

# 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遵规守信情况的说明              | 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 | 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<br>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） $\times 95\%$ + 活期存款利率（税后） $\times 5\%$   |
| 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。<br>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<br>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<br>6号105室-42891 (集中办公<br>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<br>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<br>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,<br>Massachusetts 02111, United States |
| 办公地址 |    | 无      | One Lincoln Street, Boston,<br>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 | <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<br>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<br>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

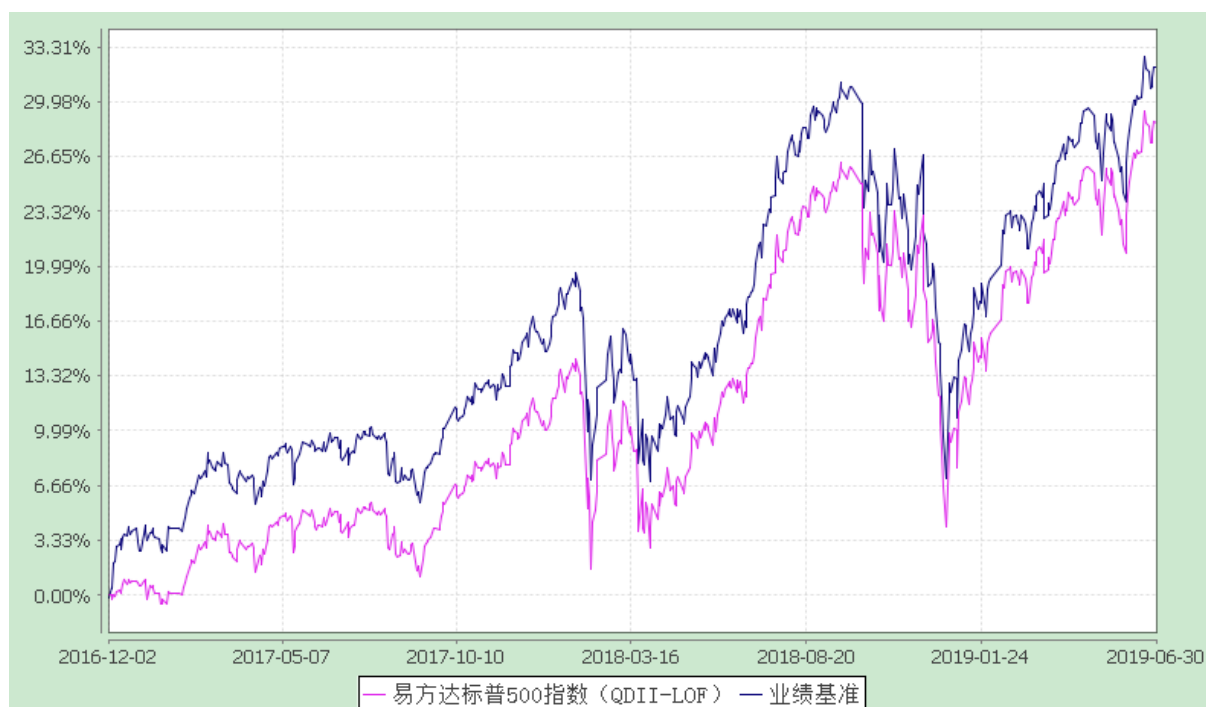
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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遵规守信、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<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 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    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>159,112,706.75</b>          | <b>156,386,143.23</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| 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                    |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |                                  |
| 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<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b> |          | <b>24,590,382.64</b>                     | <b>854,305.42</b>                             |
| 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          |
| <b>减: 二、费用</b>              |          | <b>1,108,342.09</b>  | <b>1,145,223.39</b> |
| 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          |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |          | <b>23,482,040.55</b> | <b>-290,917.97</b>  |
| 减: 所得税费用                    |          | -                    | -                   |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |          | <b>23,482,040.55</b> | <b>-290,917.97</b>  |

### 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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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                   | 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 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自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自有资金投资本基金。

##### 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 | 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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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

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<br>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 |
| <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>  | <b>1-5 年</b> | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>     | <b>合计</b>      |
| 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<br>折合人民币           | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计                    |
| <b>以外币计价的资产</b>                |                       |             |               |                       |
| 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                           | -                     | -           | -             | -                     |
| <b>资产合计</b>                    | <b>156,966,134.93</b> | -           | -             | <b>156,966,134.93</b> |
| <b>以外币计价的负债</b>                |                       |             |               |                       |
| 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                |
| <b>负债合计</b>                    | <b>141,774.74</b>     | -           | -             | <b>141,774.74</b>     |
| <b>资产负债表<br/>外汇风险敞<br/>口净额</b> | <b>156,824,360.19</b> | -           | -             | <b>156,824,360.19</b> |
| 项目                             | 上年度末<br>2018年12月31日   |             |               |                       |
|                                | 美元<br>折合人民币           | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计                    |
| <b>以外币计价的资产</b>                |                       |             |               |                       |
| 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                 | -                     | - | - | -                     |
| <b>资产合计</b>          | <b>147,079,527.28</b> | - | - | <b>147,079,527.28</b> |
