

易方达纳斯达克 100 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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	14
6.3	所有者权益 (基金净值) 变动表	15
6.4	报表附注	16
7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	期末在各个国家 (地区) 证券市场的权益投资分布	34
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	34
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	35
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	42
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	备查文件目录
11.1	备查文件目录
11.2	存放地点
11.3	查阅方式

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF)
场内简称	纳指 LOF
基金主代码	161130
交易代码	161130
基金运作方式	契约型、上市开放式 (LOF)
基金合同生效日	2017 年 6 月 23 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	60,733,912.40 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	2017 年 7 月 14 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	作为追踪纳斯达克 100 指数的被动式海外指数基金，本基金主要采取完全复制法进行投资，力争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。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（使用估值汇率折算） $\times 95\%$ + 活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	400 881 8088	010-67595096
传真	020-85104666	010-66275853
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891 (集中办公区)	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	刘晓艳	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	263,069.30
本期利润	6,612,653.16
加权平均基金份额本期利润	0.1017
本期加权平均净值利润率	9.38%
本期基金份额净值增长率	10.15%
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	676,248.55
期末可供分配基金份额利润	0.0111
期末基金资产净值	70,117,977.97
期末基金份额净值	1.1545
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	15.45%

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	3.99%	0.84%	4.02%	0.84%	-0.03%	0.00%
过去三个月	11.81%	0.98%	11.93%	0.98%	-0.12%	0.00%
过去六个月	10.15%	1.29%	10.93%	1.28%	-0.78%	0.01%
过去一年	15.44%	0.99%	20.69%	1.02%	-5.25%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.45%	0.97%	17.31%	1.03%	-1.86%	-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

易方达纳斯达克 100 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
 (2017 年 6 月 23 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.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十三部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 15.45%，同期业绩比较基准收益率为 17.31%。

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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、量化策略部副总经理	2017-06-23	-	10 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指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员、量化基金组合部副总经理、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联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理。
FAN	本基金的基金经理、易方达中	2017-06-27	-	13 年	硕士研究生，曾

BING(范冰)	证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				任皇家加拿大银行托管部核算专员, 美国道富集团 Middle Office 中台交易支持专员, 巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、主管, 新加坡金融数据部主管, 贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。
----------	--	--	--	--	--

注: 1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期, 林伟斌的“任职日期”为基金合同生效之日, FAN BING(范冰)的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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。

3. 根据 2018 年 8 月 11 日《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告》, 自 2018 年 8 月 11 日起, 林伟斌不再担任本基金的基金经理, 增聘成曦担任本基金的基金经理, FAN BING(范冰)仍任本基金的基金经理。

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

2018 年一季度，FaceBook 的信息泄露、Cohn 和 Tillerson 的突然离职以及特朗普的贸易摩擦等风险事件引起了市场的不安，全球股市出现恐慌性抛售。美联储 3 月如期加息 25 个基点。国际方面，美国在对朝鲜实施了“史上最严厉”制裁后，又决定展开元首层面的对话。美国经济基本面继续向好，就业充分，非农数据亮眼，核心通胀上升。

2018 年二季度，美国与各国的贸易摩擦不断升温，对中国公布 301 调查结果，并对中兴公司施加制裁，对加拿大、墨西哥和欧盟等传统盟国也推高关税，加大了全球股票市场的波动。美国经济继续向好，失业率下降，核心通胀也继续上扬。美股企业盈利继续超过预期，整体美股估值稳中有降。2018 年 6 月份美联储如期加息 25 个基点，上调 18 年经济和核心 PCE 通胀预期，更多官员预计年内加息四次。国际方面，美国宣布退出伊朗核协议，特朗普和金正恩在新加坡实现历史性会面。受税改影响，海外美元资金回流美国，美股企业股票回购对股价提供了一定支撑。

作为追踪纳斯达克 100 指数的被动式海外指数基金，本基金采用完全复制法，力求追踪误差最小化。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1545 元，本报告期份额净值增长率为 10.15%，同期业绩比较基准收益率为 10.93%。年化跟踪误差 0.411%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，全球范围内美国经济复苏最为强势，带动美股企业盈利继续向好，税改和

积极的财政政策也对股市有利；但是同时也要关注全球贸易摩擦和美国加息进程不确定性对股市的潜在影响。美股科技龙头企业的业绩有望持续增长，研发和创新投入会带来长期收益，但面临的监管政策将持续趋严。

