

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF)

2018 年半年度报告

2018 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十八日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 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	9
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4	报表附注	15
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	53
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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
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
7.11	投资组合报告附注
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
8.2	期末上市基金前十名持有人
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
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
9	开放式基金份额变动
10	重大事件揭示
10.1	基金份额持有人大会决议
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
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
10.4	基金投资策略的改变
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况
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
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.8	其他重大事件
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
12	备查文件目录
12.1	备查文件目录
12.2	存放地点
12.3	查阅方式

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）
基金简称	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）
场内简称	香港小盘
基金主代码	161124
交易代码	161124
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,409,416.73 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 11 月 10 日

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	易方达恒生综合小型股指数基金（香港小盘 LOF）属于被动跟踪指数的证券投资基金。本基金主要采取完全复制指数的投资方案，剔除基金管理人认定不合适投资的成份股后，完全复制剩余成份股的指数权重进行投资。报告期内，跟随指数的成份股变化进行日常调整操作，控制基金组合与指数权重基本一致。
业绩比较基准	恒生综合小型股指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资香港证券市场，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	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	张燕
	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-85104666	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-42891（集中办公 区）	深圳市深南大道7088号招商 银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商 银行大厦
邮政编码		510620	518040
法定代表人		刘晓艳	李建红

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	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	无	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		无	香港皇后大道中一号
办公地址		无	香港九龙深旺道 1 号汇丰中心 1 座 6 楼
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	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

2.6 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

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（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	15,069,842.09
本期利润	4,764,014.96
加权平均基金份额本期利润	0.0487
本期加权平均净值利润率	4.26%
本期基金份额净值增长率	6.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	7,479,646.17
期末可供分配基金份额利润	0.1647
期末基金资产净值	52,889,062.90
期末基金份额净值	1.1647
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.47%

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	-4.36%	1.56%	-5.28%	1.44%	0.92%	0.12%
过去三个月	4.61%	1.28%	0.41%	1.18%	4.20%	0.10%
过去六个月	6.16%	1.33%	2.32%	1.30%	3.84%	0.03%
过去一年	11.66%	1.11%	9.68%	1.09%	1.98%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.47%	0.98%	12.50%	0.97%	3.97%	0.01%

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

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（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 11 月 2 日至 2018 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 16.47%，同期业绩比较基准收益率为 12.50%。

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、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。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资、

另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至 2018 年 6 月 30 日，易方达旗下管理的各类资产规模总计 1.3 万亿元，服务各类客户总数 7580 万户，公募基金累计分红超过 1000 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		
张胜记	本基金的基金经理、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、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达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、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达 50 指数证券投资基金的基金经理、指数及增强投资部副总经理	2016-11-02	-	13 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、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、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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 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

本基金跟踪的恒生综合小型股指数成分股多数为在香港上市交易的内地公司，企业盈利增速的变化跟随国内经济周期的趋势。2018 年上半年，国内经济保持平稳运行。防范化解重大风险、重点防控金融风险成为今年政府三大工作任务之一。《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》正式发布，去杠杆进入攻坚阶段，社会流动性环境不断收紧，中美贸易冲突形势日益严峻。上半年我国国内生产总值 GDP 同比增长 6.8%，规模以上工业增加值同比增长 6.7%，稳中略有回落。全国固定资产投资同比增长 6.0%，房地产开发投资同比增长 9.7%，房地产销售增速回落，全国住宅累计销售面积同比增长 3.3%。通胀稳定，6 月份居民消费价格指数（CPI）同比上涨 1.9%，我国货币政策继续稳中偏紧，央行连续两次降低存款准备金率共 1.5 个百分点，6 月末广义货币供应量 M2 同比增长 8.0%，略有回落。海外方面，美联储连续两次加息共 0.50%，美国联邦基金利率达到 1.75%~2.00% 的区间，美国股市高位震荡。报告期内，人民币兑港币先升后贬，港股通资金南下香港的趋势扭转，香港股市震荡下跌，恒生综合小型股指数上涨 1.5%（港币）。

易方达恒生综合小型股指数基金（香港小盘 LOF）属于被动跟踪指数的证券投资基金。报告期内，除基金管理人认为不适合投资的成份股外，本基金跟随指数的成份股变化进行日常调整操作，控制基金组合与指数权重基本一致。

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 1.1647 元，本报告期份额净值增长率为 6.16%，同期业绩比较基准收益率为 2.32%，年化跟踪误差 3.47%，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

恒生综合小型股指数的成分股大部分为内地公司，上市公司的基本面变化取决于国内经济的增长前景，但市场交易主体包括欧美等海外资金，流动性受欧美等发达经济体的直接影响很大。展望 2018 年下半年，中国经济稳中向好的大趋势不变，规模以上工业企业的盈利增长仍将较好，港股长期向上的基本面基础稳固。另一方面，美联储持续加息的风险加大，外汇市场波动加剧，需要密切关注流动性的变化前景，预计香港恒生综合小型股指数的短期仍将处于震荡筑底阶段。

长期来看，我国经济仍处于制度改革红利的释放期，仍处于快速的工业化、城镇化以及区域经济一体化进程中，中长期经济增长前景良好，本基金对恒生综合小型股指数的长期表现保持乐观。作为被动投资基金，下阶段本基金将继续采取紧密跟踪比较基准的投资策略，审慎管理基金资产，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，期望为投资者分享香港小盘股的未来成长提供良好的投资工具。

