

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
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 3 月 20 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 期末投资目标基金明细	43
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.4 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	44
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.7 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	56
7.8 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	57
7.9 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	57
7.10 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	57
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58

7.13	投资组合报告附注	58
§8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	59
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	60
§9	开放式基金份额变动	60
§10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8	其他重大事件	62
§11	备查文件目录	63
11.1	备查文件目录	63
11.2	存放地点	64
11.3	查阅方式	64

§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发起式联接基金	
基金简称	易方达中证 500ETF 联接发起式	
基金主代码	007028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 20 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	1,020,495,218.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C
下属分级基金的交易代码	007028	007029
报告期末下属分级基金的份额总额	394,036,956.47 份	626,458,261.86 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证 500ETF（以下简称“目标 ETF”）的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。本基金可以投资股指期货

	货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品进行交易。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证 500 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

§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3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日）	
	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C
本期已实现收益	-1,254,525.44	-1,861,747.70
本期利润	-11,822,143.25	-20,642,999.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0296	-0.0248
本期加权平均净值利润率	-3.02%	-2.52%
本期基金份额净值增长率	-3.19%	-3.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C
期末可供分配利润	-12,586,870.24	-20,326,871.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0319	-0.0324
期末基金资产净值	381,450,086.23	606,131,389.92
期末基金份额净值	0.9681	0.9676

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C
基金份额累计净值增长率	-3.19%	-3.24%

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.本基金合同于 2019 年 3 月 20 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达中证 500ETF 联接发起式 A

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	0.47%	0.64%	0.75%	1.32%	-0.28%	-0.68%
过去三个月	-3.28%	0.59%	-10.21%	1.72%	6.93%	-1.13%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.19%	0.55%	-9.81%	1.71%	6.62%	-1.16%

易方达中证 500ETF 联接发起式 C

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	0.46%	0.64%	0.75%	1.32%	-0.29%	-0.68%
过去三个月	-3.32%	0.59%	-10.21%	1.72%	6.89%	-1.13%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.24%	0.55%	-9.81%	1.71%	6.57%	-1.16%

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发起式联接基金

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

(2019 年 3 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日)

易方达中证 500ETF 联接发起式 A



易方达中证 500ETF 联接发起式 C



注：1.本基金合同于 2019 年 3 月 20 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-3.19%，C 类基金份额净值增长率为-3.24%，同期业绩比较基准收益率为-9.81%。

§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		
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	2019-03-20	-	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。
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	2019-03-20	-	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

<p>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</p>				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

本基金是易方达中证 500 ETF 的联接基金，本报告期涵盖了基金的建仓期，易方达中证 500ETF 联接基金成立于 2019 年 3 月 20 日，基于建仓期内对大盘以及市场情绪的短期判断，本基金采取了相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作，并于 2019 年 4 月 1 日开放基金的申购赎回及转换申请。本基金自成立以来，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.9681 元，本报告期份额净值增长率为-3.19%；C 类基金份额净值为 0.9676 元，本报告期份额净值增长率为-3.24%；同期业绩比较基准收益率为-9.81%。

报告期内本基金日跟踪偏离度的均值为 0.89%，年化跟踪误差为 19.686%，因本报告期包含了基金合同规定的建仓期，故跟踪误差等指标仍在调整之中。

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

易方达中证 500ETF 联接发起式 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500ETF 联接发起式 C:本报告期内未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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发起式联接基

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合规守信、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发起式联接基金的管理人——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发起式联接基金的投资运作、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发起式联接基金 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发起式联接基金 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发起式联接基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	333,754,367.87
结算备付金		3,576,499.38
存出保证金		4,745,443.52
交易性金融资产	6.4.7.2	686,578,291.70
其中：股票投资		164,352,423.91
基金投资		522,084,868.41
债券投资		140,999.38
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		28,408.90
应收利息	6.4.7.5	82,282.70
应收股利		-
应收申购款		2,360,577.95
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	7,677,235.38
资产总计		1,038,803,107.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 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		47,862,996.09
应付赎回款		2,801,935.68
应付管理人报酬		88,095.00
应付托管费		29,364.98
应付销售服务费		50,354.89
应付交易费用	6.4.7.7	366,555.44
应交税费		0.27
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	22,328.90
负债合计		51,221,631.25
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,020,495,218.33
未分配利润	6.4.7.1 0	-32,913,742.18
所有者权益合计		987,581,476.15
负债和所有者权益总计		1,038,803,107.40

注：1.本基金合同生效日为 2019 年 3 月 20 日，2019 年半年度实际报告期间为 2019 年 3 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2019 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.9681 元，C 类基金份额净值 0.9676 元；基金份额总额 1,020,495,218.33 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额

394,036,956.47 份，C 类基金份额总额 626,458,261.86 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发起式联接基金

本报告期：2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-30,730,637.96
1.利息收入		2,518,240.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,852,575.71
债券利息收入		8.49
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		665,655.85
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,011,057.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,092,626.49
基金投资收益	6.4.7.13	1,922.68
债券投资收益	6.4.7.14	561.79
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,079,084.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-29,348,869.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	111,048.59
减：二、费用		1,734,504.30
1. 管理人报酬		882,185.16
2. 托管费		141,162.22
3. 销售服务费		221,880.02
4. 交易费用	6.4.7.19	462,156.19
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		6.95
7. 其他费用	6.4.7.20	27,113.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,465,142.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,465,142.26

注：本基金合同生效日为 2019 年 3 月 20 日，2019 年半年度实际报告期间为 2019 年 3 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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发起式联接基金

本报告期：2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,985,764,476.49	-	1,985,764,476.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,465,142.26	-32,465,142.26
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）	-965,269,258.16	-448,599.92	-965,717,858.08
其中：1.基金申购款	139,720,568.05	-3,828,254.75	135,892,313.30
2.基金赎回款	-1,104,989,826.21	3,379,654.83	-1,101,610,171.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,020,495,218.33	-32,913,742.18	987,581,476.15