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

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：易方达纳斯达克 100 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	5,121,927.01	4,001,538.30
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	66,804,985.65	68,037,496.35
其中：股票投资		65,669,246.26	68,037,496.35
基金投资		1,135,739.39	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	344.15	278.68
应收股利		16,431.58	15,128.23
应收申购款		1,182,836.37	201,076.78
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		73,126,524.76	72,255,518.34
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		1,135,805.56	-
应付赎回款		1,177,051.09	186,629.58
应付管理人报酬		45,589.06	49,217.77
应付托管费		14,246.57	15,380.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	635,854.51	362,786.45
负债合计		3,008,546.79	614,014.33
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	60,733,912.40	68,355,737.09
未分配利润	6.4.7.10	9,384,065.57	3,285,766.92
所有者权益合计		70,117,977.97	71,641,504.01
负债和所有者权益总计		73,126,524.76	72,255,518.34

注: 1. 本基金合同生效日为 2017 年 6 月 23 日, 2017 年度实际报告期间为 2017 年 6 月 23 日至 2017 年 12 月 31 日。

2. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.1545 元, 基金份额总额 60,733,912.40 份。

6.2 利润表

会计主体: 易方达纳斯达克 100 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 6 月 23 日 (基 金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		7,341,476.15	124,386.78
1. 利息收入		9,149.31	143,777.21

其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,149.31	143,777.21
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）		947,228.07	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	699,444.89	-
基金投资收益	6.4.7.13	-70,032.43	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	317,815.61	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,349,583.86	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-19,580.43	-19,775.88
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	55,095.34	385.45
减：二、费用		728,822.99	84,275.77
1. 管理人报酬		279,499.70	51,109.62
2. 托管费		87,343.65	15,971.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,294.40	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		5.40	-
7. 其他费用	6.4.7.20	359,679.84	17,194.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,612,653.16	40,111.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,612,653.16	40,111.01

注：本基金合同生效日为 2017 年 6 月 23 日，上年度可比期间为 2017 年 6 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达纳斯达克 100 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）	68,355,737.09	3,285,766.92	71,641,504.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,612,653.16	6,612,653.16
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）	-7,621,824.69	-514,354.51	-8,136,179.20
其中：1.基金申购款	33,098,751.60	2,853,005.95	35,951,757.55
2.基金赎回款	-40,720,576.29	-3,367,360.46	-44,087,936.75
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）	60,733,912.40	9,384,065.57	70,117,977.97
项目	上年度可比期间		
	2017年6月23日（基金合同生效日）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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,111.01	40,111.01
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）	333,099,865.38	-	333,099,865.38
其中：1.基金申购款	333,099,865.38	-	333,099,865.38
2.基金赎回款	-	-	-
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）	333,099,865.38	40,111.01	333,139,976.39

注：本基金合同生效日为 2017 年 6 月 23 日，上年度可比期间为 2017 年 6 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日。

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

易方达纳斯达克 100 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

会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2420 号《关于准予易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)注册的批复》，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达纳斯达克 100 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，《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 333,099,865.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,429.79 份基金份额。本基金为契约型、上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达纳斯达克 100 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	5,121,927.01
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	5,121,927.01

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	55,782,262.24	65,669,246.26	9,886,984.02
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		1,135,739.39	1,135,739.39	-
其他		-	-	-
合计		56,918,001.63	66,804,985.65	9,886,984.02

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	344.15
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	344.15

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	4,106.52
预提费用	298,356.09
其他应付款	333,391.90
合计	635,854.51

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	68,355,737.09	68,355,737.09
本期申购	33,098,751.60	33,098,751.60
本期赎回 (以“-”号填列)	-40,720,576.29	-40,720,576.29
本期末	60,733,912.40	60,733,912.40

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	436,917.24	2,848,849.68	3,285,766.92
本期利润	263,069.30	6,349,583.86	6,612,653.16
本期基金份额交易产生的变动数	-23,737.99	-490,616.52	-514,354.51
其中：基金申购款	193,838.85	2,659,167.10	2,853,005.95
基金赎回款	-217,576.84	-3,149,783.62	-3,367,360.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	676,248.55	8,707,817.02	9,384,065.57

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	8,656.73
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	492.58
合计	9,149.31

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,731,120.75
减：卖出股票成本总额	9,031,675.86
买卖股票差价收入	699,444.89

6.4.7.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	7,259,062.12
减：卖出/赎回基金成本总额	7,329,094.55
基金投资收益	-70,032.43

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

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	313,459.01
基金投资产生的股利收益	4,356.60
合计	317,815.61