| <b>以外币计价的负债</b>      |                       |   |   |                       |
| 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                |
| <b>负债合计</b>          | <b>178,025.51</b>     | - | - | <b>178,025.51</b>     |
| <b>资产负债表外汇风险敞口净额</b> | <b>146,901,501.77</b> | - | - | <b>146,901,501.77</b> |

#### 6.4.13.4.2.2 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<br>2019 年 6 月 30 日        | 上年度末<br>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<br>2019 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 147,935,592.3<br>0     | 94.92                | 137,007,805.3<br>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<br>0     | 94.92                | 137,007,805.3<br>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<br>影响金额 (单位: 人民币元) |                          |
|    |                      | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日            | 上年度末<br>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<br>(英文)           | 公司名称<br>(中文) | 证券代码     | 所在证<br>券市场        | 所属国家<br>(地区) | 数量 (股) | 公允价值         | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
|----|------------------------|--------------|----------|-------------------|--------------|--------|--------------|-----------------------|
| 1  | Microsoft Corp         | -            | MSFT US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 6,681  | 6,152,765.48 | 3.95                  |
| 2  | Apple Inc              | -            | AAPL US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 3,811  | 5,185,401.42 | 3.33                  |
| 3  | Amazon.com Inc         | -            | AMZN US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 361    | 4,699,547.88 | 3.02                  |
| 4  | Alphabet Inc           | -            | GOOG US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 268    | 1,991,489.77 | 1.28                  |
|    |                        |              | GOOGL US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 262    | 1,950,308.39 | 1.25                  |
| 5  | Facebook Inc           | -            | FB US    | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国           | 2,094  | 2,778,355.01 | 1.78                  |
| 6  | Berkshire Hathaway Inc | -            | BRK/B US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 1,690  | 2,476,660.86 | 1.59                  |
| 7  | Johnson & Johnson      | -            | JNJ US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 2,315  | 2,216,631.52 | 1.42                  |
| 8  | JPMorgan Chase & Co    | -            | JPM US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 2,829  | 2,174,345.24 | 1.40                  |
| 9  | Exxon Mobil Corp       | -            | XOM US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国           | 3,689  | 1,943,395.67 | 1.25                  |
| 10 | Visa Inc               | -            | V US     | 纽约证<br>券交易<br>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<br>证券交易<br>所                     | 美国 | 3,947 | 1,147,244.16 | 0.74 |
| 27 | Boeing Co/The               | - | BA US    | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 457   | 1,143,624.01 | 0.73 |
| 28 | PepsiCo Inc                 | - | PEP US   | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 1,228 | 1,107,016.72 | 0.71 |
| 29 | Citigroup Inc               | - | C US     | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 2,017 | 971,054.88   | 0.62 |
| 30 | Netflix Inc                 | - | NFLX US  | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 382   | 964,632.06   | 0.62 |
| 31 | McDonald's Corp             | - | MCD US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 669   | 955,064.54   | 0.61 |
| 32 | Walmart Inc                 | - | WMT US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 1,220 | 926,694.44   | 0.59 |
| 33 | Abbott Laboratories         | - | ABT US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 1,535 | 887,479.08   | 0.57 |
| 34 | Adobe Inc                   | - | ADBE US  | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 427   | 864,944.16   | 0.55 |
| 35 | Oracle Corp                 | - | ORCL US  | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 2,116 | 828,734.91   | 0.53 |
| 36 | PayPal Holdings Inc         | - | PYPL US  | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 1,026 | 807,336.99   | 0.52 |
| 37 | Medtronic PLC               | - | MDT US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 1,172 | 784,685.68   | 0.50 |
| 38 | Honeywell International Inc | - | HON US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 638   | 765,761.97   | 0.49 |
| 39 | International               | - | IBM US   | 纽约证<br>券交易                            | 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<br>证券交易<br>所                     | 美国 | 227   | 407,820.33 | 0.26 |
