30日	2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,591,222.22	807,647.55
其中：支付销售机构的客户维护费	27,113.68	7,798.87

注：1.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。

2.自 2019 年 4 月 22 日起，本基金的基金管理费由“按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提”调整为本基金的基金管理费“按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提”。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同 生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	347,867.70	161,529.49

注：1.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。

2.自 2019 年 4 月 22 日起，本基金的基金托管费由“按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提”调整为本基金的基金托管费“按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提”。

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
广发证券	15,905,361.00	2.13%	7,435,600.00	0.64%
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	206,987,660.00	27.69%	-	-

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。

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年5月17日（基金合同生效日）至2018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	10,949,069.77	36,231.26	41,003,161.87	575,676.81

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票中国银行。

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（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 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。

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 2019 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 2019 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。

6.4.13 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、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2018 年 12 月 31 日：0.02%)。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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 2019年6月30日	上年度末 2018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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	173,009.86
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	173,009.86

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行

管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,949,069.77	-	-	-	10,949,069.77
结算备付金	1,353,738.39	-	-	-	1,353,738.39
存出保证金	158,574.69	-	-	-	158,574.69
交易性金融资产	-	-	-	775,613,292.53	775,613,292.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	240,593.42	240,593.42
应收利息	-	-	-	2,528.35	2,528.35
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,461,382.85	-	-	775,856,414.30	788,317,797.15
负债					

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	97,479.13	97,479.13
应付托管费	-	-	-	32,493.05	32,493.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	277,026.45	277,026.45
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	912,119.97	912,119.97
负债总计	-	-	-	1,319,118.60	1,319,118.60
利率敏感度缺口	12,461,382.85	-	-	774,537,295.70	786,998,678.55
上年度末 2018 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	22,358,614.13	-	-	-	22,358,614.13
结算备付金	711,362.76	-	-	-	711,362.76
存出保证金	661,137.83	-	-	-	661,137.83
交易性金融资产	-	-	172,999.24	938,632,976.91	938,805,976.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,384,743.07	5,384,743.07
应收利息	-	-	-	4,917.54	4,917.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,731,114.72	-	172,999.24	944,022,637.52	967,926,751.4

					8
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	-	-	-	3,971,540.95	3,971,540.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	406,780.36	406,780.36
应付托管费	-	-	-	81,356.08	81,356.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	205,681.73	205,681.73
应交税费	-	-	-	0.30	0.30
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,625,683.79	1,625,683.79
负债总计	-	-	-	6,291,043.21	6,291,043.21
利率敏感度缺口	23,731,114.72	-	172,999.24	937,731,594.31	961,635,708.2 7

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	775,613,292.53	98.55	938,632,976.91	97.61
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	775,613,292.53	98.55	938,632,976.91	97.61

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	38,738,344.54	46,940,314.65
	2.业绩比较基准下降 5%	-38,738,344.54	-46,940,314.65

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 775,613,292.53 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2018 年 12

月 31 日：第一层次 929,276,824.15 元，第二层次 9,529,152.00 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

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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	775,613,292.53	98.39
	其中：股票	775,613,292.53	98.39
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	12,302,808.16	1.56
8	其他各项资产	401,696.46	0.05
9	合计	788,317,797.15	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不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	10,225,029.00	1.30
B	采矿业	29,168,460.08	3.71
C	制造业	303,808,928.16	38.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,157,823.90	2.82
E	建筑业	22,713,624.32	2.89
F	批发和零售业	14,525,471.96	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	21,460,702.00	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,284,821.83	4.10
J	金融业	256,434,506.89	32.58
K	房地产业	39,157,656.49	4.98
L	租赁和商务服务业	11,033,799.70	1.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	634,302.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,392,504.92	0.81
R	文化、体育和娱乐业	4,720,943.00	0.60
S	综合	895,297.28	0.11

