

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
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	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	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	35
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权益投资明细 ..	36
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	72
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	74
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	74
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	74
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金融衍生品投资明
细	74
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 74
7.11	投资组合报告附注 75
8	基金份额持有人信息 76
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 76
8.2	期末上市基金前十名持有人 76
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 77
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 .. 77
9	开放式基金份额变动 77
10	重大事件揭示 77
10.1	基金份额持有人大会决议 77
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 77
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 78
10.4	基金投资策略的改变 78
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 78
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 78
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 78
10.8	其他重大事件 80
11	备查文件目录 82
11.1	备查文件目录 82
11.2	存放地点 82
11.3	查阅方式 82

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）
基金简称	易方达标普 500 指数（QDII-LOF）
场内简称	标普 500
基金主代码	161125
交易代码	161125
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	121,084,891.47 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 12 月 14 日

注：易方达标普 500 指数（QDII-LOF）含人民币份额（份额代码：161125）及美元现汇份额（份额代码：003718），交易代码仅列示人民币份额代码。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	作为追踪标普 500 指数的被动式海外指数基金，本基金采用完全复制法，力求追踪误差最小化。
业绩比较基准	标普 500 指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，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。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
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）	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	State Street Bank and Trust Company
	中文	无	道富银行
注册地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址		无	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

2.6 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	371,359.63
本期利润	23,482,040.55
加权平均基金份额本期利润	0.1867
本期加权平均净值利润率	15.44%
本期基金份额净值增长率	16.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	22,770,568.05
期末可供分配基金份额利润	0.1881
期末基金资产净值	155,850,083.10
期末基金份额净值	1.2871
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	28.71%

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

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

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

3.2 基金净值表现

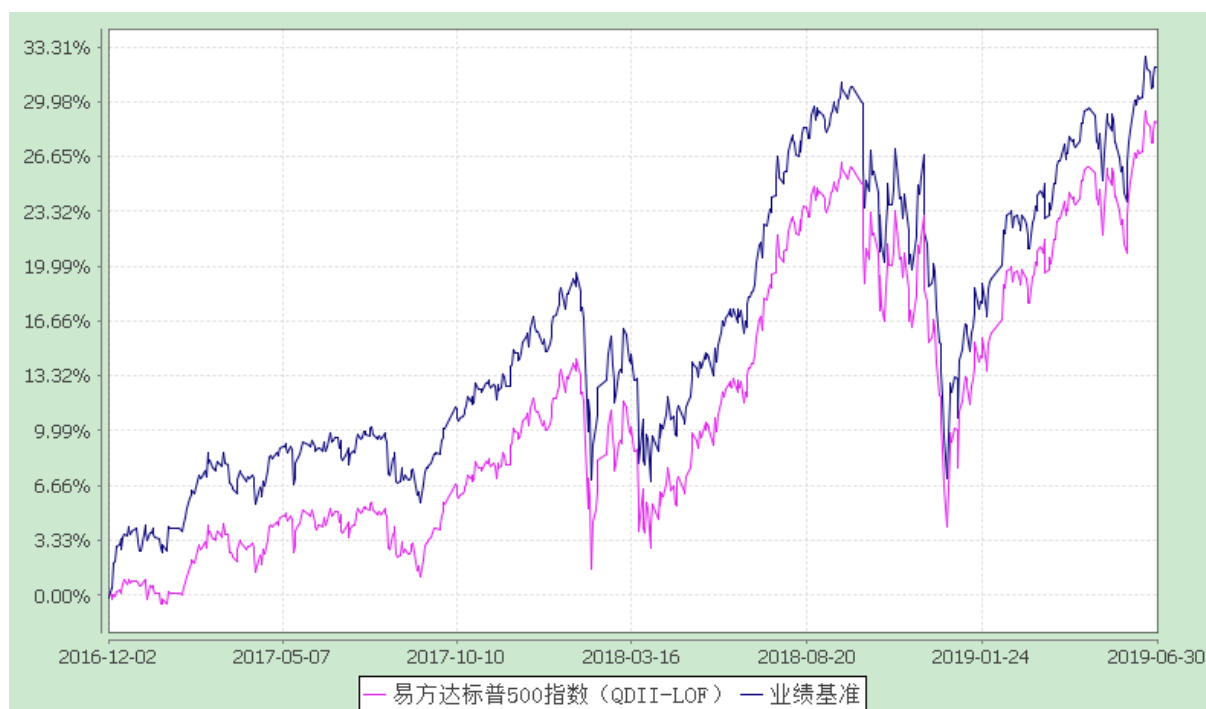
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.11%	0.67%	6.18%	0.67%	-0.07%	0.00%
过去三个月	5.85%	0.71%	5.67%	0.71%	0.18%	0.00%
过去六个月	16.84%	0.77%	16.63%	0.77%	0.21%	0.00%
过去一年	13.14%	0.97%	11.87%	0.96%	1.27%	0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起	28.71%	0.81%	32.11%	0.81%	-3.40%	0.00%

至今

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

易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）
 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
 （2016 年 12 月 2 日至 2019 年 6 月 30 日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 28.71%，同期业绩比较基准收益率为 32.11%。

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		
FAN BING(范 冰)	本基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、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的基金经理	2017-03-25	-	14 年	新加坡籍，硕士研究生，曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团 Middle Office 中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金	2018-08-11	-	12 年	硕士研究生，曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专

	经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理				员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	--------------------------

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年一季度，标普 500 指数创近十年来最大季度涨幅。美国一季度经济数据低于预期，PMI、非农就业和消费等数据显示经济基本面和需求开始从顶点转向衰退。美联储在 2019 年一季度维持利率不变，同时给出超预期的鸽派指引，进一步下调了经济和通胀预期，并在年内结束缩表。偏宽松的货币政策提振了市场的风险偏好，推动美股上涨。美国政府在 2019 年 1 月经历了史上最长的关门事件，特朗普的一些政策也受到国会的掣肘，推进放缓或停滞。中美贸易摩擦出现了缓和迹象，双方停止了互相加征关税的动作，等待后续谈判进一步解决争端，也进一步改善了市场的情绪。

2019 年二季度，宏观方面多项数据显示美国经济内生动力减弱，就业和消费不达预期，预计未来企业盈利下降。美联储 6 月维持利率水平不变，但偏鸽派的前瞻指引基本为未来降息打开了大门。2019 年 5 月初，特朗普通过推特发出了继续加征关税的信号，受此影响美股出现明显回调，直到 6 月份在美联储降息预期的推动下反弹并创出历史新高。中美两国元首在大阪 G20 会议期间会面，双方同意在平等和相互尊重的基础上重启经贸磋商，美方表示不再对中国出口产品加征新的关税，两国经贸团队将就具体问题进行讨论。

作为追踪标普 500 指数的被动式海外指数基金，本基金采用完全复制法，力求追踪误差最小化。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2871 元，本报告期份额净值增长率为 16.84%，同期业绩比

较基准收益率为 16.63%，年化跟踪误差 0.377%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，全球经济增速面临压力，各国政府转向偏宽松的货币政策；重点关注美股企业半年报的盈利情况，以及美联储是否会如市场预测的开启降息的进程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履

行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,298,362.13	15,269,237.07
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	147,935,592.30	137,007,805.36
其中：股票投资		147,935,592.30	137,007,805.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,916,144.31
应收利息	6.4.7.5	1,220.36	2,199.60

应收股利		111,096.75	147,333.42
应收申购款		766,435.21	1,043,423.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		159,112,706.75	156,386,143.23
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		-	-
应付赎回款		2,708,603.16	10,512,392.89
应付管理人报酬		100,986.30	105,700.86
应付托管费		31,558.20	33,031.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	421,475.99	1,123,268.42
负债合计		3,262,623.65	11,774,393.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	121,084,891.47	131,277,418.72
未分配利润	6.4.7.10	34,765,191.63	13,334,330.81
所有者权益合计		155,850,083.10	144,611,749.53
负债和所有者权益总计		159,112,706.75	156,386,143.23

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2871 元，基金份额总额 121,084,891.47 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

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
一、收入		24,590,382.64	854,305.42
1.利息收入		22,595.89	44,755.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,595.89	44,755.18

债券利息收入		-	-
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）		1,394,249.91	2,572,552.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	89,346.46	2,237,743.37
基金投资收益	6.4.7.13	-7,455.91	-742,317.32
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
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	1,312,359.36	1,077,126.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	23,110,680.92	-2,435,410.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-17,060.99	448,206.97
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	79,916.91	224,201.43
减：二、费用		1,108,342.09	1,145,223.39
1. 管理人报酬		603,769.68	534,683.73
2. 托管费		188,678.06	167,088.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,205.00	31,230.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		70.86	818.84
7. 其他费用	6.4.7.20	313,618.49	411,402.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,482,040.55	-290,917.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,482,040.55	-290,917.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

