

# 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

### 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 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	13
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	17
7 投资组合报告 .....	35
7.1 期末基金资产组合情况 .....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
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 .....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	64
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 .....	65
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 .....	65

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	65
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
7.12	投资组合报告附注 .....	66
8	基金份额持有人信息 .....	66
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	67
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
9	开放式基金份额变动 .....	68
10	重大事件揭示 .....	68
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	69
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
10.4	基金投资策略的改变 .....	69
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8	其他重大事件 .....	71
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
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 .....	72
12	备查文件目录 .....	73
12.1	备查文件目录 .....	73
12.2	存放地点 .....	73
12.3	查阅方式 .....	73

## 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
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	姓名	张南	郭明

负责人	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	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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
本期加权平均净值利润率	-5.92%

本期基金份额净值增长率	19.79%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	-210,079,513.67
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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-23.21%

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	-	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。
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	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

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				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与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	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		46,852,132.18	-
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		742,551,897.36	9,727,063.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	8,482,160.10	70,000.00
负债合计		47,755,717.83	75,866.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	904,875,693.20	15,056,261.44
未分配利润	6.4.7.10	-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	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-10,249,268.30</b>	<b>-2,473,084.59</b>
1.利息收入		23,064.04	4,975.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-7,577,619.22	-1,673,290.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	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	6.4.7.14	290,679.62	-
股利收益	6.4.7.15	3,326,739.61	39,180.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-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）	6.4.7.17	1,284,367.85	53,895.69

<b>减：二、费用</b>		<b>712,027.69</b>	<b>386,016.29</b>
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	6.4.7.18	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	6.4.7.19	144,009.90	294,061.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-10,961,295.99</b>	<b>-2,859,100.88</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-10,961,295.99</b>	<b>-2,859,100.88</b>

### 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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	22,824,679.86
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	22,824,679.86

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	677,384,075.10	667,026,043.18	-10,358,031.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	126,999.21	126,999.21
	银行间市场	-	-
	合计	126,999.21	126,999.21
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	677,511,074.31	667,153,042.39	-10,358,031.92

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	22,387,840.00	-	-	-
IC1912	22,387,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	22,387,840.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)
IC1912	IC1912	24	22,584,000.00	196,160.00
总额合计				196,160.00
减：可抵消期货暂收款				196,160.00
股指期货投资净额				0

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,678.40
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	1,422.49
应收债券利息	8.06
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	27.36
合计	5,136.31

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	63,056.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	63,056.92

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	43,695.90
应付替代款	8,111,963.70
可退替代款	276,500.50
其他应付款	50,000.00

合计	8,482,160.10
----	--------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,319,978.00	15,056,261.44
本期申购	168,909,819.00	1,096,196,028.83
本期赎回（以“-”号填列）	-31,800,000.00	-206,376,597.07
本期末	139,429,797.00	904,875,693.20

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,092,695.81	-10,497,759.37	-5,405,063.56
本期利润	-3,352,946.18	-7,608,349.81	-10,961,295.99
本期基金份额交易产生的变动数	311,627,381.02	-505,340,535.14	-193,713,154.12
其中：基金申购款	383,848,070.88	-627,428,671.46	-243,580,600.58
基金赎回款	-72,220,689.86	122,088,136.32	49,867,446.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	313,367,130.65	-523,446,644.32	-210,079,513.67

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	6,436.79
其他	183.44
合计	23,038.22

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-1,912,598.25
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-7,577,619.22

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	157,811,082.37
减：卖出股票成本总额	163,476,103.34
买卖股票差价收入	-5,665,020.97

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	156,509,150.61
减：现金支付赎回款总额	81,603,349.61
减：赎回股票成本总额	76,818,399.25
赎回差价收入	-1,912,598.25

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	82,468.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	70,599.88
减：应收利息总额	18.79
买卖债券差价收入	11,849.61

## 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	290,679.62

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,326,739.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,326,739.61

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	-7,804,509.81
——股票投资	-7,804,509.81
——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	196,160.00
——权证投资	-
——期货投资	196,160.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-7,608,349.81

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	649.68
替代损益收入	1,283,718.17
其他	-
合计	1,284,367.85

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

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	289,402.47
银行间市场交易费用	-
合计	289,402.47

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	4,026.13
银行汇划费	314.00
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	144,009.90

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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”。

#### 6.4.10.2.2 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”。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年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。