注：本基金合同生效日为 2019 年 3 月 20 日，2019 年半年度实际报告期间为 2019 年 3 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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发起式联接基金(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[2019]187 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发起式联接基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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发起式联接基金基金合同》于 2019 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,985,764,476.49 份基金份额，其中认购资金利息折合 684,687.28 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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。

本基金募集期间为 2019 年 2 月 25 日至 2019 年 3 月 15 日，募集金额总额为人民币 1,985,764,476.49 元，其中：有效净认购金额为人民币 1,985,079,789.21 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 684,687.28 元，经安永华明 (2019) 验字第 60468000_G03 号验资报告予以审验。

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发起式联接基金基金合同》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 重要会计政策和会计估计

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

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应

收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同,其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(5) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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	333,754,367.87
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	333,754,367.87

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	172,516,842.56	164,352,423.91	-8,164,418.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	140,999.38	140,999.38
	银行间市场	-	-
	合计	140,999.38	140,999.38
资产支持证券	-	-	-
基金	543,042,958.88	522,084,868.41	-20,958,090.47
其他	-	-	-
合计	715,700,800.82	686,578,291.70	-29,122,509.12

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	35,984,360.00	-	-	-
IC1912	35,984,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	35,984,360.00	-	-	-

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	38	35,758,000.00	-226,360.00
总额合计			35,758,000.00	-226,360.00
减：可抵消期货暂收款				-226,360.00
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	80,624.73
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	1,610.69
应收债券利息	8.04
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	39.24
合计	82,282.70

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	7,677,235.38
待摊费用	-
合计	7,677,235.38

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	366,555.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	366,555.44

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	795.72
预提费用	21,533.18
合计	22,328.90

6.4.7.9 实收基金

易方达中证 500ETF 联接发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	449,197,322.09	449,197,322.09
本期申购	73,095,742.26	73,095,742.26
本期赎回（以“-”号填列）	-128,256,107.88	-128,256,107.88
本期末	394,036,956.47	394,036,956.47

易方达中证 500ETF 联接发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,536,567,154.40	1,536,567,154.40
本期申购	66,624,825.79	66,624,825.79
本期赎回（以“-”号填列）	-976,733,718.33	-976,733,718.33
本期末	626,458,261.86	626,458,261.86

注：1.本基金合同于 2019 年 3 月 20 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,985,764,476.49 份基金份额，其中认购资金利息折合 684,687.28 份基金份额。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

易方达中证 500ETF 联接发起式 A

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,254,525.44	-10,567,617.81	-11,822,143.25
本期基金份额交易产生的变动数	-51,568.72	-713,158.27	-764,726.99
其中：基金申购款	53,034.18	-2,149,384.99	-2,096,350.81
基金赎回款	-104,602.90	1,436,226.72	1,331,623.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,306,094.16	-11,280,776.08	-12,586,870.24

易方达中证 500ETF 联接发起式 C

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,861,747.70	-18,781,251.31	-20,642,999.01
本期基金份额交易产生的变动数	-535,083.27	851,210.34	316,127.07
其中：基金申购款	21,263.30	-1,753,167.24	-1,731,903.94
基金赎回款	-556,346.57	2,604,377.58	2,048,031.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,396,830.97	-17,930,040.97	-20,326,871.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,654,983.87
定期存款利息收入	185,777.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,609.33
其他	204.73
合计	1,852,575.71

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 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,245,702.52
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-4,846,923.97
合计	-6,092,626.49

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 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,044,443.26
减：卖出股票成本总额	15,290,145.78
买卖股票差价收入	-1,245,702.52

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	466,800,480.00
减：现金支付申购款总额	251,246,361.09
减：申购股票成本总额	220,401,042.88
申购差价收入	-4,846,923.97

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	18,212.32

减：卖出/赎回基金成本总额	16,289.64
基金投资收益	1,922.68

6.4.7.14 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3月20日（基金合同生效日）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	8,563.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,999.93
减：应收利息总额	1.38
买卖债券差价收入	561.79

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,079,084.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,079,084.54

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1.交易性金融资产	-29,122,509.12
——股票投资	-8,164,418.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-20,958,090.47
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-226,360.00
——权证投资	-
——期货投资	-226,360.00
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	-29,348,869.12

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	111,016.09
其他	32.50
合计	111,048.59

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
交易所市场交易费用	444,506.60
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	17,649.59
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	17,649.59
合计	462,156.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
审计费用	21,533.18
信息披露费	-
银行汇划费	5,180.58
其他	400.00
合计	27,113.76

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、基金发起人
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、基金销售机构
易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	400,960,256.22	95.19%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券	76,085,557.00	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	373,416.65	95.19%	347,692.69	94.85%

注：上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	882,185.16
其中：支付销售机构的客户维护费	24,254.16

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）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 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金管理费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	141,162.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05%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 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金托管费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	4,562.81	4,562.81
广发证券	-	168.15	168.15
合计	-	4,730.96	4,730.96

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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

本基金本报告期末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 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C

基金合同生效日（2019 年 3 月 20 日）持有的基金份额	10,000,500.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,500.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.54%	-

注：本基金合同生效日为 2019 年 03 月 20 日。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 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

易方达中证 500ETF 联接发起式 A

无。

易方达中证 500ETF 联接发起式 C

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	333,754,367.87	1,654,983.87

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

于本报告期末,本基金持有 104,771,100 份目标 ETF 基金份额,占其总份额的比例为 75.14%。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证 500ETF 联接发起式 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500ETF 联接发起式 C

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
113028	环境转债	2019-06-19	2019-07-08	新发流通受限	100.00	100.00	1,410	140,999.38	140,999.38	-

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，采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于中证 500ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此本基金具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

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

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%。

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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	141,007.42
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	141,007.42

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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承

担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	333,754,367.87	-	-	-	333,754,367.87
结算备付金	3,576,499.38	-	-	-	3,576,499.38
存出保证金	4,745,443.52	-	-	-	4,745,443.52
交易性金融资产	-	-	140,999.38	686,437,292.32	686,578,291.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	28,408.90	28,408.90