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	6,349,583.86
——股票投资	6,349,583.86
——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	-
——权证投资	-
——期货投资	-
——期权投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	6,349,583.86

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	55,095.34
合计	55,095.34

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	1,217.43
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	1,076.97
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	1,076.97
合计	2,294.40

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	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	15.00
上市费	29,752.78
指数使用费	161,308.75
合计	359,679.84

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
道富银行	境外资产托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月23日（基金合同生效 日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	279,499.70	51,109.62
其中：支付销售机构的客户 维护费	68,019.92	9,759.04

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年6月23日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,343.65	15,971.75

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年6月23日（基金合同生效日）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
中国建设银行-活期存款	3,909,557.80	6,419.96	8,079,475.34	46,060.55
道富银行-活期存款	1,212,369.21	2,236.77	-	-

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司和道富银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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纳斯达克 100 指数的表现, 具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资境外市场上市的企业, 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

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 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	5,121,927.01	-	-	-	5,121,927.01
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	66,804,985.65	66,804,985.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	344.15	344.15
应收股利	-	-	-	16,431.58	16,431.58
应收申购款	98,769.39	-	-	1,084,066.98	1,182,836.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,220,696.40	-	-	67,905,828.36	73,126,524.76
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	-	-	-	1,135,805.56	1,135,805.56
应付赎回款	-	-	-	1,177,051.09	1,177,051.09
应付管理人报酬	-	-	-	45,589.06	45,589.06
应付托管费	-	-	-	14,246.57	14,246.57
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	-	-	-	635,854.51	635,854.51
负债总计	-	-	-	3,008,546.79	3,008,546.7

					9
利率敏感度缺口	5,220,696.40	-	-	64,897,281.57	70,117,977.97
上年度末					
2017 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
日					
资产					
银行存款	4,001,538.30	-	-	-	4,001,538.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	68,037,496.35	68,037,496.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	278.68	278.68
应收股利	-	-	-	15,128.23	15,128.23
应收申购款	81,619.00	-	-	119,457.78	201,076.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,083,157.30	-	-	68,172,361.04	72,255,518.34
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	-	-	-	186,629.58	186,629.58
应付管理人报酬	-	-	-	49,217.77	49,217.77
应付托管费	-	-	-	15,380.53	15,380.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	362,786.45	362,786.45
负债总计	-	-	-	614,014.33	614,014.33
利率敏感度缺口	4,083,157.30	-	-	67,558,346.71	71,641,504.01

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	4,073,037.83	-	-	4,073,037.83
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	66,804,985.65	-	-	66,804,985.65
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	59.55	-	-	59.55
应收股利	16,431.58	-	-	16,431.58
应收申购款	843,420.25	-	-	843,420.25
其他资产	-	-	-	-
资产合计	71,737,934.86	-	-	71,737,934.86
以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,135,805.56	-	-	1,135,805.56
应付赎回款	670,264.09	-	-	670,264.09
其他负债	2,526.15	-	-	2,526.15
负债合计	1,808,595.80	-	-	1,808,595.80

资产负债表 外汇风险敞 口净额	69,929,339.06	-	-	69,929,339.06
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	3,823,508.69	-	-	3,823,508.69
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	68,037,496.35	-	-	68,037,496.35
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算 款	-	-	-	-
应收利息	30.84	-	-	30.84
应收股利	15,128.23	-	-	15,128.23
应收申购款	65,212.62	-	-	65,212.62
其他资产	-	-	-	-
资产合计	71,941,376.73	-	-	71,941,376.73
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	-	-	-
应付赎回款	70,360.33	-	-	70,360.33
其他负债	265.16	-	-	265.16
负债合计	70,625.49	-	-	70,625.49
资产负债表 外汇风险敞 口净额	71,870,751.24	-	-	71,870,751.24

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%	-3,496,466.95	-3,593,537.56
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	3,496,466.95	3,593,537.56

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	65,669,246.26	93.66	68,037,496.35	94.97
交易性金融资产—基金投资	1,135,739.39	1.62	-	-
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	66,804,985.65	95.28	68,037,496.35	94.97

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%	3,340,249.26	3,401,874.80
2.业绩比较基准下降 5%	-3,340,249.26	-3,401,874.80	