## 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
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。

## 6.4.10.5 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	
	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	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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
6.4.12.1.2 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	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2018 年 12 月 31 日：0.00%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	112,005.89	0.00
AAA 以下	15,001.38	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	127,007.27	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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2019 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	22,824,679.86	-	-	-	22,824,679.86
结算备付金	2,713,413.21	-	-	-	2,713,413.21
存出保证金	3,003,493.41	-	-	-	3,003,493.41
交易性金融资产	-	-	126,999.21	667,026,043.18	667,153,042.39
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	46,852,132.18
应收利息	-	-	-	5,136.31	5,136.31
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,541,586.48	-	126,999.21	713,883,311.67	742,551,897.36
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	39,129,241.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	54,808.59	54,808.59
应付托管费	-	-	-	18,269.51	18,269.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	63,056.92	63,056.92
应交税费	-	-	-	8,181.57	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	8,482,160.10
负债总计	-	-	-	47,755,717.83	47,755,717.83
利率敏感度缺口	28,541,586.48	-	126,999.21	666,127,593.84	694,796,179.56



					3
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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

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

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

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

**6.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

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

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

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	667,026,043.18	96.00	9,357,603.12	96.96
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	667,026,043.18	96.00	9,357,603.12	96.96

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日

	1.业绩比较基准上升 5%	33,343,688.56	466,788.72
	2.业绩比较基准下降 5%	-33,343,688.56	-466,788.72

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 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	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
11	300450	先导智能	91,900	3,087,840.00	0.44
12	002439	启明星辰	111,350	2,995,315.00	0.43
13	600426	华鲁恒升	201,200	2,989,832.00	0.43
14	002506	协鑫集成	446,970	2,985,759.60	0.43
15	002127	南极电商	262,960	2,955,670.40	0.43

16	002507	涪陵榨菜	94,500	2,882,250.00	0.41
17	600642	申能股份	477,250	2,868,272.50	0.41
18	000401	冀东水泥	162,770	2,866,379.70	0.41
19	002129	中环股份	293,300	2,862,608.00	0.41
20	600298	安琪酵母	88,250	2,791,347.50	0.40
21	600895	张江高科	135,700	2,784,564.00	0.40
22	002463	沪电股份	204,130	2,780,250.60	0.40
23	600183	生益科技	184,065	2,770,178.25	0.40
24	002340	格林美	584,150	2,751,346.50	0.40
25	002465	海格通信	287,700	2,744,658.00	0.40
26	600763	通策医疗	30,900	2,737,431.00	0.39
27	000975	银泰资源	206,674	2,726,030.06	0.39
28	300383	光环新网	160,670	2,694,435.90	0.39
29	002223	鱼跃医疗	108,680	2,675,701.60	0.39
30	600536	中国软件	49,590	2,661,495.30	0.38
31	000623	吉林敖东	161,300	2,643,707.00	0.38
32	600739	辽宁成大	180,800	2,628,832.00	0.38
33	002268	卫士通	106,820	2,611,749.00	0.38
34	000750	国海证券	518,400	2,607,552.00	0.38
35	002384	东山精密	174,047	2,535,864.79	0.36
36	603369	今世缘	89,050	2,483,604.50	0.36
37	002075	沙钢股份	312,000	2,446,080.00	0.35
38	002926	华西证券	228,600	2,400,300.00	0.35
39	002500	山西证券	296,200	2,399,220.00	0.35
40	002385	大北农	448,400	2,372,036.00	0.34
41	600801	华新水泥	117,068	2,370,627.00	0.34
42	600879	航天电子	382,540	2,356,446.40	0.34
43	002821	凯莱英	23,700	2,324,496.00	0.33
44	000998	隆平高科	160,400	2,322,592.00	0.33
45	002797	第一创业	365,900	2,319,806.00	0.33
46	600325	华发股份	295,780	2,310,041.80	0.33
47	600161	天坛生物	91,232	2,303,608.00	0.33
48	000723	美锦能源	219,800	2,296,910.00	0.33
49	600528	中铁工业	198,400	2,295,488.00	0.33
50	600460	士兰微	137,110	2,276,026.00	0.33
51	002373	千方科技	132,580	2,267,118.00	0.33
52	600779	水井坊	44,300	2,251,326.00	0.32
53	601128	常熟银行	290,660	2,243,895.20	0.32
54	002299	圣农发展	88,450	2,239,554.00	0.32
55	600584	长电科技	173,770	2,232,944.50	0.32
56	000997	新大陆	131,310	2,217,825.90	0.32
57	000988	华工科技	139,080	2,200,245.60	0.32
58	000778	新兴铸管	492,840	2,188,209.60	0.31
59	000686	东北证券	247,300	2,178,713.00	0.31

