

**易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券
投资基金联接基金
2017 年半年度报告
2017 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：二〇一七年八月二十九日

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 2017 年 8 月 25 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 2017 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末投资目标基金明细	35
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	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股票投资明细	36
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46

7.11	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.13	投资组合报告附注	46
8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
9	开放式基金份额变动	48
10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	50
11	影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
12	备查文件目录	54
12.1	备查文件目录	54
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式联接
基金主代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 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	3,232,868,265.49 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金主代码	510310
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 25 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，本基金决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在正常市场情况下，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理

	人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	王洪章

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	16,648,238.45
本期利润	408,299,112.09
加权平均基金份额本期利润	0.1236
本期加权平均净值利润率	10.79%
本期基金份额净值增长率	11.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	721,203,520.38
期末可供分配基金份额利润	0.2231
期末基金资产净值	3,954,071,785.87
期末基金份额净值	1.2231
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	22.31%

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	5.24%	0.61%	4.73%	0.64%	0.51%	-0.03%
过去三个月	6.60%	0.57%	5.79%	0.59%	0.81%	-0.02%
过去六个月	11.27%	0.53%	10.23%	0.54%	1.04%	-0.01%
过去一年	18.90%	0.63%	15.44%	0.63%	3.46%	0.00%
过去三年	74.68%	1.63%	65.95%	1.66%	8.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	22.31%	1.42%	18.43%	1.48%	3.88%	-0.06%

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 8 月 26 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 22.31%，同期业绩比较基准收益率为 18.43%。

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，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连等分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持在“诚信规范”的前提下，通过“专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。2012 年 10 月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016 年 12 月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至 2017 年 6 月 30 日，易方达的总资产管理规模达到 11000 亿元，其中公募基金管理规模 4842 亿元。

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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2015 年 08 月 27 日至 2017 年 06 月 22 日）、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、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理（自 2013 年 03 月 06 日至 2017 年 06 月 22 日）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、量化基金组合部副总经理	2013-11-14	2017-06-23	9 年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。
余海	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	2016-04-16	-	12 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析

燕	数证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-06-23	-	8 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时

间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 16 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在产能出清、库存回补带动内需企稳，外需持续向好的背景下，2017 年上半年国内宏观经济增长延续了前期的回暖趋势，最新公布的宏观数据显示二季度 GDP 增速为 6.9%，上半年出口增速 8.5%，进口增速高达 18.9%，6 月份工业增速跳升至 7.6%，固定资产投资增速 6 月份同比回升至 8.8%。金融去杠杆主导了 2017 年以来央行的货币政策基调，叠加美联储加息和缩表的影响，宽松货币政策周期或已接近尾声，宏观流动性在二季度有所收紧。上半年人民币对美元汇率稳中有升扭转了去年四季度以来的走低趋势，半年末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均回落到 6.8 以下。资本市场方面，上证综指呈“N”型走势，最终以上涨 2.86% 收官。在风格方面，大小盘分化明显，上半年上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 11.50%、10.78%，而创业板综指、中证 500 指数分别下跌 10.12%、2.00%；行业方面，保险、家用电器、食品饮料、银行等板块涨幅居前，农林牧渔、纺织服装、传媒、商业贸易、国防军工等板块下跌。本基金是沪深 300ETF 的联接基金，作为被动型指数基金，报告期内本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深 300 指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2231 元，本报告期份额净值增长率为 11.27%，同期业绩比较基准收益率为 10.23%，日跟踪偏离度的均值为 0.01%，年化跟踪误差为 0.367%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，金融强监管下流动性收紧、房地产市场降温对经济增长的负面影响以及宏观政策与改革力图稳增长是影响未来 A 股市场最值得关注的因素。从经济增长的角度来看，考虑到房地产投资在去库存超预期的背景下依然稳健增长、制造业产能周期已经见底并逐步回升、出口也稳步回升，下半年经济增长无需过度担忧。从金融监管政策来看，全国金融工作会议在监管方面传递的信号表明未来金融去杠杆将更依赖监管规则升级而非持续紧缩流动性。如果当前经济增长的回暖趋势能够延续、货币政策适度并使物价水平不出现大的波动，同时各项改革措施稳步推进的背景下，考虑到目前 A 股市场的估值风险已经很大程度上释放，下半年 A 股市场的机会将大于风险。从长期来看改革与创新仍然值得期待，在就业与坏账压力之下，财政政策有望加码，而改革进程，包括国企、财税、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推进；通过供给侧改革、提高全要素生产率，将是中国长期可持续发展的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必太悲观。通过资本市场盘活存量，把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业并购、重组，改善上市公司业绩，A 股市场和产业发展的正反馈仍将重现。

目前以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于相对合理的位置，具有中长期投资价值。作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定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，公司常务副总裁担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察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，具备行业研究、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央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	86,238,126.25	70,166,344.00
结算备付金		58,709,732.28	58,602,355.83
存出保证金		54,317.63	74,817.33
交易性金融资产	6.4.7.2	3,811,689,340.80	3,561,093,991.05
其中：股票投资		99,885,762.38	84,993,728.22
基金投资		3,651,869,578.42	3,416,304,262.83
债券投资		59,934,000.00	59,796,000.00
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		218,204.47	3,752,398.16
应收利息	6.4.7.5	1,191,532.88	554,830.98
应收股利		-	-
应收申购款		1,495,863.67	1,799,535.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,959,597,117.98	3,696,044,272.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,942,374.85	1,620,086.32
应付管理人报酬		49,248.14	46,174.81
应付托管费		24,624.07	23,087.42
应付销售服务费		317,121.70	325,133.92
应付交易费用	6.4.7.7	14,577.68	45,759.29
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	177,385.67	342,459.86
负债合计		5,525,332.11	2,402,701.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,232,868,265.49	3,360,206,659.76
未分配利润	6.4.7.10	721,203,520.38	333,434,911.02

