

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

金

2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十八日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9	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	15
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计意见	16
6.2	形成审计意见的基础	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	46
8.1	期末基金资产组合情况	46
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12	投资组合报告附注	61
§ 9	基金份额持有人信息	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2	期末上市基金前十名持有人	62
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	63
§ 10	开放式基金份额变动	63
§ 11	重大事件揭示	63
11.1	基金份额持有人大会决议	63
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4	基金投资策略的改变	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8	其他重大事件	66
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
§ 13	备查文件目录	70
13.1	备查文件目录	70
13.2	存放地点	71
13.3	查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 500ETF
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,319,978.00 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	2015 年 9 月 14 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，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798
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55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55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	易会满

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、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-2,550,181.02	-1,694,072.62	-890,270.34
本期利润	-4,786,429.82	-1,611,861.64	-2,240,942.11
加权平均基金份额本期利润	-2.0472	-0.1431	-1.8129
本期加权平均净值利润率	-36.77%	-2.28%	-27.97%
本期基金份额净值增长率	-36.03%	-1.11%	-15.89%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-5,405,063.56	86,153.54	94,462.68
期末可供分配基金份额利润	-2.3298	0.0130	0.0861
期末基金资产净值	9,651,197.88	43,125,946.36	7,210,522.51
期末基金份额净值	4.1600	6.5027	6.5759
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-35.90%	0.20%	1.33%

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。

4.本基金已于 2015 年 9 月 9 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.15409267。

3.2 基金净值表现

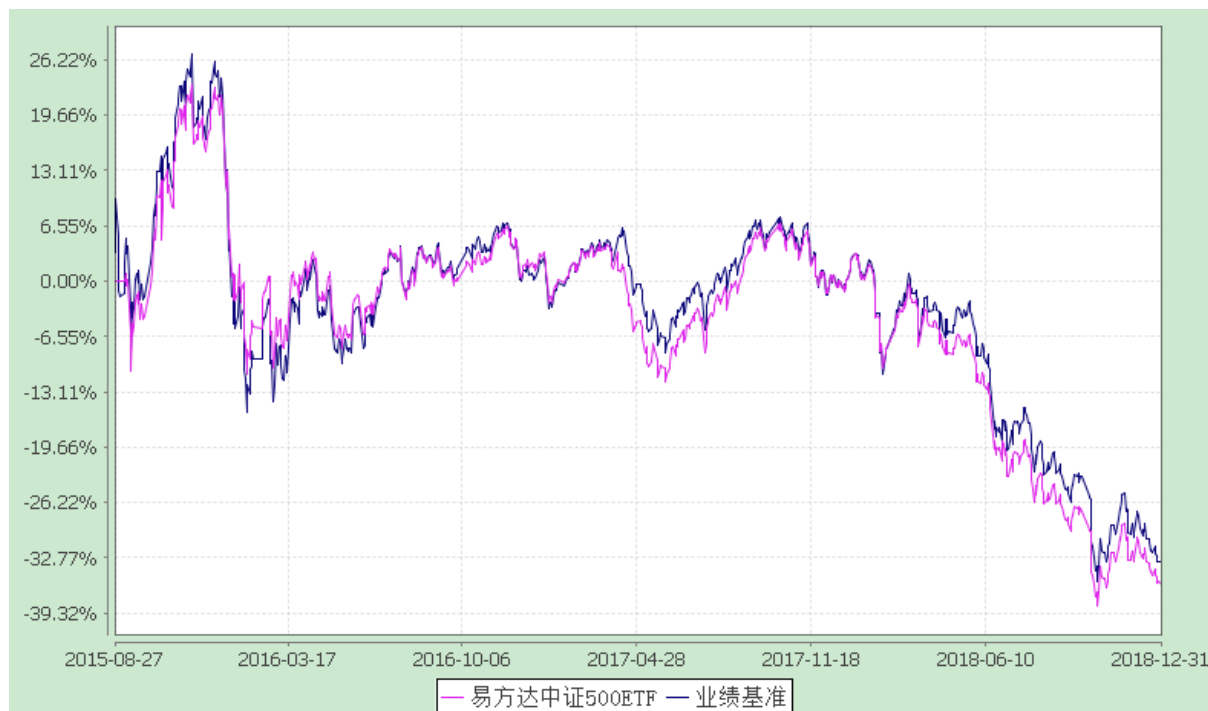
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-11.75%	1.79%	-13.18%	1.84%	1.43%	-0.05%
过去六个月	-20.50%	1.53%	-20.12%	1.58%	-0.38%	-0.05%
过去一年	-36.03%	1.41%	-33.32%	1.51%	-2.71%	-0.10%
过去三年	-46.79%	1.36%	-45.28%	1.50%	-1.51%	-0.14%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-35.90%	1.46%	-33.19%	1.64%	-2.71%	-0.18%

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

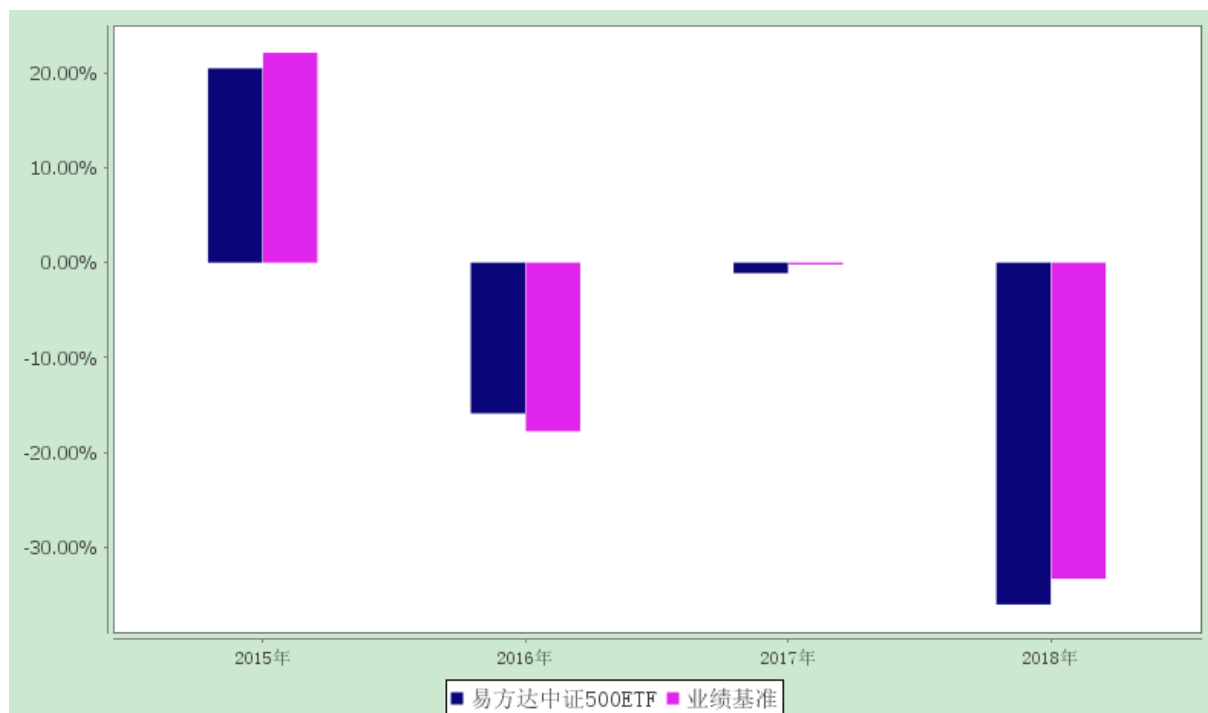
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 8 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-35.90%，同期业绩比较基准收益率为-33.19%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，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、香港、深圳等地设有分公司或子公司，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。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，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、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、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、指数量化、海外投资、多资产投资等领域全面布局。截至 2018 年 12 月 31 日，易方达总资产管理规模超过 1.2 万亿元，服务近 8000 万客户，自成立以来仅公募基金累计分红达 1150 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达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、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2016-04-16	-	13 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。
杨俊	本基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资	2017-06-23	-	9 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与

