

易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

金

2019 年半年度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金托管人中国工商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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达中证 500ETF
场内简称	ZZ500ETF
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	139,429,797.00 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，基金管理人可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

2.4 信息披露方式

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

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	-3,352,946.18
本期利润	-10,961,295.99
加权平均基金份额本期利润	-0.2998
本期基金份额净值增长率	19.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-1.5067
期末基金资产净值	694,796,179.53
期末基金份额净值	4.9831

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.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

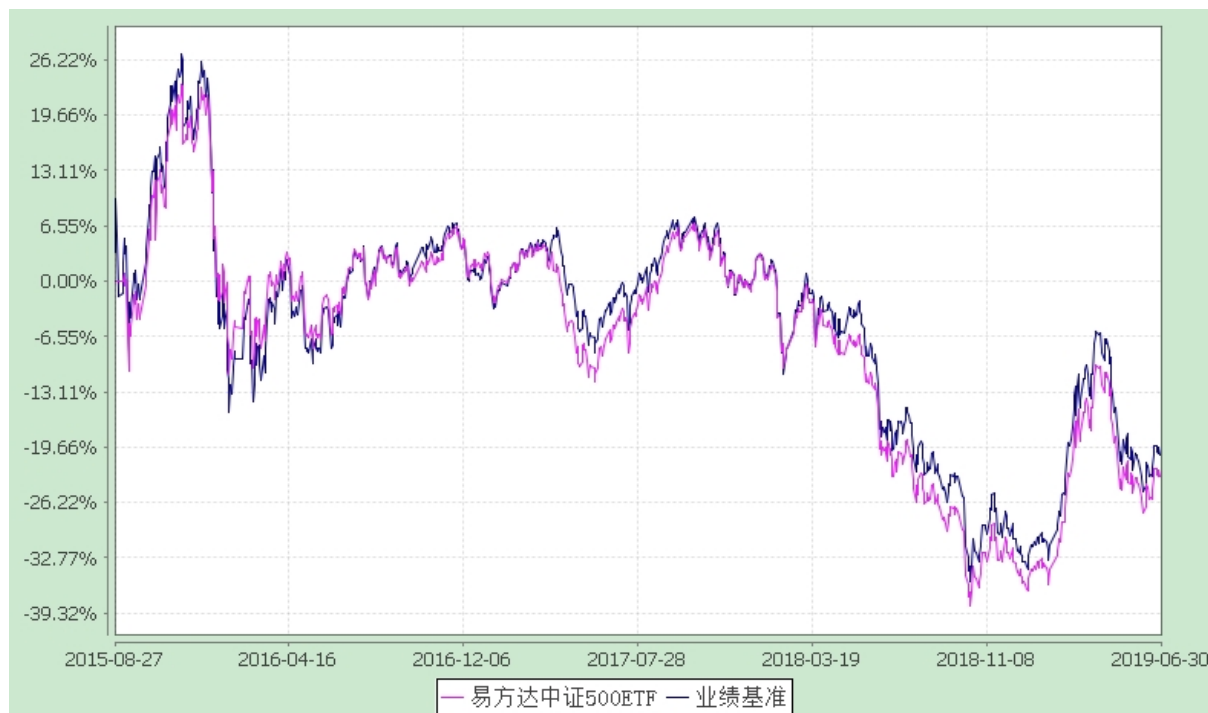
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.97%	1.41%	0.78%	1.39%	0.19%	0.02%
过去三个月	-9.70%	1.81%	-10.76%	1.81%	1.06%	0.00%
过去六个月	19.79%	1.77%	18.77%	1.79%	1.02%	-0.02%
过去一年	-4.78%	1.66%	-5.12%	1.69%	0.34%	-0.03%
过去三年	-22.14%	1.26%	-19.16%	1.31%	-2.98%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-23.21%	1.50%	-20.65%	1.66%	-2.56%	-0.16%

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 2019 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-23.21%，同期业绩比较基准收益率为-20.65%。

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		
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、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达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	2016-04-16	-	14 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。

	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				
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式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、解决方案部总经理助理	2017-06-23	-	10 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、指数与量化投资部高级账户经理。

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2019 年上半年国内宏观经济仍处于寻底过程中，在宏观经济持续走弱的背景下，年初以来政府通过多种手段对冲经济下行的压力，在一系列逆周期调节政策下，一季度 GDP 实际增速维持在 6.4%，与前值持平，经济的提前企稳，也使得二季度的宏观政策基本呈现边际收紧的迹象，伴随财政、货币政策逆周期调节政策的减弱，投资、消费、进出口数据均出现了环比放缓的态势；同时叠加 5 月初以来的中美贸易谈判局势恶化，国内外不确定性因素在二季度再次增加。2019 年年初以来，全球主要央行货币政策转向带来市场风险偏好的改善，在市场估值处于历史底部、强政策预期以及无风险利率的快速下行等因素共同驱动下，上半年 A 股市场在经历了一波快速上涨后在 4 月中旬以后转为颓势，在美国主导的贸易争端仍可能蔓延升级的背景下，投资者对全球经济前景的担忧在二季度有所加深，金融市场也因此动荡加剧，导致各类风险资产的前期涨幅均有所收窄。上半年 A 股市场表现优异，市场主流指数均录得不错的回报，最终上半年上证综指以上涨 19.45% 收官，所有板块均普涨。风格方面，大盘股表现好于中小盘股，上证 50 指数、中证 500 指数分别上涨 27.80%、18.77%；行业方面，食品饮料、非银行金融、农林牧渔、家用电器、计算机等板块领涨，建筑装饰、钢铁、传媒、纺织服装等板块表现相对落后。

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 4.9831 元，本报告期份额净值增长率为 19.79%，同期业绩比较基准收益率为 18.77%，日跟踪偏离度的均值为 0.03%，年化跟踪误差为 0.668%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国宏观经济仍将面临下行压力。宏观经济在二季度出现疲弱态势，下半年经济下行压力主要来自房地产投资后继乏力、制造业投资受挤出和利润压制、外需与贸易摩擦拖累出口这三个方面；但逆周期政策调控力度加强，基建投资的改善和消费增速的企稳有望起到托底经济的作用。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。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，未来 A 股市场仍然会经历风险继续释放与投资机会显现的阶段。A 股市场下半年将受到三方面的影响：宏观经济增长预