所有者权益合计		3,954,071,785.87	3,693,641,570.78
负债和所有者权益总计		3,959,597,117.98	3,696,044,272.40

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2231 元，基金份额总额 3,232,868,265.49 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		410,864,568.67	-605,233,336.26
1.利息收入		1,135,153.06	2,151,789.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	498,418.68	489,513.16
债券利息收入		636,734.38	1,662,275.95
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）		17,727,084.26	-11,153,693.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,748,632.96	1,115,400.57
基金投资收益	6.4.7.13	11,146,112.23	-4,097,284.58
债券投资收益	6.4.7.14	3,979.41	119,160.00
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	-	-8,714,070.00
股利收益	6.4.7.16	828,359.66	423,101.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	391,650,873.64	-596,900,107.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	351,457.71	668,674.71
减：二、费用		2,565,456.58	2,719,124.58
1. 管理人报酬		290,224.00	291,778.53
2. 托管费		145,112.02	145,889.21
3. 销售服务费		1,875,713.55	1,881,325.35
4. 交易费用	6.4.7.19	61,880.98	200,424.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	192,526.03	199,706.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		408,299,112.09	-607,952,460.84

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		408,299,112.09	-607,952,460.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	3,360,206,659.76	333,434,911.02	3,693,641,570.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	408,299,112.09	408,299,112.09
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）	-127,338,394.27	-20,530,502.73	-147,868,897.00
其中：1.基金申购款	294,179,868.93	43,796,970.32	337,976,839.25
2.基金赎回款	-421,518,263.20	-64,327,473.05	-485,845,736.25
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）	3,232,868,265.49	721,203,520.38	3,954,071,785.87
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	3,666,184,583.67	716,057,278.25	4,382,241,861.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-607,952,460.84	-607,952,460.84
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）	-25,358,681.45	-3,594,370.22	-28,953,051.67
其中：1.基金申购款	569,772,051.32	9,887,197.86	579,659,249.18
2.基金赎回款	-595,130,732.77	-13,481,568.08	-608,612,300.85
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）	3,640,825,902.22	104,510,447.19	3,745,336,349.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原名易方达沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]第 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,539,280.61 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会 2013 年 9 月 17 日下发的《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2013]812 号），易方达沪深 300 指数证券投资基金自 2013 年 9 月 17 日起变更为易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金，修改基金合同中基金名称、投资范围、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会等条款。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》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。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	86,238,126.25
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	86,238,126.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,895,297.08	99,885,762.38	9,990,465.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	59,971,200.00	59,934,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	59,971,200.00	59,934,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	3,205,785,523.57	3,651,869,578.42	446,084,054.85
其他	-	-	-
合计	3,355,652,020.65	3,811,689,340.80	456,037,320.15

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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,548.60
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	10,567.71
应收债券利息	1,164,394.52
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	22.05
合计	1,191,532.88

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	14,577.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,577.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,782.36
预提费用	168,603.31
合计	177,385.67

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,360,206,659.76	3,360,206,659.76
本期申购	294,179,868.93	294,179,868.93
本期赎回（以“-”号填列）	-421,518,263.20	-421,518,263.20
本期末	3,232,868,265.49	3,232,868,265.49

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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	1,011,502,905.33	-678,067,994.31	333,434,911.02
本期利润	16,648,238.45	391,650,873.64	408,299,112.09
本期基金份额交易产生的变动数	-38,613,779.56	18,083,276.83	-20,530,502.73
其中：基金申购款	89,238,672.15	-45,441,701.83	43,796,970.32
基金赎回款	-127,852,451.71	63,524,978.66	-64,327,473.05

本期已分配利润	-	-	-
本期末	989,537,364.22	-268,333,843.84	721,203,520.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	285,076.59
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	212,734.35
其他	607.74
合计	498,418.68

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	20,143,013.56
减：卖出股票成本总额	14,394,380.60
买卖股票差价收入	5,748,632.96

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	161,840,041.87
减：卖出/赎回基金成本总额	150,693,929.64
基金投资收益	11,146,112.23

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	118,990.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	115,000.00
减：应收利息总额	11.09
买卖债券差价收入	3,979.41

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	828,359.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	828,359.66

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	391,650,873.64
——股票投资	9,576,487.71
——债券投资	138,000.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	381,936,385.93
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	391,650,873.64

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	351,457.71
其他	-
合计	351,457.71

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	61,880.98
银行间市场交易费用	-
合计	61,880.98

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	5,322.72

银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	192,526.03

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、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
易方达海外投资(深圳)有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	290,224.00	291,778.53

其中：支付销售机构的客户维护费	425,641.72	420,474.66
-----------------	------------	------------

注：1.本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理人的管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2.客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的客户维护费