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、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，由中央国债登记结算有限责任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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	50,147,332.29	10,322,225.16
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	49,414,322.05	145,052,035.53
其中：股票投资		49,414,322.05	145,052,035.53
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	-	16,918.82
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,040,696.07	-
应收利息	6.4.7.5	2,355.31	233.18
应收股利		730,819.94	117,035.75
应收申购款		135,772.86	9,511.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		101,471,298.52	155,517,960.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		47,867,829.63	465,466.34
应付管理人报酬		65,346.49	105,940.40
应付托管费		20,420.79	33,106.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	805.32
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	628,638.71	555,497.53
负债合计		48,582,235.62	1,160,815.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	45,409,416.73	140,693,467.96
未分配利润	6.4.7.10	7,479,646.17	13,663,676.15
所有者权益合计		52,889,062.90	154,357,144.11
负债和所有者权益总计		101,471,298.52	155,517,960.07

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1647 元，基金份额总额 45,409,416.73 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入		5,872,024.46	34,631,368.92
1.利息收入		11,688.85	49,303.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,688.85	49,303.49
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）		15,636,631.11	15,195,351.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,914,013.43	9,984,220.13
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
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	33,406.74	16,475.81
股利收益	6.4.7.16	1,689,210.94	5,194,655.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,305,827.13	19,691,439.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		401,529.67	-668,881.68
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	128,001.96	364,156.61
减：二、费用		1,108,009.50	3,095,281.39
1. 管理人报酬		444,156.09	1,628,765.76
2. 托管费		138,798.81	508,989.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	252,639.87	603,180.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		126.24	-
7. 其他费用	6.4.7.20	272,288.49	354,345.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,764,014.96	31,536,087.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,764,014.96	31,536,087.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	140,693,467.96	13,663,676.15	154,357,144.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,764,014.96	4,764,014.96
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）	-95,284,051.23	-10,948,044.94	-106,232,096.17
其中：1.基金申购款	13,346,990.30	1,992,174.11	15,339,164.41
2.基金赎回款	-108,631,041.53	-12,940,219.05	-121,571,260.58
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）	45,409,416.73	7,479,646.17	52,889,062.90
项目	上年度可比期间 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）	559,822,478.22	-7,178,089.83	552,644,388.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,536,087.53	31,536,087.53
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）	-240,870,012.09	-10,599,620.35	-251,469,632.44
其中：1.基金申购款	37,922,845.04	1,928,311.81	39,851,156.85
2.基金赎回款	-278,792,857.13	-12,527,932.16	-291,320,789.29
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）	318,952,466.13	13,758,377.35	332,710,843.48

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

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(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[2015]2434 号《关于准予易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2193 号《关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 11 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 399,318,394.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 86,452.09 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式型基金,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,基金托管人为招商银行股份有限公司,境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

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》、《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19

号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	50,147,332.29
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	50,147,332.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	45,969,324.97	49,414,322.05	3,444,997.08

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		45,969,324.97	49,414,322.05	3,444,997.08

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	2,355.31
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	2,355.31

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 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	136,435.42
预提费用	417,795.49
其他应付款	74,407.80
合计	628,638.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,693,467.96	140,693,467.96
本期申购	13,346,990.30	13,346,990.30
本期赎回（以“-”号填列）	-108,631,041.53	-108,631,041.53
本期末	45,409,416.73	45,409,416.73

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	13,881,184.10	-217,507.95	13,663,676.15
本期利润	15,069,842.09	-10,305,827.13	4,764,014.96
本期基金份额交易产生的变动数	-15,476,900.99	4,528,856.05	-10,948,044.94
其中：基金申购款	2,019,683.80	-27,509.69	1,992,174.11
基金赎回款	-17,496,584.79	4,556,365.74	-12,940,219.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,474,125.20	-5,994,479.03	7,479,646.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	11,498.14
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	190.71
合计	11,688.85

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	119,367,405.67
减：卖出股票成本总额	105,453,392.24
买卖股票差价收入	13,914,013.43

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出权证成交总额	34,408.94
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	1,002.20
买卖权证差价收入	33,406.74

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,689,210.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,689,210.94

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-10,288,908.31
——股票投资	-10,288,908.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-16,918.82
——权证投资	-16,918.82
——期货投资	-
——期权投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-10,305,827.13

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	128,001.96
合计	128,001.96

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	252,639.87
银行间市场交易费用	-
合计	252,639.87

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	39,275.19
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	1,534.69
上市费	29,752.78
指数使用费	49,330.50
其他	3,627.81
合计	272,288.49

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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
香港上海汇丰银行有限公司(以下简称“汇丰银行”)	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
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	444,156.09	1,628,765.76
其中：支付销售机构的客户维护费	69,499.08	225,597.41

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	138,798.81	508,989.31
----------------	------------	------------

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
广发证券	73,703.00	0.16%	1,014,681.00	0.72%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
招商银行-活期存款	49,050,317.43	11,240.13	2,744,012.82	34,404.87
汇丰银行-活期存款	1,097,014.86	258.01	11,936,183.68	776.23

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司和香港上海汇丰银行有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2018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

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
1886 HK	CHINA HUIYUAN JUICE GROUP	2018-04-03	重大事项停牌	1.70	-	-	99,000	246,529.98	168,603.14	-
2369 HK	COOLPAD GROUP LTD	2017-03-31	重大事项停牌	0.09	-	-	2,188,000	1,889,728.65	202,917.31	-
404 HK	HSINCHONG GROUP HOLDINGS LTD	2017-04-03	重大事项停牌	0.08	-	-	1,940,000	610,099.91	147,205.26	-

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 2018 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 2018 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恒生综合小型股指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市企业，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 2018 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% (2017 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 2018年6月30日	上年度末 2017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、同业存单。

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 2018年6月30日	上年度末 2017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 2018年6月30日	上年度末 2017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 2018年6月30日	上年度末 2017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 2018年6月30日	上年度末 2017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 2018年6月30日	上年度末 2017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。

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 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。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，面临海外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降。此外，本基金主要投资的香港证券市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此香港证券市场证券的每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