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）	131,277,418.72	13,334,330.81	144,611,749.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,482,040.55	23,482,040.55

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）	-10,192,527.25	-2,051,179.73	-12,243,706.98
其中：1.基金申购款	43,510,063.40	9,323,309.33	52,833,372.73
2.基金赎回款	-53,702,590.65	-11,374,489.06	-65,077,079.71
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）	121,084,891.47	34,765,191.63	155,850,083.10
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）	145,981,884.60	14,622,609.78	160,604,494.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-290,917.97	-290,917.97
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）	-10,516,911.03	4,309,245.80	-6,207,665.23
其中：1.基金申购款	158,037,248.38	16,889,942.55	174,927,190.93
2.基金赎回款	-168,554,159.41	-12,580,696.75	-181,134,856.16
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）	135,464,973.57	18,640,937.61	154,105,911.18

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

易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)(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[2016]2193 号《关于准予易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，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《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

693,199,312.42 份基金份额, 其中认购资金利息折合 37,037.35 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金, 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, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司, 境外资产托管人为道富银行。

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》、《易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	10,298,362.13
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	10,298,362.13

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		131,202,022.62	147,935,592.30	16,733,569.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		131,202,022.62	147,935,592.30	16,733,569.68

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,220.36
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,220.36

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

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	9,036.00
预提费用	208,289.32
其他应付款	204,150.67
合计	421,475.99

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	131,277,418.72	131,277,418.72
本期申购	43,510,063.40	43,510,063.40
本期赎回（以“-”号填列）	-53,702,590.65	-53,702,590.65
本期末	121,084,891.47	121,084,891.47

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	24,284,813.98	-10,950,483.17	13,334,330.81
本期利润	371,359.63	23,110,680.92	23,482,040.55
本期基金份额交易产生的变动数	-1,885,605.56	-165,574.17	-2,051,179.73
其中：基金申购款	8,128,504.70	1,194,804.63	9,323,309.33
基金赎回款	-10,014,110.26	-1,360,378.80	-11,374,489.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,770,568.05	11,994,623.58	34,765,191.63

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	22,336.23
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	-

其他	259.66
合计	22,595.89

6.4.7.12 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,995,344.95
减：卖出股票成本总额	13,905,998.49
买卖股票差价收入	89,346.46

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	2,107,702.56
减：卖出/赎回基金成本总额	2,115,158.47
基金投资收益	-7,455.91

6.4.7.14 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

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1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,312,359.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,312,359.36

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1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	23,110,680.92
——股票投资	23,110,680.92
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
——期货投资	-
——期权投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	23,110,680.92

6.4.7.18 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	79,916.91
其他	-
合计	79,916.91

6.4.7.19 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	2,020.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	184.62
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	184.62
合计	2,205.00

6.4.7.20 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	19,835.79
信息披露费	58,700.75
银行汇划费	1,178.50
上市费	29,752.78
指数使用费	136,082.00
指数数据费	68,068.67
合计	313,618.49

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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
道富银行	境外资产托管人

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	603,769.68	534,683.73
其中：支付销售机构的客户维护费	137,935.15	125,305.25

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 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, 支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年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	188,678.06	167,088.68

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 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, 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, 支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	7,449,859.33	15,071.28	8,812,756.87	40,038.61
道富银行-活期存款	2,848,502.80	7,264.95	2,141,367.05	4,156.68

注: 本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司和道富银行保管, 按银行

同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于托管行道富银行发行的股票 STT US。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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。

本基金属股票指数基金，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。本基金主要采用完全复制法跟踪标普 500 指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资境外上市企业，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。

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 0.00%(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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

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约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

本基金投资于海外市场,面临市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂,包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等,都将影响基金净值的升跌。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,298,362.13	-	-	-	10,298,362.13
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	147,935,592.30	147,935,592.30
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	-	-	-	1,220.36	1,220.36
应收股利	-	-	-	111,096.75	111,096.75
应收申购款	95,417.14	-	-	671,018.07	766,435.21
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	10,393,779.27	-	-	148,718,927.48	159,112,706.75
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	-	-	-	2,708,603.16	2,708,603.16
应付管理人报酬	-	-	-	100,986.30	100,986.30
应付托管费	-	-	-	31,558.20	31,558.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	421,475.99	421,475.99
负债总计	-	-	-	3,262,623.65	3,262,623.65
利率敏感度缺口	10,393,779.27	-	-	145,456,303.83	155,850,083.10
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	15,269,237.07	-	-	-	15,269,237.07
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	137,007,805.36	137,007,805.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,916,144.31	2,916,144.31
应收利息	-	-	-	2,199.60	2,199.60
应收股利	-	-	-	147,333.42	147,333.42

应收申购款	133,636.42	-	-	909,787.05	1,043,423.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,402,873.49	-	-	140,983,269.74	156,386,143.23
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	-	-	-	10,512,392.89	10,512,392.89
应付管理人报酬	-	-	-	105,700.86	105,700.86
应付托管费	-	-	-	33,031.53	33,031.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,123,268.42	1,123,268.42
负债总计	-	-	-	11,774,393.70	11,774,393.70
利率敏感度缺口	15,402,873.49	-	-	129,208,876.04	144,611,749.53

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

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	8,723,030.40	-	-	8,723,030.40
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	147,935,592.30	-	-	147,935,592.30
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	883.06	-	-	883.06
应收股利	111,096.75	-	-	111,096.75
应收申购款	195,532.42	-	-	195,532.42
其他资产	-	-	-	-
资产合计	156,966,134.93	-	-	156,966,134.93
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	141,282.72	-	-	141,282.72
其他负债	492.02	-	-	492.02
负债合计	141,774.74	-	-	141,774.74
资产负债表 外汇风险敞口净额	156,824,360.19	-	-	156,824,360.19
项目	上年度末 2018年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,677,063.15	-	-	6,677,063.15
结算备付金	-	-	-	-

交易性金融资产	137,007,805.36	-	-	137,007,805.36
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	2,916,144.31	-	-	2,916,144.31
应收利息	412.41	-	-	412.41
应收股利	147,333.42	-	-	147,333.42
应收申购款	330,768.63	-	-	330,768.63
其他资产	-	-	-	-
资产合计	147,079,527.28	-	-	147,079,527.28
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	177,400.68	-	-	177,400.68
其他负债	624.83	-	-	624.83
负债合计	178,025.51	-	-	178,025.51
资产负债表外汇风险敞口净额	146,901,501.77	-	-	146,901,501.77

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-7,841,218.01	-7,345,075.09
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	7,841,218.01	7,345,075.09

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	147,935,592.3 0	94.92	137,007,805.3 6	94.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	147,935,592.3 0	94.92	137,007,805.3 6	94.74

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%	7,396,779.42	6,850,390.08
	2.业绩比较基准下降 5%	-7,396,779.42	-6,850,390.08

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 147,935,592.30 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 137,007,805.36 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。

(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	147,935,592.30	92.98
	其中：普通股	143,477,133.71	90.17
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	4,458,458.59	2.80
	优先股	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,298,362.13	6.47
8	其他各项资产	878,752.32	0.55
9	合计	159,112,706.75	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	147,935,592.30	94.92
合计	147,935,592.30	94.92

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	7,464,670.39	4.79
材料	4,181,261.42	2.68
工业	13,963,120.58	8.96
非必需消费品	15,113,717.81	9.70
必需消费品	10,760,045.32	6.90
保健	20,975,394.58	13.46
金融	19,333,631.26	12.41
信息技术	31,649,809.01	20.31
电信服务	14,990,944.69	9.62
公用事业	4,946,495.80	3.17

房地产	4,556,501.44	2.92
合计	147,935,592.30	94.92

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,681	6,152,765.48	3.95
2	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,811	5,185,401.42	3.33
3	Amazon.com Inc	-	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	361	4,699,547.88	3.02
4	Alphabet Inc	-	GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	268	1,991,489.77	1.28
			GOOGL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	262	1,950,308.39	1.25
5	Facebook Inc	-	FB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,094	2,778,355.01	1.78
6	Berkshire Hathaway Inc	-	BRK/B US	纽约证 券交易 所	美国	1,690	2,476,660.86	1.59
7	Johnson & Johnson	-	JNJ US	纽约证 券交易 所	美国	2,315	2,216,631.52	1.42
8	JPMorgan Chase & Co	-	JPM US	纽约证 券交易 所	美国	2,829	2,174,345.24	1.40
9	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证 券交易 所	美国	3,689	1,943,395.67	1.25
10	Visa Inc	-	V US	纽约证 券交易 所	美国	1,517	1,809,939.05	1.16