E 为前一日代销机构保有该基金份额的基金资产净值

R 为代销机构的客户维护费率

对于非工作日，则按照前一工作日的保有资产市值计算当日客户维护费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	145,112.02	145,889.21

注：本基金托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	1,031,836.98
中国建设银行	178,617.90
广发证券	6,260.11
合计	1,216,714.99
获得销售服务费的各	上年度可比期间

关联方名称	2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	1,040,486.03
中国建设银行	175,985.11
广发证券	10,937.11
合计	1,227,408.25

注：根据本基金基金合同的约定，“本基金销售服务费的年费率在 0 至 0.5% 的范围内，具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施”。目前，本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。其计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达海外投资 (深圳)有限公司	1,038,656.96	0.03%	1,038,656.96	0.03%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016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	86,238,126.25	285,076.59	83,412,450.14	243,098.41

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

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	600089	特变电工	配股发行	4,860	34,846.20
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,206	30,089.70
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	300518	盛讯达	新股网下发行	1,306	29,019.32
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	2,793	28,460.67

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 2,363,363,693 份和 2,471,463,693 份目标 ETF 基金

份额，占其总份额的比例分别为 97.01%和 93.06%。

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（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000100	TCL 集团	2017-04-21	重大事项停牌	3.43	2017-07-26	3.72	63,000	233,536.74	216,090.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项停牌	24.93	-	-	8,500	362,399.71	211,905.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项停牌	30.82	2017-07-17	27.74	4,400	144,192.00	135,608.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	10.25	-	-	6,100	54,113.00	62,525.00	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项停牌	20.34	-	-	11,620	250,994.24	236,350.80	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项停牌	7.68	-	-	20,400	186,284.00	156,672.00	-

300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	28.61	-	-	7,100	328,111.15	203,131.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项停牌	6.85	2017-08-21	8.22	81,400	431,876.96	557,590.00	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项停牌	14.12	-	-	17,100	245,445.28	241,452.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.59	-	-	12,000	209,062.00	175,080.00	-
600654	*ST 中安	2017-06-07	重大事项停牌	13.48	-	-	5,900	113,058.00	79,532.00	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项停牌	17.40	-	-	6,880	130,083.56	119,712.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项停牌	3.60	-	-	113,300	349,699.19	407,880.00	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项停牌	10.57	-	-	14,770	160,010.09	156,118.90	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项停牌	23.49	-	-	18,900	299,230.05	443,961.00	-
601608	中信重工	2017-04-19	重大事项停牌	5.54	2017-07-26	5.26	12,500	68,634.07	69,250.00	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项停牌	7.57	2017-07-03	7.54	29,700	214,992.47	224,829.00	-
601872	招商轮船	2017-05-02	重大事项停牌	5.16	-	-	20,300	104,932.57	104,748.00	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大事项停牌	5.35	2017-07-26	5.89	36,600	204,255.26	195,810.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项停牌	6.46	-	-	88,300	612,633.02	570,418.00	-

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 2017 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 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于沪深 300 E T F，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此本基金具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2017 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%(2016 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	61,098,394.52	60,323,671.23
合计	61,098,394.52	60,323,671.23

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、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 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 2017年6月30日	上年度末 2016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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，期末除 6.4.12 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	86,238,126.25	-	-	-	86,238,126.25
结算备付金	58,709,732.28	-	-	-	58,709,732.28
存出保证金	54,317.63	-	-	-	54,317.63
交易性金融资产	59,934,000.00	-	-	3,751,755,340.80	3,811,689,340.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	218,204.47	218,204.47
应收利息	-	-	-	1,191,532.88	1,191,532.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,495,863.67	1,495,863.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	204,936,176.16	-	-	3,754,660,941.82	3,959,597,117.98
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	-	-	-	4,942,374.85	4,942,374.85
应付管理人报酬	-	-	-	49,248.14	49,248.14
应付托管费	-	-	-	24,624.07	24,624.07
应付销售服务费	-	-	-	317,121.70	317,121.70
应付交易费用	-	-	-	14,577.68	14,577.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	177,385.67	177,385.67
负债总计	-	-	-	5,525,332.11	5,525,332.11
利率敏感度缺口	204,936,176.16	-	-	3,749,135,609.71	3,954,071,785.87
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	70,166,344.00	-	-	-	70,166,344.00
结算备付金	58,602,355.83	-	-	-	58,602,355.83
存出保证金	74,817.33	-	-	-	74,817.33
交易性金融资产	59,796,000.00	-	-	3,501,297,991.05	3,561,093,991.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,752,398.16	3,752,398.16
应收利息	-	-	-	554,830.98	554,830.98
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	1,799,535.05	1,799,535.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	188,639,517.16	-	-	3,507,404,755.24	3,696,044,272.40
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,620,086.32	1,620,086.32
应付管理人报酬	-	-	-	46,174.81	46,174.81
应付托管费	-	-	-	23,087.42	23,087.42
应付销售服务费	-	-	-	325,133.92	325,133.92
应付交易费用	-	-	-	45,759.29	45,759.29
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	342,459.86	342,459.86
负债总计	-	-	-	2,402,701.62	2,402,701.62
利率敏感度缺口	188,639,517.16	-	-	3,505,002,053.62	3,693,641,570.78

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	1.市场利率下降 25 个基点	14,331.87	87,327.47
	2.市场利率上升 25 个基点	-14,325.02	-87,073.14