基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				量化投资部高级账户经理。
---	--	--	--	--------------

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

方可执行。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2018 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 131 次，其中 127 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，4 次为不同基金经理管理的组合间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。

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

2018 年国内宏观经济基本面呈现前高后低的走势。随着以资管新规及其配套细则为标志的去杠杆的推进，非标融资大幅收缩，融资增速回落拖累经济和通胀下行；叠加外部贸易摩擦所造成的出口转差、居民购房形成的高杠杆对内需的制约，使得经济增速稳中趋缓。全年中国经济 GDP 实际增速 6.6%，较 2017 年下滑 0.2 个百分点，创下自 1991 年以来的新低；2018 年一、二、三、四季度的 GDP 实际增速分别为 6.8%、6.7%、6.5%、6.4%。结构上，消费、投资、净出口对 GDP 增速的贡献分别为 5.0、2.1、-0.6 个百分点，其中消费较 2017 年上升 0.9 个百分点，投资与净出口分别下滑 0.1 和 1.2 个百分点。随着经济下行压力的加剧，宏观经济政策在 2018 年更强化了其逆周期调节的功能，出台了一系列货币和信贷宽松等协调稳增长、稳信心的措施。外围市场方面，美联储如期完成了年内四次加息，在美国经济扩张周期接近尾声以及中美贸易摩擦的冲击下，美股市场自四季度开始大幅向下波动，并带动了全球主要股市普跌，避险资产如黄金、美债明显上涨。人民币对美元即期汇

率在一季度保持升值态势，自二季度后伴随实体经济下行风险的增加，叠加中美贸易摩擦升级的影响，人民币汇率贬值预期增强，截止年末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均升至 6.87 附近。资本市场方面，2018 年中国 A 股市场在经济放缓的预期以及贸易摩擦的负荷之下步履维艰，市场风险偏好大幅回落，最终上证综指以下跌 24.59% 收官，所有板块均普跌。风格方面，大小盘齐跌，上证 50 指数、创业板指分别下跌 19.83%、28.65%；行业方面，休闲服务、银行、食品饮料、农林牧渔等板块跌幅较小，电子、有色金属、传媒等板块跌幅较大。报告期内中证 500 指数下跌 33.32%。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 4.1600 元，本报告期份额净值增长率为-36.03%，同期业绩比较基准收益率为-33.32%，日跟踪偏离度的均值为 0.09%，年化跟踪误差为 2.288%，大于合同规定的目标控制范围，主要是由报告期内成份股停牌复牌数量较多，标的指数成份股调整以及基金申购赎回冲击等因素所导致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国宏观经济仍将面临下行压力，全球经济疲软和中美贸易摩擦依然制约出口，房地产投资和消费有下行压力，基建和制造业有望小幅上升但力度有限。从目前的数据看社会融资、地产销售两大领先指标仍未见底，意味着 19 年上半年经济或仍在寻底中。内外部环境可能使得未来宏观政策更加注重增长平稳、提振内需，为改革创造稳定环境。从短期看整体宏观经济从去杠杆向稳杠杆的转变，意味着上半年货币和融资增速有望见底企稳，财政减税有望继续发力，居民消费和企业创新潜力将进一步提升，意味着中长期内需将有改善的希望。受经济增长继续下行、政策逐步托底等基本面对政策交互演变的影响，2019 年中国 A 股市场可能会经历风险继续释放与投资机会显现的阶段。考虑到 A 股估值经历 2018 年的大幅压缩后目前已经处于历史底部区域，如果未来货币政策适度并使物价水平不出现大的波动，同时各项稳增长、改革措施稳步推进的背景下，未来 A 股市场的机会仍将大于风险。从长期来看改革与创新仍然值得期待，中国新老经济的结构转换仍在深化中，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必悲观。通过资本市场把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业升级，改善上市公司业绩，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期高成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等新法规、相关监管要求以及公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规和监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实流动性风险管理规定、债券交易业务新规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

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

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。

(6) 持续督促落实投资者适当性管理法规，不断推动投资者适当性管理制度、相关销售流程规范及系统的修订、更新，持续检讨完善客户投诉处理机制流程，切实保障投资者合法权益。

(7) 深入践行“风险为本”的工作方法，落实反洗钱最新法规和监管要求，夯实反洗钱工作基础，加强客户身份识别，建立受益所有人识别机制，开展洗钱风险评估，完善洗钱风险控制措施，做好反洗钱宣传培训、系统支持、内部审计、信息报送等各项工作。

(8) 紧跟法规、监管要求、市场变化和业务发展，持续优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、规范。

(9) 进一步深入落实《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》，不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、

针对性与有效性。

截至 2018 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 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

本报告期，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自 2018 年 1 月 31 日至本报告期末，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

§ 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，本基金托管人在对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2019)第 22826 号

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

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

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2019 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	363,796.96	967,040.64
结算备付金		4,140.08	103,377.59
存出保证金		1,448.54	50,251.40
交易性金融资产	7.4.7.2	9,357,603.12	42,259,807.49
其中: 股票投资		9,357,603.12	42,259,807.49
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,753.65
应收利息	7.4.7.5	75.23	270.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,727,063.93	43,382,500.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,258.82	13,310.72
应付托管费		851.77	2,662.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	755.46	581.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.8	70,000.00	240,000.00
负债合计		75,866.05	256,554.55
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	15,056,261.44	43,039,792.82
未分配利润	7.4.7.10	-5,405,063.56	86,153.54
所有者权益合计		9,651,197.88	43,125,946.36
负债和所有者权益总计		9,727,063.93	43,382,500.91

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.1600 元，基金份额总额 2,319,978.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-4,383,291.07	-342,873.60
1.利息收入		6,777.34	26,511.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,775.36	26,503.02
债券利息收入		1.98	8.49
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）		-2,215,824.88	-839,083.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,292,822.27	-1,949,300.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	604.18	5,594.46
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-

股利收益	7.4.7.15	76,393.21	1,104,622.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,236,248.80	82,210.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	62,005.27	387,487.18
减：二、费用		403,138.75	1,268,988.04
1. 管理人报酬		64,432.19	349,054.69
2. 托管费		12,886.49	69,810.87
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	44,983.76	397,750.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	280,836.31	452,372.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,786,429.82	-1,611,861.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,786,429.82	-1,611,861.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,039,792.82	86,153.54	43,125,946.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,786,429.82	-4,786,429.82