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 2018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	50,147,332.29	-	-	-	50,147,332.29
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	49,414,322.05	49,414,322.05

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,040,696.07	1,040,696.07
应收利息	-	-	-	2,355.31	2,355.31
应收股利	-	-	-	730,819.94	730,819.94
应收申购款	52,421.00	-	-	83,351.86	135,772.86
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	50,199,753.29	-	-	51,271,545.23	101,471,298.52
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	-	-	-	47,867,829.63	47,867,829.63
应付管理人报酬	-	-	-	65,346.49	65,346.49
应付托管费	-	-	-	20,420.79	20,420.79
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	-	-	-	628,638.71	628,638.71
负债总计	-	-	-	48,582,235.62	48,582,235.62
利率敏感度缺口	50,199,753.29	-	-	2,689,309.61	52,889,062.90
上年度末					
2017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	10,322,225.16	-	-	-	10,322,225.16
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	145,052,035.53	145,052,035.53

					3
衍生金融资产	-	-	-	16,918.82	16,918.82
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	233.18	233.18
应收股利	-	-	-	117,035.75	117,035.75
应收申购款	1,669.74	-	-	7,841.89	9,511.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,323,894.90	-	-	145,194,065.17	155,517,960.07
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	-	-	-	465,466.34	465,466.34
应付管理人报酬	-	-	-	105,940.40	105,940.40
应付托管费	-	-	-	33,106.37	33,106.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	805.32	805.32
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	555,497.53	555,497.53
负债总计	-	-	-	1,160,815.96	1,160,815.96
利率敏感度缺口	10,323,894.90	-	-	144,033,249.21	154,357,144.11

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			
	2018年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	1,097,148.01	-	1,097,148.01
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	49,414,322.05	-	49,414,322.05
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	1,040,696.07	-	1,040,696.07
应收利息	-	46.51	-	46.51
应收股利	-	730,819.94	-	730,819.94
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	52,283,032.58	-	52,283,032.58
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	52,283,032.58	-	52,283,032.58
项目	上年度末			
	2017年12月31日			

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	10,020,990.00	-	10,020,990.00
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	145,052,035.53	-	145,052,035.53
衍生金融资产	-	16,918.82	-	16,918.82
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	90.97	-	90.97
应收股利	-	117,035.75	-	117,035.75
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	155,207,071.07	-	155,207,071.07
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	155,207,071.07	-	155,207,071.07

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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-2,614,151.63	-7,760,353.55
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	2,614,151.63	7,760,353.55

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 2018年6月30日		上年度末 2017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	49,414,322.05	93.43	145,052,035.53	93.97
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	-	-	16,918.82	0.01
其他	-	-	-	-
合计	49,414,322.05	93.43	145,068,954.35	93.98

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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,470,716.08	7,252,601.71
2.业绩比较基准下降 5%	-2,470,716.08	-7,252,601.71	

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 2018 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 48,895,596.34 元，属于第二层次的余额为 168,603.14 元，属于第三层次的余额为 350,122.57 元(2017 年 12 月 31 日：第一层次 144,721,817.64 元，无属于第二层次的余额，第三层次 347,136.71 元)。

(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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的第三层次金融工具公允价值为 350,122.57 元 (2017 年 12 月 31 日：347,136.71 元)。

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产
	权益工具投资
2018 年 1 月 1 日	347,136.71
购买	-
出售	-
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	2,985.86
-计入损益的利得或损失	2,985.86
2018 年 6 月 30 日	350,122.57
2018 年 6 月 30 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动	2,985.86

——公允价值变动损益	
	交易性金融资产
	权益工具投资
2017 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层级	355,076.77
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-7,940.06
-计入损益的利得或损失	-7,940.06
2017 年 12 月 31 日	347,136.71
2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动	-2,152,691.85
——公允价值变动损益	

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司盈利预期及市盈率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的盈利预期及市盈率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 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	49,414,322.05	48.70
	其中：普通股	48,692,544.14	47.99

	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	721,777.91	0.71
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	50,147,332.29	49.42
8	其他各项资产	1,909,644.18	1.88
9	合计	101,471,298.52	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（%）
香港	49,414,322.05	93.43
合计	49,414,322.05	93.43

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	715,758.18	1.35
材料	5,527,909.10	10.45
工业	6,702,957.80	12.67
非必需消费品	11,659,668.34	22.05
必需消费品	1,389,355.36	2.63
保健	5,151,591.42	9.74
金融	1,875,171.33	3.55

信息技术	5,043,697.78	9.54
电信服务	882,455.90	1.67
公用事业	3,389,013.29	6.41
房地产	7,076,743.55	13.38
合计	49,414,322.05	93.43

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	Kingdee Internatio nal Software Group Co. Ltd.	金蝶国际 软件集团 有限公司	268 HK	香港证 券交易 所	香港	182,000	1,232,156.93	2.33
2	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限 公司	2331 HK	香港证 券交易 所	香港	160,500	1,170,496.81	2.21
3	Chinasoft Internatio nal Ltd.	中软国际 有限公司	354 HK	香港证 券交易 所	香港	190,000	980,356.68	1.85
4	SSY Group Limited	石四药集 团有限公 司	2005 HK	香港证 券交易 所	香港	128,000	939,955.33	1.78
5	China Maple Leaf Education al Systems Limited	中国枫叶 教育集团 有限公司	1317 HK	香港证 券交易 所	香港	70,000	834,500.38	1.58
6	IGG Inc	-	799 HK	香港证 券交易 所	香港	88,000	744,895.71	1.41
7	Fu Shou Yuan Internatio nal Group Limited	福寿园国 际集团有 限公司	1448 HK	香港证 券交易 所	香港	95,000	708,836.33	1.34

