

**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
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末投资目标基金明细	37
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45

7.11	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.13	投资组合报告附注	46
8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
9	开放式基金份额变动	48
10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	52
11	影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
12	备查文件目录	55
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式联接
基金主代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,300,011,117.15 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

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

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路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 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	83,550,070.02
本期利润	-484,671,804.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1517
本期加权平均净值利润率	-11.45%
本期基金份额净值增长率	-11.32%
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	644,393,053.74
期末可供分配基金份额利润	0.1953
期末基金资产净值	3,944,404,170.89
期末基金份额净值	1.1953
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	19.53%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.60%	1.21%	-7.29%	1.22%	0.69%	-0.01%
过去三个月	-8.59%	1.06%	-9.45%	1.08%	0.86%	-0.02%
过去六个月	-11.32%	1.08%	-12.25%	1.10%	0.93%	-0.02%
过去一年	-2.27%	0.89%	-3.97%	0.90%	1.70%	-0.01%
过去三年	-14.52%	1.38%	-20.19%	1.41%	5.67%	-0.03%
自基金合同生效起至今	19.53%	1.37%	13.72%	1.42%	5.81%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 8 月 26 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 19.53%，同期业绩比较基准收益率为 13.72%。

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		
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 医	2016-04-16	-	13 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

	药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-06-23	-	9 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 66 次，其中 64 次为指数量化投资组合因投资策略

略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年国内宏观经济增长在一季度保持了稳健回升的态势后在二季度增长动能有所减弱，前期货币、财政政策收紧的效果开始逐步传导到实体经济。宏观数据显示二季度国内实际 GDP 同比增速 6.7%，较一季度回落 0.1 个百分点；名义 GDP 同比增速 9.8%，较一季度回落 0.4 个百分点。二季度规模以上工业增加值同比增速 6.6%，较一季度回落 0.2 个百分点，其中 6 月份同比增速 6.0%，较 5 月份大幅下滑 0.8 个百分点。2018 年 6 月份中国制造业采购经理指数（PMI）为 51.5%，比上月回落 0.4 个百分点。二季度以来社会融资大幅下滑，经济下行压力加大，央行定向降准，货币政策逐步转向中性偏松。人民币对美元即期汇率在一季度保持升值态势，二季度伴随实体经济下行风险的增加，叠加中美贸易摩擦升级的影响，人民币汇率贬值预期增强，在半年末一度出现快速贬值态势，在岸和离岸美元对人民币即期汇率均贬至 6.6 以上。资本市场方面，上半年 A 股市场在经历了年初的快速上涨后转为颓势，面临去杠杆、财政及金融环境收紧、贸易摩擦、人民币贬值、债券信用风险暴露速度加快、股权质押等风险因素影响，上半年上证综指以下跌 13.90% 收官；在市场风格方面，大小盘齐跌，上证 50 指数、沪深 300 指数、创业板综指分别下跌 13.30%、12.90%、11.92%；行业方面，休闲服务、医药生物、食品饮料等板块涨幅居前，通信、电气设备、机械设备、有色金属、建筑装饰、国防军工等板块跌幅较大。本基金是易方达沪深 300ETF 的联接基金，作为被动型指数基金，报告期内本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深 300 指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1953 元，本报告期份额净值增长率为-11.32%，同期业绩比较基准收益率为-12.25%，日跟踪偏离度的均值为 0.02%，年化跟踪误差为 0.507%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中美贸易争端叠加全球经济复苏放缓将对出口带来冲击、房地产市场降温对经济增长的负面影响以及宏观政策与改革力图稳增长依然是影响未来 A 股市场最值得关注的因素。内外部环境可能使得下半年宏观政策更加注重增长平稳、提振内需，为改革创造稳定环境。货币政策为了实现全年中性的目标会有更加灵活的空间，财政政策也可能会更加积极。从海外因素来看，中美贸易摩擦依然存在升级风险，但市场对中国出口到美国的商品关税提升已有一定的预期，未来市场反应上可能会逐步钝化；政策协调性增加后经济企稳预期的提升也将有助于缓和人民币汇率的波动。考虑到政策潜在的灵活性及新经济的韧性，在宏观政策的“预调微调”下，下半年经济仍然有望实现平稳增长。如果未来货币政策适度并使物价水平不出现大的波动，同时各项改革措施稳步推进的背景下，考虑到当前 A 股市场整体估值水平仍偏低，未来 A 股市场的机会仍将大于风险。从长期来看改革与创新仍然值得期待，中国新老经济的结构转换仍在深化中，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必悲观。通过资本市场把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业升级，改善上市公司业绩，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

