

# 易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基 金

## 2019 年半年度报告

### 2019 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 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遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
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.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.12	投资组合报告附注 .....	40
8	基金份额持有人信息 .....	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
9	开放式基金份额变动 .....	42
10	重大事件揭示 .....	43
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4	基金投资策略的改变 .....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8	其他重大事件 .....	45
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	45
12	备查文件目录 .....	46
12.1	备查文件目录 .....	46
12.2	存放地点 .....	46
12.3	查阅方式 .....	46

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证中盘 ETF
场内简称	中盘 ETF
基金主代码	510130
交易代码	510130
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2010 年 3 月 29 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	71,085,089.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 6 月 23 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资，即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，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	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-4,058,122.25
本期利润	57,802,234.98
加权平均基金份额本期利润	0.7986
本期加权平均净值利润率	21.41%
本期基金份额净值增长率	24.13%
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	70,432,145.53

期末可供分配基金份额利润	0.9908
期末基金资产净值	277,112,082.39
期末基金份额净值	3.8983
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	34.08%

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

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

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

4.本基金已于 2010 年 5 月 28 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.34394741。

## 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

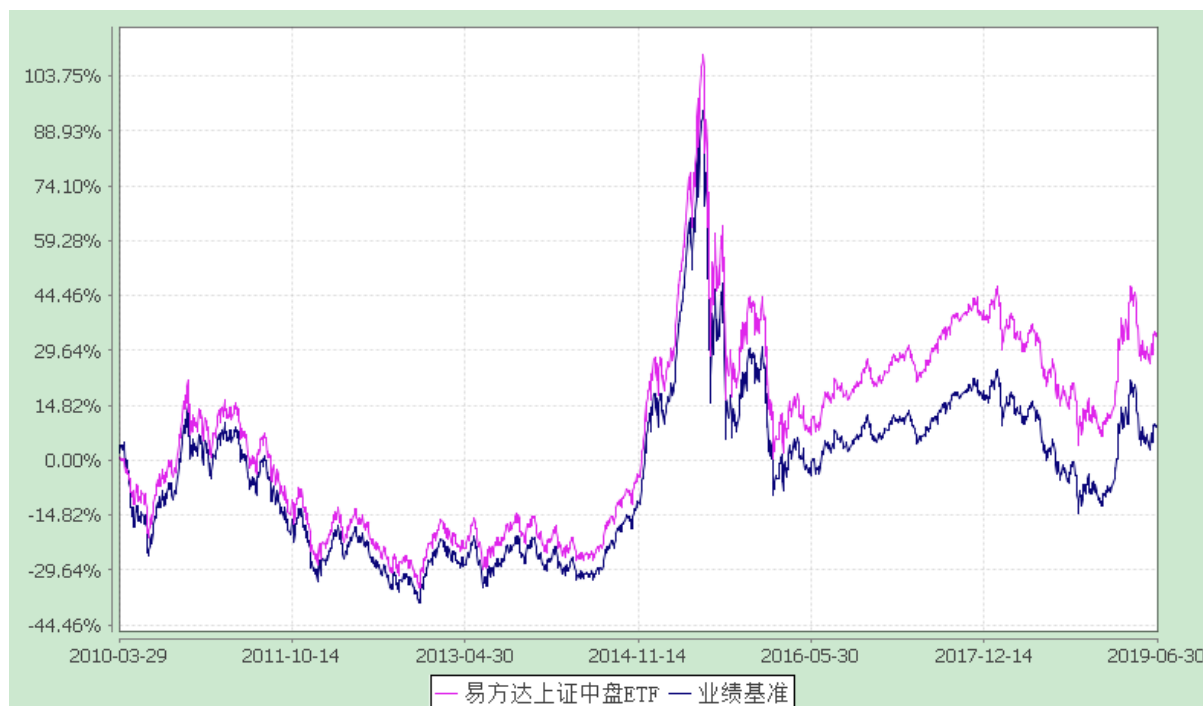
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.99%	1.16%	3.50%	1.18%	0.49%	-0.02%
过去三个月	-2.84%	1.57%	-4.27%	1.58%	1.43%	-0.01%
过去六个月	24.13%	1.62%	22.70%	1.64%	1.43%	-0.02%
过去一年	7.71%	1.50%	4.87%	1.53%	2.84%	-0.03%
过去三年	20.80%	1.07%	10.52%	1.09%	10.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	34.08%	1.53%	9.18%	1.57%	24.90%	-0.04%