11	Procter & Gamble Co/The	-	PG US	纽约证券交易所	美国	2,186	1,647,830.53	1.06
12	Bank of America Corp	-	BAC US	纽约证券交易所	美国	7,710	1,537,114.17	0.99
13	AT&T Inc	-	T US	纽约证券交易所	美国	6,366	1,466,543.04	0.94
14	Walt Disney Co/The	-	DIS US	纽约证券交易所	美国	1,526	1,464,934.22	0.94
15	Pfizer Inc	-	PFE US	纽约证券交易所	美国	4,852	1,444,983.84	0.93
16	Mastercard Inc	-	MA US	纽约证券交易所	美国	784	1,425,754.48	0.91
17	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	1,661	1,420,965.02	0.91
18	Verizon Communications Inc	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	3,611	1,418,226.07	0.91
19	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	3,733	1,404,549.95	0.90
20	UnitedHealth Group Inc	-	UNH US	纽约证券交易所	美国	829	1,390,643.81	0.89
21	Home Depot Inc/The	-	HD US	纽约证券交易所	美国	960	1,372,542.10	0.88
22	Merck & Co Inc	-	MRK US	纽约证券交易所	美国	2,256	1,300,456.75	0.83
23	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	3,904	1,284,774.73	0.82
24	Coca-Cola Co/The	-	KO US	纽约证券交易所	美国	3,363	1,177,250.85	0.76
25	Wells	-	WFC US	纽约证	美国	3,527	1,147,371.21	0.74

	Fargo & Co			券交易所				
26	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯达克证 券交易所	美国	3,947	1,147,244.16	0.74
27	Boeing Co/The	-	BA US	纽约证 券交易所	美国	457	1,143,624.01	0.73
28	PepsiCo Inc	-	PEP US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,228	1,107,016.72	0.71
29	Citigroup Inc	-	C US	纽约证 券交易所	美国	2,017	971,054.88	0.62
30	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯达克证 券交易所	美国	382	964,632.06	0.62
31	McDonald's Corp	-	MCD US	纽约证 券交易所	美国	669	955,064.54	0.61
32	Walmart Inc	-	WMT US	纽约证 券交易所	美国	1,220	926,694.44	0.59
33	Abbott Laboratories	-	ABT US	纽约证 券交易所	美国	1,535	887,479.08	0.57
34	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯达克证 券交易所	美国	427	864,944.16	0.55
35	Oracle Corp	-	ORCL US	纽约证 券交易所	美国	2,116	828,734.91	0.53
36	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,026	807,336.99	0.52
37	Medtronic PLC	-	MDT US	纽约证 券交易所	美国	1,172	784,685.68	0.50
38	Honeywell International Inc	-	HON US	纽约证 券交易所	美国	638	765,761.97	0.49
39	International	-	IBM US	纽约证 券交易所	美国	778	737,560.44	0.47

	Business Machines Corp			所				
40	Philip Morris International Inc	-	PM US	纽约证券交易所	美国	1,359	733,683.59	0.47
41	Union Pacific Corp	-	UNP US	纽约证券交易所	美国	618	718,474.76	0.46
42	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	352	710,674.59	0.46
43	Accenture PLC	-	ACN US	纽约证券交易所	美国	558	708,792.98	0.45
44	salesforce.com Inc	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	677	706,177.50	0.45
45	Costco Wholesale Corp	-	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	385	699,432.67	0.45
46	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	347	686,696.05	0.44
47	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	532	673,974.69	0.43
48	Linde Public Limited	-	LIN US	纽约证券交易所	美国	474	654,328.45	0.42
49	Texas Instruments Inc	-	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	821	647,720.21	0.42
50	AbbVie Inc	-	ABBV US	纽约证券交易所	美国	1,289	644,407.43	0.41
51	NIKE Inc	-	NKE US	纽约证券交易所	美国	1,100	634,844.17	0.41
52	United Technologies Corp	-	UTX US	纽约证券交易所	美国	709	634,615.93	0.41

53	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,056	608,579.24	0.39
54	3M Co	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	504	600,596.89	0.39
55	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	530	598,386.95	0.38
56	NextEra Energy Inc	-	NEE US	纽约证券交易所	美国	418	588,690.74	0.38
57	Eli Lilly & Co	-	LLY US	纽约证券交易所	美国	755	575,044.25	0.37
58	QUALCOMM Inc	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,058	553,290.02	0.36
59	General Electric Co	-	GE US	纽约证券交易所	美国	7,607	549,106.35	0.35
60	American Tower Corp	-	AMT US	纽约证券交易所	美国	386	542,535.51	0.35
61	Danaher Corp	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	550	540,392.67	0.35
62	Lockheed Martin Corp	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	215	537,334.11	0.34
63	Altria Group Inc	-	MO US	纽约证券交易所	美国	1,638	533,196.92	0.34
64	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,115	517,867.03	0.33
65	American Express Co	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	605	513,410.85	0.33
66	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	38	489,746.62	0.31
67	Lowe's Cos Inc	-	LOW US	纽约证券交易所	美国	683	473,814.84	0.30

				所				
68	US Bancorp	-	USB US	纽约证券交易所	美国	1,315	473,708.08	0.30
69	Caterpillar Inc	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	503	471,287.29	0.30
70	Mondelez International Inc	-	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,262	467,629.47	0.30
71	Bristol-Myers Squibb Co	-	BMY US	纽约证券交易所	美国	1,427	444,892.43	0.29
72	Anthem Inc	-	ANTM US	纽约证券交易所	美国	225	436,524.54	0.28
73	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	381	433,042.37	0.28
74	United Parcel Service Inc	-	UPS US	纽约证券交易所	美国	609	432,359.71	0.28
75	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	1,134	424,799.13	0.27
76	Goldman Sachs Group Inc/The	-	GS US	纽约证券交易所	美国	300	421,969.09	0.27
77	CME Group Inc	-	CME US	纳斯达克证券交易所	美国	313	417,682.23	0.27
78	ConocoPhillips	-	COP US	纽约证券交易所	美国	992	416,001.85	0.27
79	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	152	412,945.08	0.26
80	Becton Dickinson and Co	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	236	408,868.38	0.26

81	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克 证券交易所	美国	227	407,820.33	0.26
82	Chubb Ltd	-	CB US	纽约证 券交易 所	美国	400	405,029.83	0.26
83	Celgene Corp	-	CELG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	614	390,195.32	0.25
84	Duke Energy Corp	-	DUK US	纽约证 券交易 所	美国	636	385,812.56	0.25
85	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证 券交易 所	美国	1,058	384,619.12	0.25
86	Stryker Corp	-	SYK US	纽约证 券交易 所	美国	271	383,004.52	0.25
87	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证 券交易 所	美国	712	378,464.88	0.24
88	PNC Financial Services Group Inc	-	PNC US	纽约证 券交易 所	美国	394	371,840.97	0.24
89	Colgate-P almolive Co	-	CL US	纽约证 券交易 所	美国	753	371,010.44	0.24
90	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	102	367,824.64	0.24
91	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	678	360,625.18	0.23
92	Cigna Corp	-	CI US	纽约证 券交易 所	美国	331	358,509.07	0.23
93	Boston Scientific Corp	-	BSX US	纽约证 券交易 所	美国	1,212	358,115.22	0.23
94	Southern Co/The	-	SO US	纽约证 券交易 所	美国	921	350,010.78	0.22
95	Morgan	-	MS US	纽约证	美国	1,135	341,839.99	0.22

	Stanley			券交易 所				
96	S&P Global Inc	-	SPGI US	纽约证 券交易 所	美国	218	341,385.37	0.22
97	DuPont De Nemours Inc.	-	DD US	纽约证 券交易 所	美国	657	339,067.01	0.22
98	Northrop Grumman Corp	-	NOC US	纽约证 券交易 所	美国	152	337,635.22	0.22
99	BlackRoc k Inc	-	BLK US	纽约证 券交易 所	美国	104	335,534.86	0.22
100	Schlumbe rger Ltd	-	SLB US	纽约证 券交易 所	美国	1,212	331,119.10	0.21
101	Zoetis Inc	-	ZTS US	纽约证 券交易 所	美国	419	326,907.87	0.21
102	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	129	326,488.78	0.21
103	Crown Castle Internatio nal Corp	-	CCI US	纽约证 券交易 所	美国	364	326,186.64	0.21
104	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证 券交易 所	美国	507	324,706.66	0.21
105	Norfolk Southern Corp	-	NSC US	纽约证 券交易 所	美国	232	317,917.48	0.20
106	Deere & Co	-	DE US	纽约证 券交易 所	美国	279	317,838.62	0.20
107	Allergan plc	-	AGN US	纽约证 券交易 所	美国	274	315,382.50	0.20
108	Marsh & McLenna n Cos Inc	-	MMC US	纽约证 券交易 所	美国	450	308,588.10	0.20
109	Air	-	APD US	纽约证	美国	196	305,020.26	0.20