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）	-27,983,531.38	-704,787.28	-28,688,318.66
其中：1.基金申购款	7,940,085.39	-1,864,029.84	6,076,055.55
2.基金赎回款	-35,923,616.77	1,159,242.56	-34,764,374.21
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）	15,056,261.44	-5,405,063.56	9,651,197.88
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,116,059.83	94,462.68	7,210,522.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,611,861.64	-1,611,861.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,923,732.99	1,603,552.50	37,527,285.49
其中：1.基金申购款	223,994,900.71	-2,105,845.22	221,889,055.49
2.基金赎回款	-188,071,167.72	3,709,397.72	-184,361,770.00
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）	43,039,792.82	86,153.54	43,125,946.36
-----------------	---------------	-----------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 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[2014]999 号《关于准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2015]2176 号《关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 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，《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 295,259,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,000.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与中证 500 指数进行对比，根据《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，易方达基金管理有限公司确定 2015 年 9 月 9 日为本基金的基金份额折算日。当日中证 500 指数收盘值为 6551.01 点，本基金资产净值为 298,052,917.95 元，折算前基金份额总额为 295,259,000 份，折算前基金份额净值为 1.0095 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.15409267，折算后基金份额总额为 45,496,515 份，折算后基金份额净值为 6.5511 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2015 年 9 月 10 日进行了变更登记。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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》、《易方达中证 500 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 15 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 15 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 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。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	363,796.96	967,040.64
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	363,796.96	967,040.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		11,911,125.23	9,357,603.12	-2,553,522.11
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		11,911,125.23	9,357,603.12	-2,553,522.11
项目	上年度末			
	2017 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		42,577,080.80	42,259,807.49	-317,273.31
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		42,577,080.80	42,259,807.49	-317,273.31

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	72.73	200.14
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	1.90	47.40
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	0.60	22.60
合计	75.23	270.14

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	755.46	581.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	755.46	581.69

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	-
预提费用	20,000.00	190,000.00
其他应付款	50,000.00	50,000.00
合计	70,000.00	240,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,632,005.00	43,039,792.82
本期申购	1,223,463.00	7,940,085.39
本期赎回（以“-”号填列）	-5,535,490.00	-35,923,616.77
本期末	2,319,978.00	15,056,261.44

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,877,702.97	-20,791,549.43	86,153.54
本期利润	-2,550,181.02	-2,236,248.80	-4,786,429.82
本期基金份额交易产生的变动数	-13,234,826.14	12,530,038.86	-704,787.28
其中：基金申购款	3,006,397.14	-4,870,426.98	-1,864,029.84
基金赎回款	-16,241,223.28	17,400,465.84	1,159,242.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,092,695.81	-10,497,759.37	-5,405,063.56

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,590.07	18,156.30

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	932.38	7,627.38
其他	252.91	719.34
合计	6,775.36	26,503.02

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	38,569,033.02	332,655,862.14
减：卖出股票成本总额	40,861,855.29	334,605,162.80
买卖股票差价收入	-2,292,822.27	-1,949,300.66

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,706.16	49,802.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,099.95	44,199.71
减：应收利息总额	2.03	8.78
买卖债券差价收入	604.18	5,594.46

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	76,393.21	1,104,622.93
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	76,393.21	1,104,622.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-2,236,248.80	82,210.98
——股票投资	-2,236,248.80	82,210.98
——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	-2,236,248.80	82,210.98

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	52,146.56	276,542.67
基金申购费收入	1,749.13	110,944.51
替代损益收入	8,109.58	-
其他	-	-
合计	62,005.27	387,487.18

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	44,983.76	397,750.34
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	-	-
合计	44,983.76	397,750.34

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	20,000.00	30,000.00
信息披露费	-	160,000.00
银行汇划费	836.31	2,372.14
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他	-	-
合计	280,836.31	452,372.14

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

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。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	64,432.19	349,054.69
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,886.49	69,810.87

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	623,463.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	623,463.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.87%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存	363,796.96	5,590.07	967,040.64	18,156.30

款				
---	--	--	--	--

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

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
000693	*ST 华泽	2018-05-02	暂停上市	3.31	-	-	700	12,897.87	2,317.00	-
000987	越秀金控	2018-12-25	重大事项停牌	7.97	2019-01-10	8.77	860	7,849.98	6,854.20	-
002183	怡亚通	2018-12-25	重大事项停牌	5.01	2019-01-02	4.96	4,520	30,612.35	22,645.20	-
600270	外运发展	2018-12-13	重大事项停牌	20.99	2019-01-18	5.30	1,190	23,500.84	24,978.10	-

注：根据中外运空运发展股份有限公司(以下简称“外运发展”)于 2018 年 11 月 3 日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司(以下简称“中国外运”)于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》，中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票，以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 5.30 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0,无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0,无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合,全面管理、专业分工”的思路,将风险控制嵌入到全公司的组织架构中,对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看,投资决策委员会、投资总监、基金投资部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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

7.4.13.2 信用风险

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

于 2018 年 12 月 31 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2017 年 12 月 31 日: 0.00%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2018 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开

募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	363,796.96	-	-	-	363,796.96
结算备付金	4,140.08	-	-	-	4,140.08
存出保证金	1,448.54	-	-	-	1,448.54
交易性金融资产	-	-	-	9,357,603.12	9,357,603.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	75.23	75.23
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	369,385.58	-	-	9,357,678.35	9,727,063.93
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	-	-	-	4,258.82	4,258.82
应付托管费	-	-	-	851.77	851.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	755.46	755.46
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债总计	-	-	-	75,866.05	75,866.05
利率敏感度缺口	369,385.58	-	-	9,281,812.30	9,651,197.88
上年度末					
2017 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	967,040.64	-	-	-	967,040.64
结算备付金	103,377.59	-	-	-	103,377.59
存出保证金	50,251.40	-	-	-	50,251.40
交易性金融资产	-	-	-	42,259,807.49	42,259,807.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,753.65	1,753.65
应收利息	-	-	-	270.14	270.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,120,669.63	-	-	42,261,831.28	43,382,500.91
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	-	-	-	13,310.72	13,310.72
应付托管费	-	-	-	2,662.14	2,662.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	581.69	581.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	-	-	-	256,554.55	256,554.55
利率敏感度缺口	1,120,669.63	-	-	42,005,276.73	43,125,946.36

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-	-
假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	-	-	

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	9,357,603.12	96.96	42,259,807.49	97.99
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,357,603.12	96.96	42,259,807.49	97.99

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	466,788.72	2,097,549.72
2.业绩比较基准下降 5%	-466,788.72	-2,097,549.72	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于

第一层次的余额为9,300,808.62元,属于第二层次的余额为56,794.50元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次38,929,443.67元,第二层次3,330,363.82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2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,357,603.12	96.20
	其中:股票	9,357,603.12	96.20
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	367,937.04	3.78
8	其他各项资产	1,523.77	0.02
9	合计	9,727,063.93	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	97,606.20	1.01
B	采矿业	228,572.36	2.37
C	制造业	5,302,568.32	54.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	295,068.10	3.06
E	建筑业	172,765.20	1.79
F	批发和零售业	518,402.82	5.37
G	交通运输、仓储和邮政业	330,264.11	3.42
H	住宿和餐饮业	35,229.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	864,953.72	8.96
J	金融业	311,611.78	3.23
K	房地产业	513,447.11	5.32
L	租赁和商务服务业	147,723.60	1.53
M	科学研究和技术服务业	16,077.60	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	55,723.54	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,081.20	0.09
Q	卫生和社会工作	63,560.30	0.66
R	文化、体育和娱乐业	261,950.46	2.71
S	综合	132,997.70	1.38
	合计	9,357,603.12	96.96