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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010年3月29日至2019年6月30日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 34.08%，同期业绩比较基准收益率为 9.18%。

## 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		



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、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理	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 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

本基金跟踪的标的指数为上证中盘指数，上证中盘指数由上证 180 指数成份股中剔除 50 只上证 50 指数成份股后剩余的 130 家成份股构成，以综合反映沪市中盘公司的整体状况。报告期内，本基金主要采取完全复制法投资策略，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而进行相应调整。

上半年，国内宏观经济总体较为稳定，二季度出现企稳回升迹象。中国二季度 GDP 同比增长 6.2%，预期 6.3%；上半年 GDP 同比增长 6.3%，预期 6.3%；6 月规上工业增加值同比 6.3%（预期 5.2%，前值 5.0%）；6 月社会消费品零售总额同比 9.8%（预期 8.5%，前值 8.6%）；1-6 月固定资产投资同比 5.8%（预期 5.5%，前值 5.6%）。股票市场呈现前高后低的走势，一季度市场全面上涨，二季度出现回调，上证中盘指数上半年涨 22.7%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 3.8983 元，本报告期份额净值增长率为 24.13%，同期业绩比

较基准收益率为 22.70%，年化跟踪误差 0.71%，在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济仍面临较大的下行压力。一方面全球经济景气度疲软，6 月摩根大通全球制造业 PMI 继续下滑至 49.4，已连续两个月低于 50 的荣枯线，预示着全球经济前景不容乐观；美联储、欧央行、英国央行等机构也纷纷表示下行压力明显增加，全球不确定性日益提升。另一方面，当前中美贸易谈判已经重启，但关税加征至 25% 已经开始生效，下半年我国 GDP 增速、出口、产业转移和就业的冲击将逐步显现。稳经济仍是目前国内各项政策的首要出发点。

证券市场及行业走势上，预计下半年难以重现今年一季度白马股与爆雷股齐飞的无差别的估值修复行情。3、4 季度基本面恶化风险边际减弱，部分行业景气度见底回升概率较大，业绩获得改善的行业有望获得二级市场的认可与追捧。上证中盘指数成份股平均市值 500 亿是市场的中坚力量，具有较强的抗风险与盈利能力，行业分布上以金融、公用事业、交通运输为主与实体经济基本面状况相关度较高。作为被动投资的基金，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，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

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

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,880,209.60	2,512,892.87
结算备付金		6,490.07	13,509.42
存出保证金		1,706.65	5,496.27
交易性金融资产	6.4.7.2	275,667,419.26	232,053,991.19
其中：股票投资		275,667,419.26	232,053,991.19
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		-	436,999.17
应收利息	6.4.7.5	319.86	519.74
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		277,556,145.44	235,023,408.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付管理人报酬		110,838.58	101,554.09
应付托管费		22,167.72	20,310.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	42,850.44	42,476.78
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	268,206.31	310,882.80
负债合计		444,063.05	475,224.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	206,679,936.86	217,146,938.93
未分配利润	6.4.7.10	70,432,145.53	17,401,245.25
所有者权益合计		277,112,082.39	234,548,184.18