| 82 | Chubb<br>Ltd                              | - | CB US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 400   | 405,029.83 | 0.26 |
| 83 | Celgene<br>Corp                           | - | CELG US | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 614   | 390,195.32 | 0.25 |
| 84 | Duke<br>Energy<br>Corp                    | - | DUK US  | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 636   | 385,812.56 | 0.25 |
| 85 | TJX Cos<br>Inc/The                        | - | TJX US  | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 1,058 | 384,619.12 | 0.25 |
| 86 | Stryker<br>Corp                           | - | SYK US  | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 271   | 383,004.52 | 0.25 |
| 87 | Dominion<br>Energy<br>Inc                 | - | D US    | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 712   | 378,464.88 | 0.24 |
| 88 | PNC<br>Financial<br>Services<br>Group Inc | - | PNC US  | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 394   | 371,840.97 | 0.24 |
| 89 | Colgate-P<br>almolive<br>Co               | - | CL US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 753   | 371,010.44 | 0.24 |
| 90 | Intuitive<br>Surgical<br>Inc              | - | ISRG US | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 102   | 367,824.64 | 0.24 |
| 91 | CSX Corp                                  | - | CSX US  | 纳斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 678   | 360,625.18 | 0.23 |
| 92 | Cigna<br>Corp                             | - | CI US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 331   | 358,509.07 | 0.23 |
| 93 | Boston<br>Scientific<br>Corp              | - | BSX US  | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 1,212 | 358,115.22 | 0.23 |
| 94 | Southern<br>Co/The                        | - | SO US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 921   | 350,010.78 | 0.22 |
| 95 | Morgan                                    | - | MS US   | 纽约证<br>券交易<br>所                       | 美国 | 1,135 | 341,839.99 | 0.22 |

|     |   |   |         |                   |    |       |            |      |
|-----|---|---|---------|-------------------|----|-------|------------|------|
|     | Stanley                                   |   |         | 券交易<br>所          |    |       |            |      |
| 96  | S&P<br>Global Inc                         | - | SPGI US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 218   | 341,385.37 | 0.22 |
| 97  | DuPont<br>De<br>Nemours<br>Inc.           | - | DD US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 657   | 339,067.01 | 0.22 |
| 98  | Northrop<br>Grumman<br>Corp               | - | NOC US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 152   | 337,635.22 | 0.22 |
| 99  | BlackRoc<br>k Inc                         | - | BLK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 104   | 335,534.86 | 0.22 |
| 100 | Schlumbe<br>rger Ltd                      | - | SLB US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,212 | 331,119.10 | 0.21 |
| 101 | Zoetis Inc                                | - | ZTS US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 419   | 326,907.87 | 0.21 |
| 102 | Illumina<br>Inc                           | - | ILMN US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 129   | 326,488.78 | 0.21 |
| 103 | Crown<br>Castle<br>Internatio<br>nal Corp | - | CCI US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 364   | 326,186.64 | 0.21 |
| 104 | EOG<br>Resources<br>Inc                   | - | EOG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 507   | 324,706.66 | 0.21 |
| 105 | Norfolk<br>Southern<br>Corp               | - | NSC US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 232   | 317,917.48 | 0.20 |
| 106 | Deere &<br>Co                             | - | DE US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 279   | 317,838.62 | 0.20 |
| 107 | Allergan<br>plc                           | - | AGN US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 274   | 315,382.50 | 0.20 |
| 108 | Marsh &<br>McLenna<br>n Cos Inc           | - | MMC US  | 纽约证<br>券交易<br>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<br>证券交易<br>交易所 | 美国 | 195   | 218,378.28 | 0.14 |
| 165 | Eaton Corp PLC              | - | ETN US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 381   | 218,132.03 | 0.14 |
| 166 | Anadarko Petroleum Corp     | - | APC US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 445   | 215,860.08 | 0.14 |
| 167 | Humana Inc                  | - | HUM US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 118   | 215,215.23 | 0.14 |
| 168 | Dollar General Corp         | - | DG US   | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 226   | 209,995.69 | 0.13 |