期的下修，上市公司盈利预期的下滑；中美贸易谈判的不确定性；市场改革开放红利的释放、稳增长政策加码及境外资金的流入。总体而言，A 股市场将面临风险的逐步出清，但政策红利的支撑使得这种出清带来的下行空间有限。A 股市场的机遇来自于不确定性的落地，稳健优质的龙头上市公司仍将是较为受益的结构性投资机会。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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自本报告期初至 2019 年 1 月 24 日，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。

自本报告期初至 2019 年 1 月 24 日，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 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 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	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	22,824,679.86	363,796.96
结算备付金	2,713,413.21	4,140.08
存出保证金	3,003,493.41	1,448.54
交易性金融资产	667,153,042.39	9,357,603.12
其中：股票投资	667,026,043.18	9,357,603.12

基金投资	-	-
债券投资	126,999.21	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	46,852,132.18	-
应收利息	5,136.31	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	742,551,897.36	9,727,063.93
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	39,129,241.14	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	54,808.59	4,258.82
应付托管费	18,269.51	851.77
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	63,056.92	755.46
应交税费	8,181.57	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	8,482,160.10	70,000.00
负债合计	47,755,717.83	75,866.05
所有者权益：		
实收基金	904,875,693.20	15,056,261.44
未分配利润	-210,079,513.67	-5,405,063.56
所有者权益合计	694,796,179.53	9,651,197.88
负债和所有者权益总计	742,551,897.36	9,727,063.93

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.9831 元，基金份额总额 139,429,797.00 份。

6.2 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：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	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	-10,249,268.30	-2,473,084.59
1.利息收入	23,064.04	4,975.33
其中：存款利息收入	23,038.22	4,975.33
债券利息收入	25.82	-
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）	-3,948,350.38	-1,634,110.09
其中：股票投资收益	-7,577,619.22	-1,673,290.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,849.61	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	290,679.62	-
股利收益	3,326,739.61	39,180.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-7,608,349.81	-897,845.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,284,367.85	53,895.69
减：二、费用	712,027.69	386,016.29
1. 管理人报酬	220,195.00	41,795.98
2. 托管费	57,373.85	8,359.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	289,402.47	41,800.09
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	1,046.47	-
7. 其他费用	144,009.90	294,061.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-10,961,295.99	-2,859,100.88
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-10,961,295.99	-2,859,100.88

6.3 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：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）	15,056,261.44	-5,405,063.56	9,651,197.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,961,295.99	-10,961,295.99
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）	889,819,431.76	-193,713,154.12	696,106,277.64
其中：1.基金申购款	1,096,196,028.83	-243,580,600.58	852,615,428.25
2.基金赎回款	-206,376,597.07	49,867,446.46	-156,509,150.61
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）	904,875,693.20	-210,079,513.67	694,796,179.53
项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 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）	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）	-	-2,859,100.88	-2,859,100.88
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）	-31,877,429.02	611,305.68	-31,266,123.34
其中：1.基金申购款	4,046,187.75	-547,936.88	3,498,250.87
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）	11,162,363.80	-2,161,641.66	9,000,722.14

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。

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。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	220,195.00	41,795.98
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

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”。

6.4.8.2.2 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1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,373.85	8,359.22

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。

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”。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
报告期初持有的基金份额	623,463.00	-
报告期间申购/买入总份额	8,109,819.00	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	8,733,282.00	623,463.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.26%	36.25%
---------------------	-------	--------

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.8.4.2 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
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	104,771,100.00	75.14%	-	-
广发证券	1,382,300.00	0.99%	-	-

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。

6.4.8.5 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1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
中国工商银行-活期存款	22,824,679.86	16,417.99	598,438.02	3,947.69

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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	-
6.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113027	华钰转债	2019-06-17	2019-07-10	新发流通受限	100.00	100.00	150	14,999.70	14,999.70	-
113028	环境转债	2019-06-19	2019-07-08	新发流通受限	100.00	100.00	1,120	111,999.51	111,999.51	-

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 667,153,042.39 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 9,300,808.62 元,第二层次 56,794.50 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	667,026,043.18	89.83
	其中:股票	667,026,043.18	89.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,999.21	0.02
	其中:债券	126,999.21	0.02

	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	25,538,093.07	3.44
8	其他各项资产	49,860,761.90	6.71
9	合计	742,551,897.36	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	7,228,902.30	1.04
B	采矿业	21,168,992.86	3.05
C	制造业	373,013,759.11	53.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,135,802.60	3.04
E	建筑业	11,745,544.22	1.69
F	批发和零售业	35,596,941.79	5.12
G	交通运输、仓储和邮政业	22,199,123.62	3.20
H	住宿和餐饮业	2,648,759.20	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,018,523.70	9.50
J	金融业	29,806,024.52	4.29
K	房地产业	30,954,108.30	4.46
L	租赁和商务服务业	9,377,522.81	1.35
M	科学研究和技术服务业	879,174.90	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	5,973,675.19	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,257,984.16	0.32
Q	卫生和社会工作	3,864,733.20	0.56
R	文化、体育和娱乐业	13,945,163.90	2.01
S	综合	9,212,202.80	1.33

	合计	667,026,939.18	96.00
--	----	----------------	-------

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002405	四维图新	278,700	4,487,070.00	0.65
2	000860	顺鑫农业	90,816	4,236,566.40	0.61
3	600872	中炬高新	95,050	4,070,991.50	0.59
4	002157	正邦科技	206,300	3,436,958.00	0.49
5	603444	吉比特	15,630	3,281,674.80	0.47
6	300253	卫宁健康	227,000	3,218,860.00	0.46
7	000066	中国长城	312,080	3,208,182.40	0.46
8	600201	生物股份	203,419	3,191,644.11	0.46
9	002049	紫光国微	72,090	3,179,889.90	0.46
10	002195	二三四五	810,782	3,153,941.98	0.45