60	600848	上海临港	69,890	2,175,675.70	0.31
61	000009	中国宝安	379,900	2,169,229.00	0.31
62	601168	西部矿业	336,240	2,145,211.20	0.31
63	600572	康恩贝	332,060	2,125,184.00	0.31
64	002092	中泰化学	266,760	2,123,409.60	0.31
65	600410	华胜天成	197,540	2,119,604.20	0.31
66	600820	隧道股份	334,300	2,109,433.00	0.30
67	002572	索菲亚	113,200	2,100,992.00	0.30
68	600673	东阳光	267,180	2,097,363.00	0.30
69	600875	东方电气	197,330	2,095,644.60	0.30
70	000060	中金岭南	443,200	2,078,608.00	0.30
71	601005	重庆钢铁	1,033,800	2,077,938.00	0.30
72	600699	均胜电子	96,400	2,059,104.00	0.30
73	600392	盛和资源	183,283	2,027,109.98	0.29
74	300168	万达信息	155,900	2,022,023.00	0.29
75	600376	首开股份	226,100	2,019,073.00	0.29
76	000999	华润三九	68,420	2,007,442.80	0.29
77	002353	杰瑞股份	86,750	2,003,925.00	0.29
78	000039	中集集团	187,052	1,997,715.36	0.29
79	000690	宝新能源	309,980	1,996,271.20	0.29
80	600718	东软集团	154,940	1,986,330.80	0.29
81	000960	锡业股份	177,740	1,985,355.80	0.29
82	002371	北方华创	28,660	1,984,705.00	0.29
83	000581	威孚高科	106,650	1,979,424.00	0.28
84	000830	鲁西化工	180,271	1,961,348.48	0.28
85	600166	福田汽车	819,190	1,941,480.30	0.28
86	002372	伟星新材	111,480	1,939,752.00	0.28
87	600811	东方集团	520,510	1,936,297.20	0.28
88	002191	劲嘉股份	155,940	1,935,215.40	0.28
89	600755	厦门国贸	224,231	1,935,113.53	0.28
90	002916	深南电路	18,940	1,930,364.80	0.28
91	600022	山东钢铁	1,151,806	1,923,516.02	0.28
92	600839	四川长虹	650,820	1,919,919.00	0.28
93	600959	江苏有线	431,100	1,918,395.00	0.28
94	600315	上海家化	61,420	1,913,233.00	0.28
95	000547	航天发展	199,771	1,909,810.76	0.27
96	600567	山鹰纸业	563,600	1,899,332.00	0.27
97	601866	中远海发	697,454	1,897,074.88	0.27
98	600497	驰宏锌锗	372,400	1,891,792.00	0.27
99	600804	鹏博士	250,200	1,881,504.00	0.27
100	601872	招商轮船	427,100	1,862,156.00	0.27
101	600745	闻泰科技	56,000	1,860,320.00	0.27
102	002281	光迅科技	69,990	1,853,335.20	0.27
103	002078	太阳纸业	272,120	1,853,137.20	0.27

104	600881	亚泰集团	567,850	1,845,512.50	0.27
105	002387	维信诺	140,900	1,838,745.00	0.26
106	002217	合力泰	331,900	1,835,407.00	0.26
107	002074	国轩高科	138,100	1,810,491.00	0.26
108	600885	宏发股份	74,486	1,810,009.80	0.26
109	600549	厦门钨业	125,600	1,797,336.00	0.26
110	600037	歌华有线	174,880	1,792,520.00	0.26
111	002273	水晶光电	154,075	1,784,188.50	0.26
112	600808	马钢股份	521,840	1,779,474.40	0.26
113	600260	凯乐科技	88,920	1,776,621.60	0.26
114	300009	安科生物	111,400	1,771,260.00	0.25
115	603077	和邦生物	927,990	1,763,181.00	0.25
116	002221	东华能源	202,940	1,747,313.40	0.25
117	600094	大名城	276,350	1,738,241.50	0.25
118	000970	中科三环	153,140	1,738,139.00	0.25
119	600160	巨化股份	243,960	1,734,555.60	0.25
120	600909	华安证券	263,800	1,725,252.00	0.25
121	600079	人福医药	163,270	1,714,335.00	0.25
122	002670	国盛金控	135,695	1,709,757.00	0.25
123	600967	内蒙一机	152,380	1,706,656.00	0.25
124	300315	掌趣科技	489,200	1,687,740.00	0.24
125	603000	人民网	94,550	1,685,826.50	0.24
126	002002	鸿达兴业	271,915	1,683,153.85	0.24
127	300274	阳光电源	179,670	1,679,914.50	0.24
128	300027	华谊兄弟	341,500	1,676,765.00	0.24
129	600643	爱建集团	174,900	1,675,542.00	0.24
130	002085	万丰奥威	228,600	1,664,208.00	0.24
131	000983	西山煤电	274,400	1,662,864.00	0.24
132	002038	双鹭药业	70,520	1,661,451.20	0.24
133	600064	南京高科	154,480	1,654,480.80	0.24
134	600466	蓝光发展	265,596	1,652,007.12	0.24
135	600388	龙净环保	133,040	1,648,365.60	0.24
136	000729	燕京啤酒	247,790	1,645,325.60	0.24
137	600143	金发科技	335,750	1,645,175.00	0.24
138	601098	中南传媒	130,100	1,644,464.00	0.24
139	600282	南钢股份	469,300	1,642,550.00	0.24
140	600266	北京城建	203,784	1,642,499.04	0.24
141	600435	北方导航	182,040	1,636,539.60	0.24
142	002110	三钢闽光	175,700	1,634,010.00	0.24
143	000878	云南铜业	152,940	1,625,752.20	0.23
144	300166	东方国信	132,210	1,624,860.90	0.23
145	300088	长信科技	320,210	1,620,262.60	0.23
146	600863	内蒙华电	513,610	1,612,735.40	0.23
147	600737	中粮糖业	185,071	1,606,416.28	0.23