	合计	775,613,871.53	98.55
--	----	----------------	-------

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	47,300	46,543,200.00	5.91
2	601318	中国平安	401,100	35,541,471.00	4.52
3	600036	招商银行	765,400	27,539,092.00	3.50
4	000858	五粮液	143,700	16,949,415.00	2.15
5	601166	兴业银行	769,333	14,071,100.57	1.79
6	600000	浦发银行	1,086,670	12,692,305.60	1.61
7	601398	工商银行	1,997,500	11,765,275.00	1.49
8	600276	恒瑞医药	164,618	10,864,788.00	1.38
9	000002	万科 A	360,000	10,011,600.00	1.27
10	601288	农业银行	2,760,500	9,937,800.00	1.26
11	600900	长江电力	543,021	9,720,075.90	1.24
12	002415	海康威视	346,600	9,559,228.00	1.21
13	601668	中国建筑	1,550,880	8,917,560.00	1.13
14	601328	交通银行	1,453,449	8,895,107.88	1.13
15	603288	海天味业	83,910	8,810,550.00	1.12
16	000001	平安银行	636,200	8,766,836.00	1.11
17	600030	中信证券	364,300	8,673,983.00	1.10
18	601601	中国太保	233,400	8,521,434.00	1.08
19	600016	民生银行	1,323,280	8,402,828.00	1.07
20	600887	伊利股份	225,278	7,526,537.98	0.96
21	600104	上汽集团	288,900	7,366,950.00	0.94
22	601766	中国中车	901,500	7,293,135.00	0.93
23	600050	中国联通	1,149,300	7,079,688.00	0.90
24	300498	温氏股份	197,100	7,068,006.00	0.90
25	002304	洋河股份	55,844	6,788,396.64	0.86
26	000333	美的集团	128,400	6,658,824.00	0.85
27	601888	中国国旅	72,358	6,414,536.70	0.82
28	600585	海螺水泥	148,200	6,150,300.00	0.78
29	000651	格力电器	111,500	6,132,500.00	0.78
30	600048	保利地产	440,500	5,620,780.00	0.71
31	601818	光大银行	1,474,400	5,617,464.00	0.71
32	601688	华泰证券	241,600	5,392,512.00	0.69
33	601988	中国银行	1,426,600	5,335,484.00	0.68
34	600028	中国石化	940,800	5,146,176.00	0.65

35	601211	国泰君安	278,000	5,101,300.00	0.65
36	001979	招商蛇口	243,700	5,093,330.00	0.65
37	601229	上海银行	404,704	4,795,742.40	0.61
38	601989	中国重工	853,000	4,742,680.00	0.60
39	002142	宁波银行	193,200	4,683,168.00	0.60
40	601169	北京银行	783,300	4,629,303.00	0.59
41	600019	宝钢股份	687,200	4,466,800.00	0.57
42	601006	大秦铁路	550,600	4,454,354.00	0.57
43	000568	泸州老窖	55,100	4,453,733.00	0.57
44	000725	京东方 A	1,254,100	4,314,104.00	0.55
45	601336	新华保险	77,400	4,259,322.00	0.54
46	600837	海通证券	299,900	4,255,581.00	0.54
47	601186	中国铁建	425,660	4,235,317.00	0.54
48	000063	中兴通讯	128,000	4,163,840.00	0.53
49	601857	中国石油	600,051	4,128,350.88	0.52
50	002024	苏宁易购	345,200	3,962,896.00	0.50
51	600690	青岛海尔	226,000	3,907,540.00	0.50
52	002475	立讯精密	152,600	3,782,954.00	0.48
53	600031	三一重工	288,800	3,777,504.00	0.48
54	600015	华夏银行	474,782	3,655,821.40	0.46
55	600340	华夏幸福	111,340	3,626,343.80	0.46
56	600999	招商证券	211,936	3,621,986.24	0.46
57	601933	永辉超市	354,100	3,615,361.00	0.46
58	300015	爱尔眼科	114,860	3,557,214.20	0.45
59	000166	申万宏源	695,400	3,483,954.00	0.44
60	002594	比亚迪	67,100	3,403,312.00	0.43
61	601155	新城控股	84,130	3,349,215.30	0.43
62	601088	中国神华	163,700	3,336,206.00	0.42
63	300059	东方财富	241,000	3,265,550.00	0.41
64	000538	云南白药	39,000	3,253,380.00	0.41
65	600406	国电南瑞	169,400	3,157,616.00	0.40
66	002714	牧原股份	53,700	3,157,023.00	0.40
67	601012	隆基股份	134,488	3,108,017.68	0.39
68	600919	江苏银行	427,243	3,101,784.18	0.39
69	600009	上海机场	35,700	2,990,946.00	0.38
70	601628	中国人寿	102,679	2,907,869.28	0.37
71	002027	分众传媒	543,400	2,874,586.00	0.37
72	601225	陕西煤业	309,300	2,857,932.00	0.36
73	600010	包钢股份	1,688,100	2,852,889.00	0.36
74	600547	山东黄金	68,700	2,828,379.00	0.36
75	000338	潍柴动力	221,900	2,727,151.00	0.35
76	000876	新希望	156,500	2,718,405.00	0.35
77	601985	中国核电	479,200	2,664,352.00	0.34
78	601939	建设银行	355,000	2,641,200.00	0.34