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的半年度报告正文。

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	002405	四维图新	5,882,284.50	60.95
2	000860	顺鑫农业	4,829,620.83	50.04
3	002195	二三四五	3,985,089.00	41.29
4	002049	紫光国微	3,977,921.00	41.22
5	000066	中国长城	3,940,717.40	40.83
6	002157	正邦科技	3,870,931.76	40.11
7	002129	中环股份	3,745,896.13	38.81
8	300253	卫宁健康	3,666,149.56	37.99
9	002268	卫士通	3,623,981.20	37.55
10	000401	冀东水泥	3,614,120.00	37.45
11	000623	吉林敖东	3,607,941.45	37.38
12	300450	先导智能	3,595,192.85	37.25
13	300383	光环新网	3,552,966.46	36.81
14	000750	国海证券	3,517,716.50	36.45
15	002465	海格通信	3,462,599.70	35.88
16	002439	启明星辰	3,459,260.24	35.84

17	002506	协鑫集成	3,435,557.99	35.60
18	002127	南极电商	3,403,867.75	35.27
19	002384	东山精密	3,353,152.50	34.74
20	002223	鱼跃医疗	3,345,540.00	34.66
21	002507	涪陵榨菜	3,329,181.61	34.50
22	002340	格林美	3,328,954.00	34.49
23	300347	泰格医药	3,244,423.00	33.62
24	000723	美锦能源	3,226,499.00	33.43
25	002500	山西证券	3,167,672.00	32.82
26	002385	大北农	3,047,834.00	31.58
27	002371	北方华创	2,997,646.00	31.06
28	000998	隆平高科	2,974,042.00	30.82
29	002373	千方科技	2,972,191.01	30.80
30	000975	银泰资源	2,945,321.67	30.52
31	000778	新兴铸管	2,932,762.00	30.39
32	000686	东北证券	2,916,770.52	30.22
33	000830	鲁西化工	2,900,256.00	30.05
34	000009	中国宝安	2,900,255.40	30.05
35	000997	新大陆	2,888,086.57	29.92
36	002092	中泰化学	2,886,607.00	29.91
37	002463	沪电股份	2,878,141.00	29.82
38	002410	广联达	2,871,100.92	29.75
39	002299	圣农发展	2,866,055.90	29.70
40	000581	威孚高科	2,839,537.92	29.42
41	000060	中金岭南	2,819,265.00	29.21
42	002075	沙钢股份	2,784,927.40	28.86
43	000690	宝新能源	2,771,422.50	28.72
44	002916	深南电路	2,704,298.44	28.02
45	300168	万达信息	2,695,012.38	27.92
46	000039	中集集团	2,602,656.14	26.97
47	000960	锡业股份	2,583,869.00	26.77
48	000656	金科股份	2,552,016.31	26.44
49	000547	航天发展	2,521,281.00	26.12
50	002353	杰瑞股份	2,513,244.88	26.04
51	002926	华西证券	2,513,035.00	26.04
52	000988	华工科技	2,506,266.00	25.97
53	002221	东华能源	2,497,664.25	25.88
54	300146	汤臣倍健	2,469,180.00	25.58
55	002191	劲嘉股份	2,444,310.88	25.33
56	002797	第一创业	2,438,627.77	25.27
57	002074	国轩高科	2,394,608.00	24.81
58	002078	太阳纸业	2,384,601.00	24.71
59	000999	华润三九	2,365,961.44	24.51
60	002281	光迅科技	2,351,426.14	24.36

61	300315	掌趣科技	2,327,128.70	24.11
62	300027	华谊兄弟	2,325,465.44	24.10
63	002821	凯莱英	2,292,628.00	23.75
64	300274	阳光电源	2,286,960.00	23.70
65	002372	伟星新材	2,260,301.16	23.42
66	002273	水晶光电	2,224,492.00	23.05
67	000729	燕京啤酒	2,218,188.00	22.98
68	002110	三钢闽光	2,209,127.68	22.89
69	002572	索菲亚	2,207,381.00	22.87
70	300166	东方国信	2,181,395.00	22.60
71	000636	风华高科	2,180,173.00	22.59
72	300001	特锐德	2,180,025.80	22.59
73	000970	中科三环	2,168,474.00	22.47
74	300088	长信科技	2,164,808.00	22.43
75	002174	游族网络	2,129,141.28	22.06
76	002019	亿帆医药	2,127,395.01	22.04
77	002131	利欧股份	2,119,127.44	21.96
78	002440	闰土股份	2,105,133.50	21.81
79	002038	双鹭药业	2,081,975.93	21.57
80	000089	深圳机场	2,062,162.00	21.37
81	000878	云南铜业	2,055,105.63	21.29
82	002217	合力泰	2,024,245.00	20.97
83	000930	中粮生化	2,022,087.47	20.95
84	000563	陕国投 A	2,001,281.90	20.74
85	002670	国盛金控	1,999,606.05	20.72
86	300418	昆仑万维	1,981,786.00	20.53
87	000008	神州高铁	1,980,192.96	20.52
88	002387	维信诺	1,967,622.00	20.39
89	002589	瑞康医药	1,959,921.00	20.31
90	002583	海能达	1,959,759.00	20.31
91	000559	万向钱潮	1,936,088.05	20.06
92	002002	鸿达兴业	1,911,277.00	19.80
93	000932	华菱钢铁	1,903,351.00	19.72
94	300009	安科生物	1,902,125.00	19.71
95	002470	金正大	1,898,927.87	19.68
96	300182	捷成股份	1,887,123.00	19.55
97	000681	视觉中国	1,887,065.97	19.55
98	000598	兴蓉环境	1,884,384.00	19.52
99	000732	泰禾集团	1,874,053.58	19.42
100	000513	丽珠集团	1,869,537.70	19.37
101	002399	海普瑞	1,838,408.00	19.05
102	002152	广电运通	1,831,978.52	18.98
103	000738	航发控制	1,831,256.42	18.97
104	000983	西山煤电	1,807,403.00	18.73