	Products & Chemicals Inc			券交易所				
110	General Motors Co	-	GM US	纽约证券交易所	美国	1,146	303,554.99	0.19
111	Prologis Inc	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	551	303,415.57	0.19
112	General Dynamics Corp	-	GD US	纽约证券交易所	美国	242	302,489.82	0.19
113	Simon Property Group Inc	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	275	302,033.07	0.19
114	Ecolab Inc	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	222	301,329.65	0.19
115	Raytheon Co	-	RTN US	纽约证券交易所	美国	247	295,257.09	0.19
116	Intercontinental Exchange Inc	-	ICE US	纽约证券交易所	美国	497	293,633.42	0.19
117	Charles Schwab Corp/The	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	1,037	286,517.08	0.18
118	Exelon Corp	-	EXC US	纽约证券交易所	美国	863	284,421.60	0.18
119	MetLife Inc	-	MET US	纽约证券交易所	美国	829	283,075.60	0.18
120	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	224	282,392.88	0.18
121	Progressive Corp/The	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	511	280,791.83	0.18
122	Aon PLC	-	AON US	纽约证券交易所	美国	210	278,602.72	0.18

123	American International Group Inc	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	759	278,009.57	0.18
124	Kimberly-Clark Corp	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	301	275,794.26	0.18
125	Illinois Tool Works Inc	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	264	273,708.21	0.18
126	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	170	273,323.64	0.18
127	Target Corp	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	456	271,510.50	0.17
128	Waste Management Inc	-	WM US	纽约证券交易所	美国	341	270,458.74	0.17
129	Capital One Financial Corp	-	COF US	纽约证券交易所	美国	420	262,000.32	0.17
130	American Electric Power Co Inc	-	AEP US	纽约证券交易所	美国	431	260,773.25	0.17
131	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	980	259,988.78	0.17
132	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达克证券交易所	美国	74	256,546.34	0.16
133	Walgreens Boots Alliance Inc	-	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	678	254,819.42	0.16
134	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	817	252,242.85	0.16
135	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	322	249,855.06	0.16
136	Prudential Financial	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	358	248,575.40	0.16

	Inc			所				
137	Kinder Morgan Inc/DE	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	1,729	248,187.12	0.16
138	Emerson Electric Co	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	538	246,769.83	0.16
139	Estee Lauder Cos Inc	-	EL US	纽约证券交易所	美国	196	246,729.96	0.16
140	Aflac Inc	-	AFL US	纽约证券交易所	美国	650	244,921.50	0.16
141	Fidelity National Information Services Inc	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	290	244,582.58	0.16
142	Ford Motor Co	-	F US	纽约证券交易所	美国	3,477	244,531.09	0.16
143	Baxter International Inc	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	425	239,291.12	0.15
144	Edwards Lifesciences Corp	-	EW US	纽约证券交易所	美国	187	237,496.00	0.15
145	Bank of New York Mellon Corp	-	BK US	纽约证券交易所	美国	782	237,351.08	0.15
146	FedEx Corp	-	FDX US	纽约证券交易所	美国	210	237,038.97	0.15
147	Travelers Cos Inc/The	-	TRV US	纽约证券交易所	美国	229	235,390.28	0.15
148	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	365	234,716.69	0.15
149	Roper Technologies Inc	-	ROP US	纽约证券交易所	美国	93	234,167.27	0.15

150	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	246	232,435.26	0.15
151	Marriott International Inc/MD	-	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	241	232,432.85	0.15
152	BB&T Corp	-	BBT US	纽约证券交易所	美国	686	231,699.25	0.15
153	Occidental Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	655	226,407.24	0.15
154	Sherwin-Williams Co/The	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	71	223,693.04	0.14
155	HCA Healthcare Inc	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	240	223,020.77	0.14
156	Marathon Petroleum Corp	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	578	222,043.46	0.14
157	Dow Inc	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	653	221,361.42	0.14
158	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	375	220,703.65	0.14
159	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	680	220,650.37	0.14
160	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	352	220,597.57	0.14
161	Public Storage	-	PSA US	纽约证券交易所	美国	134	219,404.54	0.14
162	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	503	219,200.98	0.14
163	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	321	218,735.90	0.14

				交易所				
164	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达克 证券交易 所	美国	195	218,378.28	0.14
165	Eaton Corp PLC	-	ETN US	纽约证 券交易 所	美国	381	218,132.03	0.14
166	Anadarko Petroleum Corp	-	APC US	纽约证 券交易 所	美国	445	215,860.08	0.14
167	Humana Inc	-	HUM US	纽约证 券交易 所	美国	118	215,215.23	0.14
168	Dollar General Corp	-	DG US	纽约证 券交易 所	美国	226	209,995.69	0.13
169	Yum! Brands Inc	-	YUM US	纽约证 券交易 所	美国	276	209,987.16	0.13
170	Williams Cos Inc/The	-	WMB US	纽约证 券交易 所	美国	1,078	207,802.38	0.13
171	Sysco Corp	-	SYU US	纽约证 券交易 所	美国	424	206,139.80	0.13
172	Red Hat Inc	-	RHT US	纽约证 券交易 所	美国	159	205,236.19	0.13
173	Allstate Corp/The	-	ALL US	纽约证 券交易 所	美国	291	203,434.68	0.13
174	Delta Air Lines Inc	-	DAL US	纽约证 券交易 所	美国	520	202,872.40	0.13
175	Constellation Brands Inc	-	STZ US	纽约证 券交易 所	美国	149	201,731.61	0.13
176	Moody's Corp	-	MCO US	纽约证 券交易 所	美国	148	198,719.25	0.13
177	Johnson Controls Internatio	-	JCI US	纽约证 券交易 所	美国	694	197,091.74	0.13

	nal plc							
178	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克 证券交易所	美国	715	194,158.71	0.12
179	TE Connectiv ity Ltd	-	TEL US	纽约证 券交易 所	美国	294	193,586.88	0.12
180	Welltower Inc	-	WELL US	纽约证 券交易 所	美国	343	192,249.54	0.12
181	General Mills Inc	-	GIS US	纽约证 券交易 所	美国	531	191,722.46	0.12
182	HP Inc	-	HPQ US	纽约证 券交易 所	美国	1,341	191,662.44	0.12
183	Ingersoll- Rand PLC	-	IR US	纽约证 券交易 所	美国	218	189,838.38	0.12
184	Newmont Goldcorp Corp	-	NEM US	纽约证 券交易 所	美国	714	188,831.37	0.12
185	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	458	187,310.96	0.12
186	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达 克证券 交易所	美国	269	187,259.54	0.12
187	Xilinx Inc	-	XLNX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	226	183,210.21	0.12
188	Public Service Enterprise Group Inc	-	PEG US	纽约证 券交易 所	美国	450	181,966.43	0.12
189	O'Reilly Automoti ve Inc	-	ORLY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	71	180,266.46	0.12
190	Alexion Pharmace uticals Inc	-	ALXN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	199	179,189.19	0.11
191	Amphenol Corp	-	APH US	纽约证 券交易 所	美国	268	176,761.74	0.11

192	Hilton Worldwide Holdings Inc	-	HLT US	纽约证 券交易 所	美国	263	176,718.43	0.11
193	AvalonBay Communi ties Inc	-	AVB US	纽约证 券交易 所	美国	126	175,996.99	0.11
194	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证 券交易 所	美国	367	173,608.66	0.11
195	VF Corp	-	VFC US	纽约证 券交易 所	美国	289	173,545.96	0.11
196	SunTrust Banks Inc	-	STI US	纽约证 券交易 所	美国	398	171,965.81	0.11
197	Consolida ted Edison Inc	-	ED US	纽约证 券交易 所	美国	284	171,187.73	0.11
198	Motorola Solutions Inc	-	MSI US	纽约证 券交易 所	美国	149	170,786.59	0.11
199	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证 券交易 所	美国	212	170,097.40	0.11
200	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	131	169,166.02	0.11
201	Equity Residential	-	EQR US	纽约证 券交易 所	美国	323	168,582.49	0.11
202	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证 券交易 所	美国	22	166,287.58	0.11
203	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	784	163,687.16	0.11
204	LyondellB asell Industries NV	-	LYB US	纽约证 券交易 所	美国	274	162,240.31	0.10
205	Corning	-	GLW US	纽约证	美国	707	161,511.52	0.10