| 169 | Yum! Brands Inc             | - | YUM US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 276   | 209,987.16 | 0.13 |
| 170 | Williams Cos Inc/The        | - | WMB US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 1,078 | 207,802.38 | 0.13 |
| 171 | Sysco Corp                  | - | SYU US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 424   | 206,139.80 | 0.13 |
| 172 | Red Hat Inc                 | - | RHT US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 159   | 205,236.19 | 0.13 |
| 173 | Allstate Corp/The           | - | ALL US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 291   | 203,434.68 | 0.13 |
| 174 | Delta Air Lines Inc         | - | DAL US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 520   | 202,872.40 | 0.13 |
| 175 | Constellation Brands Inc    | - | STZ US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 149   | 201,731.61 | 0.13 |
| 176 | Moody's Corp                | - | MCO US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 148   | 198,719.25 | 0.13 |
| 177 | Johnson Controls Internatio | - | JCI US  | 纽约证<br>券交易<br>所     | 美国 | 694   | 197,091.74 | 0.13 |

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

|     |  |   |         |                   |    |     |            |      |
|-----|--|---|---------|-------------------|----|-----|------------|------|
| 192 | Hilton<br>Worldwide<br>Holdings<br>Inc | - | HLT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 263 | 176,718.43 | 0.11 |
| 193 | AvalonBay<br>Communi<br>ties Inc       | - | AVB US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 126 | 175,996.99 | 0.11 |
| 194 | ONEOK<br>Inc                           | - | OKE US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 367 | 173,608.66 | 0.11 |
| 195 | VF Corp                                | - | VFC US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 289 | 173,545.96 | 0.11 |
| 196 | SunTrust<br>Banks Inc                  | - | STI US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 398 | 171,965.81 | 0.11 |
| 197 | Consolida<br>ted Edison<br>Inc         | - | ED US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 284 | 171,187.73 | 0.11 |
| 198 | Motorola<br>Solutions<br>Inc           | - | MSI US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 149 | 170,786.59 | 0.11 |
| 199 | PPG<br>Industries<br>Inc               | - | PPG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 212 | 170,097.40 | 0.11 |
| 200 | Lam<br>Research<br>Corp                | - | LRCX US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 131 | 169,166.02 | 0.11 |
| 201 | Equity<br>Residentia<br>l              | - | EQR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 323 | 168,582.49 | 0.11 |
| 202 | AutoZone<br>Inc                        | - | AZO US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 22  | 166,287.58 | 0.11 |
| 203 | Advanced<br>Micro<br>Devices<br>Inc    | - | AMD US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 784 | 163,687.16 | 0.11 |
| 204 | LyondellB<br>asell<br>Industries<br>NV | - | LYB US  | 纽约证<br>券交易<br>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<br>所          |    |     |            |      |
| 206 | Paychex<br>Inc                        | - | PAYX US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 285 | 161,229.93 | 0.10 |
| 207 | WEC<br>Energy<br>Group Inc            | - | WEC US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 281 | 161,053.39 | 0.10 |
| 208 | Pioneer<br>Natural<br>Resources<br>Co | - | PXD US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 152 | 160,776.68 | 0.10 |
| 209 | T Rowe<br>Price<br>Group Inc          | - | TROW US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 213 | 160,649.57 | 0.10 |
| 210 | McKesso<br>n Corp                     | - | MCK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 173 | 159,833.13 | 0.10 |
| 211 | Twitter<br>Inc                        | - | TWTR US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 659 | 158,111.91 | 0.10 |
| 212 | Discover<br>Financial<br>Services     | - | DFS US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 295 | 157,355.35 | 0.10 |
| 213 | Dollar<br>Tree Inc                    | - | DLTR US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 212 | 156,514.09 | 0.10 |
| 214 | SBA<br>Communi<br>cations<br>Corp     | - | SBAC US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 101 | 156,116.46 | 0.10 |
| 215 | IQVIA<br>Holdings<br>Inc              | - | IQV US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 141 | 155,965.63 | 0.10 |
| 216 | Global<br>Payments<br>Inc             | - | GPN US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 141 | 155,219.25 | 0.10 |