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	99,885,762.38	2.53	84,993,728.22	2.30
交易性金融资产—基金投资	3,651,869,578.42	92.36	3,416,304,262.83	92.49
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	3,751,755,340.80	94.88	3,501,297,991.05	94.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	180,996,209.02	158,574,101.42
2.业绩比较基准下降 5%	-180,996,209.02	-158,574,101.42	

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 2017 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 3,747,186,678.10 元，属于第二层次的余额为 64,502,662.70 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 3,499,222,699.04 元，第二层次 61,871,292.01 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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(2016 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	99,885,762.38	2.52
	其中：股票	99,885,762.38	2.52
2	基金投资	3,651,869,578.42	92.23
3	固定收益投资	59,934,000.00	1.51
	其中：债券	59,934,000.00	1.51

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	144,947,858.53	3.66
8	其他各项资产	2,959,918.65	0.07
9	合计	3,959,597,117.98	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)、发起式	易方达基金管理有限公司	3,651,869,578.42	92.36

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	236,912.00	0.01
B	采矿业	3,100,538.12	0.08
C	制造业	36,259,875.83	0.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,686,742.00	0.07
E	建筑业	4,574,871.94	0.12
F	批发和零售业	2,132,670.05	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,886,896.00	0.07

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,002,110.89	0.13
J	金融业	33,950,985.76	0.86
K	房地产业	5,628,104.40	0.14
L	租赁和商务服务业	863,827.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	817,446.20	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	195,500.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,138,104.64	0.03
S	综合	411,177.55	0.01
	合计	99,885,762.38	2.53

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
1	601318	中国平安	102,700	5,094,947.00	0.13
2	600036	招商银行	106,300	2,541,633.00	0.06
3	600519	贵州茅台	4,800	2,264,880.00	0.06
4	601166	兴业银行	118,200	1,992,852.00	0.05
5	000002	万科A	79,100	1,975,127.00	0.05
6	000651	格力电器	45,600	1,877,352.00	0.05
7	000333	美的集团	42,900	1,846,416.00	0.05
8	600016	民生银行	224,100	1,842,102.00	0.05
9	601328	交通银行	260,500	1,604,680.00	0.04
10	600030	中信证券	81,800	1,392,236.00	0.04
11	601668	中国建筑	142,200	1,376,496.00	0.03
12	600000	浦发银行	106,569	1,348,097.85	0.03
13	601288	农业银行	362,400	1,275,648.00	0.03
14	601398	工商银行	242,500	1,273,125.00	0.03
15	600837	海通证券	84,631	1,256,770.35	0.03
16	600887	伊利股份	57,600	1,243,584.00	0.03
17	002415	海康威视	34,950	1,128,885.00	0.03
18	601169	北京银行	115,380	1,058,034.60	0.03
19	600104	上汽集团	33,200	1,030,860.00	0.03

20	601601	中国太保	29,800	1,009,326.00	0.03
21	000858	五粮液	18,000	1,001,880.00	0.03
22	600900	长江电力	62,600	962,788.00	0.02
23	000725	京东方 A	225,300	937,248.00	0.02
24	601766	中国中车	92,300	934,076.00	0.02
25	601211	国泰君安	42,800	877,828.00	0.02
26	002456	欧菲光	45,000	817,650.00	0.02
27	600276	恒瑞医药	16,000	809,440.00	0.02
28	000001	平安银行	81,400	764,346.00	0.02
29	601988	中国银行	199,800	739,260.00	0.02
30	601688	华泰证券	37,700	674,830.00	0.02
31	600048	保利地产	67,500	672,975.00	0.02
32	601390	中国中铁	70,700	612,969.00	0.02
33	601818	光大银行	151,000	611,550.00	0.02
34	600518	康美药业	28,100	610,894.00	0.02
35	600028	中国石化	99,700	591,221.00	0.01
36	601989	中国重工	88,300	570,418.00	0.01
37	600019	宝钢股份	83,820	562,432.20	0.01
38	600015	华夏银行	60,840	560,944.80	0.01
39	600050	中国联通	81,400	557,590.00	0.01
40	000063	中兴通讯	22,600	536,524.00	0.01
41	002450	康得新	23,394	526,832.88	0.01
42	601186	中国铁建	43,600	524,508.00	0.01
43	002304	洋河股份	5,700	494,817.00	0.01
44	600999	招商证券	28,700	494,214.00	0.01
45	001979	招商蛇口	22,500	480,600.00	0.01
46	601006	大秦铁路	56,400	473,196.00	0.01
47	000538	云南白药	4,900	459,865.00	0.01
48	600703	三安光电	23,160	456,252.00	0.01
49	601088	中国神华	18,900	443,961.00	0.01
50	600690	青岛海尔	28,900	434,945.00	0.01
51	600585	海螺水泥	19,000	431,870.00	0.01
52	601628	中国人寿	15,800	426,284.00	0.01
53	600958	东方证券	29,500	410,345.00	0.01
54	600795	国电电力	113,300	407,880.00	0.01
55	601336	新华保险	7,900	406,060.00	0.01
56	002024	苏宁云商	35,300	397,125.00	0.01
57	601901	方正证券	39,000	387,270.00	0.01
58	601009	南京银行	34,460	386,296.60	0.01
59	600340	华夏幸福	11,200	376,096.00	0.01
60	600309	万华化学	12,980	371,747.20	0.01
61	002230	科大讯飞	9,200	367,080.00	0.01
62	600089	特变电工	35,460	366,301.80	0.01
63	600741	华域汽车	14,900	361,176.00	0.01