105	002250	联化科技	1,803,653.00	18.69
106	000813	德展健康	1,802,045.00	18.67
107	002368	太极股份	1,800,887.24	18.66
108	300316	晶盛机电	1,784,949.70	18.49
109	002004	华邦健康	1,761,166.50	18.25
110	002085	万丰奥威	1,756,778.15	18.20
111	002155	湖南黄金	1,756,430.00	18.20
112	000596	古井贡酒	1,752,632.15	18.16
113	000887	中鼎股份	1,750,586.28	18.14
114	000807	云铝股份	1,732,707.39	17.95
115	000031	大悦城	1,726,691.89	17.89
116	002183	怡亚通	1,725,515.00	17.88
117	300058	蓝色光标	1,722,582.00	17.85
118	000488	晨鸣纸业	1,718,871.36	17.81
119	002266	浙富控股	1,717,652.87	17.80
120	002233	塔牌集团	1,710,323.00	17.72
121	000685	中山公用	1,693,807.00	17.55
122	002603	以岭药业	1,684,394.76	17.45
123	002407	多氟多	1,679,287.00	17.40
124	002607	中公教育	1,665,090.00	17.25
125	600739	辽宁成大	1,663,525.80	17.24
126	000027	深圳能源	1,653,547.00	17.13
127	002690	美亚光电	1,645,434.08	17.05
128	000758	中色股份	1,639,194.00	16.98
129	002212	南洋股份	1,630,577.00	16.90
130	000528	柳工	1,621,899.70	16.81
131	300113	顺网科技	1,620,441.00	16.79
132	300207	欣旺达	1,619,107.00	16.78
133	002408	齐翔腾达	1,602,786.43	16.61
134	600763	通策医疗	1,598,186.31	16.56
135	000883	湖北能源	1,588,647.00	16.46
136	002176	江特电机	1,565,000.00	16.22
137	002242	九阳股份	1,559,029.70	16.15
138	002244	滨江集团	1,551,159.00	16.07
139	002358	森源电气	1,543,857.00	16.00
140	000877	天山股份	1,534,768.00	15.90
141	300244	迪安诊断	1,531,871.76	15.87
142	002640	跨境通	1,528,531.00	15.84
143	002013	中航机电	1,523,521.00	15.79
144	002414	高德红外	1,522,377.66	15.77
145	300324	旋极信息	1,517,712.00	15.73
146	300002	神州泰岳	1,517,563.00	15.72
147	300133	华策影视	1,504,772.40	15.59
148	002701	奥瑞金	1,503,687.00	15.58

149	000826	启迪桑德	1,498,294.00	15.52
150	300413	芒果超媒	1,497,547.00	15.52
151	002030	达安基因	1,479,197.84	15.33
152	002051	中工国际	1,468,207.48	15.21
153	002491	通鼎互联	1,461,755.00	15.15
154	000156	华数传媒	1,461,002.67	15.14
155	002426	胜利精密	1,454,336.00	15.07
156	002665	首航节能	1,438,128.00	14.90
157	000712	锦龙股份	1,437,020.00	14.89
158	000021	深科技	1,423,975.00	14.75
159	300115	长盈精密	1,421,924.00	14.73
160	300026	红日药业	1,421,892.00	14.73
161	002064	华峰氨纶	1,409,110.37	14.60
162	002285	世联行	1,404,584.00	14.55
163	300010	立思辰	1,404,156.00	14.55
164	600745	闻泰科技	1,403,426.00	14.54
165	000078	海王生物	1,396,344.00	14.47
166	000090	天健集团	1,382,905.65	14.33
167	000727	华东科技	1,380,301.00	14.30
168	002056	横店东磁	1,376,607.00	14.26
169	600497	驰宏锌锗	1,367,337.00	14.17
170	002128	露天煤业	1,359,775.00	14.09
171	600549	厦门钨业	1,350,766.00	14.00
172	000400	许继电气	1,346,241.00	13.95
173	002280	联络互动	1,345,982.50	13.95
174	000717	韶钢松山	1,312,353.00	13.60
175	002505	大康农业	1,309,336.00	13.57
176	000028	国药一致	1,309,037.00	13.56
177	300197	铁汉生态	1,308,500.00	13.56
178	002249	大洋电机	1,293,014.00	13.40
179	002812	恩捷股份	1,282,581.00	13.29
180	000718	苏宁环球	1,275,809.00	13.22
181	002831	裕同科技	1,262,291.40	13.08
182	000301	东方盛虹	1,256,350.00	13.02
183	000158	常山北明	1,256,269.63	13.02
184	002424	贵州百灵	1,248,554.00	12.94
185	002317	众生药业	1,246,926.00	12.92
186	000006	深振业 A	1,245,886.00	12.91
187	002028	思源电气	1,238,889.00	12.84
188	000519	中兵红箭	1,238,244.25	12.83
189	300134	大富科技	1,233,946.29	12.79
190	002839	张家港行	1,232,351.00	12.77
191	002366	台海核电	1,232,173.00	12.77
192	002302	西部建设	1,231,829.00	12.76

193	000564	供销大集	1,218,438.00	12.62
194	000012	南玻 A	1,216,149.00	12.60
195	000848	承德露露	1,211,255.60	12.55
196	000980	众泰汽车	1,208,451.00	12.52
197	000926	福星股份	1,204,251.00	12.48
198	002419	天虹股份	1,200,571.06	12.44
199	300459	金科文化	1,194,431.56	12.38
200	300287	飞利信	1,190,020.00	12.33
201	300055	万邦达	1,185,765.00	12.29
202	000543	皖能电力	1,184,188.00	12.27
203	002672	东江环保	1,181,098.89	12.24
204	000600	建投能源	1,164,045.00	12.06
205	002444	巨星科技	1,161,662.00	12.04
206	002390	信邦制药	1,158,966.00	12.01
207	002807	江阴银行	1,158,585.16	12.00
208	300308	中际旭创	1,150,196.40	11.92
209	002573	清新环境	1,148,078.40	11.90
210	600909	华安证券	1,145,613.00	11.87
211	002431	棕榈股份	1,144,511.50	11.86
212	300199	翰宇药业	1,120,998.66	11.62
213	002254	泰和新材	1,119,836.00	11.60
214	601333	广深铁路	1,115,447.00	11.56
215	300376	易事特	1,111,531.00	11.52
216	002544	杰赛科技	1,095,747.00	11.35
217	000990	诚志股份	1,093,609.00	11.33
218	002332	仙琚制药	1,088,608.00	11.28
219	300159	新研股份	1,064,334.00	11.03
220	002745	木林森	1,059,497.00	10.98
221	300297	蓝盾股份	1,058,940.00	10.97
222	000062	深圳华强	1,052,001.35	10.90
223	002635	安洁科技	1,046,308.00	10.84
224	002093	国脉科技	1,045,456.90	10.83
225	000959	首钢股份	1,033,937.00	10.71
226	300266	兴源环境	1,024,815.00	10.62
227	002048	宁波华翔	1,023,812.00	10.61
228	600486	扬农化工	1,022,760.00	10.60
229	600521	华海药业	1,019,839.00	10.57
230	601699	潞安环能	1,002,706.00	10.39
231	000537	广宇发展	997,894.00	10.34
232	000667	美好置业	987,915.00	10.24
233	000937	冀中能源	978,746.00	10.14
234	002118	紫鑫药业	977,113.16	10.12
235	300257	开山股份	972,382.00	10.08
236	000418	小天鹅 A	961,692.00	9.96