8	Tianneng Power International Ltd	天能动力国际有限公司	819 HK	香港证券交易所	香港	66,000	679,977.01	1.29
9	HKBN Ltd.	香港宽频有限公司	1310 HK	香港证券交易所	香港	65,500	667,094.44	1.26
10	Sinotrans Limited	中国外运股份有限公司	598 HK	香港证券交易所	香港	187,000	652,711.16	1.23
11	Greentown Service Group Co. Ltd.	绿城服务集团有限公司	2869 HK	香港证券交易所	香港	100,000	600,287.20	1.13
12	United Energy Group Limited	联合能源集团有限公司	467 HK	香港证券交易所	香港	684,000	599,747.62	1.13
13	Angang Steel Company Limited	鞍钢股份有限公司	347 HK	香港证券交易所	香港	98,000	584,976.50	1.11
14	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Company Limited	广州白云山医药集团股份有限公司	874 HK	香港证券交易所	香港	20,000	583,425.20	1.10
15	Dongyue Group Limited	东岳集团有限公司	189 HK	香港证券交易所	香港	102,000	567,574.92	1.07
16	China Water Affairs Group Limited	中国水务集团有限公司	855 HK	香港证券交易所	香港	80,000	552,399.12	1.04
17	Tong Ren Tang Technologies Co. Limited	北京同仁堂科技发展股份有限公司	1666 HK	香港证券交易所	香港	51,000	535,756.33	1.01
18	Datang	大唐国际	991 HK	香港证	香港	262,000	530,141.28	1.00

	International Power Generation Co.,Ltd.	发电股份有限公司		券交易所				
19	Yihai International Holding Ltd.	颐海国际控股有限公司	1579 HK	香港证券交易所	香港	42,000	529,736.59	1.00
20	Red Star Macalline Group Corporation Ltd.	红星美凯龙家居集团股份有限公司	1528 HK	香港证券交易所	香港	58,400	520,927.88	0.98
21	China Scea Property Holdings Ltd.	中骏置业控股有限公司	1966 HK	香港证券交易所	香港	166,000	520,631.11	0.98
22	China Education Group Holdings Limited	中国教育集团控股有限公司	839 HK	香港证券交易所	香港	45,000	500,801.40	0.95
23	Lonking Holdings Limited	中国龙工控股有限公司	3339 HK	香港证券交易所	香港	164,000	499,148.92	0.94
24	Universal Medical Financial & Technical Advisory Services Company Limited	环球医疗金融与技术咨询有限公司	2666 HK	香港证券交易所	香港	94,500	497,955.94	0.94
25	BBMG Corporation	北京金隅集团股份有限公司	2009 HK	香港证券交易所	香港	203,000	496,332.97	0.94
26	Powerlong Real Estate Holdings Limited	宝龙地产控股有限公司	1238 HK	香港证券交易所	香港	139,000	495,717.51	0.94
27	Metallurgical	中国冶金科工股份	1618 HK	香港证券交易所	香港	250,000	488,998.00	0.92

	Corporation of China Ltd.	有限公司		所				
28	China Yuhua Education Corporation Limited	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港证券交易所	香港	102,000	479,858.80	0.91
29	Guangshen Railway Company Limited	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港证券交易所	香港	128,000	476,992.26	0.90
30	MicroPort Scientific Corporation	微创医疗科学有限公司	853 HK	香港证券交易所	香港	59,000	471,562.69	0.89
31	Giordano International Ltd.	佐丹奴国际有限公司	709 HK	香港证券交易所	香港	112,000	466,470.37	0.88
32	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港证券交易所	香港	91,500	462,090.46	0.87
33	China Aoyuan Property Group Limited	中国奥园地产集团股份有限公司	3883 HK	香港证券交易所	香港	94,000	455,695.55	0.86
34	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd	新疆金风科技股份有限公司	2208 HK	香港证券交易所	香港	56,420	454,271.55	0.86
35	China Everbright Greentech Limited	中国光大绿色环保有限公司	1257 HK	香港证券交易所	香港	65,000	449,372.30	0.85
36	Maanshan Iron & Steel Company	马鞍山钢铁股份有限公司	323 HK	香港证券交易所	香港	152,000	447,247.69	0.85

	Limited							
37	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	长飞光纤光缆股份有限公司	6869 HK	香港证券交易所	香港	16,500	442,374.57	0.84
38	China Oriental Group Co. Ltd.	中国东方集团控股有限公司	581 HK	香港证券交易所	香港	94,000	438,260.24	0.83
39	Far East Consortium International Ltd.	远东发展有限公司	35 HK	香港证券交易所	香港	110,000	433,100.47	0.82
40	Fufeng Group Ltd	阜丰集团有限公司	546 HK	香港证券交易所	香港	145,000	431,540.74	0.82
41	China ZhengTong Auto Services Holdings Limited	中国正通汽车服务控股有限公司	1728 HK	香港证券交易所	香港	97,500	429,917.77	0.81
42	Sunlight Real Estate Investment Trust	-	435 HK	香港证券交易所	香港	94,000	429,542.59	0.81
43	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd	远大医药健康控股有限公司	512 HK	香港证券交易所	香港	92,000	428,159.90	0.81
44	Jiayuan International Group Limited	佳源国际控股有限公司	2768 HK	香港证券交易所	香港	36,000	412,781.76	0.78
45	China	中国利郎	1234 HK	香港证	香港	43,000	408,212.16	0.77