64	601899	紫金矿业	104,900	359,807.00	0.01
65	000423	东阿阿胶	5,000	359,450.00	0.01
66	002142	宁波银行	18,500	357,050.00	0.01
67	601857	中国石油	46,100	354,509.00	0.01
68	600660	福耀玻璃	13,300	346,332.00	0.01
69	601985	中国核电	44,300	345,983.00	0.01
70	601669	中国电建	43,500	344,520.00	0.01
71	600009	上海机场	9,100	339,521.00	0.01
72	002241	歌尔股份	17,400	335,472.00	0.01
73	000568	泸州老窖	6,600	333,828.00	0.01
74	300070	碧水源	17,828	332,492.20	0.01
75	601377	兴业证券	44,400	329,892.00	0.01
76	000166	申万宏源	57,060	319,536.00	0.01
77	300072	三聚环保	8,550	316,777.50	0.01
78	601607	上海医药	10,900	314,792.00	0.01
79	000069	华侨城 A	31,100	312,866.00	0.01
80	002236	大华股份	13,700	312,497.00	0.01
81	002466	天齐锂业	5,700	309,795.00	0.01
82	002736	国信证券	23,300	308,725.00	0.01
83	600886	国投电力	38,600	304,940.00	0.01
84	000338	潍柴动力	23,000	303,600.00	0.01
85	000783	长江证券	31,500	298,305.00	0.01
86	600031	三一重工	36,300	295,119.00	0.01
87	600068	葛洲坝	26,200	294,488.00	0.01
88	600196	复星医药	9,500	294,405.00	0.01
89	300059	东方财富	24,432	293,672.64	0.01
90	600029	南方航空	33,300	289,710.00	0.01
91	600010	包钢股份	129,620	283,867.80	0.01
92	601600	中国铝业	62,300	281,596.00	0.01
93	002008	大族激光	8,100	280,584.00	0.01
94	601888	中国国旅	9,200	277,288.00	0.01
95	601788	光大证券	18,500	276,205.00	0.01
96	600066	宇通客车	12,500	274,625.00	0.01
97	600637	东方明珠	12,600	273,042.00	0.01
98	600606	绿地控股	34,600	270,572.00	0.01
99	000625	长安汽车	18,500	266,770.00	0.01
100	000839	中信国安	26,000	259,740.00	0.01
101	002594	比亚迪	5,200	259,740.00	0.01
102	601099	太平洋	64,600	259,692.00	0.01
103	601933	永辉超市	36,300	257,004.00	0.01
104	601555	东吴证券	22,800	256,044.00	0.01
105	601618	中国中冶	50,800	254,508.00	0.01
106	600535	天士力	6,100	253,394.00	0.01
107	600893	航发动力	9,200	251,160.00	0.01

108	000413	东旭光电	22,200	249,084.00	0.01
109	600383	金地集团	21,400	245,458.00	0.01
110	600522	中天科技	20,300	244,615.00	0.01
111	600406	国电南瑞	13,800	243,570.00	0.01
112	300124	汇川技术	9,499	242,604.46	0.01
113	000768	中航飞机	13,100	241,564.00	0.01
114	600100	同方股份	17,100	241,452.00	0.01
115	600705	中航资本	42,600	240,690.00	0.01
116	002673	西部证券	16,638	236,592.36	0.01
117	002252	上海莱士	11,620	236,350.80	0.01
118	600109	国金证券	20,100	235,572.00	0.01
119	002475	立讯精密	8,050	235,382.00	0.01
120	600816	安信信托	17,320	235,378.80	0.01
121	600111	北方稀土	20,700	234,531.00	0.01
122	601800	中国交建	14,500	230,405.00	0.01
123	002739	万达电影	4,500	229,365.00	0.01
124	002202	金风科技	14,800	228,956.00	0.01
125	000963	华东医药	4,600	228,620.00	0.01
126	601727	上海电气	29,700	224,829.00	0.01
127	000895	双汇发展	9,400	223,250.00	0.01
128	600271	航天信息	10,600	218,784.00	0.01
129	000100	TCL 集团	63,000	216,090.00	0.01
130	600570	恒生电子	4,600	214,728.00	0.01
131	000503	海虹控股	8,500	211,905.00	0.01
132	601018	宁波港	37,500	211,875.00	0.01
133	600023	浙能电力	38,700	211,302.00	0.01
134	600739	辽宁成大	11,600	209,148.00	0.01
135	600177	雅戈尔	20,420	206,650.40	0.01
136	600352	浙江龙盛	21,600	205,848.00	0.01
137	000728	国元证券	16,800	205,296.00	0.01
138	600674	川投能源	20,900	205,238.00	0.01
139	601992	金隅股份	31,600	204,452.00	0.01
140	300104	乐视网	7,100	203,131.00	0.01
141	600547	山东黄金	7,000	202,510.00	0.01
142	000623	吉林敖东	8,840	202,347.60	0.01
143	300024	机器人	10,360	202,020.00	0.01
144	601225	陕西煤业	28,400	200,788.00	0.01
145	600221	海航控股	62,300	200,606.00	0.01
146	600018	上港集团	31,100	197,174.00	0.00
147	601919	中远海控	36,600	195,810.00	0.00
148	002508	老板电器	4,500	195,660.00	0.00
149	002044	美年健康	11,500	195,500.00	0.00
150	002007	华兰生物	5,320	194,180.00	0.00
151	002065	东华软件	8,900	193,931.00	0.00