237	000426	兴业矿业	957,801.00	9.92
238	002503	搜于特	952,326.00	9.87
239	603939	益丰药房	951,226.00	9.86
240	601118	海南橡胶	940,164.49	9.74
241	002375	亚厦股份	927,078.00	9.61
242	000501	鄂武商 A	925,238.00	9.59
243	000333	美的集团	911,845.19	9.45
244	000061	农产品	895,394.60	9.28
245	002517	恺英网络	892,164.50	9.24
246	600845	宝信软件	884,339.56	9.16
247	002509	天广中茂	875,351.00	9.07
248	002489	浙江永强	871,782.00	9.03
249	000766	通化金马	871,501.00	9.03
250	002815	崇达技术	868,604.61	9.00
251	000536	华映科技	867,318.00	8.99
252	002400	省广集团	849,601.00	8.80
253	002437	誉衡药业	834,255.00	8.64
254	002707	众信旅游	833,132.00	8.63
255	603517	绝味食品	832,860.00	8.63
256	002709	天赐材料	825,710.00	8.56
257	002512	达华智能	813,864.00	8.43
258	002434	万里扬	813,320.00	8.43
259	002563	森马服饰	790,942.00	8.20
260	600515	海航基础	788,942.00	8.17
261	000829	天音控股	786,701.17	8.15
262	002920	德赛西威	779,366.15	8.08
263	000541	佛山照明	776,096.70	8.04
264	002482	广田集团	757,493.00	7.85
265	002681	奋达科技	756,076.00	7.83
266	002251	步步高	755,931.00	7.83
267	000552	靖远煤电	751,397.34	7.79
268	000869	张裕 A	747,129.00	7.74
269	002818	富森美	715,773.70	7.42
270	000612	焦作万方	707,914.40	7.33
271	002382	蓝帆医疗	701,588.00	7.27
272	002344	海宁皮城	690,729.00	7.16
273	000025	特力 A	680,837.60	7.05
274	000969	安泰科技	667,562.00	6.92
275	002276	万马股份	642,834.00	6.66
276	002948	青岛银行	642,506.00	6.66
277	601611	中国核建	636,127.00	6.59
278	603501	韦尔股份	620,093.00	6.43
279	002936	郑州银行	601,584.00	6.23
280	002699	美盛文化	580,132.00	6.01

281	002663	普邦股份	577,103.00	5.98
282	600317	营口港	543,104.00	5.63
283	000987	越秀金控	540,904.00	5.60
284	002277	友阿股份	511,707.00	5.30
285	600872	中炬高新	509,980.00	5.28
286	000049	德赛电池	502,268.99	5.20
287	002416	爱施德	486,461.00	5.04
288	002941	新疆交建	470,647.50	4.88
289	002308	威创股份	463,960.00	4.81
290	600536	中国软件	423,410.00	4.39
291	002588	史丹利	419,916.00	4.35
292	002354	天神娱乐	403,815.00	4.18
293	603444	吉比特	399,537.00	4.14
294	002041	登海种业	389,300.00	4.03
295	600707	彩虹股份	377,400.48	3.91
296	600748	上实发展	368,385.00	3.82
297	002359	*ST 北讯	365,388.00	3.79
298	000761	本钢板材	363,212.00	3.76
299	600642	申能股份	360,532.00	3.74
300	600848	上海临港	356,892.00	3.70
301	600037	歌华有线	355,497.00	3.68
302	600779	水井坊	355,097.00	3.68
303	600426	华鲁恒升	343,819.00	3.56
304	600959	江苏有线	339,855.00	3.52
305	601139	深圳燃气	335,971.00	3.48
306	002345	潮宏基	324,296.00	3.36
307	600754	锦江股份	322,087.00	3.34
308	600201	生物股份	321,422.00	3.33
309	601019	山东出版	319,364.00	3.31
310	600777	新潮能源	316,272.00	3.28
311	300291	华录百纳	314,858.66	3.26
312	603659	璞泰来	301,248.00	3.12
313	002946	新乳业	300,448.00	3.11
314	600903	贵州燃气	297,811.00	3.09
315	600801	华新水泥	297,570.00	3.08
316	601615	明阳智能	294,740.00	3.05
317	603228	景旺电子	293,216.00	3.04
318	603712	七一二	293,012.00	3.04
319	000587	金洲慈航	291,860.63	3.02
320	600879	航天电子	284,997.00	2.95
321	600584	长电科技	284,197.00	2.94
322	600183	生益科技	277,357.00	2.87
323	600325	华发股份	275,892.00	2.86
324	601128	常熟银行	272,164.00	2.82