148	002607	中公教育	116,800	1,603,664.00	0.23
149	000089	深圳机场	180,271	1,602,609.19	0.23
150	002019	亿帆医药	130,680	1,600,830.00	0.23
151	000513	丽珠集团	48,128	1,599,293.44	0.23
152	300001	特锐德	88,750	1,599,275.00	0.23
153	601333	广深铁路	494,300	1,596,589.00	0.23
154	600021	上海电力	182,500	1,584,100.00	0.23
155	002589	瑞康医药	208,210	1,580,313.90	0.23
156	600026	中远海能	243,490	1,580,250.10	0.23
157	600258	首旅酒店	87,800	1,578,644.00	0.23
158	000636	风华高科	129,810	1,570,701.00	0.23
159	300207	欣旺达	135,700	1,563,264.00	0.22
160	002174	游族网络	92,400	1,559,712.00	0.22
161	002131	利欧股份	814,830	1,556,325.30	0.22
162	600521	华海药业	110,300	1,555,230.00	0.22
163	600171	上海贝岭	95,350	1,549,437.50	0.22
164	000563	陕国投 A	346,806	1,539,818.64	0.22
165	002155	湖南黄金	152,110	1,531,747.70	0.22
166	000826	启迪桑德	129,200	1,523,268.00	0.22
167	002690	美亚光电	46,660	1,521,116.00	0.22
168	002233	塔牌集团	129,520	1,512,793.60	0.22
169	600380	健康元	174,570	1,510,030.50	0.22
170	601718	际华集团	384,700	1,504,177.00	0.22
171	601106	中国一重	478,600	1,502,804.00	0.22
172	603939	益丰药房	21,300	1,490,787.00	0.21
173	000930	中粮生化	198,187	1,490,366.24	0.21
174	600373	中文传媒	118,000	1,482,080.00	0.21
175	000883	湖北能源	341,100	1,480,374.00	0.21
176	601966	玲珑轮胎	86,800	1,475,600.00	0.21
177	002440	闰土股份	118,080	1,471,276.80	0.21
178	002250	联化科技	132,250	1,466,652.50	0.21
179	000732	泰禾集团	88,650	1,462,725.00	0.21
180	000559	万向钱潮	244,500	1,462,110.00	0.21
181	600649	城投控股	223,644	1,446,976.68	0.21
182	601100	恒立液压	46,000	1,443,480.00	0.21
183	000598	兴蓉环境	315,110	1,433,750.50	0.21
184	300316	晶盛机电	112,800	1,431,432.00	0.21
185	601000	唐山港	519,599	1,428,897.25	0.21
186	002152	广电运通	208,330	1,427,060.50	0.21
187	600008	首创股份	402,100	1,415,392.00	0.20
188	000932	华菱钢铁	295,280	1,408,485.60	0.20
189	002399	海普瑞	66,600	1,397,934.00	0.20
190	600648	外高桥	66,490	1,394,960.20	0.20
191	300182	捷成股份	316,160	1,394,265.60	0.20