应收利息	-	-	-	82,282.70	82,282.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,360,577.95	2,360,577.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	7,677,235.38	7,677,235.38
资产总计	342,076,310.77	-	140,999.38	696,585,797.25	1,038,803,107.40
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	-	-	-	47,862,996.09	47,862,996.09
应付赎回款	-	-	-	2,801,935.68	2,801,935.68
应付管理人报酬	-	-	-	88,095.00	88,095.00
应付托管费	-	-	-	29,364.98	29,364.98
应付销售服务费	-	-	-	50,354.89	50,354.89
应付交易费用	-	-	-	366,555.44	366,555.44
应交税费	-	-	-	0.27	0.27
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	22,328.90	22,328.90
负债总计	-	-	-	51,221,631.25	51,221,631.25
利率敏感度缺口	342,076,310.77	-	140,999.38	645,364,166.00	987,581,476.15

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	164,352,423.91	16.64
交易性金融资产—基金投资	522,084,868.41	52.86
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	686,437,292.32	69.51

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
	1.业绩比较基准上升 5%	24,698,296.41
	2.业绩比较基准下降 5%	-24,698,296.41

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 686,578,291.70 元，无属于第二层次的余额，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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(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。

(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	164,352,423.91	15.82
	其中：股票	164,352,423.91	15.82
2	基金投资	522,084,868.41	50.26
3	固定收益投资	140,999.38	0.01
	其中：债券	140,999.38	0.01

	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	337,330,867.25	32.47
8	其他各项资产	14,893,948.45	1.43
9	合计	1,038,803,107.40	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)	易方达基金管理有限公司	522,084,868.41	52.86

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	930,134.00	0.09
B	采矿业	4,525,534.25	0.46
C	制造业	89,518,962.30	9.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,969,781.40	0.71
E	建筑业	3,075,040.00	0.31
F	批发和零售业	10,918,975.46	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	9,541,708.40	0.97
H	住宿和餐饮业	997,496.00	0.10

I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,895,655.76	1.20
J	金融业	5,031,882.94	0.51
K	房地产业	11,147,969.80	1.13
L	租赁和商务服务业	1,132,923.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	652,587.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,114,228.60	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	114,600.00	0.01
Q	卫生和社会工作	50,940.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	3,370,677.00	0.34
S	综合	3,363,328.00	0.34
	合计	164,352,423.91	16.64

7.4 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	600872	中炬高新	60,144	2,575,967.52	0.26
2	600779	水井坊	37,700	1,915,914.00	0.19
3	600201	生物股份	116,800	1,832,592.00	0.19
4	600642	申能股份	267,500	1,607,675.00	0.16
5	603444	吉比特	7,600	1,595,696.00	0.16
6	600183	生益科技	105,500	1,587,775.00	0.16
7	600426	华鲁恒升	101,700	1,511,262.00	0.15
8	600161	天坛生物	57,270	1,446,067.50	0.15
9	600298	安琪酵母	45,200	1,429,676.00	0.14
10	600895	张江高科	67,800	1,391,256.00	0.14
11	600460	士兰微	80,400	1,334,640.00	0.14
12	601005	重庆钢铁	662,200	1,331,022.00	0.13
13	600801	华新水泥	65,560	1,327,590.00	0.13
14	600699	均胜电子	60,300	1,288,008.00	0.13
15	600879	航天电子	207,200	1,276,352.00	0.13
16	600325	华发股份	162,000	1,265,220.00	0.13
17	603369	今世缘	45,200	1,260,628.00	0.13
18	600536	中国软件	22,600	1,212,942.00	0.12
19	600885	宏发股份	49,000	1,190,700.00	0.12
20	601168	西部矿业	184,600	1,177,748.00	0.12

21	600528	中铁工业	101,700	1,176,669.00	0.12
22	600392	盛和资源	105,500	1,166,830.00	0.12
23	600820	隧道股份	184,600	1,164,826.00	0.12
24	600376	首开股份	128,100	1,143,933.00	0.12
25	600673	东阳光	139,600	1,095,860.00	0.11
26	600811	东方集团	290,100	1,079,172.00	0.11
27	603000	人民网	60,300	1,075,149.00	0.11
28	600755	厦门国贸	123,800	1,068,394.00	0.11
29	600166	福田汽车	449,600	1,065,552.00	0.11
30	600315	上海家化	33,900	1,055,985.00	0.11
31	600848	上海临港	33,900	1,055,307.00	0.11
32	600167	联美控股	98,780	1,045,092.40	0.11
33	600839	四川长虹	354,210	1,044,919.50	0.11
34	600022	山东钢铁	625,600	1,044,752.00	0.11
35	600410	华胜天成	97,200	1,042,956.00	0.11
36	600875	东方电气	98,100	1,041,822.00	0.11
37	601866	中远海发	380,500	1,034,960.00	0.10
38	600567	山鹰纸业	304,100	1,024,817.00	0.10
39	600881	亚泰集团	312,700	1,016,275.00	0.10
40	600718	东软集团	79,100	1,014,062.00	0.10
41	600804	鹏博士	133,400	1,003,168.00	0.10
42	601128	常熟银行	129,800	1,002,056.00	0.10
43	601872	招商轮船	229,800	1,001,928.00	0.10
44	600808	马钢股份	290,100	989,241.00	0.10
45	600079	人福医药	94,200	989,100.00	0.10
46	600171	上海贝岭	60,300	979,875.00	0.10
47	600021	上海电力	105,500	915,740.00	0.09
48	600143	金发科技	184,600	904,540.00	0.09
49	600266	北京城建	110,760	892,725.60	0.09
50	600572	康恩贝	139,300	891,520.00	0.09
51	600967	内蒙一机	79,100	885,920.00	0.09
52	600160	巨化股份	124,300	883,773.00	0.09
53	603077	和邦生物	464,600	882,740.00	0.09
54	600643	爱建集团	90,400	866,032.00	0.09
55	600511	国药股份	37,700	865,969.00	0.09
56	600863	内蒙华电	275,000	863,500.00	0.09
57	600260	凯乐科技	43,200	863,136.00	0.09
58	600525	长园集团	135,700	857,624.00	0.09
59	601098	中南传媒	67,800	856,992.00	0.09
60	600064	南京高科	79,100	847,161.00	0.09
61	600466	蓝光发展	135,560	843,183.20	0.09
62	600737	中粮糖业	96,900	841,092.00	0.09
63	600388	龙净环保	67,800	840,042.00	0.09
64	601106	中国一重	267,500	839,950.00	0.09