报告截止日：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	170,072,989.41	169,444,647.98
结算备付金		1,232,179.13	981,356.89
存出保证金		189,588.10	49,897.79
交易性金融资产	6.4.7.2	3,781,562,489.33	4,029,324,526.67
其中：股票投资		65,403,375.09	65,977,463.54
基金投资		3,666,144,114.24	3,913,606,063.16
债券投资		50,015,000.00	49,740,999.97
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		12,686.52	-
应收利息	6.4.7.5	1,698,844.43	814,053.19
应收股利		-	-
应收申购款		5,219,521.30	2,979,525.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	567,652.40	-
资产总计		3,960,555,950.62	4,203,594,008.15
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		10,926,009.40	-
应付赎回款		4,180,928.43	2,598,259.00
应付管理人报酬		46,738.12	48,723.91
应付托管费		23,369.09	24,361.98
应付销售服务费		328,767.21	356,867.43
应付交易费用	6.4.7.7	265,254.46	26,433.24
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	380,713.02	346,821.06
负债合计		16,151,779.73	3,401,466.62

所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,300,011,117.15	3,116,211,051.13
未分配利润	6.4.7.10	644,393,053.74	1,083,981,490.40
所有者权益合计		3,944,404,170.89	4,200,192,541.53
负债和所有者权益总计		3,960,555,950.62	4,203,594,008.15

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1953 元，基金份额总额 3,300,011,117.15 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：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		-480,845,464.55	410,864,568.67
1.利息收入		1,570,555.17	1,135,153.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	682,904.89	498,418.68
债券利息收入		887,650.28	636,734.38
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）		84,804,622.48	17,727,084.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,558,233.24	5,748,632.96
基金投资收益	6.4.7.13	81,583,328.51	11,146,112.23
债券投资收益	6.4.7.14	1,270.15	3,979.41
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	661,790.58	828,359.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-568,221,874.94	391,650,873.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,001,232.74	351,457.71
减：二、费用		3,826,340.37	2,565,456.58
1. 管理人报酬		300,399.30	290,224.00
2. 托管费		150,199.70	145,112.02
3. 销售服务费		2,101,314.70	1,875,713.55
4. 交易费用	6.4.7.19	1,069,171.28	61,880.98
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		10,389.44	-
7. 其他费用	6.4.7.20	194,865.95	192,526.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-484,671,804.92	408,299,112.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-484,671,804.92	408,299,112.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：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）	3,116,211,051.13	1,083,981,490.40	4,200,192,541.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-484,671,804.92	-484,671,804.92
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）	183,800,066.02	45,083,368.26	228,883,434.28
其中：1.基金申购款	948,362,197.73	308,980,912.18	1,257,343,109.91
2.基金赎回款	-764,562,131.71	-263,897,543.92	-1,028,459,675.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,300,011,117.15	644,393,053.74	3,944,404,170.89
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）	3,360,206,659.76	333,434,911.02	3,693,641,570.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	408,299,112.09	408,299,112.09
三、本期基金份额交易产	-127,338,394.27	-20,530,502.73	-147,868,897.00

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	294,179,868.93	43,796,970.32	337,976,839.25
2.基金赎回款	-421,518,263.20	-64,327,473.05	-485,845,736.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,232,868,265.49	721,203,520.38	3,954,071,785.87

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会（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》、《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]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。

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。金融商品转让, 按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票 (不包括限售股)、债券、基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价 (2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股

票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。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。存款利息收入不征收增值税。

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

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

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

(5) 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	170,072,989.41
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	170,072,989.41

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	67,990,187.71	65,403,375.09	-2,586,812.62