325	300202	聚龙股份	271,659.00	2.81
326	600989	宝丰能源	270,838.72	2.81
327	600699	均胜电子	270,326.00	2.80
328	300156	神雾环保	267,600.00	2.77
329	600435	北方导航	266,919.00	2.77
330	603056	德邦股份	266,696.00	2.76
331	600820	隧道股份	264,365.00	2.74
332	600094	大名城	261,419.00	2.71
333	600648	外高桥	259,958.00	2.69
334	603369	今世缘	257,373.00	2.67
335	600410	华胜天成	256,852.00	2.66
336	600895	张江高科	255,371.00	2.65
337	600600	青岛啤酒	250,491.00	2.60
338	600804	鹏博士	248,752.00	2.58
339	603000	人民网	248,271.00	2.57
340	601068	中铝国际	247,815.00	2.57
341	600376	首开股份	246,599.00	2.56
342	600885	宏发股份	238,868.00	2.48
343	600298	安琪酵母	235,552.00	2.44
344	002477	*ST 雏鹰	235,101.00	2.44
345	600277	亿利洁能	234,954.00	2.43
346	601168	西部矿业	234,784.00	2.43
347	600572	康恩贝	228,949.00	2.37
348	600755	厦门国贸	223,545.12	2.32
349	600985	淮北矿业	223,216.71	2.31
350	600315	上海家化	223,046.00	2.31
351	600673	东阳光	222,589.00	2.31
352	600875	东方电气	220,945.00	2.29
353	601005	重庆钢铁	220,895.00	2.29
354	600373	中文传媒	220,066.00	2.28
355	600718	东软集团	217,876.00	2.26
356	002642	*ST 荣联	216,229.00	2.24
357	601872	招商轮船	215,016.00	2.23
358	600839	四川长虹	213,695.00	2.21
359	603866	桃李面包	213,379.80	2.21
360	600567	山鹰纸业	209,684.00	2.17
361	600580	卧龙电驱	208,336.00	2.16
362	600143	金发科技	207,397.16	2.15
363	600808	马钢股份	204,595.00	2.12
364	600643	爱建集团	203,688.00	2.11
365	600633	浙数文化	203,581.00	2.11
366	603377	东方时尚	202,359.00	2.10
367	600282	南钢股份	201,969.00	2.09
368	600167	联美控股	201,525.60	2.09

369	600862	中航高科	200,492.00	2.08
370	600881	亚泰集团	199,205.00	2.06
371	600460	士兰微	198,551.00	2.06
372	601866	中远海发	196,044.00	2.03
373	600161	天坛生物	195,371.00	2.02
374	600160	巨化股份	194,333.00	2.01
375	600782	新钢股份	193,178.00	2.00
376	600458	时代新材	193,164.00	2.00

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300347	泰格医药	3,314,037.40	34.34
2	002410	广联达	3,012,486.24	31.21
3	000656	金科股份	2,419,104.50	25.07
4	300146	汤臣倍健	2,249,314.84	23.31
5	000596	古井贡酒	1,845,108.86	19.12
6	600600	青岛啤酒	1,783,619.60	18.48
7	300413	芒果超媒	1,453,657.00	15.06
8	600256	广汇能源	1,452,995.70	15.06
9	002013	中航机电	1,430,997.32	14.83
10	002405	四维图新	1,355,031.50	14.04
11	603444	吉比特	1,331,205.00	13.79
12	002371	北方华创	1,144,140.95	11.85
13	000418	小天鹅 A	1,062,706.19	11.01
14	603899	晨光文具	1,055,575.00	10.94
15	002916	深南电路	1,022,966.00	10.60
16	000860	顺鑫农业	1,008,939.20	10.45
17	000667	美好置业	1,000,225.00	10.36
18	600655	豫园股份	998,875.61	10.35
19	000066	中国长城	972,696.00	10.08
20	002129	中环股份	930,324.00	9.64
21	000623	吉林敖东	919,479.00	9.53
22	000401	冀东水泥	917,940.00	9.51
23	300383	光环新网	914,044.00	9.47
24	000333	美的集团	911,160.75	9.44
25	002268	卫士通	872,279.00	9.04
26	000750	国海证券	828,073.00	8.58
27	002049	紫光国微	816,953.00	8.46
28	000612	焦作万方	798,427.20	8.27

29	002465	海格通信	782,127.00	8.10
30	000969	安泰科技	776,287.64	8.04
31	002223	鱼跃医疗	775,292.00	8.03
32	601598	中国外运	770,149.73	7.98
33	603658	安图生物	768,552.90	7.96
34	002400	省广集团	768,041.80	7.96
35	002384	东山精密	766,388.00	7.94
36	002563	森马服饰	756,175.00	7.84
37	002195	二三四五	755,634.00	7.83
38	002500	山西证券	745,708.00	7.73
39	300450	先导智能	741,039.00	7.68
40	600366	宁波韵升	732,413.56	7.59
41	000686	东北证券	727,610.00	7.54
42	000723	美锦能源	723,645.00	7.50
43	600779	水井坊	698,849.00	7.24
44	000581	威孚高科	698,182.00	7.23
45	000009	中国宝安	691,657.98	7.17
46	000060	中金岭南	682,345.00	7.07
47	002463	沪电股份	680,013.00	7.05
48	000778	新兴铸管	675,390.00	7.00
49	002373	千方科技	673,959.00	6.98
50	000997	新大陆	671,363.00	6.96
51	002299	圣农发展	667,916.00	6.92
52	000830	鲁西化工	658,656.00	6.82
53	002507	涪陵榨菜	653,975.00	6.78
54	002092	中泰化学	652,760.12	6.76
55	300253	卫宁健康	633,231.87	6.56
56	600503	华丽家族	631,722.50	6.55
57	000690	宝新能源	628,639.00	6.51
58	002506	协鑫集成	625,702.00	6.48
59	002221	东华能源	625,655.00	6.48
60	000998	隆平高科	617,742.33	6.40
61	000008	神州高铁	606,100.00	6.28
62	002385	大北农	599,855.00	6.22
63	002340	格林美	595,914.77	6.17
64	002041	登海种业	595,199.90	6.17
65	002127	南极电商	589,854.00	6.11
66	002276	万马股份	588,073.60	6.09
67	002439	启明星辰	583,570.00	6.05
68	002353	杰瑞股份	580,123.22	6.01
69	000960	锡业股份	579,664.00	6.01
70	000729	燕京啤酒	563,874.00	5.84
71	300027	华谊兄弟	563,551.02	5.84
72	300168	万达信息	562,949.00	5.83