	Inc			券交易 所				
206	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达 克证券 交易所	美国	285	161,229.93	0.10
207	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证 券交易 所	美国	281	161,053.39	0.10
208	Pioneer Natural Resources Co	-	PXD US	纽约证 券交易 所	美国	152	160,776.68	0.10
209	T Rowe Price Group Inc	-	TROW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	213	160,649.57	0.10
210	McKesso n Corp	-	MCK US	纽约证 券交易 所	美国	173	159,833.13	0.10
211	Twitter Inc	-	TWTR US	纽约证 券交易 所	美国	659	158,111.91	0.10
212	Discover Financial Services	-	DFS US	纽约证 券交易 所	美国	295	157,355.35	0.10
213	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	212	156,514.09	0.10
214	SBA Communi cations Corp	-	SBAC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	101	156,116.46	0.10
215	IQVIA Holdings Inc	-	IQV US	纽约证 券交易 所	美国	141	155,965.63	0.10
216	Global Payments Inc	-	GPN US	纽约证 券交易 所	美国	141	155,219.25	0.10
217	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达 克证券 交易所	美国	352	154,461.86	0.10
218	Cummins Inc	-	CMI US	纽约证 券交易 所	美国	130	153,128.44	0.10
219	Regenero	-	REGN US	纳斯达	美国	71	152,776.46	0.10

	n Pharmaceuticals Inc			克证券 交易所				
220	Willis Towers Watson PLC	-	WLTW US	纳斯达 克证券 交易所	美国	116	152,746.48	0.10
221	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证 券交易 所	美国	325	152,712.87	0.10
222	Digital Realty Trust Inc	-	DLR US	纽约证 券交易 所	美国	188	152,236.93	0.10
223	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	309	152,226.07	0.10
224	FleetCor Technologies Inc	-	FLT US	纽约证 券交易 所	美国	78	150,599.24	0.10
225	Eversource Energy	-	ES US	纽约证 券交易 所	美国	289	150,519.08	0.10
226	TransDigm Group Inc	-	TDG US	纽约证 券交易 所	美国	45	149,669.09	0.10
227	Tyson Foods Inc	-	TSN US	纽约证 券交易 所	美国	269	149,312.02	0.10
228	Southwest Airlines Co	-	LUV US	纽约证 券交易 所	美国	427	149,064.53	0.10
229	Zimmer Biomet Holdings Inc	-	ZBH US	纽约证 券交易 所	美国	182	147,315.75	0.09
230	Cerner Corp	-	CERN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	292	147,143.33	0.09
231	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达 克证券 交易所	美国	146	147,002.81	0.09
232	Fortive Corp	-	FTV US	纽约证 券交易 所	美国	262	146,831.49	0.09

233	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	166	145,936.68	0.09
234	Agilent Technologies Inc	-	A US	纽约证券交易所	美国	283	145,273.48	0.09
235	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	124	144,978.35	0.09
236	Ball Corp	-	BLL US	纽约证券交易所	美国	298	143,385.76	0.09
237	IHS Markit Ltd	-	INFO US	纳斯达克证券交易所	美国	327	143,244.27	0.09
238	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	75	141,960.84	0.09
239	Harris Corp	-	HRS US	纽约证券交易所	美国	108	140,422.90	0.09
240	PPL Corp	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	657	140,062.18	0.09
241	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	499	139,963.39	0.09
242	Edison International	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	297	137,636.79	0.09
243	Stanley Black & Decker Inc	-	SWK US	纽约证券交易所	美国	138	137,192.75	0.09
244	Parker-Hannifin Corp	-	PH US	纽约证券交易所	美国	117	136,745.83	0.09
245	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	375	135,190.98	0.09
246	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达克证券交易所	美国	94	135,163.75	0.09
247	Corteva	-	CTVA US	纽约证	美国	657	133,558.17	0.09

	Inc			券交易 所				
248	Mettler-T oledo Internatio nal Inc	-	MTD US	纽约证 券交易 所	美国	23	132,819.20	0.09
249	Synchron y Financial	-	SYF US	纽约证 券交易 所	美国	553	131,805.25	0.08
250	American Water Works Co Inc	-	AWK US	纽约证 券交易 所	美国	165	131,581.76	0.08
251	Royal Caribbean Cruises Ltd	-	RCL US	纽约证 券交易 所	美国	157	130,825.33	0.08
252	FirstEnergy Corp	-	FE US	纽约证 券交易 所	美国	443	130,377.52	0.08
253	State Street Corp	-	STT US	纽约证 券交易 所	美国	337	129,878.34	0.08
254	Concho Resources Inc	-	CXO US	纽约证 券交易 所	美国	183	129,807.67	0.08
255	Total System Services Inc	-	TSS US	纽约证 券交易 所	美国	147	129,627.21	0.08
256	Aptiv PLC	-	APTV US	纽约证 券交易 所	美国	232	128,918.22	0.08
257	Microchip Technolog y Inc	-	MCHP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	216	128,743.88	0.08
258	Realty Income Corp	-	O US	纽约证 券交易 所	美国	269	127,545.83	0.08
259	AMETEK Inc	-	AME US	纽约证 券交易 所	美国	204	127,397.54	0.08
260	Hartford Financial Services	-	HIG US	纽约证 券交易 所	美国	327	125,260.06	0.08

	Group Inc							
261	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	257	125,106.96	0.08
262	Boston Properties Inc	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	141	125,043.92	0.08
263	MSCI Inc	-	MSCI US	纽约证券交易所	美国	76	124,762.33	0.08
264	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	76	123,978.61	0.08
265	Weyerhaeuser Co	-	WY US	纽约证券交易所	美国	683	123,677.37	0.08
266	Clorox Co/The	-	CLX US	纽约证券交易所	美国	117	123,152.48	0.08
267	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	65	122,304.35	0.08
268	Ameriprise Financial Inc	-	AMP US	纽约证券交易所	美国	122	121,747.64	0.08
269	Fifth Third Bancorp	-	FITB US	纳斯达克证券交易所	美国	634	121,603.82	0.08
270	United Airlines Holdings Inc	-	UAL US	纳斯达克证券交易所	美国	202	121,579.76	0.08
271	Halliburton Co	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	777	121,468.94	0.08
272	L3 Technologies Inc	-	LLL US	纽约证券交易所	美国	72	121,353.85	0.08
273	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	567	120,992.52	0.08
274	Northern	-	NTRS US	纳斯达克	美国	195	120,650.99	0.08

	Trust Corp			克证券交易所				
275	Rockwell Automation Inc	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	107	120,512.18	0.08
276	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	136	120,319.90	0.08
277	Hewlett Packard Enterprise Co	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	1,168	120,043.26	0.08
278	Fox Corp	-	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	321	80,856.37	0.05
			FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	152	38,172.18	0.02
279	Essex Property Trust Inc	-	ESS US	纽约证券交易所	美国	59	118,408.94	0.08
280	McCormick & Co Inc/MD	-	MKC US	纽约证券交易所	美国	111	118,286.84	0.08
281	Hershey Co/The	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	128	117,941.25	0.08
282	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克证券交易所	美国	524	117,400.35	0.08
283	Ulta Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯达克证券交易所	美国	49	116,853.47	0.07
284	Carnival Corp	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	365	116,806.31	0.07
285	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	165	116,756.12	0.07
286	Ameren Corp	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	223	115,147.99	0.07
287	KLA-Tencor Corp	-	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	141	114,575.13	0.07

				交易所				
288	Republic Services Inc	-	RSG US	纽约证券交易所	美国	192	114,359.81	0.07
289	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	121	114,219.77	0.07
290	Church & Dwight Co Inc	-	CHD US	纽约证券交易所	美国	225	113,009.76	0.07
291	Amcor PLC	-	AMCR US	纽约证券交易所	美国	1,415	111,771.28	0.07
292	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	22	110,843.26	0.07
293	KeyCorp	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	906	110,555.49	0.07
294	ResMed Inc	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	130	109,059.55	0.07
295	Kroger Co/The	-	KR US	纽约证券交易所	美国	727	108,504.56	0.07
296	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	77	108,421.86	0.07
297	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	192	108,169.28	0.07
298	International Paper Co	-	IP US	纽约证券交易所	美国	357	106,318.89	0.07
299	Diamondback Energy Inc	-	FANG US	纳斯达克证券交易所	美国	141	105,628.18	0.07
300	Keysight Technologies Inc	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	171	105,578.27	0.07
301	Freeport-McMoRan Inc	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	1,320	105,356.15	0.07