65	600827	百联股份	82,900	813,249.00	0.08
66	600258	首旅酒店	45,200	812,696.00	0.08
67	601718	际华集团	207,200	810,152.00	0.08
68	600026	中远海能	124,300	806,707.00	0.08
69	600120	浙江东方	63,229	805,537.46	0.08
70	600500	中化国际	105,500	788,085.00	0.08
71	600380	健康元	90,400	781,960.00	0.08
72	601000	唐山港	282,800	777,700.00	0.08
73	600008	首创股份	218,500	769,120.00	0.08
74	601966	玲珑轮胎	45,200	768,400.00	0.08
75	600282	南钢股份	219,400	767,900.00	0.08
76	600649	城投控股	117,000	756,990.00	0.08
77	600039	四川路桥	207,200	754,208.00	0.08
78	600959	江苏有线	169,400	753,830.00	0.08
79	600584	长电科技	58,400	750,440.00	0.08
80	600216	浙江医药	71,600	733,184.00	0.07
81	600557	康缘药业	49,000	728,140.00	0.07
82	600598	北大荒	67,800	727,494.00	0.07
83	601179	中国西电	195,900	724,830.00	0.07
84	600138	中青旅	56,500	716,985.00	0.07
85	601678	滨化股份	105,500	713,180.00	0.07
86	603233	大参林	15,830	712,350.00	0.07
87	600373	中文传媒	56,500	709,640.00	0.07
88	601100	恒立液压	22,600	709,188.00	0.07
89	600316	洪都航空	49,000	701,190.00	0.07
90	600729	重庆百货	22,600	683,424.00	0.07
90	601608	中信重工	158,200	683,424.00	0.07
92	600158	中体产业	66,600	681,318.00	0.07
93	601231	环旭电子	56,500	680,825.00	0.07
94	600348	阳泉煤业	116,800	678,608.00	0.07
95	600970	中材国际	105,500	678,365.00	0.07
96	600435	北方导航	75,300	676,947.00	0.07
97	600507	方大特钢	67,800	663,084.00	0.07
98	603883	老百姓	11,300	660,824.00	0.07
99	600645	中源协和	37,700	652,587.00	0.07
100	600094	大名城	102,600	645,354.00	0.07
101	600884	杉杉股份	60,300	642,195.00	0.07
102	601880	大连港	301,400	641,982.00	0.07
103	600060	海信电器	74,300	640,466.00	0.06
104	600409	三友化工	113,000	639,580.00	0.06
105	600418	江淮汽车	123,700	638,292.00	0.06
106	600312	平高电气	82,900	637,501.00	0.06
107	603228	景旺电子	15,740	629,757.40	0.06
108	600823	世茂股份	135,600	625,116.00	0.06

109	600717	天津港	96,320	618,374.40	0.06
110	600037	歌华有线	60,200	617,050.00	0.06
111	600155	华创阳安	45,600	612,408.00	0.06
112	600307	酒钢宏兴	301,400	611,842.00	0.06
113	600056	中国医药	45,200	609,748.00	0.06
114	600125	铁龙物流	94,200	607,590.00	0.06
115	600597	光明乳业	56,500	607,375.00	0.06
116	600291	西水股份	60,300	606,618.00	0.06
117	600338	西藏珠峰	34,680	606,206.40	0.06
118	601958	金钼股份	90,400	605,680.00	0.06
119	601200	上海环境	44,340	603,467.40	0.06
120	600782	新钢股份	120,500	602,500.00	0.06
121	600664	哈药股份	144,200	596,988.00	0.06
122	603885	吉祥航空	45,200	592,120.00	0.06
123	600478	科力远	103,600	579,124.00	0.06
124	600648	外高桥	27,600	579,048.00	0.06
125	600062	华润双鹤	45,200	569,972.00	0.06
126	600267	海正药业	56,500	565,000.00	0.06
127	600835	上海机电	33,900	562,740.00	0.06
128	600582	天地科技	162,000	558,900.00	0.06
129	603816	顾家家居	17,340	553,492.80	0.06
130	601928	凤凰传媒	67,800	547,146.00	0.06
131	600017	日照港	173,300	545,895.00	0.06
132	600575	皖江物流	184,600	540,878.00	0.05
133	603866	桃李面包	12,940	538,951.00	0.05
134	601311	骆驼股份	49,000	531,650.00	0.05
135	603659	璞泰来	11,300	531,326.00	0.05
136	600908	无锡银行	94,200	531,288.00	0.05
137	600993	马应龙	29,900	527,735.00	0.05
138	603486	科沃斯	17,340	524,535.00	0.05
139	600765	中航重机	56,400	520,572.00	0.05
140	600565	迪马股份	139,400	519,962.00	0.05
141	600859	王府井	33,900	514,941.00	0.05
142	601326	秦港股份	139,400	506,022.00	0.05
143	600073	上海梅林	54,000	496,800.00	0.05
144	600499	科达洁能	113,000	494,940.00	0.05
145	600633	浙数文化	52,700	492,745.00	0.05
146	600901	江苏租赁	79,100	481,719.00	0.05
147	600611	大众交通	101,700	472,905.00	0.05
148	600151	航天机电	90,400	465,560.00	0.05
149	600563	法拉电子	11,300	465,221.00	0.05
150	600141	兴发集团	45,200	464,656.00	0.05
151	600169	太原重工	173,300	462,711.00	0.05
152	600259	广晟有色	11,300	455,390.00	0.05