| 217 | Monster<br>Beverage<br>Corp           | - | MNST US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 352 | 154,461.86 | 0.10 |
| 218 | Cummins<br>Inc                        | - | CMI US  | 纽约证<br>券交易<br>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<br>Pharmaceuticals Inc            |   |         | 克证券<br>交易所        |    |     |            |      |
| 220 | Willis<br>Towers<br>Watson<br>PLC   | - | WLTW US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 116 | 152,746.48 | 0.10 |
| 221 | Ventas Inc                          | - | VTR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 325 | 152,712.87 | 0.10 |
| 222 | Digital<br>Realty<br>Trust Inc      | - | DLR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 188 | 152,236.93 | 0.10 |
| 223 | PACCAR<br>Inc                       | - | PCAR US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 309 | 152,226.07 | 0.10 |
| 224 | FleetCor<br>Technologies Inc        | - | FLT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 78  | 150,599.24 | 0.10 |
| 225 | Eversource<br>Energy                | - | ES US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 289 | 150,519.08 | 0.10 |
| 226 | TransDigm<br>Group<br>Inc           | - | TDG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 45  | 149,669.09 | 0.10 |
| 227 | Tyson<br>Foods Inc                  | - | TSN US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 269 | 149,312.02 | 0.10 |
| 228 | Southwest<br>Airlines<br>Co         | - | LUV US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 427 | 149,064.53 | 0.10 |
| 229 | Zimmer<br>Biomet<br>Holdings<br>Inc | - | ZBH US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 182 | 147,315.75 | 0.09 |
| 230 | Cerner<br>Corp                      | - | CERN US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 292 | 147,143.33 | 0.09 |
| 231 | Verisk<br>Analytics<br>Inc          | - | VRSK US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 146 | 147,002.81 | 0.09 |
| 232 | Fortive<br>Corp                     | - | FTV US  | 纽约证<br>券交易<br>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<br>所          |    |     |            |      |
| 248 | Mettler-T<br>oledo<br>Internatio<br>nal Inc | - | MTD US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 23  | 132,819.20 | 0.09 |
| 249 | Synchron<br>y<br>Financial                  | - | SYF US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 553 | 131,805.25 | 0.08 |
| 250 | American<br>Water<br>Works Co<br>Inc        | - | AWK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 165 | 131,581.76 | 0.08 |
| 251 | Royal<br>Caribbean<br>Cruises<br>Ltd        | - | RCL US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 157 | 130,825.33 | 0.08 |
| 252 | FirstEnergy<br>Corp                         | - | FE US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 443 | 130,377.52 | 0.08 |
| 253 | State<br>Street<br>Corp                     | - | STT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 337 | 129,878.34 | 0.08 |
| 254 | Concho<br>Resources<br>Inc                  | - | CXO US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 183 | 129,807.67 | 0.08 |
| 255 | Total<br>System<br>Services<br>Inc          | - | TSS US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 147 | 129,627.21 | 0.08 |
| 256 | Aptiv<br>PLC                                | - | APTV US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 232 | 128,918.22 | 0.08 |
| 257 | Microchip<br>Technolog<br>y Inc             | - | MCHP US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 216 | 128,743.88 | 0.08 |
| 258 | Realty<br>Income<br>Corp                    | - | O US    | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 269 | 127,545.83 | 0.08 |
| 259 | AMETEK<br>Inc                               | - | AME US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 204 | 127,397.54 | 0.08 |
| 260 | Hartford<br>Financial<br>Services           | - | HIG US  | 纽约证<br>券交易<br>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<br>券交易<br>所       | 美国 | 307 | 105,315.59 | 0.07 |
| 303 | Laborator<br>y Corp of<br>America<br>Holdings | - | LH US   | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 88  | 104,599.94 | 0.07 |
| 304 | Cooper<br>Cos<br>Inc/The                      | - | COO US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 45  | 104,220.80 | 0.07 |
| 305 | Nucor<br>Corp                                 | - | NUE US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 275 | 104,168.89 | 0.07 |
| 306 | CMS<br>Energy<br>Corp                         | - | CMS US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 259 | 103,111.49 | 0.07 |
| 307 | Best Buy<br>Co Inc                            | - | BBY US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 214 | 102,585.79 | 0.07 |