302	CBS Corp	-	CBS US	纽约证 券交易 所	美国	307	105,315.59	0.07
303	Laborator y Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证 券交易 所	美国	88	104,599.94	0.07
304	Cooper Cos Inc/The	-	COO US	纽约证 券交易 所	美国	45	104,220.80	0.07
305	Nucor Corp	-	NUE US	纽约证 券交易 所	美国	275	104,168.89	0.07
306	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽约证 券交易 所	美国	259	103,111.49	0.07
307	Best Buy Co Inc	-	BBY US	纽约证 券交易 所	美国	214	102,585.79	0.07
308	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证 券交易 所	美国	110	102,270.79	0.07
309	Arthur J Gallagher & Co	-	AJG US	纽约证 券交易 所	美国	168	101,162.04	0.06
310	First Republic Bank/CA	-	FRC US	纽约证 券交易 所	美国	150	100,697.17	0.06
311	Maxim Integrated Products Inc	-	MXIM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	244	100,343.67	0.06
312	Citizens Financial Group Inc	-	CFG US	纽约证 券交易 所	美国	410	99,666.65	0.06
313	Hess Corp	-	HES US	纽约证 券交易 所	美国	227	99,204.60	0.06
314	Expedia Group Inc	-	EXPE US	纳斯达 克证券 交易所	美国	108	98,770.46	0.06
315	Cincinnati Financial Corp	-	CINF US	纳斯达 克证券 交易所	美国	138	98,352.62	0.06

316	CBRE Group Inc	-	CBRE US	纽约证券交易所	美国	278	98,042.85	0.06
317	Waters Corp	-	WAT US	纽约证券交易所	美国	65	96,181.18	0.06
318	HCP Inc	-	HCP US	纽约证券交易所	美国	435	95,636.01	0.06
319	Teleflex Inc	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	42	95,615.39	0.06
320	Principal Financial Group Inc	-	PFG US	纳斯达克证券交易所	美国	240	95,563.83	0.06
321	Genuine Parts Co	-	GPC US	纽约证券交易所	美国	134	95,418.91	0.06
322	Darden Restaurants Inc	-	DRI US	纽约证券交易所	美国	114	95,401.72	0.06
323	Alexandria Real Estate Equities Inc	-	ARE US	纽约证券交易所	美国	98	95,055.24	0.06
324	Discovery Inc	-	DISCK US	纳斯达克证券交易所	美国	329	64,347.54	0.04
			DISCA US	纳斯达克证券交易所	美国	145	30,602.73	0.02
325	Loews Corp	-	L US	纽约证券交易所	美国	252	94,711.64	0.06
326	Evergy Inc	-	EVRG US	纽约证券交易所	美国	229	94,694.52	0.06
327	Xylem Inc/NY	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	164	94,299.98	0.06
328	NetApp Inc	-	NTAP US	纳斯达克证券交易所	美国	222	94,165.52	0.06

329	Incyte Corp	-	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	161	94,036.00	0.06
330	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证券交易所	美国	906	93,053.46	0.06
331	International Flavors & Fragrances Inc	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	93	92,762.87	0.06
332	DR Horton Inc	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	312	92,509.81	0.06
333	Dover Corp	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	134	92,305.22	0.06
334	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达克证券交易所	美国	179	91,972.90	0.06
335	Huntington Bancshares Inc/OH	-	HBAN US	纳斯达克证券交易所	美国	967	91,873.08	0.06
336	Gartner Inc	-	IT US	纽约证券交易所	美国	83	91,832.38	0.06
337	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	58	91,752.36	0.06
338	DXC Technology Co	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	241	91,372.67	0.06
339	CarMax Inc	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	152	90,733.39	0.06
340	Broadridge Financial Solutions Inc	-	BR US	纽约证券交易所	美国	103	90,409.45	0.06
341	WellCare Health Plans Inc	-	WCG US	纽约证券交易所	美国	46	90,149.45	0.06

342	CenterPoint Energy Inc	-	CNP US	纽约证券交易所	美国	457	89,947.96	0.06
343	MGM Resorts International	-	MGM US	纽约证券交易所	美国	457	89,759.45	0.06
344	Cardinal Health Inc	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	272	88,073.16	0.06
345	Symantec Corp	-	SYMC US	纳斯达克证券交易所	美国	582	87,063.40	0.06
346	Quest Diagnostics Inc	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	124	86,789.24	0.06
347	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	264	86,299.48	0.06
348	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	48	85,670.86	0.05
349	Extra Space Storage Inc	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	117	85,340.46	0.05
350	Celanese Corp	-	CE US	纽约证券交易所	美国	115	85,225.66	0.05
351	Kellogg Co	-	K US	纽约证券交易所	美国	231	85,072.14	0.05
352	Lennar Corp	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	255	84,952.73	0.05
353	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纽约证券交易所	美国	676	84,673.75	0.05
354	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	104	84,194.73	0.05

355	AmerisourceBergen Corp	-	ABC US	纽约证券交易所	美国	143	83,817.58	0.05
356	Expeditors International of Washington Inc	-	EXPD US	纳斯达克证券交易所	美国	158	82,399.33	0.05
357	JM Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	104	82,357.26	0.05
358	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达克证券交易所	美国	155	82,337.25	0.05
359	Akamai Technologies Inc	-	AKAM US	纳斯达克证券交易所	美国	149	82,089.83	0.05
360	Lincoln National Corp	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	184	81,525.69	0.05
361	DENTSPLY SIRONA Inc	-	XRAY US	纳斯达克证券交易所	美国	203	81,445.12	0.05
362	Hologic Inc	-	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	246	81,210.28	0.05
363	Take-Two Interactive Software Inc	-	TTWO US	纳斯达克证券交易所	美国	104	81,170.41	0.05
364	Tractor Supply Co	-	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	108	80,780.47	0.05
365	Conagra Brands Inc	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	443	80,766.45	0.05
366	American Airlines Group Inc	-	AAL US	纳斯达克证券交易所	美国	356	79,809.49	0.05
367	Baker Hughes a GE Co	-	BHGE US	纽约证券交易所	美国	468	79,243.57	0.05

368	Hasbro Inc	-	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	108	78,463.98	0.05
369	Kansas City Southern	-	KSU US	纽约证券交易所	美国	93	77,885.26	0.05
370	Varian Medical Systems Inc	-	VAR US	纽约证券交易所	美国	83	77,675.79	0.05
371	UDR Inc	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	251	77,459.93	0.05
372	WW Grainger Inc	-	GWV US	纽约证券交易所	美国	42	77,448.03	0.05
373	Seagate Technology PLC	-	STX US	纳斯达克证券交易所	美国	238	77,096.74	0.05
374	Textron Inc	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	211	76,937.79	0.05
375	Wynn Resorts Ltd	-	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	90	76,715.46	0.05
376	SVB Financial Group	-	SIVB US	纳斯达克证券交易所	美国	49	75,655.45	0.05
377	Citrix Systems Inc	-	CTXS US	纳斯达克证券交易所	美国	112	75,564.50	0.05
378	ABIOMED Inc	-	ABMD US	纳斯达克证券交易所	美国	42	75,213.21	0.05
379	Norwegian Cruise Line Holdings	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	201	74,106.72	0.05
380	Cboe Global Markets Inc	-	CBOE US	巴兹全球市场	美国	104	74,092.22	0.05
381	Comerica Inc	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	148	73,907.97	0.05

382	CH Robinson Worldwide Inc	-	CHRW US	纳斯达克证券交易所	美国	127	73,644.88	0.05
383	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证券交易所	美国	100	72,569.33	0.05
384	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纽约证券交易所	美国	215	72,543.21	0.05
385	Masco Corp	-	MAS US	纽约证券交易所	美国	265	71,487.26	0.05
386	Marathon Oil Corp	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	729	71,215.64	0.05
387	Regency Centers Corp	-	REG US	纽约证券交易所	美国	155	71,116.71	0.05
388	Duke Realty Corp	-	DRE US	纽约证券交易所	美国	327	71,060.13	0.05
389	Devon Energy Corp	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	362	70,976.05	0.05
390	FMC Corp	-	FMC US	纽约证券交易所	美国	123	70,141.53	0.05
391	CenturyLink Inc	-	CTL US	纽约证券交易所	美国	867	70,093.89	0.04
392	Nasdaq Inc	-	NDAQ US	纳斯达克证券交易所	美国	106	70,080.83	0.04
393	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	78	69,918.59	0.04
394	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达克证券交易所	美国	132	69,720.18	0.04
395	Vornado Realty Trust	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	158	69,625.59	0.04