	Lilang Limited	有限公司		券交易所				
46	Shenzhen Expressway Company Limited	深圳高速公路股份有限公司	548 HK	香港证券交易所	香港	62,000	402,495.94	0.76
47	The United Laboratories International Holdings Ltd	联邦制药国际控股有限公司	3933 HK	香港证券交易所	香港	58,000	399,511.37	0.76
48	Ronshine China Holdings Limited	融信中国控股有限公司	3301 HK	香港证券交易所	香港	46,068	394,613.70	0.75
49	Xtep International Holdings Limited	特步国际控股有限公司	1368 HK	香港证券交易所	香港	87,000	393,887.89	0.74
50	Tibet Water Resources Ltd.	西藏水资源有限公司	1115 HK	香港证券交易所	香港	157,000	393,129.10	0.74
51	China Dongxian g (Group) Co., Ltd.	中国动向(集团)有限公司	3818 HK	香港证券交易所	香港	320,000	388,500.48	0.73
52	Huadian Power International Corporation Limited	华电国际电力股份有限公司	1071 HK	香港证券交易所	香港	144,000	376,359.84	0.71
53	Beijing Enterprises Clean Energy Group Limited	北控清洁能源集团有限公司	1250 HK	香港证券交易所	香港	2,160,000	369,682.49	0.70

54	Cosco Shipping Development Company Limited	中远海运发展股份有限公司	2866 HK	香港证券交易所	香港	326,000	360,054.29	0.68
55	China BlueChemical Ltd.	中海石油化学股份有限公司	3983 HK	香港证券交易所	香港	144,000	350,864.50	0.66
56	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co., Ltd.	中远海运能源运输股份有限公司	1138 HK	香港证券交易所	香港	110,000	350,560.98	0.66
57	China New Higher Education Group Limited	中国新高教集团有限公司	2001 HK	香港证券交易所	香港	57,000	348,411.08	0.66
58	Huadian Fuxin Energy Corporation Limited	华电福新能源股份有限公司	816 HK	香港证券交易所	香港	224,000	347,492.10	0.66
59	Orient Securities Company Limited	东方证券股份有限公司	3958 HK	香港证券交易所	香港	67,200	346,170.12	0.65
60	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	丽珠医药集团股份有限公司	1513 HK	香港证券交易所	香港	10,795	342,207.55	0.65
61	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd.	中联重科股份有限公司	1157 HK	香港证券交易所	香港	120,000	338,926.20	0.64
62	China	中国神威	2877 HK	香港证	香港	26,000	336,262.00	0.64

	Shineway Pharmaceutical Group Ltd	药业集团有限公司		券交易所				
63	Yuexiu Transport Infrastructure Limited	越秀交通基建有限公司	1052 HK	香港证券交易所	香港	68,000	327,932.18	0.62
64	Shougang Fushan Resources Group Limited	首钢福山资源集团有限公司	639 HK	香港证券交易所	香港	208,000	327,932.18	0.62
65	China Overseas Grand Oceans Group Limited	中国海外宏洋集团有限公司	81 HK	香港证券交易所	香港	134,000	326,498.91	0.62
66	Goodbaby International Holdings Ltd	好孩子国际控股有限公司	1086 HK	香港证券交易所	香港	81,000	324,382.73	0.61
67	Redco Properties Group Limited	力高地产集团有限公司	1622 HK	香港证券交易所	香港	96,000	323,750.40	0.61
68	Wisdom Education International Holdings Company Limited	睿见教育国际控股有限公司	6068 HK	香港证券交易所	香港	54,000	311,862.69	0.59
69	China Securities Co.,Ltd.	中信建投证券股份有限公司	6066 HK	香港证券交易所	香港	65,596	308,596.25	0.58
70	Shanghai Jin Jiang International Hotels (Group) Company	上海锦江国际酒店(集团)股份有限公司	2006 HK	香港证券交易所	香港	112,000	300,278.50	0.57

	Limited							
71	Gemdale Properties and Investment Corporation Limited	金地商置集团有限公司	535 HK	香港证券交易所	香港	412,000	295,253.62	0.56
72	Prosperity REIT	-	808 HK	香港证券交易所	香港	109,000	292,235.32	0.55
73	Tian Ge Interactive Holdings Limited	天鸽互动控股有限公司	1980 HK	香港证券交易所	香港	57,164	280,494.72	0.53
74	Greatview Aseptic Packaging Company Limited	纷美包装有限公司	468 HK	香港证券交易所	香港	71,000	280,145.27	0.53
75	Road King Infrastructure Ltd.	路劲基建有限公司	1098 HK	香港证券交易所	香港	24,000	277,615.97	0.52
76	Bosideng International Holdings Ltd.	波司登国际控股有限公司	3998 HK	香港证券交易所	香港	280,000	254,953.44	0.48
77	China Gold International Resources Corp. Ltd.	中国黄金国际资源有限公司	2099 HK	香港证券交易所	香港	22,400	252,687.19	0.48
78	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业集团有限公司	2669 HK	香港证券交易所	香港	115,000	252,086.90	0.48
79	Sun Hung Kai & Co. Ltd.	新鸿基有限公司	86 HK	香港证券交易所	香港	66,000	245,392.69	0.46

80	Texhong Textile Group Limited	天虹纺织集团有限公司	2678 HK	香港证券交易所	香港	24,500	244,566.45	0.46
81	Consun Pharmaceutical Group Limited	康臣药业集团有限公司	1681 HK	香港证券交易所	香港	39,000	241,345.81	0.46
82	Dah Chong Hong Holdings Limited	大昌行集团有限公司	1828 HK	香港证券交易所	香港	73,000	240,646.03	0.46
83	Digital China Holdings Ltd.	神州数码控股有限公司	861 HK	香港证券交易所	香港	66,000	239,271.78	0.45
84	Bank of Chongqing Co., Ltd.	重庆银行股份有限公司	1963 HK	香港证券交易所	香港	55,500	233,492.33	0.44
85	Zhuguang Holdings Group Company Limited	珠光控股集团有限公司	1176 HK	香港证券交易所	香港	196,000	231,346.64	0.44
86	Canvest Environmental Protection Group Company Limited	粤丰环保电力有限公司	1381 HK	香港证券交易所	香港	65,000	230,714.32	0.44
87	Yadea Group Holdings Ltd.	雅迪集团控股有限公司	1585 HK	香港证券交易所	香港	94,000	230,621.57	0.44
88	Beijing Jingneng Clean Energy Co., Limited	北京京能清洁能源电力股份有限公司	579 HK	香港证券交易所	香港	150,000	230,166.30	0.44
89	China Oil	中油燃气	603 HK	香港证	香港	440,000	226,288.04	0.43