152	000793	华闻传媒	19,100	193,292.00	0.00
153	600804	鹏博士	10,700	189,925.00	0.00
154	600115	东方航空	27,900	189,720.00	0.00
155	300315	掌趣科技	23,200	189,312.00	0.00
156	600415	小商品城	25,800	186,792.00	0.00
157	000157	中联重科	41,600	186,784.00	0.00
158	603993	洛阳钼业	36,800	186,208.00	0.00
159	000540	中天金融	26,700	185,565.00	0.00
160	601111	中国国航	18,900	184,275.00	0.00
161	600208	新湖中宝	40,800	183,600.00	0.00
162	601998	中信银行	29,100	183,039.00	0.00
163	600085	同仁堂	5,200	181,792.00	0.00
164	600820	隧道股份	17,900	180,790.00	0.00
165	601198	东兴证券	10,400	179,296.00	0.00
166	600436	片仔癀	2,900	177,016.00	0.00
167	600485	信威集团	12,000	175,080.00	0.00
168	002465	海格通信	16,300	175,062.00	0.00
169	600153	建发股份	13,400	173,262.00	0.00
170	000826	启迪桑德	4,900	172,088.00	0.00
171	002310	东方园林	10,200	170,544.00	0.00
172	000630	铜陵有色	59,900	170,116.00	0.00
173	000709	河钢股份	40,300	168,857.00	0.00
174	600157	永泰能源	47,100	168,147.00	0.00
175	600362	江西铜业	9,800	165,228.00	0.00
176	300017	网宿科技	13,675	165,057.25	0.00
177	000009	中国宝安	20,395	164,995.55	0.00
178	002081	金螳螂	15,000	164,700.00	0.00
179	000060	中金岭南	14,700	164,640.00	0.00
180	600489	中金黄金	16,404	164,532.12	0.00
181	000876	新希望	20,000	164,400.00	0.00
182	600663	陆家嘴	6,940	164,061.60	0.00
183	600061	国投安信	10,500	163,275.00	0.00
184	002146	荣盛发展	16,500	162,855.00	0.00
185	600170	上海建工	42,217	161,268.94	0.00
186	601229	上海银行	6,300	160,902.00	0.00
187	002027	分众传媒	11,600	159,616.00	0.00
188	601155	新城控股	8,600	159,444.00	0.00
189	002426	胜利精密	20,400	156,672.00	0.00
190	601216	君正集团	32,000	156,480.00	0.00
191	600959	江苏有线	14,770	156,118.90	0.00
192	600118	中国卫星	5,600	155,904.00	0.00
193	600682	南京新百	4,200	154,980.00	0.00
194	002074	国轩高科	4,900	154,595.00	0.00
195	002500	山西证券	16,100	154,238.00	0.00

196	000750	国海证券	28,000	154,000.00	0.00
197	600332	白云山	5,300	153,912.00	0.00
198	600297	广汇汽车	20,370	153,386.10	0.00
199	601633	长城汽车	11,400	151,506.00	0.00
200	600008	首创股份	22,900	150,682.00	0.00
201	600369	西南证券	26,800	150,348.00	0.00
202	000425	徐工机械	39,900	149,625.00	0.00
203	600150	中国船舶	6,500	148,655.00	0.00
204	601333	广深铁路	32,200	145,544.00	0.00
205	300144	宋城演艺	6,900	144,003.00	0.00
206	000559	万向钱潮	13,100	139,122.00	0.00
207	000792	盐湖股份	13,200	137,940.00	0.00
208	600688	上海石化	20,800	137,488.00	0.00
209	002049	紫光国芯	4,400	135,608.00	0.00
210	000686	东北证券	13,300	133,665.00	0.00
211	002195	二三四五	18,670	133,490.50	0.00
212	000402	金融街	11,300	132,436.00	0.00
213	600583	海油工程	21,000	131,040.00	0.00
214	601117	中国化学	18,700	130,713.00	0.00
215	000983	西山煤电	14,900	130,673.00	0.00
216	600718	东软集团	8,300	129,065.00	0.00
217	300027	华谊兄弟	15,796	127,789.64	0.00
218	002411	必康股份	4,400	127,248.00	0.00
219	600498	烽火通信	5,000	126,750.00	0.00
220	600649	城投控股	12,040	126,540.40	0.00
221	600827	百联股份	7,700	125,125.00	0.00
222	300033	同花顺	2,000	124,420.00	0.00
223	600895	张江高科	7,300	123,224.00	0.00
224	600256	广汇能源	29,700	122,958.00	0.00
225	600373	中文传媒	5,200	122,252.00	0.00
226	000917	电广传媒	10,800	122,040.00	0.00
227	002385	大北农	19,400	122,026.00	0.00
228	002183	怡亚通	14,100	121,683.00	0.00
229	600588	用友网络	7,000	119,840.00	0.00
230	600666	奥瑞德	6,880	119,712.00	0.00
231	600704	物产中大	16,355	119,227.95	0.00
232	000415	渤海金控	17,600	118,448.00	0.00
233	600074	保千里	9,200	117,852.00	0.00
234	000008	神州高铁	16,000	116,480.00	0.00
235	600060	海信电器	7,400	112,258.00	0.00
236	002470	金正大	14,900	112,197.00	0.00
237	600376	首开股份	9,800	112,112.00	0.00
238	600919	江苏银行	12,000	111,480.00	0.00
239	601718	际华集团	12,500	109,875.00	0.00