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600201	生物股份	3,552	58,963.20	0.61
2	600872	中炬高新	1,750	51,555.00	0.53
3	000656	金科股份	8,050	49,829.50	0.52
4	300347	泰格医药	1,100	47,025.00	0.49
5	300146	汤臣倍健	2,736	46,484.64	0.48
6	600256	广汇能源	12,210	45,909.60	0.48
7	002410	广联达	2,110	43,909.10	0.45
8	300253	卫宁健康	3,500	43,610.00	0.45
9	600426	华鲁恒升	3,500	42,245.00	0.44
10	600699	均胜电子	1,800	42,048.00	0.44
11	000623	吉林敖东	2,900	41,847.00	0.43
12	300450	先导智能	1,400	40,516.00	0.42
13	600642	申能股份	8,250	40,260.00	0.42
14	000998	隆平高科	2,700	39,960.00	0.41
15	601005	重庆钢铁	20,300	39,382.00	0.41
16	600298	安琪酵母	1,550	39,106.50	0.41
17	000860	顺鑫农业	1,220	38,905.80	0.40
18	000750	国海证券	8,900	38,804.00	0.40
19	002465	海格通信	4,900	38,220.00	0.40
20	600600	青岛啤酒	1,090	37,997.40	0.39
21	002049	紫光国微	1,290	37,281.00	0.39
22	002129	中环股份	5,100	36,873.00	0.38
23	002223	鱼跃医疗	1,880	36,866.80	0.38
24	000778	新兴铸管	8,440	36,376.40	0.38
25	300383	光环新网	2,870	36,362.90	0.38
26	600879	航天电子	6,640	35,922.40	0.37
27	600895	张江高科	2,400	35,880.00	0.37
28	600528	中铁工业	3,400	35,700.00	0.37
29	600820	隧道股份	5,700	35,682.00	0.37
30	000690	宝新能源	5,280	35,534.40	0.37
31	000401	冀东水泥	2,870	35,530.60	0.37
32	600779	水井坊	1,100	34,837.00	0.36
33	002195	二三四五	9,432	34,804.08	0.36
34	603444	吉比特	230	34,040.00	0.35
35	601168	西部矿业	5,840	33,988.80	0.35
36	002340	格林美	8,850	33,984.00	0.35
37	002439	启明星辰	1,650	33,924.00	0.35
38	600673	东阳光科	4,580	33,342.40	0.35

39	300413	芒果超媒	900	33,309.00	0.35
40	002384	东山精密	2,947	33,271.63	0.34
41	600811	东方集团	9,010	32,976.60	0.34
42	000418	小天鹅 A	760	32,870.00	0.34
43	600183	生益科技	3,265	32,845.90	0.34
44	002038	双鹭药业	1,320	32,749.20	0.34
45	000581	威孚高科	1,850	32,671.00	0.34
46	600881	亚泰集团	9,850	32,603.50	0.34
47	002268	卫士通	1,820	32,505.20	0.34
48	002507	涪陵榨菜	1,500	32,400.00	0.34
49	300168	万达信息	2,700	32,373.00	0.34
50	000997	新大陆	2,210	32,354.40	0.34
51	002092	中泰化学	4,560	32,148.00	0.33
52	600325	华发股份	5,180	32,116.00	0.33
53	002281	光迅科技	1,190	31,963.40	0.33
54	002174	游族网络	1,700	31,603.00	0.33
55	002470	金正大	5,000	31,600.00	0.33
56	000975	银泰资源	3,074	31,324.06	0.32
57	600808	马钢股份	9,040	31,278.40	0.32
58	600885	宏发股份	1,386	31,268.16	0.32
59	600022	山东钢铁	19,806	31,095.42	0.32
60	000830	鲁西化工	3,171	31,075.80	0.32
61	600804	鹏博士	4,400	30,932.00	0.32
62	002506	协鑫集成	6,170	30,850.00	0.32
63	002500	山西证券	5,200	30,784.00	0.32
64	002358	森源电气	1,720	30,616.00	0.32
65	600315	上海家化	1,120	30,576.00	0.32
66	600718	东软集团	2,640	30,492.00	0.32
67	000999	华润三九	1,220	30,329.20	0.31
68	600567	山鹰纸业	9,700	30,264.00	0.31
69	000060	中金岭南	7,600	30,096.00	0.31
70	000681	视觉中国	1,290	30,082.80	0.31
71	300315	掌趣科技	8,400	29,652.00	0.31
72	600079	人福医药	2,870	29,101.80	0.30
73	000960	锡业股份	3,040	29,001.60	0.30
74	600572	康恩贝	4,860	28,819.80	0.30
75	000039	中集集团	2,710	28,671.80	0.30
76	002221	东华能源	3,540	28,532.40	0.30
77	600143	金发科技	5,750	28,462.50	0.29
78	002013	中航机电	4,355	28,351.05	0.29
79	002127	南极电商	3,760	28,275.20	0.29
80	600161	天坛生物	1,327	28,198.75	0.29
81	600376	首开股份	3,900	28,041.00	0.29
82	000009	中国宝安	6,500	28,015.00	0.29

83	600160	巨化股份	4,220	27,978.60	0.29
84	300027	华谊兄弟	5,900	27,671.00	0.29
85	002399	海普瑞	1,200	27,660.00	0.29
86	601098	中南传媒	2,200	27,500.00	0.28
87	600755	厦门国贸	3,931	27,438.38	0.28
88	600392	盛和资源	3,183	27,405.63	0.28
89	300274	阳光电源	3,070	27,384.40	0.28
90	600282	南钢股份	8,000	27,360.00	0.28
90	601866	中远海发	12,000	27,360.00	0.28
92	601872	招商轮船	7,400	27,306.00	0.28
93	603899	晨光文具	900	27,225.00	0.28
94	300001	特锐德	1,550	27,171.50	0.28
95	000686	东北证券	4,300	26,918.00	0.28
96	002078	太阳纸业	4,720	26,904.00	0.28
97	600967	内蒙一机	2,580	26,832.00	0.28
98	002463	沪电股份	3,730	26,744.10	0.28
99	000008	神州高铁	6,800	26,452.00	0.27
100	600655	豫园股份	3,571	26,425.40	0.27
101	600875	东方电气	3,330	26,273.70	0.27
102	000547	航天发展	3,471	26,240.76	0.27
103	002176	江特电机	4,430	26,004.10	0.27
104	600021	上海电力	3,200	25,920.00	0.27
105	600839	四川长虹	11,220	25,918.20	0.27
106	603077	和邦生物	15,990	25,903.80	0.27
107	600260	凯乐科技	1,520	25,794.40	0.27
108	000813	德展健康	2,800	25,704.00	0.27
109	600166	福田汽车	14,090	25,643.80	0.27
110	002299	圣农发展	1,550	25,637.00	0.27
111	002110	三钢闽光	2,000	25,580.00	0.27
112	000066	中国长城	5,380	25,501.20	0.26
113	600643	爱建集团	3,000	25,470.00	0.26
114	600801	华新水泥	1,520	25,414.40	0.26
115	002373	千方科技	2,280	25,353.60	0.26
116	600270	外运发展	1,190	24,978.10	0.26
117	002372	伟星新材	1,600	24,816.00	0.26
118	600466	蓝光发展	4,596	24,726.48	0.26
119	000089	深圳机场	3,171	24,702.09	0.26
120	600584	长电科技	2,970	24,472.80	0.25
121	002019	亿帆医药	2,280	24,396.00	0.25
122	600959	江苏有线	5,900	24,308.00	0.25
123	002074	国轩高科	2,100	24,276.00	0.25
124	000729	燕京啤酒	4,290	24,195.60	0.25
125	002670	国盛金控	2,395	24,141.60	0.25
126	002916	深南电路	300	24,051.00	0.25