	and Gas Group Limited	集团有限公司		券交易所				
90	West China Cement Limited	中国西部水泥有限公司	2233 HK	香港证券交易所	香港	214,000	225,529.25	0.43
91	Beijing Capital Land Ltd.	首创置业股份有限公司	2868 HK	香港证券交易所	香港	78,000	222,274.88	0.42
92	PAX Global Technology Limited	百富环球科技有限公司	327 HK	香港证券交易所	香港	68,000	221,870.20	0.42
93	TCL Electronics Holdings Limited	TCL 电子控股有限公司	1070 HK	香港证券交易所	香港	70,000	220,723.58	0.42
94	Global Brands Group Holding Limited	利标品牌有限公司	787 HK	香港证券交易所	香港	556,000	220,318.89	0.42
95	Lai Sun Development Co. Ltd.	丽新发展有限公司	488 HK	香港证券交易所	香港	19,800	218,683.28	0.41
96	Cosmo Lady (China) Holdings Company Limited	都市丽人(中国)控股有限公司	2298 HK	香港证券交易所	香港	66,000	217,570.39	0.41
97	CITIC Resources Holdings Limited	中信资源控股有限公司	1205 HK	香港证券交易所	香港	308,000	215,530.08	0.41
98	Citic Telecom International Holdings Limited	中信国际电讯集团有限公司	1883 HK	香港证券交易所	香港	124,000	215,361.46	0.41
99	C.banner	千百度国	1028 HK	香港证	香港	115,000	214,273.87	0.41

	International Holdings Limited	际控股有限公司		券交易所				
100	Sinotrans Shipping Limited	中外运航运有限公司	368 HK	香港证券交易所	香港	121,000	211,171.26	0.40
101	Central China Securities Co., Ltd.	中原证券股份有限公司	1375 HK	香港证券交易所	香港	103,000	206,677.53	0.39
102	Coolpad Group Limited	酷派集团有限公司	2369 HK	香港证券交易所	香港	2,188,000	202,917.31	0.38
103	China Machinery Engineering Corporation	中国机械设备工程股份有限公司	1829 HK	香港证券交易所	香港	63,000	199,713.53	0.38
104	Everbright Securities Company Limited	光大证券股份有限公司	6178 HK	香港证券交易所	香港	24,600	198,276.89	0.37
105	Sany Heavy Equipment International Holdings Company Limited	三一重装国际控股有限公司	631 HK	香港证券交易所	香港	80,000	194,924.72	0.37
106	Colour Life Services Group Co., Limited	彩生活服务集团有限公司	1778 HK	香港证券交易所	香港	29,000	193,154.21	0.37
107	Chaowei Power Holdings Limited	超威动力控股有限公司	951 HK	香港证券交易所	香港	57,000	192,226.80	0.36

108	Texwinca Holdings Ltd.	德永佳集团有限公司	321 HK	香港证券交易所	香港	68,000	192,058.18	0.36
109	China Harmony New Energy Auto Holding Limited	中国和谐新能源汽车控股有限公司	3836 HK	香港证券交易所	香港	67,000	190,363.55	0.36
110	Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd.	李氏大药厂控股有限公司	950 HK	香港证券交易所	香港	21,500	185,616.90	0.35
111	HC International, Inc.	慧聪集团有限公司	2280 HK	香港证券交易所	香港	47,500	184,217.35	0.35
112	Citychamp Watch & Jewellery Group Limited	冠城钟表珠宝集团有限公司	256 HK	香港证券交易所	香港	134,000	181,890.39	0.34
113	Fairwood Holdings Ltd.	-	52 HK	香港证券交易所	香港	7,000	177,051.00	0.33
114	Q Technology (Group) Company Limited	丘钛科技(集团)有限公司	1478 HK	香港证券交易所	香港	34,000	170,559.13	0.32
115	Regina Miracle International (Holdings) Limited	维珍妮国际(控股)有限公司	2199 HK	香港证券交易所	香港	33,000	169,716.03	0.32
116	China Huiyuan Juice Group Limited	中国汇源果汁集团有限公司	1886 HK	香港证券交易所	香港	99,000	168,603.14	0.32
117	China Aircraft	中国飞机租赁集团	1848 HK	香港证券交易所	香港	24,500	166,073.84	0.31

	Leasing Group Holdings Limited	控股有限公司		所				
118	Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	海昌海洋公园控股有限公司	2255 HK	香港证券交易所	香港	104,000	165,719.74	0.31
119	Dalian Port (PDA) Company Limited	大连港股份有限公司	2880 HK	香港证券交易所	香港	160,000	157,828.32	0.30
120	Shanghai Industrial Urban Development Group Ltd	上海实业城市开发集团有限公司	563 HK	香港证券交易所	香港	130,000	157,828.32	0.30
121	Hi Sun Technology (China) Limited	高阳科技(中国)有限公司	818 HK	香港证券交易所	香港	159,000	154,160.84	0.29
122	Wasion Holdings Limited	威胜控股有限公司	3393 HK	香港证券交易所	香港	42,000	150,847.45	0.29
123	361 Degrees International Limited	361 度国际有限公司	1361 HK	香港证券交易所	香港	73,000	148,326.58	0.28
124	China Merchants Land Limited	招商局置地有限公司	978 HK	香港证券交易所	香港	130,000	147,964.05	0.28
125	Hsin Chong Group Holdings Limited	新昌集团控股有限公司	404 HK	香港证券交易所	香港	1,940,000	147,205.26	0.28
126	CPMC Holdings Limited	中粮包装控股有限公司	906 HK	香港证券交易所	香港	36,000	147,205.26	0.28
127	Sinofert	中化化肥	297 HK	香港证	香港	186,000	145,839.44	0.28