负债和所有者权益总计		277,556,145.44	235,023,408.66
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.8983 元，基金份额总额 71,085,089.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>58,922,622.37</b>	<b>-24,737,478.08</b>
1.利息收入		8,526.33	29,205.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,373.73	29,205.74
债券利息收入		152.60	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,947,863.19	10,675,976.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,916,655.84	8,641,665.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	109,851.72	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,858,940.93	2,034,310.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	61,860,357.23	-35,445,245.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,602.00	2,585.32
<b>减：二、费用</b>		<b>1,120,387.39</b>	<b>1,172,080.04</b>
1. 管理人报酬		667,167.54	624,077.06
2. 托管费		133,433.51	124,815.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	101,278.66	114,649.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.37	-
7. 其他费用	6.4.7.19	218,507.31	308,538.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>57,802,234.98</b>	<b>-25,909,558.12</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>57,802,234.98</b>	<b>-25,909,558.12</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	217,146,938.93	17,401,245.25	234,548,184.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,802,234.98	57,802,234.98
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）	-10,467,002.07	-4,771,334.70	-15,238,336.77
其中：1.基金申购款	5,815,001.15	1,400,605.20	7,215,606.35
2.基金赎回款	-16,282,003.22	-6,171,939.90	-22,453,943.12
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）	206,679,936.86	70,432,145.53	277,112,082.39
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）	186,908,932.95	71,697,178.40	258,606,111.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-25,909,558.12	-25,909,558.12
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）	8,141,001.61	1,963,727.57	10,104,729.18
其中：1.基金申购款	13,956,002.75	4,512,254.23	18,468,256.98
2.基金赎回款	-5,815,001.14	-2,548,526.66	-8,363,527.80
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）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	195,049,934.56	47,751,347.85	242,801,282.41

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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1498 号《关于核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，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《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,752,478,065 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,000 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。

为了与上证中盘指数进行对比，根据《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，易方达基金管理有限公司确定 2010 年 5 月 28 日为本基金的基金份额折算日。当日上证中盘指数收盘值为 2706.88 点，本基金资产净值为 2,562,624,152.24 元，折算前基金份额总额为 2,752,478,065 份，折算前基金份额净值为 0.931 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.34394741，折算后基金份额总额为 946,685,089 份，折算后基金份额净值为 2.707 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2010 年 5 月 31 日进行了变更登记。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的

个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款	1,880,209.60
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	1,880,209.60	

##### 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	271,513,565.19	275,667,419.26	4,153,854.07
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	271,513,565.19	275,667,419.26	4,153,854.07

##### 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	316.53
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	2.61
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.72
合计	319.86

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	42,850.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	42,850.44

#### 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	-
预提费用	218,206.31

其他应付款	50,000.00
合计	268,206.31

#### 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	74,685,089.00	217,146,938.93
本期申购	2,000,000.00	5,815,001.15
本期赎回（以“-”号填列）	-5,600,000.00	-16,282,003.22
本期末	71,085,089.00	206,679,936.86

#### 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	107,107,953.63	-89,706,708.38	17,401,245.25
本期利润	-4,058,122.25	61,860,357.23	57,802,234.98
本期基金份额交易产生的变动数	-4,911,288.83	139,954.13	-4,771,334.70
其中：基金申购款	2,805,100.44	-1,404,495.24	1,400,605.20
基金赎回款	-7,716,389.27	1,544,449.37	-6,171,939.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	98,138,542.55	-27,706,397.02	70,432,145.53

#### 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	7,598.37
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	750.33
其他	25.03
合计	8,373.73

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,777,342.13
股票投资收益——赎回差价收入	860,686.29
股票投资收益——申购差价收入	-

合计	-4,916,655.84
----	---------------

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	46,372,793.12
减：卖出股票成本总额	52,150,135.25
买卖股票差价收入	-5,777,342.13

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	22,453,943.12
减：现金支付赎回款总额	-18,577.88
减：赎回股票成本总额	21,611,834.71
赎回差价收入	860,686.29

#### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,068,007.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	957,993.41
减：应收利息总额	162.27
买卖债券差价收入	109,851.72

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,858,940.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,858,940.93

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	61,860,357.23
——股票投资	61,860,357.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	61,860,357.23

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	1,602.00
其他	-
合计	1,602.00

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

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	101,278.66
银行间市场交易费用	-
合计	101,278.66