192	600039	四川路桥	381,610	1,389,060.40	0.20
193	600598	北大荒	129,310	1,387,496.30	0.20
194	000681	视觉中国	71,590	1,387,414.20	0.20
195	600782	新钢股份	276,500	1,382,500.00	0.20
196	600845	宝信软件	48,540	1,382,419.20	0.20
197	600486	扬农化工	25,200	1,378,440.00	0.20
198	601699	潞安环能	173,200	1,375,208.00	0.20
199	601231	环旭电子	113,900	1,372,495.00	0.20
200	600827	百联股份	138,800	1,361,628.00	0.20
201	600500	中化国际	182,000	1,359,540.00	0.20
202	300418	昆仑万维	105,100	1,352,637.00	0.19
203	603517	绝味食品	34,600	1,346,286.00	0.19
204	000758	中色股份	244,730	1,343,567.70	0.19
205	002583	海能达	160,040	1,342,735.60	0.19
206	002368	太极股份	44,260	1,341,078.00	0.19
207	600138	中青旅	105,550	1,339,429.50	0.19
208	002004	华邦健康	275,290	1,337,909.40	0.19
209	601608	中信重工	309,500	1,337,040.00	0.19
210	000685	中山公用	156,440	1,335,997.60	0.19
211	601179	中国西电	360,300	1,333,110.00	0.19
212	600748	上实发展	160,450	1,330,130.50	0.19
213	600729	重庆百货	43,808	1,324,753.92	0.19
214	000031	大悦城	205,320	1,318,154.40	0.19
215	002266	浙富控股	275,250	1,307,437.50	0.19
216	000738	航发控制	96,800	1,297,120.00	0.19
217	000877	天山股份	111,480	1,295,397.60	0.19
218	000008	神州高铁	340,600	1,284,062.00	0.18
219	000027	深圳能源	206,630	1,281,106.00	0.18
220	600167	联美控股	121,070	1,280,920.60	0.18
221	000807	云铝股份	273,100	1,280,839.00	0.18
222	002414	高德红外	66,640	1,279,488.00	0.18
223	601118	海南橡胶	248,400	1,279,260.00	0.18
224	600507	方大特钢	130,700	1,278,246.00	0.18
225	600633	浙数文化	136,450	1,275,807.50	0.18
226	300058	蓝色光标	298,720	1,275,534.40	0.18
227	002183	怡亚通	265,020	1,264,145.40	0.18
228	000887	中鼎股份	131,510	1,261,180.90	0.18
229	002603	以岭药业	108,820	1,260,135.60	0.18
230	601678	滨化股份	186,352	1,259,739.52	0.18
231	600777	新潮能源	601,200	1,250,496.00	0.18
232	600409	三友化工	220,900	1,250,294.00	0.18
233	600056	中国医药	92,450	1,247,150.50	0.18
234	300133	华策影视	184,410	1,241,079.30	0.18
235	000488	晨鸣纸业	231,210	1,239,285.60	0.18

236	600823	世茂股份	266,520	1,228,657.20	0.18
237	600120	浙江东方	96,285	1,226,670.90	0.18
238	600155	华创阳安	91,150	1,224,144.50	0.18
239	603883	老百姓	20,930	1,223,986.40	0.18
240	603885	吉祥航空	93,000	1,218,300.00	0.18
241	002408	齐翔腾达	156,740	1,214,735.00	0.17
242	600348	阳泉煤业	208,130	1,209,235.30	0.17
243	000528	柳工	180,894	1,204,754.04	0.17
244	000813	德展健康	157,700	1,201,674.00	0.17
245	600216	浙江医药	116,450	1,192,448.00	0.17
246	600418	江淮汽车	230,060	1,187,109.60	0.17
247	600277	亿利洁能	243,640	1,186,526.80	0.17
248	600158	中体产业	115,445	1,181,002.35	0.17
249	600060	海信电器	136,910	1,180,164.20	0.17
250	600597	光明乳业	109,780	1,180,135.00	0.17
251	600970	中材国际	182,200	1,171,546.00	0.17
252	601958	金钼股份	174,400	1,168,480.00	0.17
253	600511	国药股份	50,590	1,162,052.30	0.17
254	600525	长园集团	183,860	1,161,995.20	0.17
255	002701	奥瑞金	248,030	1,158,300.10	0.17
256	002212	南洋股份	84,500	1,157,650.00	0.17
257	601880	大连港	540,070	1,150,349.10	0.17
258	600717	天津港	179,048	1,149,488.16	0.17
259	600062	华润双鹤	91,124	1,149,073.64	0.17
260	000301	东方盛虹	208,800	1,146,312.00	0.16
261	600580	卧龙电驱	135,880	1,142,750.80	0.16
262	603228	景旺电子	28,402	1,136,364.02	0.16
263	600478	科力远	203,171	1,135,725.89	0.16
264	002640	跨境通	136,280	1,135,212.40	0.16
265	601200	上海环境	83,407	1,135,169.27	0.16
266	002244	滨江集团	272,220	1,129,713.00	0.16
267	002419	天虹股份	86,500	1,129,690.00	0.16
268	300244	迪安诊断	66,390	1,127,302.20	0.16
269	000090	天健集团	228,133	1,126,977.02	0.16
270	002812	恩捷股份	24,100	1,126,675.00	0.16
271	600515	海航基础	227,400	1,125,630.00	0.16
272	002128	露天煤业	129,780	1,122,597.00	0.16
273	300113	顺网科技	71,120	1,115,161.60	0.16
274	300010	立思辰	118,580	1,113,466.20	0.16
275	002407	多氟多	93,880	1,111,539.20	0.16
276	600307	酒钢宏兴	546,570	1,109,537.10	0.16
277	600664	哈药股份	267,920	1,109,188.80	0.16
278	300026	红日药业	316,610	1,092,304.50	0.16
279	300002	神州泰岳	273,590	1,088,888.20	0.16