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	49,846,700.00	50,015,000.00	168,300.00
	合计	49,846,700.00	50,015,000.00	168,300.00
资产支持证券		-	-	-
基金		3,417,738,033.85	3,666,144,114.24	248,406,080.39
其他		-	-	-
合计		3,535,574,921.56	3,781,562,489.33	245,987,567.77

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	30,863.97
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	506.43
应收债券利息	1,667,397.26
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	76.77
合计	1,698,844.43

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	567,652.40
待摊费用	-
合计	567,652.40

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	265,254.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	265,254.46

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	12,109.71
预提费用	368,603.31
合计	380,713.02

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	3,116,211,051.13	3,116,211,051.13
本期申购	948,362,197.73	948,362,197.73
本期赎回（以“-”号填列）	-764,562,131.71	-764,562,131.71
本期末	3,300,011,117.15	3,300,011,117.15

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	991,397,010.01	92,584,480.39	1,083,981,490.40
本期利润	83,550,070.02	-568,221,874.94	-484,671,804.92
本期基金份额交易产生的变动数	60,913,843.57	-15,830,475.31	45,083,368.26
其中：基金申购款	315,706,702.80	-6,725,790.62	308,980,912.18
基金赎回款	-254,792,859.23	-9,104,684.69	-263,897,543.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,135,860,923.60	-491,467,869.86	644,393,053.74

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	667,305.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,606.05
其他	993.61
合计	682,904.89

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,874,137.79
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-1,315,904.55
合计	2,558,233.24

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	284,152,356.03
减：卖出股票成本总额	280,278,218.24
买卖股票差价收入	3,874,137.79

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	646,180,800.00
减：现金支付申购款总额	215,339,286.22
减：申购股票成本总额	432,157,418.33
申购差价收入	-1,315,904.55

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	442,784,466.41
减：卖出/赎回基金成本总额	361,201,137.90
基金投资收益	81,583,328.51

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,176.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,899.90
减：应收利息总额	6.69
买卖债券差价收入	1,270.15

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	661,790.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	661,790.58

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	-568,221,874.94
——股票投资	-11,919,509.83
——债券投资	280,000.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-556,582,365.11
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-568,221,874.94

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	1,001,232.74
其他	-
合计	1,001,232.74

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	1,035,048.05
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	34,123.23
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	34,123.23
合计	1,069,171.28

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	7,662.64
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	194,865.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	300,399.30	290,224.00
其中：支付销售机构的客户维护费	477,909.74	425,641.72

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

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

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

2.客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的客户维护费

E 为前一日代销机构保有该基金份额的基金资产净值

R 为代销机构的客户维护费率

对于非工作日，则按照前一工作日的保有资产市值计算当日客户维护费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	150,199.70	145,112.02

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	1,192,308.59
中国建设银行	173,089.91
广发证券	4,875.51
合计	1,370,274.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	1,031,836.98
中国建设银行	178,617.90
广发证券	6,260.11
合计	1,216,714.99

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

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

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
易方达海外投资（深圳）有限公司	1,038,656.96	0.03%	1,038,656.96	0.03%

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	170,072,989.41	667,305.23	86,238,126.25	285,076.59
-------------	----------------	------------	---------------	------------

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	600089	特变电工	配股发行	4,860	34,846.20
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,206	30,089.70

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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 2,436,785,719 份和 2,287,454,593 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 94.95%和 96.10%。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

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
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.20	2018-07-17	5.26	600	3,930.82	3,120.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	4.87	-	-	40,050	180,144.04	195,043.50	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项停牌	21.46	-	-	2,300	44,749.00	49,358.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	38.03	-	-	4,500	306,868.91	171,135.00	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大事项停牌	3.23	2018-07-20	2.91	100,200	325,650.00	323,646.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.59	-	-	42,500	620,075.00	620,075.00	-
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大事项停牌	6.62	-	-	12,300	71,974.56	81,426.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

于 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	51,682,397.26	50,514,753.42
合计	51,682,397.26	50,514,753.42

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	6,000.15
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	6,000.15

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	170,072,989.41	-	-	-	170,072,989.41
结算备付金	1,232,179.13	-	-	-	1,232,179.13
存出保证金	189,588.10	-	-	-	189,588.10