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78

信息披露费	58,700.75
银行汇划费	301.00
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	218,507.31

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
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	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	667,167.54	624,077.06
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	133,433.51	124,815.46

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日



	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	58,993,715.00	82.99%	61,333,274.00	82.12%
广发证券	365,848.00	0.51%	244,487.00	0.33%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,880,209.60	7,598.37	8,647,193.75	28,695.68

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	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

				型						
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	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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 0.00%(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	1,880,209.60	-	-	-	1,880,209.60
结算备付金	6,490.07	-	-	-	6,490.07
存出保证金	1,706.65	-	-	-	1,706.65
交易性金融资产	-	-	-	275,667,419.26	275,667,419.26
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	-	-	-	319.86	319.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,888,406.32	-	-	275,667,739.12	277,556,145.44
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	110,838.58	110,838.58
应付托管费	-	-	-	22,167.72	22,167.72

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	42,850.44	42,850.44
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	268,206.31	268,206.31
负债总计	-	-	-	444,063.05	444,063.05
利率敏感度缺口	1,888,406.32	-	-	275,223,676.07	277,112,082.39
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	2,512,892.87	-	-	-	2,512,892.87
结算备付金	13,509.42	-	-	-	13,509.42
存出保证金	5,496.27	-	-	-	5,496.27
交易性金融资产	-	-	-	232,053,991.19	232,053,991.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	436,999.17	436,999.17
应收利息	-	-	-	519.74	519.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,531,898.56	-	-	232,491,510.10	235,023,408.66
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	101,554.09	101,554.09

应付托管费	-	-	-	20,310.81	20,310.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	42,476.78	42,476.78
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	310,882.80	310,882.80
负债总计	-	-	-	475,224.48	475,224.48
利率敏感度缺口	2,531,898.56	-	-	232,016,285.62	234,548,184.18

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	275,667,419.26	99.48	232,053,991.19	98.94
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	275,667,419.26	99.48	232,053,991.19	98.94

#### 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%	13,767,676.49	11,596,898.74
	2.业绩比较基准下降5%	-13,767,676.49	-11,596,898.74

#### 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 275,667,419.26 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 232,053,991.19 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	275,667,419.26	99.32
	其中：股票	275,667,419.26	99.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,886,699.67	0.68
8	其他各项资产	2,026.51	0.00
9	合计	277,556,145.44	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	726,421.00	0.26
B	采矿业	14,453,310.41	5.22
C	制造业	104,991,086.37	37.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,641,756.50	8.17
E	建筑业	8,679,406.39	3.13
F	批发和零售业	7,095,741.08	2.56
G	交通运输、仓储和邮政业	19,595,204.42	7.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,576,566.39	5.26
J	金融业	69,295,745.81	25.01
K	房地产业	10,518,655.89	3.80
L	租赁和商务服务业	467,775.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,113,426.00	0.40
S	综合	1,512,324.00	0.55
	合计	275,667,419.26	99.48