280	002426	胜利精密	425,000	1,088,000.00	0.16
281	601928	凤凰传媒	134,610	1,086,302.70	0.16
282	002491	通鼎互联	133,910	1,083,331.90	0.16
283	603501	韦尔股份	19,700	1,081,727.00	0.16
284	600312	平高电气	140,180	1,077,984.20	0.16
285	603659	璞泰来	22,800	1,072,056.00	0.15
286	000021	深科技	131,810	1,071,615.30	0.15
287	002056	横店东磁	140,940	1,071,144.00	0.15
288	600754	锦江股份	43,430	1,070,115.20	0.15
289	000156	华数传媒	96,800	1,065,768.00	0.15
290	600759	洲际油气	275,378	1,062,959.08	0.15
291	002665	首航节能	313,360	1,062,290.40	0.15
292	002470	金正大	290,800	1,058,512.00	0.15
293	600267	海正药业	105,650	1,056,500.00	0.15
294	600557	康缘药业	71,020	1,055,357.20	0.15
295	002242	九阳股份	50,690	1,054,858.90	0.15
296	000712	锦龙股份	82,020	1,053,136.80	0.15
297	600073	上海梅林	114,380	1,052,296.00	0.15
298	300134	大富科技	67,520	1,048,585.60	0.15
299	300324	旋极信息	180,429	1,044,683.91	0.15
300	000028	国药一致	24,930	1,042,821.90	0.15
301	300197	铁汉生态	290,060	1,041,315.40	0.15
302	601717	郑煤机	182,040	1,039,448.40	0.15
303	600316	洪都航空	72,620	1,039,192.20	0.15
304	600859	王府井	67,990	1,032,768.10	0.15
305	600125	铁龙物流	159,540	1,029,033.00	0.15
306	002064	华峰氨纶	204,900	1,028,598.00	0.15
307	002030	达安基因	95,165	1,021,120.45	0.15
308	600884	杉杉股份	95,550	1,017,607.50	0.15
309	000078	海王生物	291,850	1,015,638.00	0.15
310	002051	中工国际	88,350	1,013,374.50	0.15
311	600259	广晟有色	25,130	1,012,739.00	0.15
312	600017	日照港	320,910	1,010,866.50	0.15
313	002176	江特电机	207,230	1,009,210.10	0.15
314	600582	天地科技	291,730	1,006,468.50	0.14
315	600751	海航科技	316,080	1,005,134.40	0.14
316	600575	皖江物流	340,040	996,317.20	0.14
317	000727	华东科技	475,750	994,317.50	0.14
318	002302	西部建设	89,200	993,688.00	0.14
319	002285	世联行	219,571	990,265.21	0.14
320	000400	许继电气	109,080	988,264.80	0.14
321	600835	上海机电	59,390	985,874.00	0.14
322	002280	联络互动	268,700	983,442.00	0.14
323	300115	长盈精密	93,750	983,437.50	0.14

324	600499	科达洁能	223,260	977,878.80	0.14
325	000959	首钢股份	275,600	970,112.00	0.14
326	002317	众生药业	113,820	968,608.20	0.14
327	002358	森源电气	95,120	965,468.00	0.14
328	600563	法拉电子	23,314	959,837.38	0.14
329	600901	江苏租赁	157,500	959,175.00	0.14
330	000158	常山北明	176,680	957,605.60	0.14
331	603866	桃李面包	22,960	956,284.00	0.14
332	002424	贵州百灵	95,900	947,492.00	0.14
333	600565	迪马股份	253,590	945,890.70	0.14
334	600291	西水股份	93,880	944,432.80	0.14
335	002505	大康农业	478,550	942,743.50	0.14
336	000926	福星股份	135,210	935,653.20	0.13
337	002390	信邦制药	177,540	935,635.80	0.13
338	000718	苏宁环球	268,220	928,041.20	0.13
339	002444	巨星科技	92,850	926,643.00	0.13
340	000717	韶钢松山	208,900	925,427.00	0.13
341	600141	兴发集团	89,388	918,908.64	0.13
342	002028	思源电气	92,250	918,810.00	0.13
343	000519	中兵红箭	118,750	917,937.50	0.13
344	000980	众泰汽车	218,000	917,780.00	0.13
345	600151	航天机电	178,070	917,060.50	0.13
346	600611	大众交通	196,760	914,934.00	0.13
347	002573	清新环境	113,480	913,514.00	0.13
348	000012	南玻 A	218,943	910,802.88	0.13
349	600770	综艺股份	136,310	910,550.80	0.13
350	600908	无锡银行	160,670	906,178.80	0.13
351	601326	秦港股份	249,600	906,048.00	0.13
352	603816	顾家家居	28,342	904,676.64	0.13
353	600458	时代新材	86,920	903,098.80	0.13
354	603712	七一二	42,300	898,029.00	0.13
355	002249	大洋电机	206,230	895,038.20	0.13
356	600787	中储股份	155,900	893,307.00	0.13
357	002839	张家港行	158,400	891,792.00	0.13
358	000848	承德露露	106,850	890,060.50	0.13
359	601611	中国核建	114,400	890,032.00	0.13
360	002332	仙琚制药	131,480	888,804.80	0.13
361	000006	深振业 A	162,970	888,186.50	0.13
362	600993	马应龙	50,090	884,088.50	0.13
363	600645	中源协和	50,790	879,174.90	0.13
364	002831	裕同科技	45,840	878,752.80	0.13
365	002807	江阴银行	186,848	874,448.64	0.13
366	000543	皖能电力	185,600	874,176.00	0.13
367	000600	建投能源	129,910	870,397.00	0.13