79	600436	片仔癀	22,547	2,597,414.40	0.33
80	601009	南京银行	314,300	2,596,118.00	0.33
81	603993	洛阳钼业	654,100	2,590,236.00	0.33
82	002230	科大讯飞	77,700	2,582,748.00	0.33
83	000895	双汇发展	101,800	2,533,802.00	0.32
84	600741	华域汽车	117,300	2,533,680.00	0.32
85	600588	用友网络	92,640	2,490,163.20	0.32
86	601669	中国电建	470,700	2,490,003.00	0.32
87	300760	迈瑞医疗	15,077	2,460,566.40	0.31
88	600029	南方航空	318,300	2,457,276.00	0.31
89	601899	紫金矿业	641,100	2,416,947.00	0.31
90	000776	广发证券	174,700	2,400,378.00	0.31
91	600958	东方证券	221,000	2,360,280.00	0.30
92	600115	东方航空	363,200	2,277,264.00	0.29
93	601901	方正证券	312,400	2,221,164.00	0.28
94	600809	山西汾酒	32,100	2,216,505.00	0.28
95	600332	白云山	53,000	2,171,410.00	0.28
96	300122	智飞生物	49,900	2,150,690.00	0.27
97	600018	上港集团	314,900	2,147,618.00	0.27
98	000069	华侨城 A	304,100	2,113,495.00	0.27
99	600570	恒生电子	30,200	2,058,130.00	0.26
100	600606	绿地控股	300,700	2,053,781.00	0.26
101	600438	通威股份	144,500	2,031,670.00	0.26
102	601618	中国中冶	659,400	2,004,576.00	0.25
103	002736	国信证券	152,000	2,000,320.00	0.25
104	600383	金地集团	166,823	1,990,198.39	0.25
105	300033	同花顺	19,900	1,957,364.00	0.25
106	600886	国投电力	251,200	1,951,824.00	0.25
107	600352	浙江龙盛	121,000	1,908,170.00	0.24
108	600893	航发动力	83,836	1,903,915.56	0.24
109	601600	中国铝业	483,300	1,894,536.00	0.24
110	600196	复星医药	74,600	1,887,380.00	0.24
111	300750	宁德时代	27,100	1,866,648.00	0.24
112	601877	正泰电器	80,000	1,847,200.00	0.23
113	600795	国电电力	725,600	1,843,024.00	0.23
114	600061	国投资本	130,100	1,822,701.00	0.23
115	603833	欧派家居	16,774	1,805,217.88	0.23
116	600705	中航资本	332,500	1,802,150.00	0.23
117	601138	工业富联	145,900	1,758,095.00	0.22
118	600111	北方稀土	134,300	1,724,412.00	0.22
119	600703	三安光电	151,200	1,705,536.00	0.22
120	600660	福耀玻璃	74,235	1,687,361.55	0.21
121	000963	华东医药	64,740	1,680,650.40	0.21
122	000100	TCL 集团	501,600	1,670,328.00	0.21