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	627,626	11,234,505.40	4.05

2	601169	北京银行	1,407,400	8,317,734.00	3.00
3	603288	海天味业	77,124	8,098,020.00	2.92
4	600009	上海机场	91,640	7,677,599.20	2.77
5	601012	隆基股份	241,302	5,576,489.22	2.01
6	600919	江苏银行	658,700	4,782,162.00	1.73
7	601009	南京银行	564,644	4,663,959.44	1.68
8	600999	招商证券	272,000	4,648,480.00	1.68
9	601006	大秦铁路	565,500	4,574,895.00	1.65
10	600015	华夏银行	585,280	4,506,656.00	1.63
11	601899	紫金矿业	1,151,172	4,339,918.44	1.57
12	600570	恒生电子	61,129	4,165,941.35	1.50
13	600352	浙江龙盛	247,500	3,903,075.00	1.41
14	601669	中国电建	727,400	3,847,946.00	1.39
15	601933	永辉超市	364,027	3,716,715.67	1.34
16	600958	东方证券	340,500	3,636,540.00	1.31
17	601225	陕西煤业	380,400	3,514,896.00	1.27
18	601155	新城控股	85,856	3,417,927.36	1.23
19	600436	片仔癀	28,700	3,306,240.00	1.19
20	600406	国电南瑞	175,860	3,278,030.40	1.18
21	600741	华域汽车	149,934	3,238,574.40	1.17
22	600588	用友网络	118,301	3,179,930.88	1.15
23	600660	福耀玻璃	133,400	3,032,182.00	1.09
24	601377	兴业证券	445,800	3,004,692.00	1.08
25	600010	包钢股份	1,733,934	2,930,348.46	1.06
26	600547	山东黄金	70,708	2,911,048.36	1.05
27	600795	国电电力	1,121,118	2,847,639.72	1.03
28	601901	方正证券	391,400	2,782,854.00	1.00
29	600705	中航资本	512,157	2,775,890.94	1.00
30	600111	北方稀土	207,300	2,661,732.00	0.96
31	601108	财通证券	238,900	2,623,122.00	0.95
32	600011	华能国际	418,360	2,606,382.80	0.94
33	600438	通威股份	184,600	2,595,476.00	0.94
34	600383	金地集团	214,683	2,561,168.19	0.92
35	600089	特变电工	353,250	2,561,062.50	0.92
36	600886	国投电力	322,654	2,507,021.58	0.90
37	601985	中国核电	444,100	2,469,196.00	0.89
38	600271	航天信息	106,330	2,450,906.50	0.88
39	601600	中国铝业	621,847	2,437,640.24	0.88
40	600606	绿地控股	347,200	2,371,376.00	0.86
41	601555	东吴证券	228,277	2,339,839.25	0.84
42	600115	东方航空	373,150	2,339,650.50	0.84
43	601099	太平洋	648,189	2,307,552.84	0.83
44	600872	中炬高新	53,100	2,274,273.00	0.82
45	600061	国投资本	160,834	2,253,284.34	0.81

46	600109	国金证券	230,100	2,236,572.00	0.81
47	603589	口子窖	34,278	2,208,188.76	0.80
48	600332	白云山	53,496	2,191,731.12	0.79
49	600522	中天科技	233,280	2,139,177.60	0.77
50	600487	亨通光电	126,800	2,125,168.00	0.77
51	601788	光大证券	185,800	2,121,836.00	0.77
52	603019	中科曙光	60,020	2,106,702.00	0.76
53	600018	上港集团	308,596	2,104,624.72	0.76
54	600637	东方明珠	195,920	2,064,996.80	0.75
55	601618	中国中冶	679,130	2,064,555.20	0.75
56	601607	上海医药	109,745	1,991,871.75	0.72
57	600893	航发动力	85,600	1,943,976.00	0.70
58	600176	中国巨石	199,900	1,905,047.00	0.69
59	601877	正泰电器	81,900	1,891,071.00	0.68
60	600516	方大炭素	153,580	1,887,498.20	0.68
61	601727	上海电气	335,289	1,803,854.82	0.65
62	600004	白云机场	98,400	1,790,880.00	0.65
63	600867	通化东宝	116,138	1,788,525.20	0.65
64	601998	中信银行	291,465	1,740,046.05	0.63
65	600809	山西汾酒	24,900	1,719,345.00	0.62
66	600489	中金黄金	164,130	1,685,615.10	0.61
67	600600	青岛啤酒	33,100	1,652,683.00	0.60
68	600066	宇通客车	126,356	1,645,155.12	0.59
69	600068	葛洲坝	262,753	1,636,951.19	0.59
70	600926	杭州银行	195,140	1,625,516.20	0.59
71	601233	桐昆股份	103,900	1,611,489.00	0.58
72	600426	华鲁恒升	108,200	1,607,852.00	0.58
73	601997	贵阳银行	183,620	1,588,313.00	0.57
74	601198	东兴证券	131,200	1,558,656.00	0.56
75	600362	江西铜业	98,666	1,553,002.84	0.56
76	600398	海澜之家	170,900	1,550,063.00	0.56
77	600482	中国动力	65,304	1,542,480.48	0.56
78	601838	成都银行	171,600	1,515,228.00	0.55
79	600085	同仁堂	52,194	1,513,626.00	0.55
80	600895	张江高科	73,700	1,512,324.00	0.55
81	601881	中国银河	122,600	1,501,850.00	0.54
82	603156	养元饮品	40,200	1,490,616.00	0.54
83	600298	安琪酵母	47,100	1,489,773.00	0.54
84	600535	天士力	86,235	1,427,189.25	0.52
85	603986	兆易创新	16,300	1,413,210.00	0.51
86	600297	广汇汽车	311,021	1,387,153.66	0.50
87	603369	今世缘	47,800	1,333,142.00	0.48
88	603799	华友钴业	61,596	1,312,610.76	0.47
89	600208	新潮中宝	409,834	1,286,878.76	0.46