	Holdings Limited	控股有限公司		券交易所				
128	Concord New Energy Group Limited	协合新能源集团有限公司	182 HK	香港证券交易所	香港	500,000	145,434.75	0.27
129	Fantasia Holdings Group Co., Limited	花样年控股集团有限公司	1777 HK	香港证券交易所	香港	127,500	140,818.78	0.27
130	Xingda International Holdings Ltd.	兴达国际控股有限公司	1899 HK	香港证券交易所	香港	72,000	139,617.36	0.26
131	CGN New Energy Holdings Co., Ltd.	中国广核新能源控股有限公司	1811 HK	香港证券交易所	香港	114,000	133,597.63	0.25
132	Tianjin Port Development Holdings Limited	天津港发展控股有限公司	3382 HK	香港证券交易所	香港	162,000	129,753.09	0.25
133	Central China Real Estate Ltd	建业地产股份有限公司	832 HK	香港证券交易所	香港	42,000	129,601.33	0.25
134	Ajisen (China) Holdings Limited	味千(中国)控股有限公司	538 HK	香港证券交易所	香港	49,000	127,653.77	0.24
135	Emperor Capital Group Limited	英皇证券集团有限公司	717 HK	香港证券交易所	香港	300,000	126,465.00	0.24
136	Yashili International Holdings Ltd	雅士利国际控股有限公司	1230 HK	香港证券交易所	香港	84,000	126,060.31	0.24
137	Comba	京信通信	2342 HK	香港证	香港	132,000	124,643.90	0.24

	Telecom Systems Holdings Ltd.	系统控股有限公司		券交易所				
138	Greenland Hong Kong Holdings Limited	绿地香港控股有限公司	337 HK	香港证券交易所	香港	50,000	122,671.05	0.23
139	COSCO SHIPPING International (Hong Kong) Co., Ltd.	中远海运国际(香港)有限公司	517 HK	香港证券交易所	香港	48,000	120,597.02	0.23
140	China Power Clean Energy Development Company Limited	中国电力清洁能源发展有限公司	735 HK	香港证券交易所	香港	36,500	117,861.16	0.22
141	NewOcean Energy Holdings Ltd.	新海能源集团有限公司	342 HK	香港证券交易所	香港	86,000	116,010.56	0.22
142	Minsheng Education Group Co., Ltd.	民生教育集团有限公司	1569 HK	香港证券交易所	香港	70,000	115,673.32	0.22
143	CK Life Sciences Int'l. (Holdings) Inc.	长江生命科技集团有限公司	775 HK	香港证券交易所	香港	254,000	115,639.60	0.22
144	Tianjin Development Holdings Ltd.	天津发展控股有限公司	882 HK	香港证券交易所	香港	40,000	110,277.48	0.21
145	Bocom International	交银国际控股有限公司	3329 HK	香港证券交易所	香港	72,000	109,265.76	0.21

	Holdings Company Limited							
146	Bright Smart Securities & Commodities Group Limited	耀才证券金融集团有限公司	1428 HK	香港证券交易所	香港	52,000	100,834.76	0.19
147	Regal Hotels International Holdings Ltd.	富豪酒店国际控股有限公司	78 HK	香港证券交易所	香港	24,000	98,743.87	0.19
148	Ju Teng International Holdings Ltd.	巨腾国际控股有限公司	3336 HK	香港证券交易所	香港	78,000	85,490.34	0.16
149	Kangda International Environmental Company Limited	康达国际环保有限公司	6136 HK	香港证券交易所	香港	82,000	84,343.72	0.16
150	Soundwill Holdings Ltd.	金朝阳集团有限公司	878 HK	香港证券交易所	香港	7,500	81,949.32	0.15
151	Nvc Lighting Holding Limited	雷士照明控股有限公司	2222 HK	香港证券交易所	香港	140,000	77,902.44	0.15
152	China Pioneer Pharma Holdings Limited	中国先锋医药控股有限公司	1345 HK	香港证券交易所	香港	40,000	74,192.80	0.14
153	Cofco Meat Holdings Limited	中粮肉食控股有限公司	1610 HK	香港证券交易所	香港	66,546	64,520.67	0.12
154	CGN	中广核矿	1164 HK	香港证	香港	170,000	62,347.25	0.12

	Mining Company Limited	业有限公司		券交易所				
155	Tenwow International Holdings Limited	天喔国际控股有限公司	1219 HK	香港证券交易所	香港	75,000	29,403.11	0.06

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	Dongyue Group Limited	189 HK	1,337,213.81	0.87
2	Yihai International Holding Ltd.	1579 HK	879,032.23	0.57
3	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd	512 HK	875,404.48	0.57
4	China Gold International Resources Corp. Ltd.	2099 HK	716,779.30	0.46
5	China Education Group Holdings Limited	839 HK	716,078.01	0.46
6	Sun Hung Kai & Co. Ltd.	86 HK	584,330.45	0.38
7	Zhuguang Holdings Group Company Limited	1176 HK	519,117.57	0.34
8	Digital China Holdings Ltd.	861 HK	509,008.50	0.33
9	Global Brands Group Holding Limited	787 HK	508,717.64	0.33
10	C.banner International Holdings Limited	1028 HK	496,343.88	0.32
11	Lai Sun Development Co. Ltd.	488 HK	393,326.52	0.25
12	China Overseas Grand Oceans Group Limited	81 HK	380,864.43	0.25
13	Regina Miracle International (Holdings) Limited	2199 HK	361,250.93	0.23
14	China ZhengTong Auto	1728 HK	352,741.29	0.23