153	600787	中储股份	79,100	453,243.00	0.05
154	600770	综艺股份	67,800	452,904.00	0.05
155	603888	新华网	22,600	451,096.00	0.05
156	600580	卧龙电驱	52,700	443,207.00	0.04
157	600623	华谊集团	57,800	441,592.00	0.04
158	600978	宜华生活	116,800	439,168.00	0.04
159	601016	节能风电	162,000	430,920.00	0.04
160	601717	郑煤机	75,300	429,963.00	0.04
161	600545	卓郎智能	60,300	428,733.00	0.04
162	600006	东风汽车	80,100	426,933.00	0.04
163	601869	长飞光纤	11,300	423,750.00	0.04
164	600640	号百控股	31,400	420,132.00	0.04
165	603806	福斯特	11,300	415,049.00	0.04
166	600058	五矿发展	49,000	414,050.00	0.04
167	603568	伟明环保	19,185	412,861.20	0.04
168	600759	洲际油气	106,200	409,932.00	0.04
169	600874	创业环保	49,000	406,210.00	0.04
170	603198	迎驾贡酒	22,600	404,766.00	0.04
171	600393	粤泰股份	86,400	401,760.00	0.04
172	600751	海航科技	125,300	398,454.00	0.04
173	600996	贵广网络	36,200	390,236.00	0.04
174	600098	广州发展	62,500	385,000.00	0.04
175	600757	长江传媒	56,500	384,765.00	0.04
176	600748	上实发展	46,400	384,656.00	0.04
177	603766	隆鑫通用	88,900	372,491.00	0.04
178	600195	中牧股份	26,600	368,410.00	0.04
179	600639	浦东金桥	22,600	365,442.00	0.04
180	603515	欧普照明	11,300	364,425.00	0.04
181	600416	湘电股份	60,500	364,210.00	0.04
182	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.04
183	601001	大同煤业	79,100	361,487.00	0.04
184	600750	江中药业	27,650	359,726.50	0.04
185	600869	智慧能源	79,100	357,532.00	0.04
186	601689	拓普集团	22,600	346,232.00	0.04
187	603868	飞科电器	8,800	344,520.00	0.03
188	600350	山东高速	71,600	343,680.00	0.03
189	601801	皖新传媒	56,500	339,565.00	0.03
190	600657	信达地产	79,100	325,892.00	0.03
191	600329	中新药业	22,600	322,954.00	0.03
192	600777	新潮能源	154,100	320,528.00	0.03
193	600335	国机汽车	46,300	320,396.00	0.03
194	600694	大商股份	11,300	315,383.00	0.03
195	600971	恒源煤电	53,480	312,858.00	0.03
196	601127	小康股份	22,600	296,060.00	0.03

197	600428	中远海特	79,100	292,670.00	0.03
198	600939	重庆建工	57,100	279,219.00	0.03
199	600862	中航高科	30,100	270,599.00	0.03
200	600053	九鼎投资	11,300	263,290.00	0.03
201	601003	柳钢股份	45,200	261,708.00	0.03
202	600458	时代新材	23,800	247,282.00	0.03
203	603650	彤程新材	11,300	246,792.00	0.02
204	603328	依顿电子	22,600	232,102.00	0.02
205	600280	中央商场	60,300	216,477.00	0.02
206	600126	杭钢股份	45,190	206,066.40	0.02
207	600277	亿利洁能	41,800	203,566.00	0.02
208	603556	海兴电力	14,600	201,772.00	0.02
209	601969	海南矿业	33,900	199,332.00	0.02
210	601777	力帆股份	44,000	188,760.00	0.02
211	600754	锦江股份	7,500	184,800.00	0.02
212	600917	重庆燃气	26,400	183,744.00	0.02
213	000860	顺鑫农业	3,900	181,935.00	0.02
214	002049	紫光国微	4,000	176,440.00	0.02
215	603877	太平鸟	11,300	175,376.00	0.02
216	603712	七一二	7,500	159,225.00	0.02
217	603355	莱克电气	7,300	157,096.00	0.02
218	000066	中国长城	15,000	154,200.00	0.02
219	603225	新风鸣	11,700	146,133.00	0.01
220	000401	冀东水泥	8,000	140,880.00	0.01
221	002371	北方华创	2,000	138,500.00	0.01
222	601811	新华文轩	11,300	137,973.00	0.01
223	002129	中环股份	14,000	136,640.00	0.01
224	002463	沪电股份	10,000	136,200.00	0.01
225	300450	先导智能	4,000	134,400.00	0.01
226	300383	光环新网	8,000	134,160.00	0.01
227	002195	二三四五	33,800	131,482.00	0.01
228	000623	吉林敖东	8,000	131,120.00	0.01
229	600179	ST 安通	43,800	128,334.00	0.01
230	300253	卫宁健康	9,000	127,620.00	0.01
231	002465	海格通信	13,000	124,020.00	0.01
232	002223	鱼跃医疗	5,000	123,100.00	0.01
233	002916	深南电路	1,200	122,304.00	0.01
234	002268	卫士通	5,000	122,250.00	0.01
235	002507	涪陵榨菜	4,000	122,000.00	0.01
236	000750	国海证券	24,000	120,720.00	0.01
237	002384	东山精密	8,000	116,560.00	0.01
238	603025	大豪科技	11,300	115,712.00	0.01
239	603377	东方时尚	7,500	114,600.00	0.01
240	002506	协鑫集成	17,000	113,560.00	0.01