396	AES Corp/VA	-	AES US	纽约证券交易所	美国	604	69,592.86	0.04
397	Wabtec Corp	-	WAB US	纽约证券交易所	美国	141	69,559.31	0.04
398	Hormel Foods Corp	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	249	69,396.38	0.04
399	TechnipFMC PLC	-	FTI US	纽约证券交易所	美国	388	69,191.93	0.04
400	Apache Corp	-	APA US	纽约证券交易所	美国	346	68,909.38	0.04
401	Eastman Chemical Co	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	128	68,487.41	0.04
402	PerkinElmer Inc	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	103	68,217.79	0.04
403	Advance Auto Parts Inc	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	64	67,818.64	0.04
404	United Rentals Inc	-	URI US	纽约证券交易所	美国	74	67,472.57	0.04
405	E*TRADE Financial Corp	-	ETFC US	纳斯达克证券交易所	美国	220	67,454.56	0.04
406	Noble Energy Inc	-	NBL US	纽约证券交易所	美国	438	67,449.06	0.04
407	Pinnacle West Capital Corp	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	104	67,271.41	0.04
408	Allegion PLC	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	88	66,879.83	0.04
409	Henry Schein Inc	-	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	139	66,795.27	0.04

410	Viacom Inc	-	VIAB US	纳斯达克证券交易所	美国	322	66,121.83	0.04
411	Molson Coors Brewing Co	-	TAP US	纽约证券交易所	美国	171	65,832.13	0.04
412	Franklin Resources Inc	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	275	65,790.88	0.04
413	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	113	65,681.92	0.04
414	NiSource Inc	-	NI US	纽约证券交易所	美国	331	65,535.14	0.04
415	Everest Re Group Ltd	-	RE US	纽约证券交易所	美国	38	64,572.96	0.04
416	Jack Henry & Associates Inc	-	JKHY US	纳斯达克证券交易所	美国	70	64,446.19	0.04
417	CF Industries Holdings Inc	-	CF US	纽约证券交易所	美国	199	63,902.33	0.04
418	Tiffany & Co	-	TIF US	纽约证券交易所	美国	99	63,730.94	0.04
419	Arconic Inc	-	ARNC US	纽约证券交易所	美国	359	63,724.21	0.04
420	Jacobs Engineering Group Inc	-	JEC US	纽约证券交易所	美国	109	63,237.00	0.04
421	Avery Dennison Corp	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	79	62,825.96	0.04
422	Cabot Oil & Gas Corp	-	COG US	纽约证券交易所	美国	393	62,032.34	0.04
423	Mylan	-	MYL US	纳斯达克	美国	470	61,520.32	0.04

	NV			克证券 交易所				
424	Garmin Ltd	-	GRMN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	112	61,443.32	0.04
425	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证 券交易 所	美国	253	61,084.18	0.04
426	Federal Realty Investmen t Trust	-	FRT US	纽约证 券交易 所	美国	68	60,192.67	0.04
427	Mohawk Industries Inc	-	MHK US	纽约证 券交易 所	美国	58	58,801.10	0.04
428	Brown-Fo rman Corp	-	BF/B US	纽约证 券交易 所	美国	154	58,683.95	0.04
429	Torchmar k Corp	-	TMK US	纽约证 券交易 所	美国	95	58,426.01	0.04
430	Lamb Weston Holdings Inc	-	LW US	纽约证 券交易 所	美国	134	58,367.85	0.04
431	Snap-on Inc	-	SNA US	纽约证 券交易 所	美国	51	58,074.99	0.04
432	WestRock Co	-	WRK US	纽约证 券交易 所	美国	231	57,916.39	0.04
433	Whirlpool Corp	-	WHR US	纽约证 券交易 所	美国	59	57,742.26	0.04
434	Juniper Networks Inc	-	JNPR US	纽约证 券交易 所	美国	315	57,668.08	0.04
435	Packaging Corp of America	-	PKG US	纽约证 券交易 所	美国	88	57,666.08	0.04
436	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证 券交易 所	美国	264	57,587.44	0.04
437	Under	-	UAA US	纽约证	美国	174	30,323.61	0.02

	Armour Inc			券交易所				
			UA US	纽约证券交易所	美国	178	27,166.06	0.02
438	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	37	57,165.74	0.04
439	Iron Mountain Inc	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	261	56,161.49	0.04
440	F5 Networks Inc	-	FFIV US	纳斯达克证券交易所	美国	56	56,065.10	0.04
441	DISH Network Corp	-	DISH US	纳斯达克证券交易所	美国	212	55,980.13	0.04
442	Western Union Co/The	-	WU US	纽约证券交易所	美国	409	55,925.75	0.04
443	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	324	55,751.89	0.04
444	Interpublic Group of Cos Inc	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	355	55,131.31	0.04
445	BorgWarner Inc	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	190	54,833.98	0.04
446	National Oilwell Varco Inc	-	NOV US	纽约证券交易所	美国	350	53,488.60	0.03
447	LKQ Corp	-	LKQ US	纳斯达克证券交易所	美国	290	53,051.37	0.03
448	Zions Bancorp NA	-	ZION US	纳斯达克证券交易所	美国	166	52,472.39	0.03
449	Qorvo Inc	-	QRVO US	纳斯达克证券交易所	美国	114	52,203.31	0.03
450	PulteGroup Inc	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	239	51,953.35	0.03

				所				
451	Fortune Brands Home & Security Inc	-	FBHS US	纽约证券交易所	美国	131	51,450.46	0.03
452	Nielsen Holdings PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	324	50,339.30	0.03
453	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克证券交易所	美国	80	50,273.31	0.03
454	Alaska Air Group Inc	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	114	50,087.28	0.03
455	Invesco Ltd	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	354	49,792.35	0.03
456	Apartment Investment & Management Co	-	AIV US	纽约证券交易所	美国	144	49,616.63	0.03
457	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	389	49,420.29	0.03
458	Kohl's Corp	-	KSS US	纽约证券交易所	美国	151	49,360.69	0.03
459	Campbell Soup Co	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	178	49,033.52	0.03
460	FLIR Systems Inc	-	FLIR US	纳斯达克证券交易所	美国	128	47,605.92	0.03
461	Albemarle Corp	-	ALB US	纽约证券交易所	美国	98	47,436.67	0.03
462	HollyFrontier Corp	-	HFC US	纽约证券交易所	美国	148	47,087.85	0.03
463	Xerox Corp	-	XXR US	纽约证券交易所	美国	192	46,739.16	0.03

				所				
464	Unum Group	-	UNM US	纽约证券交易所	美国	202	46,590.53	0.03
465	PVH Corp	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	69	44,892.89	0.03
466	DaVita Inc	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	115	44,478.62	0.03
467	News Corp	-	NWSA US	纳斯达克证券交易所	美国	356	33,015.33	0.02
			NWS US	纳斯达克证券交易所	美国	115	11,036.64	0.01
468	Flowserve Corp	-	FLS US	纽约证券交易所	美国	121	43,829.58	0.03
469	SL Green Realty Corp	-	SLG US	纽约证券交易所	美国	79	43,649.05	0.03
470	Robert Half International Inc	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	111	43,503.86	0.03
471	AO Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	133	43,120.04	0.03
472	Sealed Air Corp	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	145	42,644.45	0.03
473	Macy's Inc	-	M US	纽约证券交易所	美国	284	41,898.82	0.03
474	Alliance Data Systems Corp	-	ADS US	纽约证券交易所	美国	43	41,424.12	0.03
475	People's United Financial Inc	-	PBCT US	纳斯达克证券交易所	美国	349	40,259.76	0.03
476	Hanesbra	-	HBI US	纽约证	美国	333	39,421.32	0.03

	nds Inc			券交易 所				
477	Nektar Therapeut ics	-	NKTR US	纳斯达 克证券 交易所	美国	160	39,136.29	0.03
478	Ralph Lauren Corp	-	RL US	纽约证 券交易 所	美国	50	39,044.86	0.03
479	H&R Block Inc	-	HRB US	纽约证 券交易 所	美国	190	38,271.45	0.02
480	Perrigo Co PLC	-	PRGO US	纽约证 券交易 所	美国	116	37,975.29	0.02
481	L Brands Inc	-	LB US	纽约证 券交易 所	美国	211	37,859.66	0.02
482	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证 券交易 所	美国	148	37,849.35	0.02
483	Cimarex Energy Co	-	XEC US	纽约证 券交易 所	美国	92	37,524.59	0.02
484	Harley-Da vidson Inc	-	HOG US	纽约证 券交易 所	美国	151	37,194.40	0.02
485	Newell Brands Inc	-	NWL US	纽约证 券交易 所	美国	350	37,102.76	0.02
486	Quanta Services Inc	-	PWR US	纽约证 券交易 所	美国	135	35,443.55	0.02
487	Helmerich & Payne Inc	-	HP US	纽约证 券交易 所	美国	101	35,147.73	0.02
488	Assurant Inc	-	AIZ US	纽约证 券交易 所	美国	48	35,103.87	0.02
489	IPG Photonics Corp	-	IPGP US	纳斯达 克证券 交易所	美国	33	34,993.94	0.02
490	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证 券交易 所	美国	136	33,536.99	0.02