123	601377	兴业证券	247,800	1,670,172.00	0.21
124	601788	光大证券	144,700	1,652,474.00	0.21
125	000768	中航飞机	102,500	1,614,375.00	0.21
126	300142	沃森生物	56,900	1,613,684.00	0.21
127	002236	大华股份	111,100	1,613,172.00	0.20
128	002422	科伦药业	54,100	1,608,393.00	0.20
129	002202	金风科技	128,846	1,601,555.78	0.20
130	000783	长江证券	204,600	1,597,926.00	0.20
131	600271	航天信息	68,900	1,588,145.00	0.20
132	600926	杭州银行	190,260	1,584,865.80	0.20
133	601727	上海电气	291,700	1,569,346.00	0.20
134	601021	春秋航空	33,900	1,525,500.00	0.19
135	300003	乐普医疗	66,000	1,519,320.00	0.19
136	002146	荣盛发展	161,600	1,517,424.00	0.19
137	600482	中国动力	63,400	1,497,508.00	0.19
138	002352	顺丰控股	44,000	1,494,240.00	0.19
139	600085	同仁堂	51,500	1,493,500.00	0.19
140	600674	川投能源	163,800	1,457,820.00	0.19
141	601108	财通证券	132,600	1,455,948.00	0.19
142	002044	美年健康	115,738	1,439,780.72	0.18
143	000703	恒逸石化	105,200	1,437,032.00	0.18
144	000157	中联重科	238,400	1,432,784.00	0.18
145	601111	中国国航	149,700	1,432,629.00	0.18
146	300124	汇川技术	61,500	1,408,965.00	0.18
147	300347	泰格医药	18,100	1,395,510.00	0.18
148	600346	恒力石化	114,100	1,387,456.00	0.18
149	600297	广汇汽车	303,504	1,353,627.84	0.17
150	600637	东方明珠	127,980	1,348,909.20	0.17
151	600489	中金黄金	128,685	1,321,594.95	0.17
152	002493	荣盛石化	108,700	1,310,922.00	0.17
153	002673	西部证券	129,600	1,306,368.00	0.17
154	601607	上海医药	71,300	1,294,095.00	0.16
155	000425	徐工机械	290,100	1,293,846.00	0.16
156	600600	青岛啤酒	25,800	1,288,194.00	0.16
157	300144	宋城演艺	54,500	1,261,130.00	0.16
158	300408	三环集团	64,500	1,254,525.00	0.16
159	601998	中信银行	210,000	1,253,700.00	0.16
160	300601	康泰生物	23,800	1,249,500.00	0.16
161	600362	江西铜业	77,000	1,211,980.00	0.15
162	601198	东兴证券	102,000	1,211,760.00	0.15
163	601919	中远海控	239,800	1,203,796.00	0.15
164	600487	亨通光电	71,720	1,202,027.20	0.15
165	000656	金科股份	198,300	1,195,749.00	0.15
166	002153	石基信息	32,900	1,190,651.00	0.15

167	601838	成都银行	133,500	1,178,805.00	0.15
168	000709	河钢股份	393,000	1,175,070.00	0.15
169	600688	上海石化	225,800	1,165,128.00	0.15
170	601992	金隅集团	309,500	1,163,720.00	0.15
171	600867	通化东宝	75,400	1,161,160.00	0.15
172	000728	国元证券	125,300	1,149,001.00	0.15
173	601800	中国交建	101,300	1,146,716.00	0.15
174	601555	东吴证券	111,200	1,139,800.00	0.14
175	600516	方大炭素	92,032	1,131,073.28	0.14
176	601117	中国化学	182,700	1,099,854.00	0.14
177	600011	华能国际	176,400	1,098,972.00	0.14
178	300450	先导智能	32,700	1,098,720.00	0.14
179	600109	国金证券	112,100	1,089,612.00	0.14
180	601360	三六零	50,800	1,086,104.00	0.14
181	600875	东方电气	101,700	1,080,054.00	0.14
182	002466	天齐锂业	42,600	1,076,928.00	0.14
183	600066	宇通客车	82,401	1,072,861.02	0.14
184	002241	歌尔股份	120,600	1,072,134.00	0.14
185	002555	三七互娱	78,900	1,069,095.00	0.14
186	000999	华润三九	36,300	1,065,042.00	0.14
187	300413	芒果超媒	25,900	1,063,195.00	0.14
188	600068	葛洲坝	170,284	1,060,869.32	0.13
189	000413	东旭光电	203,200	1,044,448.00	0.13
190	601997	贵阳银行	119,880	1,036,962.00	0.13
191	601216	君正集团	313,300	1,030,757.00	0.13
192	600816	安信信托	202,772	1,023,998.60	0.13
193	002081	金螳螂	99,100	1,021,721.00	0.13
194	000050	深天马 A	76,000	1,021,440.00	0.13
195	002926	华西证券	97,200	1,020,600.00	0.13
196	600398	海澜之家	111,600	1,012,212.00	0.13
197	600642	申能股份	168,200	1,010,882.00	0.13
198	600760	中航沈飞	34,592	1,004,205.76	0.13
199	600188	兖州煤业	92,300	1,003,301.00	0.13
200	600208	新潮中宝	318,200	999,148.00	0.13
201	600118	中国卫星	44,200	996,710.00	0.13
202	600089	特变电工	137,350	995,787.50	0.13
203	000627	天茂集团	152,700	991,023.00	0.13
204	300017	网宿科技	90,600	976,668.00	0.12
205	002460	赣锋锂业	41,500	972,345.00	0.12
206	601238	广汽集团	88,880	971,458.40	0.12
207	000423	东阿阿胶	24,200	963,644.00	0.12
208	000938	紫光股份	35,284	961,489.00	0.12
209	000630	铜陵有色	389,500	958,170.00	0.12
210	000625	长安汽车	144,400	957,372.00	0.12