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 66,804,985.65 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 68,037,496.35 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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	65,669,246.26	89.80
	其中：普通股	64,176,101.69	87.76
	存托凭证	1,493,144.57	2.04
2	基金投资	1,135,739.39	1.55
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	5,121,927.01	7.00
8	其他各项资产	1,199,612.10	1.64
9	合计	73,126,524.76	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	65,669,246.26	93.66
合计	65,669,246.26	93.66

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	-	-
材料	-	-
工业	1,336,012.55	1.91
非必需消费品	14,988,079.66	21.38
必需消费品	2,624,665.74	3.74
保健	6,144,935.61	8.76
金融	-	-
信息技术	40,063,230.55	57.14
电信服务	512,322.15	0.73
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	65,669,246.26	93.66

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	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,200	7,593,752.72	10.83
2	Amazon.com Inc	-	AMZN US	纳斯达 克证券 交易所	美国	602	6,770,631.80	9.66
3	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,529	6,217,319.22	8.87
4	Alphabet Inc	-	GOOG US	纳斯达 克证券 交易所	美国	436	3,218,469.07	4.59
			GOOGL US	纳斯达 克证券 交易所	美国	372	2,779,360.26	3.96
5	Facebook Inc	-	FB US	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,999	3,855,927.40	5.50
6	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,743	1,888,936.94	2.69

7	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	5,900	1,679,802.56	2.40
8	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯达克证券交易所	美国	537	1,390,795.49	1.98
9	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	5,541	1,202,899.27	1.72
10	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	751	1,177,171.88	1.68
11	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	886	1,082,123.36	1.54
12	Adobe Systems Inc	-	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	608	980,821.49	1.40
13	Texas Instruments Inc	-	TXN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,217	887,777.34	1.27
14	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,487	819,283.89	1.17
15	Broadcom Ltd	-	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	502	805,936.82	1.15
16	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	60	804,746.62	1.15
17	Twenty-First Century Fox Inc	-	FOXA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,325	435,631.98	0.62
			FOX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,004	327,303.88	0.47
18	Costco Wholesale Corp	-	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	546	754,974.44	1.08
19	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,583	741,983.67	1.06
20	QUALCOMM Inc	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	1,811	672,467.03	0.96

				交易所				
21	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,513	628,885.73	0.90
22	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	287	556,795.29	0.79
23	Baidu Inc	百度股份有限公司	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	344	553,094.83	0.79
24	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,700	549,475.55	0.78
25	Mondelez International Inc	-	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	1,836	498,071.18	0.71
26	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,435	497,908.41	0.71
27	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	259	497,384.11	0.71
28	Walgreens Boots Alliance Inc	-	WBA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,225	486,441.71	0.69
29	Celgene Corp	-	CELG US	纳斯达克证券交易所	美国	924	485,553.10	0.69
30	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	542	481,052.49	0.69
31	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达克证券交易所	美国	917	463,065.66	0.66
32	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,091	460,409.36	0.66
33	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	140	443,227.51	0.63
34	Tesla	-	TSLA US	纳斯达克	美国	192	435,679.29	0.62

	Motors Inc			克证券交易所				
35	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克证券交易所	美国	318	429,873.82	0.61
36	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,053	416,294.97	0.59
37	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,333	407,392.47	0.58
38	Cognizant Technology Solutions	-	CTSH US	纳斯达克证券交易所	美国	720	376,304.57	0.54
39	Marriott International Inc/MD	-	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	434	363,545.12	0.52
40	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达克证券交易所	美国	381	355,500.79	0.51
41	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	315	354,235.56	0.51
42	Express Scripts Holding Co	-	ESRX US	纳斯达克证券交易所	美国	686	350,455.23	0.50
43	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	179	330,783.09	0.47
44	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,272	305,175.59	0.44
45	Regeneron Pharmaceuticals Inc	-	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	130	296,745.91	0.42
46	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	453	287,502.92	0.41
47	JD.com Inc	京东商城电子商务有限公司	JD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,102	284,003.66	0.41