241	002500	山西证券	14,000	113,400.00	0.01
242	002340	格林美	24,000	113,040.00	0.01
243	002127	南极电商	10,000	112,400.00	0.01
244	002439	启明星辰	4,000	107,600.00	0.01
245	000686	东北证券	12,000	105,720.00	0.01
246	603056	德邦股份	7,500	105,600.00	0.01
247	000975	银泰资源	8,000	105,520.00	0.01
248	000723	美锦能源	10,000	104,500.00	0.01
249	000009	中国宝安	18,000	102,780.00	0.01
250	002373	千方科技	6,000	102,600.00	0.01
251	000778	新兴铸管	23,000	102,120.00	0.01
252	000998	隆平高科	7,000	101,360.00	0.01
253	000997	新大陆	6,000	101,340.00	0.01
254	002299	圣农发展	4,000	101,280.00	0.01
255	000060	中金岭南	21,000	98,490.00	0.01
256	002092	中泰化学	12,000	95,520.00	0.01
257	002385	大北农	18,000	95,220.00	0.01
258	000581	威孚高科	5,000	92,800.00	0.01
259	002353	杰瑞股份	4,000	92,400.00	0.01
260	300168	万达信息	7,000	90,790.00	0.01
261	000690	宝新能源	14,000	90,160.00	0.01
262	000039	中集集团	8,400	89,712.00	0.01
263	000960	锡业股份	8,000	89,360.00	0.01
264	002078	太阳纸业	13,000	88,530.00	0.01
265	000999	华润三九	3,000	88,020.00	0.01
266	601019	山东出版	11,200	87,136.00	0.01
267	000830	鲁西化工	8,000	87,040.00	0.01
268	002191	劲嘉股份	7,000	86,870.00	0.01
269	002221	东华能源	10,000	86,100.00	0.01
270	000547	航天发展	9,000	86,040.00	0.01
271	603569	长久物流	7,300	84,607.00	0.01
272	002372	伟星新材	4,800	83,520.00	0.01
273	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
274	000729	燕京啤酒	12,000	79,680.00	0.01
275	000970	中科三环	7,000	79,450.00	0.01
276	002281	光迅科技	3,000	79,440.00	0.01
277	300315	掌趣科技	23,000	79,350.00	0.01
278	000988	华工科技	5,000	79,100.00	0.01
279	002074	国轩高科	6,000	78,660.00	0.01
280	300027	华谊兄弟	16,000	78,560.00	0.01
281	300088	长信科技	15,000	75,900.00	0.01
282	002670	国盛金控	6,000	75,600.00	0.01
283	300274	阳光电源	8,000	74,800.00	0.01
284	002440	闰土股份	6,000	74,760.00	0.01

285	000878	云南铜业	7,000	74,410.00	0.01
286	300166	东方国信	6,000	73,740.00	0.01
287	002019	亿帆医药	6,000	73,500.00	0.01
288	000636	风华高科	6,000	72,600.00	0.01
289	002131	利欧股份	38,000	72,580.00	0.01
290	300001	特锐德	4,000	72,080.00	0.01
291	000008	神州高铁	19,000	71,630.00	0.01
292	000089	深圳机场	8,000	71,120.00	0.01
293	000563	陕国投 A	16,000	71,040.00	0.01
294	002038	双鹭药业	3,000	70,680.00	0.01
295	002155	湖南黄金	7,000	70,490.00	0.01
296	002110	三钢闽光	7,500	69,750.00	0.01
297	002273	水晶光电	6,000	69,480.00	0.01
298	002152	广电运通	10,000	68,500.00	0.01
299	002589	瑞康医药	9,000	68,310.00	0.01
300	000598	兴蓉环境	15,000	68,250.00	0.01
301	002002	鸿达兴业	11,000	68,090.00	0.01
302	000930	中粮生化	9,000	67,680.00	0.01
303	002174	游族网络	4,000	67,520.00	0.01
304	002583	海能达	8,000	67,120.00	0.01
305	000738	航发控制	5,000	67,000.00	0.01
306	000932	华菱钢铁	14,000	66,780.00	0.01
307	002250	联化科技	6,000	66,540.00	0.01
308	000513	丽珠集团	2,000	66,460.00	0.01
309	000732	泰禾集团	4,000	66,000.00	0.01
310	000559	万向钱潮	11,000	65,780.00	0.01
311	002690	美亚光电	2,000	65,200.00	0.01
312	300418	昆仑万维	5,000	64,350.00	0.01
313	000031	大悦城	10,000	64,200.00	0.01
314	300316	晶盛机电	5,000	63,450.00	0.01
315	002399	海普瑞	3,000	62,970.00	0.01
316	300113	顺网科技	4,000	62,720.00	0.01
317	002242	九阳股份	3,000	62,430.00	0.01
318	000027	深圳能源	10,000	62,000.00	0.01
319	002266	浙富控股	13,000	61,750.00	0.01
320	000807	云铝股份	13,000	60,970.00	0.01
321	002368	太极股份	2,000	60,600.00	0.01
322	000758	中色股份	11,000	60,390.00	0.01
323	000685	中山公用	7,000	59,780.00	0.01
323	300058	蓝色光标	14,000	59,780.00	0.01
325	002407	多氟多	5,000	59,200.00	0.01
326	000488	晨鸣纸业	11,000	58,960.00	0.01
327	002004	华邦健康	12,000	58,320.00	0.01
328	000681	视觉中国	3,000	58,140.00	0.01