| 308 | Equifax<br>Inc                                | - | EFX US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 110 | 102,270.79 | 0.07 |
| 309 | Arthur J<br>Gallagher<br>& Co                 | - | AJG US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 168 | 101,162.04 | 0.06 |
| 310 | First<br>Republic<br>Bank/CA                  | - | FRC US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 150 | 100,697.17 | 0.06 |
| 311 | Maxim<br>Integrated<br>Products<br>Inc        | - | MXIM US | 纳斯达<br>克证<br>券交易<br>所 | 美国 | 244 | 100,343.67 | 0.06 |
| 312 | Citizens<br>Financial<br>Group Inc            | - | CFG US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 410 | 99,666.65  | 0.06 |
| 313 | Hess Corp                                     | - | HES US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 227 | 99,204.60  | 0.06 |
| 314 | Expedia<br>Group Inc                          | - | EXPE US | 纳斯达<br>克证<br>券交易<br>所 | 美国 | 108 | 98,770.46  | 0.06 |
| 315 | Cincinnati<br>Financial<br>Corp               | - | CINF US | 纳斯达<br>克证<br>券交易<br>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 | AmerisourceBergens 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 and 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 | ABIOME D 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<br>Robinson<br>Worldwid<br>e Inc    | - | CHRW US | 纳斯达<br>克证<br>券交<br>易所 | 美国 | 127 | 73,644.88 | 0.05 |
| 383 | Atmos<br>Energy<br>Corp                | - | ATO US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 100 | 72,569.33 | 0.05 |
| 384 | Alliant<br>Energy<br>Corp              | - | LNT US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 215 | 72,543.21 | 0.05 |
| 385 | Masco<br>Corp                          | - | MAS US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 265 | 71,487.26 | 0.05 |
| 386 | Marathon<br>Oil Corp                   | - | MRO US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 729 | 71,215.64 | 0.05 |
| 387 | Regency<br>Centers<br>Corp             | - | REG US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 155 | 71,116.71 | 0.05 |
| 388 | Duke<br>Realty<br>Corp                 | - | DRE US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 327 | 71,060.13 | 0.05 |
| 389 | Devon<br>Energy<br>Corp                | - | DVN US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 362 | 70,976.05 | 0.05 |
| 390 | FMC<br>Corp                            | - | FMC US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 123 | 70,141.53 | 0.05 |
| 391 | CenturyLi<br>nk Inc                    | - | CTL US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 867 | 70,093.89 | 0.04 |
| 392 | Nasdaq<br>Inc                          | - | NDAQ US | 纳斯达<br>克证<br>券交<br>易所 | 美国 | 106 | 70,080.83 | 0.04 |
| 393 | Universal<br>Health<br>Services<br>Inc | - | UHS US  | 纽约证<br>券交<br>易所       | 美国 | 78  | 69,918.59 | 0.04 |
| 394 | Fortinet<br>Inc                        | - | FTNT US | 纳斯达<br>克证<br>券交<br>易所 | 美国 | 132 | 69,720.18 | 0.04 |
| 395 | Vornado<br>Realty<br>Trust             | - | VNO US  | 纽约证<br>券交<br>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<br>证券交易<br>所     | 美国 | 322 | 66,121.83 | 0.04 |
| 411 | Molson<br>Coors<br>Brewing<br>Co       | - | TAP US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 171 | 65,832.13 | 0.04 |
| 412 | Franklin<br>Resources<br>Inc           | - | BEN US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 275 | 65,790.88 | 0.04 |
| 413 | Raymond<br>James<br>Financial<br>Inc   | - | RJF US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 113 | 65,681.92 | 0.04 |
| 414 | NiSource<br>Inc                        | - | NI US   | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 331 | 65,535.14 | 0.04 |
| 415 | Everest<br>Re Group<br>Ltd             | - | RE US   | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 38  | 64,572.96 | 0.04 |
| 416 | Jack<br>Henry &<br>Associates<br>Inc   | - | JKHY US | 纳斯<br>达克证<br>券交易<br>所 | 美国 | 70  | 64,446.19 | 0.04 |
| 417 | CF<br>Industries<br>Holdings<br>Inc    | - | CF US   | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 199 | 63,902.33 | 0.04 |
| 418 | Tiffany &<br>Co                        | - | TIF US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 99  | 63,730.94 | 0.04 |
| 419 | Arconic<br>Inc                         | - | ARNC US | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 359 | 63,724.21 | 0.04 |
| 420 | Jacobs<br>Engineer<br>ing Group<br>Inc | - | JEC US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 109 | 63,237.00 | 0.04 |
| 421 | Avery<br>Dennison<br>Corp              | - | AVY US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 79  | 62,825.96 | 0.04 |