491	Capri Holdings Limit	-	CPRI US	纽约证券交易所	美国	139	33,139.63	0.02
492	Jefferies Financial Group Inc	-	JEF US	纽约证券交易所	美国	246	32,521.32	0.02
493	Leggett & Platt Inc	-	LEG US	纽约证券交易所	美国	121	31,917.65	0.02
494	Affiliated Managers Group Inc	-	AMG US	纽约证券交易所	美国	48	30,404.87	0.02
495	Foot Locker Inc	-	FL US	纽约证券交易所	美国	105	30,259.68	0.02
496	TripAdvisor Inc	-	TRIP US	纳斯达克证券交易所	美国	95	30,231.84	0.02
497	Gap Inc/The	-	GPS US	纽约证券交易所	美国	198	24,460.60	0.02
498	Coty Inc	-	COTY US	纽约证券交易所	美国	263	24,227.82	0.02
499	Nordstrom Inc	-	JWN US	纽约证券交易所	美国	105	22,997.93	0.01
500	Macerich Co/The	-	MAC US	纽约证券交易所	美国	98	22,562.90	0.01

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	DuPont De Nemours Inc.	DD US	344,464.21	0.24
2	Walt Disney Co/The	DIS US	282,330.26	0.20
3	Twenty-First Century Fox Inc	TFCFA US	236,260.83	0.16

4	Fox Corp	FOXA US	86,839.68	0.06
		FOX US	40,314.99	0.03
5	Corteva Inc	CTVA US	112,301.67	0.08
6	Amcor PLC	AMCR US	107,426.35	0.07
7	First Republic Bank/CA	FRC US	93,096.92	0.06
8	Teleflex Inc	TFX US	87,260.78	0.06
9	Atmos Energy Corp	ATO US	65,628.12	0.05
10	Dominion Energy Inc	D US	59,435.22	0.04
11	Newmont Goldcorp Corp	NEM US	58,527.95	0.04
12	Wabtec Corp	WAB US	45,986.26	0.03
13	Bemis Company, Inc.	BMS US	31,567.65	0.02
14	Encana Corporation	ECA US	23,304.21	0.02
15	Fifth Third Bancorp	FITB US	15,163.08	0.01
16	Facebook Inc	FB US	11,778.96	0.01
17	Baker Hughes a GE Co	BHGE US	11,467.07	0.01
18	salesforce.com Inc	CRM US	8,591.32	0.01
19	Apartment Investment & Management Co	AIV US	1,358.98	0.00

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Apple Inc	AAPL US	546,700.91	0.38
2	DowDuPont INC	DWDP US	519,383.61	0.36
3	Fox Corp	FOXA US	333,621.30	0.23
		FOX US	156,617.12	0.11
4	Microsoft Corp	MSFT US	458,638.75	0.32
5	Alphabet Inc	GOOG US	175,034.01	0.12
		GOOGL US	152,199.29	0.11
6	Amazon.com Inc	AMZN US	304,332.59	0.21
7	Twenty-First Century Fox Inc	TFCFA US	236,142.12	0.16
8	JPMorgan Chase & Co	JPM US	212,631.20	0.15
9	Facebook Inc	FB US	199,731.45	0.14
10	Johnson & Johnson	JNJ US	191,334.52	0.13
11	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	190,097.82	0.13
12	Walt Disney Co/The	DIS US	184,559.81	0.13
13	Cisco Systems Inc	CSCO US	180,212.53	0.12
14	Bank of America Corp	BAC US	168,999.56	0.12

15	Pfizer Inc	PFE US	162,382.65	0.11
16	Exxon Mobil Corp	XOM US	156,798.10	0.11
17	Wells Fargo & Co	WFC US	151,155.97	0.10
18	Oracle Corp	ORCL US	149,699.18	0.10
19	Visa Inc	V US	140,809.92	0.10
20	Intel Corp	INTC US	140,208.98	0.10

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,723,104.51
卖出收入（成交）总额	13,995,344.95

注：“买入成本”或“卖出收入”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 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 2018 年 7 月 18 日，欧盟对谷歌不恰当地利用安卓的手机装置加强谷歌搜索引擎的做法处以 43.4 亿欧元的处罚。

2018 年 10 月 9 号，美国财政部外国资产控制办公室今天宣布与摩根大通银行达成 5.26 万美元的和解为了解决 87 项明显违反古巴资产管制条例的潜在民事责任。

2018 年 12 月 26 日，美国证券交易委员会宣布，摩根大通将支付逾 1.35 亿美元，以了结其对所谓的“预发行”美国存托凭证处理不当的指控。

2019 年 1 月 7 日，土耳其反垄断监管机构对谷歌展开反垄断调查，以评估其搜索算法和精准广告服务算法是否违反了土耳其的公平竞争法。

2019 年 3 月 22 日，欧洲反垄断机构欧盟委员会因谷歌违反“在线搜索广告规定”，屏蔽竞争对手的广告，对其开出 14.9 亿欧元罚款。

2019 年 4 月 11 日，土耳其个人数据保护局对 FACEBOOK 漏洞泄露用户数据的行为处以 165 万土耳其里拉的罚款。

2019 年 5 月 16 日，欧洲反垄断机构欧盟委员会因外汇市场合谋行为对包含摩根大通在内的五家银行罚款 10.7 亿欧元。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除谷歌、摩根大通、Facebook 外，本基金投资的其他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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	111,096.75
4	应收利息	1,220.36
5	应收申购款	766,435.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	878,752.32

7.11.4 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。

7.11.5 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
56,551	2,141.16	17,233,003.96	14.23%	103,851,887.51	85.77%

注：持有人户数及结构包含人民币份额及美元现汇份额。

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	彭建军	1,638,100.00	13.52%
2	闫赞华	1,118,000.00	9.23%
3	许可	1,000,000.00	8.25%
4	夏斌	972,900.00	8.03%
5	冯麟	278,884.00	2.30%
6	叶振环	274,900.00	2.27%
7	洪川	274,354.00	2.26%
8	谭水养	247,768.00	2.04%
9	王杰	242,900.00	2.00%
10	马立杰	233,200.00	1.92%

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	10,820.89	0.0089%

注：基金管理人的从业人员持有的本基金份额含易方达标普 500 指数（QDII-LOF）人民币份额及美元现汇份额。

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（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	693,199,312.42
本报告期期初基金份额总额	131,277,418.72
本报告期基金总申购份额	43,510,063.40
减：本报告期基金总赎回份额	53,702,590.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,084,891.47

注：本基金份额变动含易方达标普 500 指数（QDII-LOF）人民币份额及美元现汇份额。

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。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	
Citigroup Global Markets Limited	1	13,067,915.97	98.45%	1,759.61	91.45%	-
Goldman Sachs	1	205,706.58	1.55%	164.55	8.55%	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
Everbright Securities (International)	1	-	-	-	-	-

Limited						
GF Futures (Hong Kong) Co., Limited	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户,于如下证券经营机构 GF Futures (Hong Kong) Co., Limited 新增一个交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构,并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下:

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行,以及能否取得较高质量的成交结果;

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等;

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面;

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训;

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献;

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下:

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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
Citigroup Global Mark	-	-	-	-	-	-	4,222,755.68	100.00%

ets Limit ed								
Gold man Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Secur ities Hong Kong Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Ever brigh t Secur ities (Inter natio nal) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Futur es (Hon g Kong) Co., Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-

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旗下部分开放式基金参加财富证券费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-01-11
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加百度百盈为销售机构、参加百度百盈费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-01-11

3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加蚂蚁基金为销售机构的公告	上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-01-16
4	易方达基金管理有限公司关于易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2019 年 1 月 21 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2019-01-16
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加九州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	2019-02-13
6	易方达基金管理有限公司关于易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2019 年 2 月 18 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2019-02-13
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华夏财富为销售机构、参加华夏财富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	2019-02-22
8	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
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加利得基金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	2019-03-13
10	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
11	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
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泉州银行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	2019-04-01
13	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
14	易方达基金管理有限公司关于易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2019 年 4 月 19 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2019-04-16
15	易方达基金管理有限公司关于易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）2019 年 5 月 27 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2019-05-22
16	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019-05-28

	新身份信息以免影响日常交易的公告	及基金管理人网站	
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇成基金为销售机构、参加汇成基金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	2019-06-14
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加德邦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	2019-06-24
19	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标普 500 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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