73	002078	太阳纸业	561,845.00	5.82
74	000547	航天发展	556,240.00	5.76
75	000039	中集集团	556,029.00	5.76
76	000970	中科三环	553,263.14	5.73
77	300315	掌趣科技	542,559.00	5.62
78	002440	闰土股份	534,346.00	5.54
79	002663	普邦股份	526,503.00	5.46
80	000975	银泰资源	524,889.00	5.44
81	002191	劲嘉股份	519,764.00	5.39
82	000636	风华高科	514,875.00	5.33
83	300418	昆仑万维	504,773.00	5.23
84	000089	深圳机场	496,583.00	5.15
85	300088	长信科技	495,015.00	5.13
86	002583	海能达	494,584.00	5.12
87	300001	特锐德	490,591.76	5.08
88	002242	九阳股份	488,105.00	5.06
89	300166	东方国信	487,684.00	5.05
90	300113	顺网科技	482,891.30	5.00
91	000878	云南铜业	481,247.00	4.99
92	000738	航发控制	481,112.46	4.99
93	002277	友阿股份	480,538.60	4.98
94	002074	国轩高科	480,211.00	4.98
95	002131	利欧股份	479,617.86	4.97
96	000999	华润三九	477,480.00	4.95
97	300274	阳光电源	475,598.00	4.93
98	002019	亿帆医药	475,288.00	4.92
99	002407	多氟多	465,628.00	4.82
100	002372	伟星新材	459,188.12	4.76
101	000563	陕国投 A	457,783.00	4.74
102	000598	兴蓉环境	456,642.00	4.73
103	000930	中粮生化	456,131.00	4.73
104	002110	三钢闽光	448,836.50	4.65
105	002308	威创股份	447,562.50	4.64
106	002281	光迅科技	441,968.00	4.58
107	002152	广电运通	440,272.50	4.56
108	300459	金科文化	440,024.00	4.56
109	000049	德赛电池	439,240.40	4.55
110	000932	华菱钢铁	439,063.00	4.55
111	002176	江特电机	438,252.00	4.54
112	000031	大悦城	432,446.41	4.48
113	000559	万向钱潮	430,499.52	4.46
114	600872	中炬高新	428,462.00	4.44
115	002470	金正大	422,619.00	4.38
116	002273	水晶光电	420,109.17	4.35

117	002155	湖南黄金	416,522.00	4.32
118	002212	南洋股份	415,260.00	4.30
119	002358	森源电气	415,151.00	4.30
120	000988	华工科技	413,193.00	4.28
121	002250	联化科技	412,608.00	4.28
122	600989	宝丰能源	412,590.64	4.28
123	603486	科沃斯	411,647.80	4.27
124	000807	云铝股份	408,977.00	4.24
125	000027	深圳能源	407,491.00	4.22
126	002670	国盛金控	407,442.89	4.22
127	000732	泰禾集团	404,665.00	4.19
128	000758	中色股份	404,322.00	4.19
129	002588	史丹利	403,794.50	4.18
130	002174	游族网络	403,773.00	4.18
131	002368	太极股份	402,727.88	4.17
132	300115	长盈精密	400,088.00	4.15
133	000681	视觉中国	399,278.00	4.14
134	002030	达安基因	395,688.20	4.10
135	002399	海普瑞	394,551.00	4.09
136	000488	晨鸣纸业	394,018.00	4.08
137	002266	浙富控股	391,495.00	4.06
138	002603	以岭药业	390,988.00	4.05
139	000887	中鼎股份	389,418.00	4.03
140	000156	华数传媒	389,016.00	4.03
141	000712	锦龙股份	388,052.00	4.02
142	002051	中工国际	384,100.00	3.98
143	002589	瑞康医药	382,509.00	3.96
144	002038	双鹭药业	381,908.00	3.96
145	300316	晶盛机电	376,495.00	3.90
146	000528	柳工	376,020.00	3.90
147	002183	怡亚通	375,918.00	3.90
148	000685	中山公用	374,945.00	3.88
149	002056	横店东磁	372,527.00	3.86
150	300324	旋极信息	369,491.51	3.83
151	002244	滨江集团	365,883.00	3.79
152	002672	东江环保	362,180.00	3.75
153	002002	鸿达兴业	359,209.00	3.72
154	600773	西藏城投	357,889.00	3.71
155	300058	蓝色光标	352,948.00	3.66
156	601990	南京证券	350,964.00	3.64
157	002408	齐翔腾达	349,783.00	3.62
158	300002	神州泰岳	348,175.00	3.61
159	300010	立思辰	347,662.30	3.60
160	002004	华邦健康	347,229.00	3.60

161	300182	捷成股份	346,596.00	3.59
162	000813	德展健康	344,512.00	3.57
163	002064	华峰氨纶	341,770.84	3.54
164	300026	红日药业	341,102.00	3.53
165	002414	高德红外	340,181.00	3.52
166	300308	中际旭创	339,177.00	3.51
167	300244	迪安诊断	337,689.00	3.50
168	002254	泰和新材	335,574.00	3.48
169	002831	裕同科技	332,870.00	3.45
170	000513	丽珠集团	332,248.64	3.44
171	002354	天神娱乐	331,494.20	3.43
172	000877	天山股份	331,060.00	3.43
173	000021	深科技	329,374.00	3.41
174	000727	华东科技	327,274.00	3.39
175	600122	宏图高科	326,665.90	3.38
176	000062	深圳华强	326,039.00	3.38
177	002505	大康农业	325,279.00	3.37
178	600167	联美控股	321,442.70	3.33
179	002690	美亚光电	321,156.00	3.33
180	600594	益佰制药	320,218.20	3.32
181	601869	长飞光纤	320,139.00	3.32
182	000718	苏宁环球	315,581.00	3.27
183	000519	中兵红箭	314,190.00	3.26
184	002491	通鼎互联	312,866.00	3.24
185	000400	许继电气	312,015.00	3.23
186	300291	华录百纳	311,979.06	3.23
187	002345	潮宏基	311,786.97	3.23
188	002285	世联行	309,442.00	3.21
189	600086	东方金钰	307,387.76	3.18
190	002249	大洋电机	306,972.00	3.18
191	000006	深振业 A	304,725.00	3.16
192	000848	承德露露	302,678.00	3.14
193	000717	韶钢松山	299,749.00	3.11
194	300055	万邦达	297,761.00	3.09
195	603233	大参林	295,284.00	3.06
196	002839	张家港行	292,542.00	3.03
197	600184	光电股份	291,070.60	3.02
198	600201	生物股份	286,976.00	2.97
199	000543	皖能电力	285,998.00	2.96
200	000078	海王生物	285,688.00	2.96
201	603169	兰石重装	285,602.30	2.96
202	300199	翰宇药业	283,710.00	2.94
203	300287	飞利信	283,508.00	2.94
204	002544	杰赛科技	282,303.00	2.93