240	601866	中远海发	30,100	108,360.00	0.00
241	002352	顺丰控股	2,000	106,320.00	0.00
242	002558	巨人网络	2,280	105,381.60	0.00
243	002602	世纪华通	2,900	105,154.00	0.00
244	000959	首钢股份	15,000	104,850.00	0.00
245	002174	游族网络	3,300	104,808.00	0.00
246	601872	招商轮船	20,300	104,748.00	0.00
247	600909	华安证券	10,300	103,927.00	0.00
248	601997	贵阳银行	6,500	102,765.00	0.00
249	002555	三七互娱	4,000	102,280.00	0.00
250	600038	中直股份	2,200	100,694.00	0.00
251	600977	中国电影	5,300	99,216.00	0.00
252	000977	浪潮信息	5,700	98,724.00	0.00
253	600021	上海电力	8,100	97,929.00	0.00
254	000627	天茂集团	12,100	97,768.00	0.00
255	600037	歌华有线	6,600	96,096.00	0.00
256	002152	广电运通	11,550	95,980.50	0.00
257	600737	中粮糖业	9,700	91,568.00	0.00
258	002714	牧原股份	3,300	89,826.00	0.00
259	000671	阳光城	15,400	89,628.00	0.00
260	600549	厦门钨业	4,100	88,109.00	0.00
261	002131	利欧股份	26,600	87,514.00	0.00
262	600372	中航电子	5,000	86,850.00	0.00
263	000938	紫光股份	1,400	85,568.00	0.00
264	600685	中船防务	3,100	84,878.00	0.00
265	601118	海南橡胶	14,900	84,632.00	0.00
266	002292	奥飞娱乐	5,000	84,500.00	0.00
267	000718	苏宁环球	14,400	84,384.00	0.00
268	000738	航发控制	4,300	84,151.00	0.00
269	600482	中国动力	3,300	83,457.00	0.00
270	300168	万达信息	5,700	82,935.00	0.00
271	600446	金证股份	4,700	82,626.00	0.00
272	000156	华数传媒	5,400	80,514.00	0.00
273	601877	正泰电器	4,000	80,360.00	0.00
274	600654	*ST 中安	5,900	79,532.00	0.00
275	601021	春秋航空	2,300	77,349.00	0.00
276	601375	中原证券	7,600	76,456.00	0.00
277	002424	贵州百灵	4,000	75,440.00	0.00
278	300133	华策影视	6,580	73,696.00	0.00
279	601881	中国银河	6,100	72,346.00	0.00
280	601608	中信重工	12,500	69,250.00	0.00
281	000961	中南建设	10,600	69,112.00	0.00
282	002153	石基信息	3,000	68,190.00	0.00
283	300251	光线传媒	8,300	67,977.00	0.00

284	601958	金钼股份	9,200	65,964.00	0.00
285	600233	圆通速递	3,200	62,688.00	0.00
286	002129	中环股份	6,100	62,525.00	0.00
287	002299	圣农发展	4,200	62,454.00	0.00
288	601163	三角轮胎	2,300	60,490.00	0.00
289	601611	中国核建	5,000	59,850.00	0.00
290	600871	石化油服	17,100	57,114.00	0.00
291	600926	杭州银行	3,800	56,430.00	0.00
292	601966	玲珑轮胎	2,300	51,589.00	0.00
293	603160	汇顶科技	500	50,150.00	0.00
294	603858	步长制药	700	50,148.00	0.00
295	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
296	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
297	000555	神州信息	2,700	45,090.00	0.00
298	600188	兖州煤业	3,600	44,064.00	0.00
299	601127	小康股份	1,700	33,915.00	0.00
300	002797	第一创业	3,640	33,524.40	0.00
301	002831	裕同科技	400	30,000.00	0.00
302	002839	张家港行	1,900	29,868.00	0.00
303	002841	视源股份	400	29,688.00	0.00
304	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
305	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
306	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
307	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
308	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
309	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
310	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
311	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	687,051.00	0.02
2	601881	中国银河	409,320.01	0.01
3	601166	兴业银行	392,003.00	0.01
4	600016	民生银行	380,249.00	0.01
5	002456	欧菲光	377,508.00	0.01
6	600036	招商银行	359,744.00	0.01

7	600519	贵州茅台	352,528.00	0.01
8	600019	宝钢股份	311,598.00	0.01
9	601328	交通银行	286,700.00	0.01
10	600000	浦发银行	253,047.00	0.01
11	000538	云南白药	246,014.22	0.01
12	600837	海通证券	245,970.00	0.01
13	600030	中信证券	243,712.00	0.01
14	600522	中天科技	236,292.00	0.01
15	601668	中国建筑	232,231.00	0.01
16	601992	金隅股份	215,512.00	0.01
17	601169	北京银行	214,549.00	0.01
18	601288	农业银行	213,829.00	0.01
19	601766	中国中车	204,682.00	0.01
20	002508	老板电器	202,422.50	0.01