90	600118	中国卫星	56,229	1,267,963.95	0.46
91	600528	中铁工业	105,659	1,222,474.63	0.44
92	603160	汇顶科技	8,700	1,207,560.00	0.44
93	601992	金隅集团	316,700	1,190,792.00	0.43
94	601878	浙商证券	126,600	1,177,380.00	0.42
95	600760	中航沈飞	40,000	1,161,200.00	0.42
96	600699	均胜电子	54,219	1,158,117.84	0.42
97	600038	中直股份	28,100	1,152,662.00	0.42
98	600572	康恩贝	177,600	1,136,640.00	0.41
99	601117	中国化学	187,700	1,129,954.00	0.41
100	600909	华安证券	172,200	1,126,188.00	0.41
101	600977	中国电影	71,100	1,113,426.00	0.40
102	603858	步长制药	42,160	1,086,463.20	0.39
103	600816	安信信托	208,081	1,050,809.05	0.38
104	600804	鹏博士	136,010	1,022,795.20	0.37
105	601238	广汽集团	88,300	965,119.00	0.35
106	601633	长城汽车	114,539	947,237.53	0.34
107	600188	兖州煤业	84,400	917,428.00	0.33
108	601699	潞安环能	113,689	902,690.66	0.33
109	600643	爱建集团	92,422	885,402.76	0.32
110	600466	蓝光发展	141,689	881,305.58	0.32
111	601360	三六零	38,600	825,268.00	0.30
112	600598	北大荒	67,700	726,421.00	0.26
113	601598	中国外运	150,300	719,937.00	0.26
114	600025	华能水电	170,900	695,563.00	0.25
115	600060	海信电器	74,565	642,750.30	0.23
116	600884	杉杉股份	53,300	567,645.00	0.20
117	601162	天风证券	49,300	534,412.00	0.19
118	600291	西水股份	52,100	524,126.00	0.19
119	600901	江苏租赁	85,300	519,477.00	0.19
120	601828	美凯龙	38,500	467,775.00	0.17
121	603260	合盛硅业	9,600	451,776.00	0.16
122	601298	青岛港	46,200	387,618.00	0.14
123	601577	长沙银行	35,600	339,624.00	0.12
124	600733	北汽蓝谷	39,700	327,922.00	0.12
125	601860	紫金银行	38,100	287,274.00	0.10
126	601990	南京证券	28,900	286,399.00	0.10
127	601615	明阳智能	26,200	284,008.00	0.10
128	600903	贵州燃气	21,600	281,448.00	0.10
129	600968	海油发展	51,187	181,713.85	0.07
130	603486	科沃斯	5,980	180,895.00	0.07
131	603013	亚普股份	5,900	93,692.00	0.03
132	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
133	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01

134	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
-----	--------	------	-------	-----------	------