127	600258	首旅酒店	1,500	23,940.00	0.25
128	300166	东方国信	2,310	23,931.60	0.25
129	600388	龙净环保	2,340	23,751.00	0.25
130	000636	风华高科	2,210	23,735.40	0.25
131	600008	首创股份	6,900	23,667.00	0.25
132	600277	亿利洁能	4,140	23,432.40	0.24
133	000513	丽珠集团	928	23,339.20	0.24
134	600737	中粮糖业	3,171	23,338.56	0.24
135	300088	长信科技	5,610	23,281.50	0.24
136	002353	杰瑞股份	1,550	23,250.00	0.24
137	000596	古井贡酒	430	23,202.80	0.24
138	300418	昆仑万维	1,800	23,148.00	0.24
139	000488	晨鸣纸业	4,110	23,057.10	0.24
140	600511	国药股份	990	23,017.50	0.24
141	600729	重庆百货	808	22,866.40	0.24
142	600266	北京城建	2,870	22,730.40	0.24
143	002183	怡亚通	4,520	22,645.20	0.23
144	600884	杉杉股份	1,750	22,610.00	0.23
145	600138	中青旅	1,750	22,557.50	0.23
146	603369	今世缘	1,550	22,459.50	0.23
147	000988	华工科技	1,880	22,447.20	0.23
148	601718	际华集团	6,700	22,445.00	0.23
149	000932	华菱钢铁	3,700	22,422.00	0.23
150	002583	海能达	2,840	22,407.60	0.23
151	002589	瑞康医药	3,210	22,373.70	0.23
152	000887	中鼎股份	2,210	22,365.20	0.23
153	000930	中粮生化	2,987	22,163.54	0.23
154	601106	中国一重	8,300	22,161.00	0.23
155	600373	中文传媒	1,700	22,117.00	0.23
156	600507	方大特钢	2,200	21,978.00	0.23
157	000028	国药一致	530	21,963.20	0.23
158	600500	中化国际	3,200	21,888.00	0.23
159	000598	兴蓉环境	5,410	21,802.30	0.23
160	600409	三友化工	3,800	21,736.00	0.23
161	000732	泰禾集团	1,550	21,731.00	0.23
162	000738	航发控制	1,800	21,708.00	0.22
163	600039	四川路桥	6,610	21,680.80	0.22
164	000559	万向钱潮	4,200	21,504.00	0.22
165	601000	唐山港	8,999	21,417.62	0.22
166	002191	劲嘉股份	2,740	21,399.40	0.22
167	002640	跨境通	1,980	21,384.00	0.22
168	600649	城投控股	3,900	21,333.00	0.22
169	603885	吉祥航空	1,700	21,301.00	0.22
170	600064	南京高科	2,700	21,276.00	0.22

171	002250	联化科技	2,250	21,217.50	0.22
172	002371	北方华创	560	21,145.60	0.22
173	600827	百联股份	2,500	21,125.00	0.22
174	000878	云南铜业	2,640	20,935.20	0.22
175	002152	广电运通	3,730	20,925.30	0.22
176	600060	海信电器	2,410	20,918.80	0.22
177	601179	中国西电	6,200	20,832.00	0.22
178	002273	水晶光电	2,175	20,793.00	0.22
179	600056	中国医药	1,650	20,740.50	0.21
180	600536	中国软件	990	20,720.70	0.21
181	601128	常熟银行	3,360	20,630.40	0.21
182	002155	湖南黄金	2,610	20,488.50	0.21
183	002385	大北农	6,400	20,480.00	0.21
184	601966	玲珑轮胎	1,500	20,475.00	0.21
185	600848	上海临港	990	20,473.20	0.21
186	600863	内蒙华电	8,810	20,351.10	0.21
187	600435	北方导航	2,740	20,303.40	0.21
188	603883	老百姓	430	20,300.30	0.21
189	002004	华邦健康	4,390	20,237.90	0.21
190	300316	晶盛机电	2,000	20,040.00	0.21
191	600312	平高电气	2,480	20,038.40	0.21
192	002831	裕同科技	500	20,030.00	0.21
193	300182	捷成股份	4,660	19,991.40	0.21
194	600167	联美控股	2,200	19,888.00	0.21
195	600125	铁龙物流	2,840	19,880.00	0.21
196	600782	新钢股份	3,900	19,851.00	0.21
197	600380	健康元	2,970	19,809.90	0.21
198	300133	华策影视	2,210	19,801.60	0.21
199	002266	浙富控股	4,850	19,739.50	0.20
200	600062	华润双鹤	1,624	19,634.16	0.20
201	002440	闰土股份	2,180	19,620.00	0.20
202	600410	华胜天成	3,340	19,572.40	0.20
203	600460	士兰微	2,410	19,569.20	0.20
204	600418	江淮汽车	4,060	19,528.60	0.20
205	002407	多氟多	1,780	19,508.80	0.20
206	002051	中工国际	1,750	19,390.00	0.20
207	000970	中科三环	2,640	19,351.20	0.20
208	603816	顾家家居	430	19,350.00	0.20
209	300113	顺网科技	1,520	19,319.20	0.20
210	000667	美好置业	7,720	19,300.00	0.20
211	000685	中山公用	2,740	19,180.00	0.20
212	002285	世联行	3,771	19,156.68	0.20
213	000027	深圳能源	3,630	19,057.50	0.20
214	002603	以岭药业	1,820	19,037.20	0.20