48	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	471	264,116.48	0.38
49	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	676	256,292.68	0.37
50	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克证券交易所	美国	504	247,072.84	0.35
51	Sirius XM Holdings Inc	-	SIRI US	纳斯达克证券交易所	美国	5,505	246,593.07	0.35
52	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	209	239,028.98	0.34
53	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达克证券交易所	美国	272	235,924.67	0.34
54	Alexion Pharmaceuticals Inc	-	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	278	228,363.35	0.33
55	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克证券交易所	美国	99	224,116.55	0.32
56	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	440	198,987.63	0.28
57	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达克证券交易所	美国	379	194,120.39	0.28
58	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	105	190,060.84	0.27
59	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达克证券交易所	美国	443	181,614.29	0.26
60	Liberty Global PLC	-	LBTYK US	纳斯达克证券交易所	美国	697	122,719.21	0.18
			LBTYA US	纳斯达克证券交易所	美国	299	54,484.13	0.08
61	Ctrip.com International	携程国际有限公司	CTRP US	纳斯达克证券交易所	美国	557	175,537.80	0.25

	nal Ltd			交易所				
62	Microchip Technology Inc	-	MCHP US	纳斯达克 证券交易所	美国	288	173,312.57	0.25
63	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达克 证券交易所	美国	298	167,598.48	0.24
64	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克 证券交易所	美国	135	165,312.11	0.24
65	NetEase Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克 证券交易所	美国	98	163,838.00	0.23
66	Cerner Corp	-	CERN US	纳斯达克 证券交易所	美国	407	161,011.85	0.23
67	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克 证券交易所	美国	111	160,064.42	0.23
68	Mylan NV	-	MYL US	纳斯达克 证券交易所	美国	658	157,343.54	0.22
69	American Airlines Group Inc	-	AAL US	纳斯达克 证券交易所	美国	595	149,443.85	0.21
70	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达克 证券交易所	美国	208	148,139.85	0.21
71	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达克 证券交易所	美国	230	147,083.71	0.21
72	Wynn Resorts Ltd	-	WYNN US	纳斯达克 证券交易所	美国	130	143,938.84	0.21
73	Maxim Integrated Products Inc	-	MXIM US	纳斯达克 证券交易所	美国	361	140,114.84	0.20
74	Workday Inc	-	WDAY US	纳斯达克 证券交易所	美国	174	139,444.05	0.20
75	Expedia Inc	-	EXPE US	纳斯达克 证券交易所	美国	175	139,168.60	0.20

76	Xilinx Inc	-	XLNX US	纳斯达克 交易所	美国	321	138,607.58	0.20
77	BioMarin Pharmace utical Inc	-	BMRN US	纳斯达克 交易所	美国	222	138,368.99	0.20
78	Seagate Technolog y PLC	-	STX US	纳斯达克 交易所	美国	365	136,378.38	0.19
79	KLA-Ten cor Corp	-	KLAC US	纳斯达克 交易所	美国	200	135,680.00	0.19
80	Check Point Software Technolog	-	CHKP US	纳斯达克 交易所	美国	206	133,139.75	0.19
81	CA Inc	-	CA US	纳斯达克 交易所	美国	524	123,602.06	0.18
82	Ultra Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯达克 交易所	美国	77	118,942.78	0.17
83	Incyte Corp	-	INCY US	纳斯达克 交易所	美国	267	118,364.36	0.17
84	Citrix Systems Inc	-	CTXS US	纳斯达克 交易所	美国	170	117,926.34	0.17
85	ASML Holding NV	-	ASML US	纳斯达克 交易所	美国	90	117,889.95	0.17
86	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克 交易所	美国	144	115,811.67	0.17
87	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克 交易所	美国	362	115,281.42	0.16
88	Take-Two Interactiv e Software	-	TTWO US	纳斯达克 交易所	美国	145	113,555.41	0.16
89	MercadoL ibre Inc	-	MELI US	纳斯达克 交易所	美国	57	112,740.31	0.16

90	Symantec Corp	-	SYMC US	纳斯达克证券交易所	美国	806	110,126.03	0.16
91	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克证券交易所	美国	187	105,876.12	0.15
92	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	366	104,882.77	0.15
93	Shire PLC	-	SHPG US	纳斯达克证券交易所	美国	92	102,753.15	0.15
94	Hasbro Inc	-	HAS US	纳斯达克证券交易所	美国	163	99,556.87	0.14
95	Vodafone Group PLC	-	VOD US	纳斯达克证券交易所	美国	597	96,027.18	0.14
96	Henry Schein Inc	-	HSIC US	纳斯达克证券交易所	美国	196	94,203.45	0.13
97	Hologic Inc	-	HOLX US	纳斯达克证券交易所	美国	358	94,157.53	0.13
98	DENTSPLY SIRONA Inc	-	XRAY US	纳斯达克证券交易所	美国	289	83,696.88	0.12
99	Liberty Interactive Corp QVC G	-	QRTEA US	纳斯达克证券交易所	美国	570	80,030.42	0.11
100	DISH Network Corp	-	DISH US	纳斯达克证券交易所	美国	287	63,824.19	0.09