交易性金融资产	50,015,000.00	-	-	3,731,547,489.33	3,781,562,489.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	12,686.52	12,686.52
应收利息	-	-	-	1,698,844.43	1,698,844.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,219,521.30	5,219,521.30
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	567,652.40	567,652.40
资产总计	221,509,756.64	-	-	3,739,046,193.98	3,960,555,950.62
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	-	-	-	10,926,009.40	10,926,009.40
应付赎回款	-	-	-	4,180,928.43	4,180,928.43
应付管理人报酬	-	-	-	46,738.12	46,738.12
应付托管费	-	-	-	23,369.09	23,369.09
应付销售服务费	-	-	-	328,767.21	328,767.21
应付交易费用	-	-	-	265,254.46	265,254.46
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	380,713.02	380,713.02
负债总计	-	-	-	16,151,779.73	16,151,779.73
利率敏感度缺口	221,509,756.64	-	-	3,722,894,414.25	3,944,404,170.89
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	169,444,647.98	-	-	-	169,444,647.98
结算备付金	981,356.89	-	-	-	981,356.89
存出保证金	49,897.79	-	-	-	49,897.79
交易性金融资产	49,735,000.00	-	5,999.97	3,979,583,526.70	4,029,324,526.67
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	-	-	-	814,053.19	814,053.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,979,525.63	2,979,525.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	220,210,902.66	-	5,999.97	3,983,377,105.52	4,203,594,008.15
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,598,259.00	2,598,259.00
应付管理人报酬	-	-	-	48,723.91	48,723.91
应付托管费	-	-	-	24,361.98	24,361.98
应付销售服务费	-	-	-	356,867.43	356,867.43
应付交易费用	-	-	-	26,433.24	26,433.24
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	346,821.06	346,821.06
负债总计	-	-	-	3,401,466.62	3,401,466.62
利率敏感度缺口	220,210,902.66	-	5,999.97	3,979,975,638.90	4,200,192,541.53

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	8,889.98	68,872.40
2. 市场利率上升 25 个基点	-8,886.82	-68,682.18	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	65,403,375.09	1.66	65,977,463.54	1.57
交易性金融资产—基金投资	3,666,144,114.24	92.95	3,913,606,063.16	93.18
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,731,547,489.33	94.60	3,979,583,526.70	94.75

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	上年度末
		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	183,878,878.41	197,726,113.81
2.业绩比较基准下降 5%	-183,878,878.41	-197,726,113.81	

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 3,730,103,685.83 元，属于第二层次的余额为 51,458,803.50 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 3,977,336,944.47 元，第二层次 51,895,834.20 元，第三层次 91,748.00 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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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	65,403,375.09	1.65
	其中：股票	65,403,375.09	1.65
2	基金投资	3,666,144,114.24	92.57
3	固定收益投资	50,015,000.00	1.26
	其中：债券	50,015,000.00	1.26
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	171,305,168.54	4.33
8	其他各项资产	7,688,292.75	0.19
9	合计	3,960,555,950.62	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产
----	------	------	------	-----	------	-------

						净值比例 (%)
1	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)、发起式	易方达基金管理有限公司	3,666,144,114.24	92.95

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	81,426.00	0.00
B	采矿业	2,932,431.28	0.07
C	制造业	21,282,512.20	0.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,537,456.85	0.06
E	建筑业	2,437,795.20	0.06
F	批发和零售业	1,041,959.85	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,829,028.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,489,234.90	0.04
J	金融业	27,271,101.57	0.69
K	房地产业	2,376,400.10	0.06
L	租赁和商务服务业	702,839.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	339,964.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	65,403,375.09	1.66