205	300376	易事特	279,722.00	2.90
206	603868	飞科电器	279,390.00	2.89
207	002701	奥瑞金	279,295.00	2.89
208	000564	供销大集	277,144.00	2.87
209	601005	重庆钢铁	277,121.00	2.87
210	000600	建投能源	275,158.00	2.85
211	002431	棕榈股份	274,552.00	2.84
212	600525	长园集团	271,873.00	2.82
213	000012	南玻 A	270,669.49	2.80
214	600743	华远地产	269,474.90	2.79
215	300134	大富科技	267,186.00	2.77
216	002807	江阴银行	265,137.80	2.75
217	000537	广宇发展	262,513.00	2.72
218	002426	胜利精密	259,868.00	2.69
219	600161	天坛生物	257,587.00	2.67
220	000926	福星股份	253,998.00	2.63
221	002640	跨境通	253,400.00	2.63
222	002280	联络互动	250,390.00	2.59
223	002028	思源电气	248,923.00	2.58
224	002317	众生药业	248,319.00	2.57
225	002375	亚厦股份	247,729.00	2.57
226	002366	台海核电	246,080.00	2.55
227	002424	贵州百灵	245,067.94	2.54
228	300133	华策影视	244,382.00	2.53
229	300257	开山股份	244,116.00	2.53
230	300266	兴源环境	243,811.00	2.53
231	300202	聚龙股份	242,168.82	2.51
232	600315	上海家化	241,526.00	2.50
233	000061	农产品	240,886.00	2.50
234	000937	冀中能源	240,861.00	2.50
235	002093	国脉科技	240,106.00	2.49
236	002128	露天煤业	236,891.00	2.45
237	000028	国药一致	235,761.60	2.44
238	002665	首航节能	235,053.00	2.44
239	002233	塔牌集团	234,647.00	2.43
240	000158	常山北明	234,115.00	2.43
241	000025	特力 A	232,355.00	2.41
242	000090	天健集团	231,745.00	2.40
243	000587	金洲慈航	231,004.00	2.39
244	603866	桃李面包	229,912.00	2.38
245	002573	清新环境	229,440.00	2.38
246	600699	均胜电子	228,286.00	2.37
247	600614	*ST 鹏起	224,304.90	2.32
248	002477	*ST 雏鹰	222,669.49	2.31

249	000990	诚志股份	222,666.00	2.31
250	002745	木林森	220,677.00	2.29
251	603000	人民网	220,066.00	2.28
252	600642	申能股份	219,539.00	2.27
253	600098	广州发展	218,277.00	2.26
254	002444	巨星科技	217,292.00	2.25
255	300159	新研股份	216,886.00	2.25
256	300197	铁汉生态	215,531.00	2.23
257	000426	兴业矿业	214,802.00	2.23
258	002390	信邦制药	212,501.00	2.20
259	600511	国药股份	212,404.00	2.20
260	300297	蓝盾股份	208,959.00	2.17
261	002635	安洁科技	206,492.00	2.14
262	002489	浙江永强	205,621.00	2.13
263	002517	恺英网络	204,928.00	2.12
264	300156	神雾环保	204,495.00	2.12
265	000536	华映科技	200,734.40	2.08
266	000980	众泰汽车	200,072.00	2.07
267	002359	*ST 北讯	198,394.00	2.06
268	600183	生益科技	197,586.00	2.05
269	600618	氯碱化工	196,440.00	2.04
270	002118	紫鑫药业	193,847.00	2.01
271	000501	鄂武商 A	193,657.00	2.01

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

7.4.3 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	540,624,431.23
卖出股票收入（成交）总额	157,811,082.37

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	126,999.21	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	126,999.21	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113028	环境转债	1,120	111,999.51	0.02
2	113027	华钰转债	150	14,999.70	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1912	IC1912	24	22,584,000.00	196,160.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					196,160.00
股指期货投资本期收益（元）					290,679.62
股指期货投资本期公允价值变动（元）					196,160.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 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	3,003,493.41
2	应收证券清算款	46,852,132.18
3	应收股利	-
4	应收利息	5,136.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,860,761.90

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		中国工商银行股份有 限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金发起式 联接基金	
		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
3,313	42,085.66	124,926,98 6.00	89.60%	14,502,811. 00	10.40%	104,771,10 0.00	75.14%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“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	易方达基金管理有限公司	7,800,000.00	5.63%
2	中信建投证券股份有限公司	1,764,404.00	1.27%
3	招商证券股份有限公司	1,564,200.00	1.13%
4	方正证券股份有限公司	1,515,000.00	1.09%
5	申万宏源证券有限公司	1,396,100.00	1.01%
6	广发证券股份有限公司	1,382,300.00	1.00%
7	中信证券股份有限公司	1,227,800.00	0.89%
8	中国银河证券股份有限公司	1,200,000.00	0.87%
9	华泰证券股份有限公司	984,900.00	0.71%
10	王锦效	558,377.00	0.40%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证 500	104,771,100.00	75.65%

	交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金		
--	-----------------------	--	--

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

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（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	2,319,978.00
本报告期基金总申购份额	168,909,819.00
减：本报告期基金总赎回份额	31,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	139,429,797.00

注：期初基金总份额包含场外份额 623,463 份；期末基金总份额包含场外份额 933,282 份；总申购份额包含场外总申购份额 309,819 份。

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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	59,474,864.77	8.55%	5,947.58	8.57%	-
国信证券	2	1,209,143.05	0.17%	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	530,963,276.36	76.36%	53,105.10	76.49%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	103,711,829.85	14.91%	10,374.23	14.94%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能

力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	12,872.40	15.61%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	69,595.88	84.39%	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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%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	2019年01月01日~2019年04月23日	623,463.00	8,109,819.00	-	8,733,282.00	6.26%
中国工商银行股份有限公司—易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2019年03月28日~2019年06月30日	-	104,774,000.00	2,900.00	104,771,100.00	75.14%
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。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日