211	002508	老板电器	35,200	955,328.00	0.12
212	600027	华电国际	251,800	949,286.00	0.12
213	600153	建发股份	105,800	939,504.00	0.12
214	600535	天士力	55,800	923,490.00	0.12
215	600583	海油工程	164,600	921,760.00	0.12
216	002558	巨人网络	50,643	920,183.31	0.12
217	002010	传化智联	120,900	910,377.00	0.12
218	600977	中国电影	57,900	906,714.00	0.12
219	600256	广汇能源	251,488	895,297.28	0.11
220	002180	纳思达	39,500	892,700.00	0.11
221	601699	潞安环能	110,800	879,752.00	0.11
222	600909	华安证券	133,800	875,052.00	0.11
223	000402	金融街	110,700	867,888.00	0.11
224	002384	东山精密	59,500	866,915.00	0.11
225	603799	华友钴业	40,442	861,819.02	0.11
226	600998	九州通	69,500	859,020.00	0.11
227	002500	山西证券	104,700	848,070.00	0.11
228	300433	蓝思科技	121,500	846,855.00	0.11
229	603858	步长制药	32,790	844,998.30	0.11
230	601098	中南传媒	66,400	839,296.00	0.11
231	002624	完美世界	32,500	838,825.00	0.11
232	600415	小商品城	202,500	834,300.00	0.11
233	002385	大北农	157,500	833,175.00	0.11
234	002195	二三四五	213,824	831,775.36	0.11
235	002797	第一创业	129,600	821,664.00	0.10
236	002465	海格通信	86,000	820,440.00	0.10
237	600739	辽宁成大	56,418	820,317.72	0.10
238	600372	中航电子	55,200	819,168.00	0.10
239	002065	东华软件	115,600	808,044.00	0.10
240	601866	中远海发	294,500	801,040.00	0.10
241	002456	欧菲光	100,400	787,136.00	0.10
242	601966	玲珑轮胎	44,900	763,300.00	0.10
243	000027	深圳能源	122,900	761,980.00	0.10
244	600808	马钢股份	221,600	755,656.00	0.10
245	600820	隧道股份	116,800	737,008.00	0.09
246	002563	森马服饰	66,600	736,596.00	0.09
247	002294	信立泰	32,300	722,874.00	0.09
248	000046	泛海控股	128,800	718,704.00	0.09
249	000983	西山煤电	116,900	708,414.00	0.09
250	000883	湖北能源	161,200	699,608.00	0.09
251	601333	广深铁路	209,300	676,039.00	0.09
252	000898	鞍钢股份	176,200	667,798.00	0.08
253	601958	金钼股份	99,400	665,980.00	0.08
254	600373	中文传媒	51,800	650,608.00	0.08

255	000826	启迪桑德	53,800	634,302.00	0.08
256	000060	中金岭南	132,150	619,783.50	0.08
257	000559	万向钱潮	101,900	609,362.00	0.08
258	000839	中信国安	145,200	583,704.00	0.07
259	000581	威孚高科	31,000	575,360.00	0.07
260	000039	中集集团	50,900	543,612.00	0.07
261	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.05
262	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
263	300779	惠城环保	1,047	54,485.88	0.01
264	300777	中简科技	1,156	42,540.80	0.01
265	603982	泉峰汽车	1,845	42,121.35	0.01
266	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
267	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
268	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
269	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
270	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.00
271	603867	新化股份	1,045	26,971.45	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	600036	招商银行	19,442,077.70	2.02
2	000858	五粮液	17,548,487.98	1.82
3	002415	海康威视	15,135,331.23	1.57
4	000002	万科 A	14,317,379.28	1.49
5	002304	洋河股份	12,065,309.21	1.25
6	000001	平安银行	10,962,070.21	1.14
7	000333	美的集团	10,669,722.00	1.11
8	300498	温氏股份	8,893,337.09	0.92
9	001979	招商蛇口	7,371,133.95	0.77
10	000651	格力电器	7,020,401.98	0.73
11	000725	京东方 A	6,315,990.00	0.66
12	000568	泸州老窖	6,065,934.11	0.63
13	002142	宁波银行	6,057,748.00	0.63
14	002024	苏宁易购	5,976,698.00	0.62
15	000063	中兴通讯	5,569,103.02	0.58
16	002714	牧原股份	5,327,211.24	0.55
17	002594	比亚迪	5,247,806.44	0.55