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

7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601881	中国银河	591,151.29	0.02
2	601212	白银有色	581,087.10	0.02
3	000333	美的集团	425,825.00	0.01
4	000651	格力电器	418,069.20	0.01
5	601228	广州港	347,540.16	0.01
6	603833	欧派家居	284,152.20	0.01
7	603986	兆易创新	267,922.88	0.01
8	601375	中原证券	240,068.37	0.01
9	000858	五粮液	236,668.25	0.01
10	601166	兴业银行	230,871.00	0.01
11	000725	京东方 A	227,648.00	0.01
12	600867	通化东宝	198,991.48	0.01
13	601952	苏垦农发	198,596.25	0.01
14	002085	万丰奥威	195,529.80	0.01
15	000001	平安银行	192,608.00	0.01
16	601878	浙商证券	184,629.40	0.00
17	000778	新兴铸管	182,615.70	0.00
18	601318	中国平安	181,460.00	0.00
19	600005	武钢股份	178,976.00	0.00
20	601366	利群股份	167,160.00	0.00

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

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,709,927.05
卖出股票收入（成交）总额	20,143,013.56

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

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,934,000.00	1.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,934,000.00	1.52

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019546	16 国债 18	600,000	59,934,000.00	1.52

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 2016 年 10 月 8 日，中国人民银行营业管理部对民生银行违反《征信业管理条例》相关规定处以人民币 40 万元的行政处罚。

2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对民生银行批量转让个人贷款、安排回购条件以及未按规定进行信息披露；违规转让非不良贷款，处以人民币 70 万元的行政处罚。

2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对招商银行批量转让个人贷款，处以人民币 50 万元的行政处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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。除民生银行、招商银行外，本基金的目标 ETF 以及本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,317.63
2	应收证券清算款	218,204.47
3	应收股利	-
4	应收利息	1,191,532.88
5	应收申购款	1,495,863.67

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,959,918.65

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
132,806	24,342.79	1,210,492,622.74	37.44%	2,022,375,642.75	62.56%

8.2 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	123,150.48	0.0038%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 8 月 26 日）基金份额总额	16,746,252,366.35
本报告期期初基金份额总额	3,360,206,659.76
本报告期基金总申购份额	294,179,868.93
减：本报告期基金总赎回份额	421,518,263.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,232,868,265.49

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

本基金管理人于 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	329,965.43	0.90%	307.32	0.98%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	2,486,169.88	6.79%	1,988.94	6.36%	-
天风证券	1	6,137,235.19	16.75%	4,909.75	15.71%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	1,951,849.15	5.33%	1,817.75	5.82%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	3,555,813.60	9.71%	2,844.65	9.10%	-
方正证券	2	9,650,091.74	26.34%	7,720.01	24.70%	-

广州证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	12,524,440.35	34.19%	11,664.11	37.32%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增长江证券股份有限公司一个交易单元。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-	3,485,176.22	2.10%
国信证券	-	-	-	-	-	-	28,191,469.81	16.97%
天风证券	-	-	-	-	-	-	34,727,413.40	20.90%
安信证券	118,990.50	100.00%	-	-	-	-	45,631,289.65	27.46%
海通证券	-	-	-	-	-	-	23,067,059.10	13.88%
长城证券	-	-	-	-	-	-	31,060,492.99	18.69%

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基金申购海利尔药业集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-06
2	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-13
3	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购浙江正裕工业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-20
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江山欧派门业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-03
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-09
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加龙江银行网上银行、手机银行申购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	2017-02-16
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资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	2017-02-23
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加肯特瑞为销售机构、参加肯特瑞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	2017-03-02
9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购拉芳家化股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-04
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加龙江银行申购及定期定额投资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	2017-03-10
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
12	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-11
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广东南粤银行为销售机构、参加广东南粤银行申购与定期定额投资费率优惠	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-15

	活动的公告		
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加朝阳永续为销售机构、参加朝阳永续申购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	2017-03-15
15	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信期货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	2017-03-20
16	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信证券（山东）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	2017-03-20
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华龙证券定期定额投资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	2017-03-22
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宜信普泽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	2017-03-22
19	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏美思德化学股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-24
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加济安财富费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-27
21	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林证券为销售机构、参加华林证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-30
22	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国工商银行个人电子银行申购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	2017-03-30
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泛华普益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	2017-04-05
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购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	2017-04-10
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构、参加瑞安农商银行申购与定期定额投资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	2017-04-13
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加民生证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19
27	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19

28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资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	2017-04-22
29	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-25
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳新兰德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	2017-05-02
31	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证金牛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	2017-05-05
32	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-09
33	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-11
34	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-12
35	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通证券申购及定期定额投资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	2017-05-15
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加川财证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
37	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南京华脉科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-25
38	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行申购及定期定额投资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	2017-06-12
39	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-12
40	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-17
41	易方达基金管理有限公司关于在中银国际证券开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加中银国际证券定期定额投资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	2017-06-19
42	易方达基金管理有限公司关于陆金所官方旗	中国证券报、上海证券	2017-06-19

	舰店关闭服务的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
43	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-20
44	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州酒家集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-21
45	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
46	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
47	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商银行申购与定期定额投资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	2017-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年01月01日~2017年06月30日	1,206,158,344.25	-	-	1,206,158,344.25	37.31%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金托管协议》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日