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
1	601318	中国平安	94,900	5,559,242.00	0.14
2	600519	贵州茅台	4,449	3,254,265.54	0.08
3	600036	招商银行	98,600	2,606,984.00	0.07
4	601166	兴业银行	109,100	1,571,040.00	0.04
5	600887	伊利股份	53,200	1,484,280.00	0.04
6	600276	恒瑞医药	19,380	1,468,228.80	0.04
7	600016	民生银行	207,000	1,449,000.00	0.04
8	601328	交通银行	240,500	1,380,470.00	0.03
9	600030	中信证券	74,100	1,227,837.00	0.03
10	601398	工商银行	230,200	1,224,664.00	0.03
11	601288	农业银行	334,600	1,151,024.00	0.03
12	600104	上汽集团	30,700	1,074,193.00	0.03
13	601668	中国建筑	183,880	1,003,984.80	0.03
14	600000	浦发银行	102,769	982,471.64	0.02
15	600900	长江电力	57,800	932,892.00	0.02
16	601601	中国太保	27,600	879,060.00	0.02
17	601169	北京银行	129,556	781,222.68	0.02
18	600048	保利地产	62,300	760,060.00	0.02
19	600837	海通证券	80,031	757,893.57	0.02
20	601988	中国银行	184,500	666,045.00	0.02
21	600309	万华化学	14,400	654,048.00	0.02
22	600485	信威集团	42,500	620,075.00	0.02
23	600690	青岛海尔	32,100	618,246.00	0.02
24	600019	宝钢股份	78,020	607,775.80	0.02
25	600518	康美药业	26,200	599,456.00	0.02
26	600028	中国石化	92,000	597,080.00	0.02
27	600585	海螺水泥	17,600	589,248.00	0.01
28	601888	中国国旅	8,600	553,926.00	0.01
29	601229	上海银行	34,190	538,834.40	0.01
30	603288	海天味业	7,100	522,844.00	0.01
31	601688	华泰证券	34,500	516,465.00	0.01
32	601818	光大银行	139,400	510,204.00	0.01
33	601766	中国中车	63,900	492,030.00	0.01
34	601211	国泰君安	32,900	484,946.00	0.01
35	600009	上海机场	8,500	471,580.00	0.01
36	601857	中国石油	56,700	437,157.00	0.01
37	601006	大秦铁路	52,100	427,741.00	0.01

38	600015	华夏银行	56,140	418,243.00	0.01
39	600703	三安光电	21,460	412,461.20	0.01
40	601009	南京银行	52,044	402,300.12	0.01
41	600050	中国联通	81,500	400,980.00	0.01
42	600919	江苏银行	60,700	389,087.00	0.01
43	600196	复星医药	8,900	368,371.00	0.01
44	600031	三一重工	40,500	363,285.00	0.01
45	600999	招商证券	26,400	361,152.00	0.01
46	601186	中国铁建	40,300	347,386.00	0.01
47	601088	中国神华	17,400	346,956.00	0.01
48	601628	中国人寿	14,600	328,792.00	0.01
49	601899	紫金矿业	90,900	328,149.00	0.01
50	600741	华域汽车	13,800	327,336.00	0.01
51	600221	海航控股	100,200	323,646.00	0.01
52	601989	中国重工	80,100	323,604.00	0.01
53	601336	新华保险	7,400	317,312.00	0.01
54	600660	福耀玻璃	12,300	316,233.00	0.01
55	603799	华友钴业	3,200	311,904.00	0.01
56	600436	片仔癀	2,700	302,211.00	0.01
57	600867	通化东宝	12,600	302,022.00	0.01
58	601225	陕西煤业	35,100	288,522.00	0.01
59	600958	东方证券	31,400	286,682.00	0.01
60	601012	隆基股份	17,160	286,400.40	0.01
61	600352	浙江龙盛	22,800	272,460.00	0.01
62	600795	国电电力	103,200	270,384.00	0.01
63	600340	华夏幸福	10,400	267,800.00	0.01
64	600029	南方航空	30,800	260,260.00	0.01
65	600886	国投电力	35,700	259,539.00	0.01
66	600487	亨通光电	11,760	259,308.00	0.01
67	601933	永辉超市	33,600	256,704.00	0.01
68	600406	国电南瑞	16,100	254,380.00	0.01
69	601155	新城控股	8,000	247,760.00	0.01
70	600271	航天信息	9,800	247,646.00	0.01
71	601901	方正证券	36,100	241,509.00	0.01
72	601607	上海医药	10,100	241,390.00	0.01
73	600011	华能国际	36,800	234,048.00	0.01
74	600570	恒生电子	4,400	232,980.00	0.01
75	601111	中国国航	26,200	232,918.00	0.01
76	601985	中国核电	40,900	231,085.00	0.01
77	600516	方大炭素	9,400	229,172.00	0.01
78	600115	东方航空	34,400	227,728.00	0.01
79	600089	特变电工	32,560	225,640.80	0.01
80	600066	宇通客车	11,700	224,523.00	0.01
81	601600	中国铝业	57,600	221,184.00	0.01