	Services Holdings Limited			
15	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	343,456.27	0.22
16	Fairwood Holdings Ltd.	52 HK	318,059.78	0.21
17	Beijing Jingneng Clean Energy Co., Limited	579 HK	279,080.68	0.18
18	COSCO SHIPPING International (Hong Kong) Co., Ltd.	517 HK	270,162.32	0.18
19	Universal Medical Financial & Technical Advisory Services Company Limited	2666 HK	265,712.03	0.17
20	China Maple Leaf Educational Systems Limited	1317 HK	265,050.71	0.17

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	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd.	2196 HK	5,186,722.24	3.36
2	China Molybdenum Co.,Ltd.	3993 HK	4,931,505.16	3.19
3	Future Land Development Holdings Limited	1030 HK	2,399,550.77	1.55
4	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	2,263,974.26	1.47
5	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	1,929,393.51	1.25
6	Chinasoft International Ltd.	354 HK	1,889,033.53	1.22
7	Yuzhou Properties Co. Ltd.	1628 HK	1,872,312.88	1.21
8	IGG Inc	799 HK	1,587,442.86	1.03
9	SSY Group Limited	2005 HK	1,585,509.81	1.03
10	Jiayuan International Group Limited	2768 HK	1,553,798.52	1.01
11	Sinotrans Limited	598 HK	1,409,211.24	0.91
12	Stella International Holdings Ltd	1836 HK	1,344,928.77	0.87
13	Fu Shou Yuan International Group Limited	1448 HK	1,312,372.79	0.85
14	Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	116 HK	1,306,996.76	0.85
15	China Maple Leaf Educational Systems Limited	1317 HK	1,303,427.79	0.84
16	HKBN Ltd.	1310 HK	1,293,352.02	0.84
17	Greentown Service Group Co. Ltd.	2869 HK	1,277,128.21	0.83
18	Angang Steel Company Limited	347 HK	1,276,079.56	0.83
19	BBMG Corporation	2009 HK	1,228,962.23	0.80

20	Tong Ren Tang Technologies Co. Limited	1666 HK	1,201,911.45	0.78
----	--	---------	--------------	------

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	20,104,587.07
卖出收入（成交）总额	119,367,455.50

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 本基金为指数型基金，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。

7.11.2 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	1,040,696.07
3	应收股利	730,819.94
4	应收利息	2,355.31
5	应收申购款	135,772.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,909,644.18

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
2,129	21,328.99	9,079,178.13	19.99%	36,330,238.60	80.01%

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	长安国际信托股份有限公司—长安信托 宏观投资 1 号集合资金信托计划	2,100,506.00	19.97%
2	屠翠华	1,780,000.00	16.93%
3	株洲结谷实业有限责任公司	1,491,971.00	14.19%
4	天弘基金—宁波银行—天弘回报灵活配置资产管理计划	646,228.00	6.14%
5	潘学军	490,000.00	4.66%
6	李志君	446,064.00	4.24%
7	缙岳松	333,300.00	3.17%
8	黄建颂	289,135.00	2.75%
9	赵伟	255,200.00	2.43%
10	黄湘丽	200,000.00	1.90%

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	503,597.20	1.1090%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月2日）基金份额总额	399,318,394.11
本报告期期初基金份额总额	140,693,467.96

本报告期基金总申购份额	13,346,990.30
减：本报告期基金总赎回份额	108,631,041.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,409,416.73

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 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官(副总经理级)，聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官(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	
Goldman Sachs	1	29,525,824.05	21.23%	23,620.66	23.19%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	6,860,241.70	4.93%	5,488.17	5.39%	-
Everbright Securities (International) Limited	1	31,522,596.33	22.66%	15,761.59	15.48%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	44,151,730.26	31.74%	35,349.16	34.71%	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	13,118,919.92	9.43%	10,495.17	10.31%	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	13,911,847.99	10.00%	11,129.57	10.93%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
State Street Securities Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，无新增交易账户。

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
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-

Co Ltd									
Ever bright Securities (International) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	34,408.95	100.00%	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞农村商业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	2018-01-02
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通华财富为销售机构、参加通华财富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	2018-01-10
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云湾投资为销售机构、参加云湾投资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	2018-01-17
4	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	2018-01-23
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2018-01-31

	式基金参加中泰证券网上渠道申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
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展恒基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-02-01
7	易方达基金管理有限公司关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-22
8	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-23
9	易方达基金管理有限公司关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2018年3月30日、4月2日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-27
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联泰资产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	2018-03-29
11	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-29
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	2018-03-30
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东海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	2018-04-02
14	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、证券时报及基金管理人网站	2018-04-12
15	易方达基金管理有限公司关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）恢复大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-05-02
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浙商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	2018-05-10
17	易方达基金管理有限公司关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2018年5月22日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-05-17
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银河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	2018-05-21

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中信建投证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-05-22
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国泰君安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	2018-05-28
21	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、证券日报及基金管理人网站	2018-06-08
22	易方达基金管理有限公司关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）2018 年 7 月 2 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-27
23	易方达基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-28
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奕丰金融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	2018-06-29
25	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	2018-06-30

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	2018 年 02 月 12 日 ~2018 年 06 月 26 日	20,001,944.00	-	20,001,944.00	-	-
	2	2018 年 02 月 12 日 ~2018 年 06 月 26 日	21,102,300.00	-	21,102,300.00	-	-
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</p>							

决时可能拥有较大话语权。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2.《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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

二〇一八年八月二十八日