329	000877	天山股份	5,000	58,100.00	0.01
330	002603	以岭药业	5,000	57,900.00	0.01
331	002414	高德红外	3,000	57,600.00	0.01
332	000887	中鼎股份	6,000	57,540.00	0.01
333	002051	中工国际	5,000	57,350.00	0.01
334	300182	捷成股份	13,000	57,330.00	0.01
335	002183	怡亚通	12,000	57,240.00	0.01
336	300010	立思辰	6,000	56,340.00	0.01
337	000156	华数传媒	5,000	55,050.00	0.01
338	002212	南洋股份	4,000	54,800.00	0.01
339	002408	齐翔腾达	7,000	54,250.00	0.01
340	002244	滨江集团	13,000	53,950.00	0.01
341	002030	达安基因	5,000	53,650.00	0.01
342	002176	江特电机	11,000	53,570.00	0.01
343	000813	德展健康	7,000	53,340.00	0.01
344	000528	柳工	8,000	53,280.00	0.01
345	002056	横店东磁	7,000	53,200.00	0.01
346	300115	长盈精密	5,000	52,450.00	0.01
347	300324	旋极信息	9,000	52,110.00	0.01
348	300026	红日药业	15,000	51,750.00	0.01
349	300002	神州泰岳	13,000	51,740.00	0.01
350	000712	锦龙股份	4,000	51,360.00	0.01
351	002470	金正大	14,000	50,960.00	0.01
352	300244	迪安诊断	3,000	50,940.00	0.01
353	002358	森源电气	5,000	50,750.00	0.01
354	000021	深科技	6,000	48,780.00	0.00
355	002491	通鼎互联	6,000	48,540.00	0.00
356	300308	中际旭创	1,400	47,586.00	0.00
357	002701	奥瑞金	10,000	46,700.00	0.00
358	300134	大富科技	3,000	46,590.00	0.00
359	000519	中兵红箭	6,000	46,380.00	0.00
360	000727	华东科技	22,000	45,980.00	0.00
361	002672	东江环保	4,000	45,360.00	0.00
362	002505	大康农业	23,000	45,310.00	0.00
363	000400	许继电气	5,000	45,300.00	0.00
364	000078	海王生物	13,000	45,240.00	0.00
365	002285	世联行	10,000	45,100.00	0.00
366	000718	苏宁环球	13,000	44,980.00	0.00
367	000717	韶钢松山	10,000	44,300.00	0.00
368	000006	深振业 A	8,000	43,600.00	0.00
369	002426	胜利精密	17,000	43,520.00	0.00
370	002249	大洋电机	10,000	43,400.00	0.00
371	002128	露天煤业	5,000	43,250.00	0.00
372	300055	万邦达	6,000	42,780.00	0.00

373	002317	众生药业	5,000	42,550.00	0.00
374	000543	皖能电力	9,000	42,390.00	0.00
375	002254	泰和新材	4,000	42,320.00	0.00
376	002831	裕同科技	2,200	42,174.00	0.00
377	000028	国药一致	1,000	41,830.00	0.00
378	000848	承德露露	5,000	41,650.00	0.00
378	002640	跨境通	5,000	41,650.00	0.00
380	000926	福星股份	6,000	41,520.00	0.00
381	000012	南玻 A	9,900	41,184.00	0.00
382	300133	华策影视	6,000	40,380.00	0.00
383	002280	联络互动	11,000	40,260.00	0.00
384	002573	清新环境	5,000	40,250.00	0.00
385	000600	建投能源	6,000	40,200.00	0.00
386	002444	巨星科技	4,000	39,920.00	0.00
387	002028	思源电气	4,000	39,840.00	0.00
388	300459	金科文化	7,000	39,830.00	0.00
389	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
390	300197	铁汉生态	11,000	39,490.00	0.00
391	300376	易事特	8,000	39,440.00	0.00
392	002839	张家港行	7,000	39,410.00	0.00
393	002807	江阴银行	8,400	39,312.00	0.00
394	000564	供销大集	15,000	39,150.00	0.00
395	002544	杰赛科技	3,000	39,000.00	0.00
396	000062	深圳华强	2,900	38,541.00	0.00
397	000090	天健集团	7,800	38,532.00	0.00
398	000158	常山北明	7,000	37,940.00	0.00
399	002366	台海核电	4,000	37,440.00	0.00
400	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
401	002093	国脉科技	4,000	37,160.00	0.00
402	002390	信邦制药	7,000	36,890.00	0.00
403	300199	翰宇药业	4,000	36,680.00	0.00
404	300287	飞利信	9,000	35,730.00	0.00
405	002375	亚厦股份	6,000	35,460.00	0.00
406	002745	木林森	3,000	35,160.00	0.00
407	002233	塔牌集团	3,000	35,040.00	0.00
408	300159	新研股份	7,000	34,860.00	0.00
409	000937	冀中能源	9,000	34,740.00	0.00
410	000537	广宇发展	5,000	34,600.00	0.00
411	002665	首航节能	10,000	33,900.00	0.00
412	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
413	002332	仙琚制药	5,000	33,800.00	0.00
414	000980	众泰汽车	8,000	33,680.00	0.00
415	002302	西部建设	3,000	33,420.00	0.00
416	300257	开山股份	3,000	33,240.00	0.00