18	000166	申万宏源	4,996,463.20	0.52
19	000776	广发证券	4,513,170.00	0.47
20	002475	立讯精密	4,473,689.70	0.47

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	24,236,836.50	2.52
2	000333	美的集团	23,218,377.64	2.41
3	002415	海康威视	22,238,413.90	2.31
4	000002	万科 A	20,415,292.15	2.12
5	002304	洋河股份	15,962,221.28	1.66
6	000001	平安银行	15,881,365.27	1.65
7	001979	招商蛇口	10,516,099.20	1.09
8	000651	格力电器	10,117,584.03	1.05
9	000725	京东方 A	9,336,280.00	0.97
10	600519	贵州茅台	8,522,125.66	0.89
11	002024	苏宁易购	8,486,026.17	0.88
12	002142	宁波银行	8,106,538.11	0.84
13	000063	中兴通讯	7,845,011.02	0.82
14	002714	牧原股份	7,825,401.87	0.81
15	000568	泸州老窖	7,778,598.33	0.81
16	002594	比亚迪	7,463,130.83	0.78
17	000166	申万宏源	7,326,126.21	0.76
18	000776	广发证券	7,308,581.67	0.76
19	002475	立讯精密	6,354,876.61	0.66
20	000538	云南白药	5,945,428.74	0.62

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	392,123,057.91
卖出股票收入（成交）总额	444,752,663.71

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 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，罚款人民币 170 万元。

2018 年 7 月 5 日，深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款 30 万元。

2018 年 10 月 16 日，上海保监局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心电话销售欺骗投保人、电话销售向投保人隐瞒与合同有关的重要情况的违法违规行为，责令改正并处 35 万元罚款。

2018 年 11 月 19 日，中国保险监督管理委员会北京监管局针对中国工商银行股份有限公司存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，对中国工商银行股份有限公司处以人民币 30 万元行政罚

款。

2019 年 5 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对中国农业银行股份有限公司信用卡中心 2016 年 9 月至 2017 年 6 月间部分信用卡资金违规用于非消费领域的违法违规事实，责令改正，并处罚款 50 万元。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	158,574.69
2	应收证券清算款	240,593.42
3	应收股利	-
4	应收利息	2,528.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	401,696.46

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
9,165	81,570.36	351,507,651 .00	47.02%	396,084,66 5.00	52.98%	206,987,66 0.00	27.69%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券股份有限公司	21,488,884.00	2.87%
2	国盛证券有限责任公司	20,002,000.00	2.68%
3	方正证券股份有限公司	18,695,393.00	2.50%
4	申万宏源证券有限公司	17,987,614.00	2.41%
5	广发证券股份有限公司	15,905,361.00	2.13%
6	陈建敏	12,000,000.00	1.61%
7	中信建投证券股份有限公司	10,901,829.00	1.46%
8	宁波日月集团有限公司	10,000,000.00	1.34%
9	陈菲	8,468,800.00	1.13%
10	谢昊	8,250,700.00	1.10%
11	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	206,987,660.00	27.69%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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	1,157,592,316.00
本报告期基金总申购份额	946,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,356,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	747,592,316.00

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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会广东监管局《关于对易方达基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，对公司个别未按规定进行备案报告的事项提出了整改要求。公司已及时完成了整改。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	45,848,890.56	5.49%	42,691.49	8.76%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

中信建投	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	86,122,103.91	10.32%	68,898.70	14.14%	-
中信证券	3	22,529,037.27	2.70%	11,264.65	2.31%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	48,507,307.43	5.81%	45,175.45	9.27%	-
长江证券	1	2,937,984.99	0.35%	2,736.13	0.56%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
华菁证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	7,083,133.28	0.85%	5,666.53	1.16%	-
方正证券	2	621,599,365.01	74.48%	310,834.88	63.79%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增光大证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华菁证券有限公司各一个交易单元。

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	217,921.90	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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关于增加兴业证券为易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-03-12
2	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-13
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-19
4	易方达基金管理有限公司关于调低旗下易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金相关基金费率并修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-04-20
5	易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-05-28
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区间					
中国银行股份有限公司—易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2019 年 04 月 02 日 ~2019 年 06 月 30 日	-	257,000,000.00	50,012,340.00	206,987,660.00	27.69%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达 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

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日