| 422 | Cabot Oil<br>& Gas<br>Corp             | - | COG US  | 纽约证<br>券交易<br>所       | 美国 | 393 | 62,032.34 | 0.04 |
| 423 | Mylan                                  | - | MYL US  | 纳斯<br>达克              | 美国 | 470 | 61,520.32 | 0.04 |

|     |   |   |         |                   |    |     |           |      |
|-----|---|---|---------|-------------------|----|-----|-----------|------|
|     | NV  |   |         | 克证券<br>交易所        |    |     |           |      |
| 424 | Garmin<br>Ltd                             | - | GRMN US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 112 | 61,443.32 | 0.04 |
| 425 | NRG<br>Energy<br>Inc                      | - | NRG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 253 | 61,084.18 | 0.04 |
| 426 | Federal<br>Realty<br>Investmen<br>t Trust | - | FRT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 68  | 60,192.67 | 0.04 |
| 427 | Mohawk<br>Industries<br>Inc               | - | MHK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 58  | 58,801.10 | 0.04 |
| 428 | Brown-Fo<br>rman<br>Corp                  | - | BF/B US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 154 | 58,683.95 | 0.04 |
| 429 | Torchmar<br>k Corp                        | - | TMK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 95  | 58,426.01 | 0.04 |
| 430 | Lamb<br>Weston<br>Holdings<br>Inc         | - | LW US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 134 | 58,367.85 | 0.04 |
| 431 | Snap-on<br>Inc                            | - | SNA US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 51  | 58,074.99 | 0.04 |
| 432 | WestRock<br>Co                            | - | WRK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 231 | 57,916.39 | 0.04 |
| 433 | Whirlpool<br>Corp                         | - | WHR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 59  | 57,742.26 | 0.04 |
| 434 | Juniper<br>Networks<br>Inc                | - | JNPR US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 315 | 57,668.08 | 0.04 |
| 435 | Packaging<br>Corp of<br>America           | - | PKG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 88  | 57,666.08 | 0.04 |
| 436 | Tapestry<br>Inc                           | - | TPR US  | 纽约证<br>券交易<br>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                           | - | XRX 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<br>所          |    |     |           |      |
| 477 | Nektar<br>Therapeut<br>ics  | - | NKTR US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 160 | 39,136.29 | 0.03 |
| 478 | Ralph<br>Lauren<br>Corp     | - | RL US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 50  | 39,044.86 | 0.03 |
| 479 | H&R<br>Block Inc            | - | HRB US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 190 | 38,271.45 | 0.02 |
| 480 | Perrigo<br>Co PLC           | - | PRGO US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 116 | 37,975.29 | 0.02 |
| 481 | L Brands<br>Inc             | - | LB US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 211 | 37,859.66 | 0.02 |
| 482 | Pentair<br>PLC              | - | PNR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 148 | 37,849.35 | 0.02 |
| 483 | Cimarex<br>Energy<br>Co     | - | XEC US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 92  | 37,524.59 | 0.02 |
| 484 | Harley-Da<br>vidson Inc     | - | HOG US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 151 | 37,194.40 | 0.02 |
| 485 | Newell<br>Brands<br>Inc     | - | NWL US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 350 | 37,102.76 | 0.02 |
| 486 | Quanta<br>Services<br>Inc   | - | PWR US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 135 | 35,443.55 | 0.02 |
| 487 | Helmerich<br>& Payne<br>Inc | - | HP US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 101 | 35,147.73 | 0.02 |
| 488 | Assurant<br>Inc             | - | AIZ US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 48  | 35,103.87 | 0.02 |
| 489 | IPG<br>Photonics<br>Corp    | - | IPGP US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 33  | 34,993.94 | 0.02 |
| 490 | Rollins<br>Inc              | - | ROL US  | 纽约证<br>券交易<br>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<br>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<br>(Hong Kong)<br>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<br>Limit<br>ed   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Gold<br>man<br>Sachs   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| State<br>Street<br>Secur<br>ities<br>Hong<br>Kong<br>Limit<br>ed               | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Ever<br>brigh<br>t<br>Secur<br>ities<br>(Inter<br>natio<br>nal)<br>Limit<br>ed | - | - | - | - | - | - | - | - |
| GF<br>Futur<br>es<br>(Hon<br>g<br>Kong<br>) Co.,<br>Limit<br>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