368	603233	大参林	19,250	866,250.00	0.12
369	600765	中航重机	93,620	864,112.60	0.12
370	601019	山东出版	111,000	863,580.00	0.12
371	600862	中航高科	95,020	854,229.80	0.12
372	002366	台海核电	90,962	851,404.32	0.12
373	002635	安洁科技	62,990	849,735.10	0.12
374	300055	万邦达	118,280	843,336.40	0.12
375	600169	太原重工	315,410	842,144.70	0.12
376	600393	粤泰股份	179,100	832,815.00	0.12
377	002093	国脉科技	89,220	828,853.80	0.12
378	000564	供销大集	316,200	825,282.00	0.12
379	600338	西藏珠峰	47,202	825,090.96	0.12
380	300308	中际旭创	24,140	820,518.60	0.12
381	002431	棕榈股份	206,700	816,465.00	0.12
382	002544	杰赛科技	62,590	813,670.00	0.12
383	603515	欧普照明	25,129	810,410.25	0.12
384	300297	蓝盾股份	133,250	803,497.50	0.12
385	300287	飞利信	202,270	803,011.90	0.12
386	002672	东江环保	70,620	800,830.80	0.12
387	002048	宁波华翔	73,590	796,243.80	0.11
388	300376	易事特	161,370	795,554.10	0.11
389	002745	木林森	67,420	790,162.40	0.11
390	601311	骆驼股份	72,820	790,097.00	0.11
391	300159	新研股份	157,340	783,553.20	0.11
392	600317	营口港	282,900	780,804.00	0.11
393	603198	迎驾贡酒	43,460	778,368.60	0.11
394	601016	节能风电	292,450	777,917.00	0.11
395	600978	宜华生活	206,330	775,800.80	0.11
396	300199	翰宇药业	84,520	775,048.40	0.11
397	603888	新华网	38,430	767,062.80	0.11
398	002254	泰和新材	72,320	765,145.60	0.11
399	603766	隆鑫通用	180,400	755,876.00	0.11
400	000869	张裕 A	23,400	751,608.00	0.11
401	601689	拓普集团	48,960	750,067.20	0.11
402	002503	搜于特	271,170	745,717.50	0.11
403	600757	长江传媒	109,180	743,515.80	0.11
404	600006	东风汽车	138,611	738,796.63	0.11
405	300266	兴源环境	162,258	736,651.32	0.11
406	000990	诚志股份	44,460	729,588.60	0.11
407	600623	华谊集团	95,200	727,328.00	0.10
408	600639	浦东金桥	44,960	727,003.20	0.10
409	000501	鄂武商 A	67,620	726,915.00	0.10
410	000426	兴业矿业	132,950	713,941.50	0.10
411	603806	福斯特	19,369	711,423.37	0.10