215	600598	北大荒	2,210	18,917.60	0.20
216	002244	滨江集团	4,720	18,785.60	0.19
217	000528	柳工	3,094	18,780.58	0.19
218	002408	齐翔腾达	2,740	18,741.60	0.19
219	600037	歌华有线	2,180	18,726.20	0.19
220	600717	天津港	2,640	18,664.80	0.19
221	000807	云铝股份	4,800	18,624.00	0.19
222	600026	中远海能	4,190	18,603.60	0.19
223	002414	高德红外	860	18,533.00	0.19
224	002701	奥瑞金	3,630	18,367.80	0.19
225	601928	凤凰传媒	2,310	18,341.40	0.19
226	002690	美亚光电	860	18,300.80	0.19
227	600348	阳泉煤业	3,630	18,295.20	0.19
228	600664	哈药股份	4,620	18,249.00	0.19
229	002491	通鼎互联	2,310	18,202.80	0.19
230	600158	中体产业	2,045	18,180.05	0.19
231	600563	法拉电子	430	18,120.20	0.19
232	300324	旋极信息	3,229	18,114.69	0.19
233	600307	酒钢宏兴	9,470	18,087.70	0.19
234	601231	环旭电子	2,000	18,000.00	0.19
235	002030	达安基因	1,765	17,932.40	0.19
236	600216	浙江医药	2,050	17,794.00	0.18
237	600525	长园集团	4,060	17,782.80	0.18
238	601958	金铂股份	3,000	17,760.00	0.18
239	600094	大名城	4,850	17,702.50	0.18
240	300459	金科文化	2,400	17,640.00	0.18
241	002368	太极股份	760	17,632.00	0.18
242	600970	中材国际	3,200	17,504.00	0.18
243	300058	蓝色光标	4,020	17,446.80	0.18
244	002672	东江环保	1,520	17,388.80	0.18
245	600823	世茂股份	4,620	17,371.20	0.18
246	601880	大连港	9,370	17,334.50	0.18
247	600291	西水股份	1,680	17,287.20	0.18
248	600582	天地科技	5,030	17,202.60	0.18
249	002317	众生药业	2,020	16,867.00	0.17
250	000717	韶钢松山	3,700	16,835.00	0.17
251	300026	红日药业	5,510	16,805.50	0.17
252	300055	万邦达	2,180	16,720.60	0.17
253	000400	许继电气	1,880	16,713.20	0.17
254	600633	浙数文化	2,050	16,707.50	0.17
255	600120	浙江东方	1,327	16,667.12	0.17
256	600901	江苏租赁	2,800	16,548.00	0.17
257	300244	迪安诊断	1,090	16,535.30	0.17
258	603228	景旺电子	330	16,496.70	0.17

259	600648	外高桥	1,190	16,350.60	0.17
260	600171	上海贝岭	1,750	16,345.00	0.17
261	000031	中粮地产	3,320	16,201.60	0.17
262	603658	安图生物	330	16,133.70	0.17
263	000563	陕国投 A	6,006	16,096.08	0.17
264	600645	中源协和	990	16,077.60	0.17
265	002242	九阳股份	990	15,849.90	0.16
266	601100	恒立液压	800	15,848.00	0.16
267	300010	立思辰	2,180	15,826.80	0.16
268	000543	皖能电力	3,300	15,807.00	0.16
268	300002	神州泰岳	4,790	15,807.00	0.16
270	600597	光明乳业	1,880	15,716.80	0.16
271	002444	巨星科技	1,650	15,642.00	0.16
272	002400	省广集团	5,280	15,628.80	0.16
273	600499	科达洁能	3,860	15,594.40	0.16
274	002366	台海核电	1,662	15,589.56	0.16
275	002212	南洋股份	1,400	15,568.00	0.16
276	600017	日照港	5,610	15,483.60	0.16
277	002280	联络互动	4,000	15,480.00	0.16
278	000758	中色股份	4,230	15,439.50	0.16
279	002064	华峰氨纶	3,630	15,209.70	0.16
280	002563	森马服饰	1,700	15,164.00	0.16
281	601717	郑煤机	2,740	15,152.20	0.16
282	600179	安通控股	2,268	15,082.20	0.16
283	600908	无锡银行	2,870	15,038.80	0.16
284	002839	张家港行	2,800	14,980.00	0.16
285	002131	利欧股份	10,130	14,891.10	0.15
286	600978	宜华生活	3,630	14,883.00	0.15
287	000848	承德露露	1,850	14,874.00	0.15
288	000006	深振业 A	2,870	14,866.60	0.15
289	600751	海航科技	5,480	14,850.80	0.15
290	600503	华丽家族	4,850	14,792.50	0.15
291	600073	上海梅林	1,980	14,751.00	0.15
292	000926	福星股份	2,410	14,749.20	0.15
293	603515	欧普照明	529	14,743.23	0.15
294	601127	小康股份	860	14,740.40	0.15
295	000718	苏宁环球	4,620	14,691.60	0.15
296	600267	海正药业	1,750	14,682.50	0.15
297	600750	江中药业	864	14,627.52	0.15
298	002426	胜利精密	6,300	14,616.00	0.15
299	601200	上海环境	1,090	14,464.30	0.15
300	000078	海王生物	4,850	14,453.00	0.15
301	600835	上海机电	990	14,404.50	0.15
302	600098	广州发展	2,540	14,376.40	0.15

303	002028	思源电气	1,450	14,311.50	0.15
304	002254	泰和新材	1,320	14,308.80	0.15
305	002573	清新环境	1,980	14,295.60	0.15
306	600141	兴发集团	1,388	14,282.52	0.15
307	000156	华数传媒	1,800	14,274.00	0.15
308	603659	璞泰来	300	14,220.00	0.15
309	601689	拓普集团	960	14,188.80	0.15
310	002128	露天煤业	1,980	14,176.80	0.15
311	601678	滨化股份	3,352	14,145.44	0.15
312	600623	华谊集团	1,750	14,140.00	0.15
313	000877	天山股份	1,980	14,077.80	0.15
314	002056	横店东磁	2,540	14,046.20	0.15
315	002807	江阴银行	2,740	13,919.20	0.14
316	000564	供销大集	5,500	13,915.00	0.14
317	601326	秦港股份	4,400	13,816.00	0.14
318	601608	中信重工	5,300	13,780.00	0.14
319	002745	木林森	1,220	13,773.80	0.14
320	000012	南玻 A	3,412	13,613.88	0.14
321	600557	康缘药业	1,320	13,569.60	0.14
322	002359	北讯集团	1,650	13,546.50	0.14
323	600694	大商股份	560	13,546.40	0.14
324	002505	大康农业	8,350	13,527.00	0.14
325	000519	中兵红箭	2,150	13,523.50	0.14
326	300115	长盈精密	1,650	13,513.50	0.14
327	600787	中储股份	2,700	13,500.00	0.14
328	000158	常山北明	2,580	13,467.60	0.14
329	600859	王府井	990	13,424.40	0.14
330	000980	众泰汽车	3,100	13,423.00	0.14
331	600611	大众交通	3,360	13,406.40	0.14
332	600869	智慧能源	2,740	13,289.00	0.14
333	600993	马应龙	990	13,285.80	0.14
334	000021	深科技	2,310	13,282.50	0.14
335	300199	翰宇药业	1,420	13,262.80	0.14
336	300287	飞利信	3,470	13,116.60	0.14
337	600316	洪都航空	1,320	13,054.80	0.14
338	600545	卓郎智能	1,750	12,950.00	0.13
339	000712	锦龙股份	1,420	12,893.60	0.13
340	002431	棕榈股份	3,600	12,852.00	0.13
341	600765	中航重机	1,720	12,796.80	0.13
342	603000	人民网	1,750	12,775.00	0.13
343	000537	广宇发展	1,700	12,733.00	0.13
344	601801	皖新传媒	1,900	12,692.00	0.13
345	603766	隆鑫通用	3,100	12,679.00	0.13
346	600575	皖江物流	5,940	12,652.20	0.13