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601169	北京银行	8,249,684.00	3.52
2	601006	大秦铁路	4,785,752.00	2.04
3	600547	山东黄金	2,513,890.46	1.07
4	600606	绿地控股	2,342,848.69	1.00
5	601108	财通证券	2,220,429.93	0.95
6	600487	亨通光电	2,151,136.00	0.92
7	600872	中炬高新	2,069,632.00	0.88
8	600426	华鲁恒升	1,513,300.68	0.65
9	600895	张江高科	1,473,376.00	0.63
10	603986	兆易创新	1,311,136.90	0.56
11	603156	养元饮品	1,219,990.60	0.52
12	601838	成都银行	1,190,311.00	0.51
13	603369	今世缘	1,185,213.00	0.51
14	600061	国投资本	1,124,591.11	0.48
15	600572	康恩贝	1,078,996.00	0.46
16	600188	兖州煤业	865,216.00	0.37
17	601360	三六零	827,370.00	0.35
18	601669	中国电建	801,791.00	0.34
19	601598	中国外运	722,163.00	0.31
20	600031	三一重工	562,655.34	0.24

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	10,022,785.58	4.27
2	600031	三一重工	7,288,816.40	3.11
3	601111	中国国航	2,545,758.83	1.09
4	600177	雅戈尔	2,132,280.60	0.91
5	600518	ST 康美	2,129,258.00	0.91
6	600023	浙能电力	1,811,453.19	0.77

7	601919	中远海控	1,744,084.30	0.74
8	600153	建发股份	1,456,382.26	0.62
9	600549	厦门钨业	1,293,986.87	0.55
10	600497	驰宏锌锗	1,288,243.04	0.55
11	600688	上海石化	1,077,653.30	0.46
12	600266	北京城建	898,215.60	0.38
13	601066	中信建投	895,133.44	0.38
14	600079	人福医药	893,527.56	0.38
15	600737	中粮糖业	863,979.46	0.37
16	600435	北方导航	771,198.84	0.33
17	600008	首创股份	727,751.00	0.31
18	601228	广州港	724,571.00	0.31
19	600158	中体产业	721,816.50	0.31
20	600373	中文传媒	655,311.00	0.28

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	48,282,422.80
卖出股票收入（成交）总额	46,372,793.12

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 2019 年 1 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局针对江苏银行股份有限公司未按业务实质准确计量风险资产；理财产品之间未能实现相分离；理财投资非标资产未严格比照自营贷款管理，对授信资金未按约定用途使用监督不力的违法违规事实，对江苏银行股份有限公司处以人民币 90 万元行政罚款。

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。除江苏银行外，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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,706.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	319.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-



8	其他	-
9	合计	2,026.51

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有限 公司一易方达上证中盘 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,246	57,050.63	60,182,076. 00	84.66%	10,903,013. 00	15.34%	58,993,715. 00	82.99%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司一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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例

1	殷淑坤	390,000.00	0.55%
2	浙江华浙白马房地产开发有限公司	375,590.00	0.53%
3	广发证券股份有限公司	365,848.00	0.51%
4	泰康人寿保险有限责任公司一分红一个人分红-019L-FH002 沪	365,583.00	0.51%
5	戴玲	231,568.00	0.33%
6	曹蕾	217,889.00	0.31%
7	王胜琦	171,973.00	0.24%
8	夏林	171,973.00	0.24%
9	潘丽琼	171,973.00	0.24%
10	曲建	171,973.00	0.24%
11	中国工商银行股份有限公司-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	58,993,715.00	82.99%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年3月29日）基金份额总额	2,752,478,065.00
---------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	74,685,089.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	71,085,089.00

## 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	
中信建投	2	93,262,424.59	100.00%	46,631.81	100.00%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	1,068,007.40	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于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
2	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
3	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
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 增加兴业证券为申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-06-14
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-22

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国工商银行股份有限公司—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	1	2019年01月01日~2019年06月30日	61,333,274.00	2,060,441.00	4,400,000.00	58,993,715.00	82.99%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部</p>							

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

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日