412	000937	冀中能源	184,000	710,240.00	0.10
413	600869	智慧能源	156,740	708,464.80	0.10
414	600640	号百控股	51,960	695,224.80	0.10
415	300257	开山股份	62,690	694,605.20	0.10
416	002815	崇达技术	44,460	693,131.40	0.10
417	601001	大同煤业	151,640	692,994.80	0.10
418	600195	中牧股份	50,024	692,832.40	0.10
419	600416	湘电股份	114,980	692,179.60	0.10
420	600329	中新药业	48,190	688,635.10	0.10
421	600694	大商股份	24,660	688,260.60	0.10
422	600545	卓郎智能	96,350	685,048.50	0.10
423	002375	亚厦股份	115,810	684,437.10	0.10
424	603056	德邦股份	48,600	684,288.00	0.10
425	000062	深圳华强	51,402	683,132.58	0.10
426	002382	蓝帆医疗	48,700	673,034.00	0.10
427	600750	江中药业	51,580	671,055.80	0.10
428	002707	众信旅游	110,420	670,249.40	0.10
429	002709	天赐材料	27,360	662,112.00	0.10
430	000537	广宇发展	95,200	658,784.00	0.09
431	603377	东方时尚	42,822	654,320.16	0.09
432	002489	浙江永强	195,400	652,636.00	0.09
433	601801	皖新传媒	108,200	650,282.00	0.09
434	000829	天音控股	110,650	643,983.00	0.09
435	002509	天广中茂	310,200	639,012.00	0.09
436	600971	恒源煤电	108,500	634,725.00	0.09
437	000061	农产品	116,780	632,947.60	0.09
438	600657	信达地产	153,510	632,461.20	0.09
439	002434	万里扬	92,650	629,093.50	0.09
440	601127	小康股份	47,960	628,276.00	0.09
441	603568	伟明环保	28,985	623,757.20	0.09
442	000536	华映科技	245,086	617,616.72	0.09
443	002437	誉衡药业	155,846	615,591.70	0.09
444	600058	五矿发展	72,520	612,794.00	0.09
445	300459	金科文化	107,600	612,244.00	0.09
446	603868	飞科电器	15,630	611,914.50	0.09
447	002512	达华智能	134,880	609,657.60	0.09
448	600874	创业环保	73,220	606,993.80	0.09
449	002118	紫鑫药业	90,050	606,937.00	0.09
450	002948	青岛银行	94,200	605,706.00	0.09
451	002681	奋达科技	141,426	599,646.24	0.09
452	002920	德赛西威	26,600	595,840.00	0.09
453	600098	广州发展	96,440	594,070.40	0.09
454	000541	佛山照明	113,215	593,246.60	0.09
455	000766	通化金马	87,202	592,973.60	0.09

456	002517	恺英网络	185,825	592,781.75	0.09
457	601869	长飞光纤	15,700	588,750.00	0.08
458	002251	步步高	72,890	580,933.30	0.08
459	600428	中远海特	153,840	569,208.00	0.08
460	002936	郑州银行	109,900	558,292.00	0.08
461	600350	山东高速	116,200	557,760.00	0.08
462	600996	贵广网络	51,290	552,906.20	0.08
463	000552	靖远煤电	201,730	546,688.30	0.08
464	002482	广田集团	110,080	534,988.80	0.08
465	600707	彩虹股份	106,600	534,066.00	0.08
466	002818	富森美	41,531	532,842.73	0.08
467	600053	九鼎投资	22,730	529,609.00	0.08
468	002344	海宁皮城	112,650	524,949.00	0.08
469	601003	柳钢股份	90,100	521,679.00	0.08
470	603328	依顿电子	49,890	512,370.30	0.07
471	603556	海兴电力	36,809	508,700.38	0.07
472	600335	国机汽车	73,420	508,066.40	0.07
473	601777	力帆股份	114,480	491,119.20	0.07
474	601139	深圳燃气	83,100	472,839.00	0.07
475	603486	科沃斯	15,580	471,295.00	0.07
476	600939	重庆建工	93,600	457,704.00	0.07
477	600903	贵州燃气	34,400	448,232.00	0.06
478	000025	特力 A	21,499	434,709.78	0.06
479	601615	明阳智能	39,700	430,348.00	0.06
480	000987	越秀金控	47,160	425,383.20	0.06
481	002416	爱施德	66,368	414,800.00	0.06
482	002941	新疆交建	15,800	410,800.00	0.06
483	600126	杭钢股份	89,496	408,101.76	0.06
484	601969	海南矿业	68,260	401,368.80	0.06
485	002699	美盛文化	65,507	393,042.00	0.06
486	600179	ST 安通	126,568	370,844.24	0.05
487	600985	淮北矿业	31,200	353,808.00	0.05
488	600280	中央商场	96,950	348,050.50	0.05
489	603650	彤程新材	15,700	342,888.00	0.05
490	603355	莱克电气	15,730	338,509.60	0.05
491	603225	新凤鸣	26,882	335,756.18	0.05
492	601811	新华文轩	25,930	316,605.30	0.05
493	601068	中铝国际	43,100	297,390.00	0.04
494	000761	本钢板材	67,420	289,906.00	0.04
495	600968	海油发展	78,750	279,562.50	0.04
496	002946	新乳业	17,600	266,464.00	0.04
497	603877	太平鸟	15,630	242,577.60	0.03
498	603025	大豪科技	20,364	208,527.36	0.03
499	600917	重庆燃气	29,060	202,257.60	0.03



500	603569	长久物流	15,682	181,754.38	0.03
501	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
502	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
503	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
504	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
505	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
506	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 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	124,926,986 .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 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	75.65%

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	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于调整易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金场外份额在直销中心申购、赎回业务数额限制的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-26
2	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-13
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-19
4	易方达基金管理有限公司关于调低旗下易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、易方达中证 500	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-04-20

	交易型开放式指数证券投资基金及联接基金相关基金费率并修订基金合同及托管协议的公告		
5	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增加方正证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-05-20
6	易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-05-28
7	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增加申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-05-30
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 增加华泰证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-06-05
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 增加兴业证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-06-14
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-22

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%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</p>							



决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日