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	Facebook Inc	FB US	173,048.10	0.24
2	Micron Technology Inc	MU US	33,293.45	0.05
3	Comcast Corp	CMCSA US	32,466.15	0.05
4	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN US	19,286.78	0.03
5	O'Reilly Automotive Inc	ORLY US	13,901.89	0.02
6	Western Digital Corp	WDC US	13,105.85	0.02
7	eBay Inc	EBAY US	11,875.22	0.02
8	Amazon.com Inc	AMZN US	10,072.49	0.01
9	Lam Research Corp	LRCX US	6,791.98	0.01

注：1. 买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL US	1,206,337.94	1.68
2	Microsoft Corp	MSFT US	854,374.62	1.19
3	Amazon.com Inc	AMZN US	798,509.81	1.11
4	Alphabet Inc	GOOG US	403,114.69	0.56
		GOOGL US	350,371.38	0.49
5	Facebook Inc	FB US	591,208.24	0.83
6	Cisco Systems Inc	CSCO US	308,451.64	0.43
7	Intel Corp	INTC US	294,166.75	0.41
8	Comcast Corp	CMCSA US	263,293.93	0.37
9	NVIDIA Corp	NVDA US	171,711.90	0.24
10	Amgen Inc	AMGN US	166,340.42	0.23
11	Netflix Inc	NFLX US	157,494.50	0.22
12	Booking Holdings Inc	BKNG US	136,391.54	0.19
13	Adobe Systems Inc	ADBE US	132,726.95	0.19
14	Gilead Sciences Inc	GILD US	128,540.60	0.18
15	Charter Communications Inc	CHTR US	125,300.76	0.17
16	Texas Instruments Inc	TXN US	124,952.94	0.17
17	Starbucks Corp	SBUX US	117,600.98	0.16
18	Broadcom Ltd	AVGO US	116,722.66	0.16
19	PayPal Holdings Inc	PYPL US	109,870.15	0.15
20	Celgene Corp	CELG US	108,542.83	0.15

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	313,841.91
卖出收入（成交）总额	9,731,120.75

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

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	Invesco QQQ Trust Series 1	ETF	开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	1,135,739.39	1.62

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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	-
3	应收股利	16,431.58
4	应收利息	344.15
5	应收申购款	1,182,836.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,199,612.10

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
2,600	23,359.20	5,227,246.15	8.61%	55,506,666.25	91.39%

注：持有人户数及结构包含人民币份额及美元现汇份额。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	清华大学教育基金会	5,000,243.00	53.06%
2	黄耀培	625,019.00	6.63%
3	杨家建	441,512.00	4.69%
4	马文博	260,117.00	2.76%
5	陈敏鹤	257,100.00	2.73%
6	黄白燕	200,027.00	2.12%
7	蔡志坤	193,003.00	2.05%
8	云南国际信托有限公司—云霞 17 期集合 资金信托计划	138,512.00	1.47%
9	李怡	133,504.00	1.42%
10	叶思嘉	100,001.00	1.06%

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	304,991.67	0.5022%

注：基金管理人的从业人员持有的本基金份额含易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) 人民币、美元现汇份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 6 月 23 日) 基金份额总额	333,099,865.38
本报告期期初基金份额总额	68,355,737.09
本报告期基金总申购份额	33,098,751.60
减: 本报告期基金总赎回份额	40,720,576.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,733,912.40

注: 本基金份额变动含易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) 人民币份额及美元现汇份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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	45,519.60	0.45%	36.40	1.89%	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	9,999,442.94	99.55%	1,891.11	98.11%	-
State Street Securities Hong Kong Limited	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	-	-	-	-	-	-	-	0.00%
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	15,723,941.07	100.00%
State Street Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年 1 月 15 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	2018-01-10
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
4	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	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

	资申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	人网站	
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	2018-01-23
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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-01-31
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大泰金石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	2018-01-31
8	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
9	易方达基金管理有限公司关于易方达纳斯达克 100 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
10	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
11	易方达基金管理有限公司关于易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年 3 月 30 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
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
13	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
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
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国工商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	2018-03-30
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
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
18	易方达基金管理有限公司关于易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 恢复大额申	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

	购业务的公告	人网站	
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
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
21	易方达基金管理有限公司关于易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）2018 年 5 月 28 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	2018-05-23
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
23	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
24	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
25	易方达基金管理有限公司关于易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）2018 年 7 月 4 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	2018-06-29
26	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
27	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 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
2. 《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日