347	300159	新研股份	2,740	12,631.40	0.13
348	600580	卧龙电气	1,980	12,474.00	0.13
349	600155	华创阳安	1,650	12,424.50	0.13
350	002048	宁波华翔	1,190	12,411.70	0.13
351	600478	科力远	3,171	12,366.90	0.13
352	002517	恺英网络	3,325	12,335.75	0.13
353	000049	德赛电池	430	12,332.40	0.13
354	600169	太原重工	5,510	12,287.30	0.13
355	600757	长江传媒	1,880	12,257.60	0.13
356	600338	西藏珠峰	630	12,240.90	0.13
357	300308	中际旭创	300	12,207.00	0.13
358	000723	美锦能源	3,800	12,198.00	0.13
359	600151	航天机电	3,070	12,157.20	0.13
360	002332	仙琚制药	1,980	12,137.40	0.13
361	002709	天赐材料	560	12,129.60	0.13
362	000727	华东科技	8,250	12,127.50	0.13
363	300376	易事特	2,870	12,082.70	0.13
364	000937	冀中能源	3,200	12,064.00	0.13
365	002249	大洋电机	3,630	11,979.00	0.12
366	603233	大参林	300	11,958.00	0.12
367	601869	长飞光纤	300	11,931.00	0.12
368	600259	广晟有色	530	11,850.80	0.12
369	600777	新潮能源	6,200	11,842.00	0.12
370	002093	国脉科技	1,620	11,809.80	0.12
371	002544	杰赛科技	1,090	11,793.80	0.12
372	601016	节能风电	5,050	11,716.00	0.12
373	600874	创业环保	1,420	11,715.00	0.12
374	000426	兴业矿业	2,350	11,703.00	0.12
375	601311	骆驼股份	1,320	11,655.60	0.12
376	000612	焦作万方	2,940	11,642.40	0.12
377	000501	鄂武商 A	1,220	11,565.60	0.12
378	600614	鹏起科技	3,207	11,513.13	0.12
379	002276	万马股份	2,280	11,491.20	0.12
380	300134	大富科技	1,220	11,468.00	0.12
381	600565	迪马股份	4,390	11,414.00	0.12
382	002424	贵州百灵	1,300	11,375.00	0.12
383	600770	综艺股份	2,410	11,351.10	0.12
384	600754	锦江股份	530	11,289.00	0.12
385	002002	鸿达兴业	3,915	11,275.20	0.12
386	601001	大同煤业	2,640	11,272.80	0.12
387	002233	塔牌集团	1,120	11,267.20	0.12
388	600366	宁波韵升	2,236	11,202.36	0.12
389	002815	崇达技术	760	11,103.60	0.12
390	000600	建投能源	2,210	11,094.20	0.11

391	600329	中新药业	890	11,071.60	0.11
392	002512	达华智能	2,080	11,044.80	0.11
393	000062	深圳华强	660	10,995.60	0.11
394	600594	益佰制药	1,980	10,929.60	0.11
395	002509	天广中茂	4,600	10,902.00	0.11
396	300257	开山股份	1,090	10,889.10	0.11
397	002482	广田集团	1,880	10,885.20	0.11
398	002434	万里扬	1,650	10,873.50	0.11
399	002665	首航节能	3,860	10,846.60	0.11
400	600416	湘电股份	2,080	10,732.80	0.11
401	603198	迎驾贡酒	760	10,723.60	0.11
402	002375	亚厦股份	2,110	10,634.40	0.11
403	002302	西部建设	1,200	10,608.00	0.11
404	601003	柳钢股份	1,600	10,512.00	0.11
405	000541	佛山照明	2,015	10,437.70	0.11
406	600122	宏图高科	2,870	10,418.10	0.11
407	600640	号百控股	1,060	10,398.60	0.11
408	002390	信邦制药	2,540	10,388.60	0.11
409	000090	天健集团	2,256	10,377.60	0.11
410	000990	诚志股份	860	10,328.60	0.11
411	000766	通化金马	1,502	10,303.72	0.11
412	600657	信达地产	2,610	10,257.30	0.11
413	002707	众信旅游	1,620	10,238.40	0.11
414	600053	九鼎投资	430	10,122.20	0.10
415	300266	兴源环境	2,858	10,088.74	0.10
416	000061	农产品	2,080	10,088.00	0.10
417	002635	安洁科技	890	10,083.70	0.10
418	603806	福斯特	369	9,889.20	0.10
419	600759	洲际油气	4,178	9,860.08	0.10
420	600195	中牧股份	924	9,831.36	0.10
421	603568	伟明环保	430	9,825.50	0.10
422	603328	依顿电子	990	9,801.00	0.10
423	002277	友阿股份	3,070	9,701.20	0.10
424	600639	浦东金桥	860	9,683.60	0.10
425	600350	山东高速	2,100	9,576.00	0.10
426	600086	东方金钰	2,046	9,432.06	0.10
427	002663	普邦股份	3,800	9,386.00	0.10
428	603888	新华网	730	9,373.20	0.10
429	600748	上实发展	1,750	9,345.00	0.10
430	600773	西藏城投	1,550	9,300.00	0.10
431	000829	天音控股	1,650	9,256.50	0.10
432	300297	蓝盾股份	1,850	9,250.00	0.10
433	603486	科沃斯	200	9,206.00	0.10
434	002642	荣之联	1,420	9,144.80	0.09

435	600240	华业资本	3,530	9,142.70	0.09
436	603377	东方时尚	622	9,081.20	0.09
437	600006	东风汽车	2,511	9,039.60	0.09
438	000552	靖远煤电	3,530	9,036.80	0.09
439	603866	桃李面包	200	9,032.00	0.09
440	002354	天神娱乐	1,720	9,012.80	0.09
441	002818	富森美	430	8,939.70	0.09
442	002344	海宁皮城	1,950	8,872.50	0.09
443	002503	搜于特	3,770	8,859.50	0.09
444	603868	飞科电器	230	8,781.40	0.09
445	000025	特力 A	330	8,751.60	0.09
446	600971	恒源煤电	1,550	8,726.50	0.09
447	002489	浙江永强	3,300	8,712.00	0.09
448	601990	南京证券	1,000	8,700.00	0.09
449	600058	五矿发展	1,320	8,593.20	0.09
450	600428	中远海特	2,640	8,580.00	0.09
451	603556	海兴电力	659	8,567.00	0.09
452	000969	安泰科技	1,880	8,554.00	0.09
453	000536	华映科技	4,450	8,321.50	0.09
454	600458	时代新材	1,220	8,271.60	0.09
455	600335	国机汽车	1,320	8,236.80	0.09
456	002251	步步高	1,090	8,087.80	0.08
457	603225	新凤鸣	430	8,062.50	0.08
458	601777	力帆股份	2,080	7,924.80	0.08
459	002437	誉衡药业	2,746	7,688.80	0.08
460	600939	重庆建工	1,660	7,652.60	0.08
461	000587	金洲慈航	3,240	7,614.00	0.08
462	600862	中航高科	1,320	7,392.00	0.08
463	002308	威创股份	1,650	7,342.50	0.08
464	002477	雏鹰农牧	4,811	7,216.50	0.07
465	600126	杭钢股份	1,596	7,197.96	0.07
466	002588	史丹利	1,850	7,196.50	0.07
467	002118	紫鑫药业	1,650	7,194.00	0.07
468	603712	七一二	400	7,124.00	0.07
469	603355	莱克电气	330	7,095.00	0.07
470	300197	铁汉生态	1,860	7,049.40	0.07
471	002681	奋达科技	1,926	7,049.16	0.07
472	601019	山东出版	900	7,038.00	0.07
473	600743	华远地产	2,870	6,945.40	0.07
474	002920	德赛西威	400	6,940.00	0.07
475	300156	神雾环保	1,900	6,897.00	0.07
476	002416	爱施德	1,168	6,867.84	0.07
477	000987	越秀金控	860	6,854.20	0.07
478	603056	德邦股份	400	6,620.00	0.07