417	000990	诚志股份	2,000	32,820.00	0.00
418	000061	农产品	6,000	32,520.00	0.00
419	002048	宁波华翔	3,000	32,460.00	0.00
420	000501	鄂武商 A	3,000	32,250.00	0.00
421	000426	兴业矿业	6,000	32,220.00	0.00
422	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
423	002815	崇达技术	2,000	31,180.00	0.00
424	300297	蓝盾股份	5,000	30,150.00	0.00
425	002489	浙江永强	9,000	30,060.00	0.00
426	002424	贵州百灵	3,000	29,640.00	0.00
427	000025	特力 A	1,450	29,319.00	0.00
428	002517	恺英网络	9,000	28,710.00	0.00
429	000536	华映科技	11,000	27,720.00	0.00
430	002437	誉衡药业	7,000	27,650.00	0.00
431	002503	搜于特	10,000	27,500.00	0.00
432	000766	通化金马	4,000	27,200.00	0.00
433	002434	万里扬	4,000	27,160.00	0.00
434	002635	安洁科技	2,000	26,980.00	0.00
435	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
436	002118	紫鑫药业	4,000	26,960.00	0.00
437	000541	佛山照明	5,000	26,200.00	0.00
438	002509	天广中茂	12,000	24,720.00	0.00
439	000552	靖远煤电	9,000	24,390.00	0.00
440	002482	广田集团	5,000	24,300.00	0.00
441	002707	众信旅游	4,000	24,280.00	0.00
442	002709	天赐材料	1,000	24,200.00	0.00
443	002251	步步高	3,000	23,910.00	0.00
444	002344	海宁皮城	5,000	23,300.00	0.00
445	000829	天音控股	4,000	23,280.00	0.00
446	002512	达华智能	5,000	22,600.00	0.00
447	002920	德赛西威	1,000	22,400.00	0.00
448	002818	富森美	1,700	21,811.00	0.00
449	002681	奋达科技	5,000	21,200.00	0.00
450	002416	爱施德	3,000	18,750.00	0.00
451	300266	兴源环境	4,000	18,160.00	0.00
452	000987	越秀金控	2,000	18,040.00	0.00
453	002699	美盛文化	3,000	18,000.00	0.00
454	600845	宝信软件	600	17,088.00	0.00
455	000761	本钢板材	3,000	12,900.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603444	吉比特	5,659,367.00	0.57
2	600872	中炬高新	4,565,370.30	0.46
3	600201	生物股份	4,157,771.99	0.42
4	600426	华鲁恒升	3,581,238.00	0.36
5	600779	水井坊	3,441,089.00	0.35
6	600642	申能股份	3,430,343.00	0.35
7	600895	张江高科	3,308,054.26	0.33
8	600699	均胜电子	3,173,167.00	0.32
9	600879	航天电子	3,120,562.00	0.32
10	600325	华发股份	3,084,355.00	0.31
11	600183	生益科技	3,073,592.95	0.31
12	601005	重庆钢铁	2,955,737.00	0.30
13	600804	鹏博士	2,947,867.00	0.30
14	600298	安琪酵母	2,945,254.00	0.30
15	600572	康恩贝	2,921,259.00	0.30
16	600460	士兰微	2,910,749.00	0.29
17	600536	中国软件	2,903,856.00	0.29
18	600820	隧道股份	2,874,126.00	0.29
19	603000	人民网	2,870,719.00	0.29
20	603369	今世缘	2,836,285.28	0.29

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600600	青岛啤酒	1,595,944.00	0.16
2	600256	广汇能源	1,285,713.00	0.13
3	603658	安图生物	919,318.00	0.09
4	603899	晨光文具	911,995.00	0.09
5	600655	豫园股份	885,763.00	0.09
6	600503	华丽家族	739,264.00	0.07
7	603444	吉比特	729,846.00	0.07
8	601598	中国外运	695,526.00	0.07
9	600366	宁波韵升	646,686.00	0.07
10	601990	南京证券	455,617.00	0.05
11	600122	宏图高科	389,218.00	0.04
12	600989	宝丰能源	330,563.92	0.03

13	600086	东方金钰	316,081.00	0.03
14	600773	西藏城投	302,055.00	0.03
15	600594	益佰制药	285,691.00	0.03
16	603169	兰石重装	256,396.00	0.03
17	600184	光电股份	239,862.00	0.02
18	600743	华远地产	236,208.00	0.02
19	300347	泰格医药	191,015.00	0.02
20	002410	广联达	175,359.00	0.02

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。

7.5.3 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	408,208,031.22
卖出股票收入（成交）总额	14,044,443.26

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。

7.6 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）	140,999.38	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	140,999.38	0.01

7.7 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	1,410	140,999.38	0.01

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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	38	35,758,000.00	-226,360.00	在本报告期内，基金利用股指期货进行套期保值操作，以应对基金由于大额净申赎等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，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。
公允价值变动总额合计（元）				-226,360.00
股指期货投资本期收益（元）				-
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-226,360.00

7.11.2 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。本基金在出现大额净申赎等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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,745,443.52
2	应收证券清算款	28,408.90
3	应收股利	-
4	应收利息	82,282.70
5	应收申购款	2,360,577.95
6	其他应收款	7,677,235.38
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	14,893,948.45

7.13.4 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。

7.13.5 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达中证 500ETF 联接发起式 A	12,045	32,713.74	10,999,681.00	2.79%	383,037,275.47	97.21%
易方达中证 500ETF 联接发起式 C	13,858	45,205.53	7,804,468.50	1.25%	618,653,793.36	98.75%
合计	25,903	39,396.80	18,804,149.50	1.84%	1,001,691,068.83	98.16%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	12,451.23	0.0032%
	易方达中证 500ETF 联接发起式 C	0.00	0.0000%

	合计	12,451.23	0.0012%
--	----	-----------	---------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	0
	易方达中证 500ETF 联接发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	0
	易方达中证 500ETF 联接发起式 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,500.00	0.9800%	10,000,500.00	0.9800%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,500.00	0.9800%	10,000,500.00	0.9800%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500ETF 联接发起式 A	易方达中证 500ETF 联接发起式 C
基金合同生效日（2019 年 3 月 20 日）基金份额总额	449,197,322.09	1,536,567,154.40
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	73,095,742.26	66,624,825.79

减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	128,256,107.88	976,733,718.33
基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	394,036,956.47	626,458,261.86

注：本基金合同生效日为 2019 年 03 月 20 日。

§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	
广发证券	1	400,960,256.22	95.19%	373,416.65	95.19%	-
中信建投	1	20,254,026.14	4.81%	18,862.75	4.81%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司各一个交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	8,563.10	100.00%	790,000.00	100.00%	-	-	76,085.557.00	100.00%

中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---	---

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	易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同生效公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-03-21
2	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-03-27
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中投证券费率优惠活动的公告	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	2019-03-29
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国盛证券费率优惠活动的公告	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	2019-04-12
5	易方达基金管理有限公司关于调低旗下易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金相关基金费率并修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-04-20
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加杭州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-05-20
7	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
8	易方达基金管理有限公司关于调整转换业务货币市场基金未付收益支付规则的公告	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	2019-06-20
9	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
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加长城国瑞证券费率优惠活动的公告	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	2019-06-28

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件；
- 2.《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发起式联接基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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