479	600393	粤泰股份	3,100	6,572.00	0.07
480	600184	光电股份	660	6,448.20	0.07
481	600996	贵广网络	990	6,296.40	0.07
482	002345	潮宏基	1,402	6,266.94	0.06
483	002699	美盛文化	1,107	6,066.36	0.06
484	600687	刚泰控股	1,420	5,893.00	0.06
485	002041	登海种业	1,090	5,875.10	0.06
486	300291	华录百纳	1,320	5,874.00	0.06
487	300202	聚龙股份	890	5,731.60	0.06
488	600280	中央商场	1,750	5,687.50	0.06
489	601969	海南矿业	1,260	5,644.80	0.06
490	603169	兰石重装	1,290	5,508.30	0.06
491	601811	新华文轩	530	4,934.30	0.05
492	600618	氯碱化工	760	4,932.40	0.05
493	600917	重庆燃气	660	4,699.20	0.05
494	601020	华钰矿业	530	4,483.80	0.05
495	603877	太平鸟	230	4,321.70	0.04
496	000761	本钢板材	1,220	4,099.20	0.04
497	603025	大豪科技	364	4,058.60	0.04
498	603650	彤程新材	200	3,966.00	0.04
499	603569	长久物流	282	3,031.50	0.03
500	000693	*ST 华泽	700	2,317.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000401	冀东水泥	98,484.00	0.23
2	000661	长春高新	75,002.00	0.17
3	300347	泰格医药	52,800.00	0.12
4	002049	紫光国微	50,694.00	0.12
5	000998	隆平高科	49,007.00	0.11
6	000830	鲁西化工	47,193.00	0.11
7	002410	广联达	45,825.00	0.11
8	000977	浪潮信息	44,461.00	0.10
9	002465	海格通信	44,367.00	0.10
10	002129	中环股份	44,332.00	0.10
11	600699	均胜电子	43,869.00	0.10
12	000623	吉林敖东	43,355.00	0.10
13	300450	先导智能	42,756.00	0.10

14	603019	中科曙光	41,231.00	0.10
15	601005	重庆钢铁	41,209.00	0.10
16	002179	中航光电	40,723.00	0.09
17	600201	生物股份	39,648.00	0.09
18	000703	恒逸石化	39,634.00	0.09
19	002038	双鹭药业	39,598.00	0.09
20	002340	格林美	38,770.00	0.09

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	327,663.80	0.76
2	300156	神雾环保	324,594.94	0.75
3	600516	方大炭素	316,162.17	0.73
4	600176	中国巨石	297,330.33	0.69
5	002405	四维图新	264,014.90	0.61
6	002422	科伦药业	252,667.60	0.59
7	603019	中科曙光	246,984.02	0.57
8	600201	生物股份	242,784.17	0.56
9	000786	北新建材	237,224.14	0.55
10	000592	平潭发展	231,419.12	0.54
11	002271	东方雨虹	218,716.00	0.51
12	002001	新和成	210,742.39	0.49
13	000031	中粮地产	209,864.00	0.49
14	000830	鲁西化工	197,998.35	0.46
15	000998	隆平高科	196,206.80	0.45
16	600525	长园集团	193,907.03	0.45
17	000806	银河生物	193,897.55	0.45
18	600521	华海药业	191,239.24	0.44
19	600004	白云机场	190,820.00	0.44
20	002179	中航光电	189,904.35	0.44

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,026,751.72
卖出股票收入（成交）总额	38,569,033.02

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,448.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,523.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
718	3,231.17	640,363.00	27.60%	1,679,615.00	72.40%

注：已包含场外持有人。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张建霞	104,900.00	6.18%
2	谭锦祥	75,400.00	4.44%
3	朱洪武	72,870.00	4.30%
4	刘健	63,564.00	3.75%
5	张琳	57,100.00	3.37%
6	杨效建	47,800.00	2.82%
7	吕爱平	43,900.00	2.59%
8	刘书云	30,900.00	1.82%
9	林涛	30,000.00	1.77%
10	陈思	28,000.00	1.65%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年8月27日)基金份额总额	295,259,000.00
本报告期期初基金份额总额	6,632,005.00
本报告期基金总申购份额	1,223,463.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,535,490.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,319,978.00

注：期初基金总份额包含场外份额 5,535,490 份；期末基金总份额包含场外份额 623,463 份；总申购份额包含场外总申购份额 623,463 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 5,535,490 份。

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	43,191,867.97	90.83%	-	-	-
中信证券	2	1,763,375.07	3.71%	881.99	40.20%	-
中信建投	3	1,195,636.08	2.51%	598.04	27.26%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	1,370,905.22	2.88%	685.67	31.25%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	30,544.00	0.06%	28.50	1.30%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增长城证券股份有限公司、国盛证券有限责任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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	4,596.56	39.27%	-	-	-	-
中信建投	992.00	8.47%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	6,117.60	52.26%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-01-23
2	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-22
3	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-23
4	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-29
5	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、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2018-06-08
6	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-07-13
7	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-07-20
8	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-07-24
9	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-07
10	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-08
11	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-09
12	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-10
13	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-18
14	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资	中国证券报、上海证券	2018-08-21

	基金场内交易价格波动提示公告	报、证券时报及基金管理人网站	
15	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-22
16	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-23
17	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-24
18	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-25
19	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-28
20	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-29
21	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-30
22	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-31
23	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-01
24	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-04
25	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-05
26	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-06
27	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-07
28	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-08

29	关于易方达基金管理有限公司北京直销中心办公地址变更的公告	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	2018-09-10
30	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-11
31	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-12
32	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-13
33	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-14
34	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-15
35	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-18
36	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-19
37	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-20
38	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-21
39	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-22
40	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-26
41	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-27
42	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-28
43	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2018-09-29

		理人网站	
44	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-09
45	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-10
46	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-11
47	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-12
48	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-13
49	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-16
50	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-17
51	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-18
52	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-19
53	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-20
54	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-23
55	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-24
56	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-25
57	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-10-27
58	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF	中国证券报、上海证券	2018-12-05

基金增加国盛证券为申购赎回代办证券公司的公告	报、证券时报及基金管理人网站
------------------------	----------------

§ 12影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年06月15日~2018年12月31日	-	623,463.00	-	623,463.00	26.87%
	2	2018年01月01日~2018年02月01日	1,543,082.00	-	1,543,082.00	-	-
	3	2018年01月01日~2018年02月01日	1,543,082.00	-	1,543,082.00	-	-
	4	2018年01月01日~2018年04月01日	2,449,326.00	-	2,449,326.00	-	-
个人	1	2018年10月23日	-	663,800.00	663,800.00	-	-
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。

§ 13备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年三月二十八日