82	600111	北方稀土	19,100	217,358.00	0.01
83	601669	中国电建	40,202	215,482.72	0.01
84	601377	兴业证券	40,700	214,489.00	0.01
85	600606	绿地控股	32,000	209,280.00	0.01
86	600535	天士力	8,020	207,076.40	0.01
87	600588	用友网络	8,390	205,638.90	0.01
88	600383	金地集团	19,800	201,762.00	0.01
89	600398	海澜之家	15,800	201,292.00	0.01
90	000540	中天金融	40,050	195,043.50	0.00
91	600332	白云山	5,000	190,250.00	0.00
92	600522	中天科技	21,500	189,415.00	0.00
93	600176	中国巨石	18,400	188,232.00	0.00
94	601788	光大证券	17,100	187,758.00	0.00
95	600010	包钢股份	119,720	185,566.00	0.00
96	600705	中航资本	39,300	183,531.00	0.00
97	600893	航发动力	7,900	176,328.00	0.00
98	600637	东方明珠	11,600	174,696.00	0.00
99	600068	葛洲坝	24,200	174,482.00	0.00
100	600085	同仁堂	4,900	172,872.00	0.00
101	002739	万达电影	4,500	171,135.00	0.00
102	601877	正泰电器	7,600	169,632.00	0.00
103	600177	雅戈尔	22,020	169,554.00	0.00
104	600674	川投能源	19,300	168,296.00	0.00
105	601998	中信银行	26,900	167,049.00	0.00
106	600023	浙能电力	35,800	166,828.00	0.00
107	601919	中远海控	33,500	164,820.00	0.00
108	600739	辽宁成大	10,800	163,944.00	0.00
109	600547	山东黄金	6,600	157,872.00	0.00
110	601198	东兴证券	12,100	157,784.00	0.00
111	600018	上港集团	26,400	157,344.00	0.00
112	601618	中国中冶	46,900	156,177.00	0.00
113	603833	欧派家居	1,200	153,036.00	0.00
114	601800	中国交建	13,400	152,626.00	0.00
115	600804	鹏博士	12,600	151,200.00	0.00
116	601997	贵阳银行	12,100	149,556.00	0.00
117	601018	宁波港	34,600	145,666.00	0.00
118	600809	山西汾酒	2,300	144,647.00	0.00
119	600362	江西铜业	9,100	144,235.00	0.00
120	601555	东吴证券	21,100	144,113.00	0.00
121	600208	新潮中宝	37,700	144,014.00	0.00
122	600926	杭州银行	12,900	143,061.00	0.00
123	601099	太平洋	59,700	139,698.00	0.00
124	600816	安信信托	19,184	138,892.16	0.00
125	600100	同方股份	15,600	136,968.00	0.00

126	600482	中国动力	7,600	132,620.00	0.00
127	600109	国金证券	18,600	132,246.00	0.00
128	600219	南山铝业	48,600	131,706.00	0.00
129	603858	步长制药	3,000	128,370.00	0.00
130	603993	洛阳钼业	20,100	126,429.00	0.00
131	601333	广深铁路	29,700	126,225.00	0.00
132	600297	广汇汽车	21,470	125,814.20	0.00
133	600498	烽火通信	4,900	121,765.00	0.00
134	600170	上海建工	39,017	118,611.68	0.00
135	600438	通威股份	17,000	117,300.00	0.00
136	601117	中国化学	17,300	116,429.00	0.00
137	600549	厦门钨业	7,450	113,091.00	0.00
138	600153	建发股份	12,500	112,375.00	0.00
139	600977	中国电影	6,600	105,864.00	0.00
140	601633	长城汽车	10,600	104,092.00	0.00
141	600038	中直股份	2,600	103,974.00	0.00
142	600489	中金黄金	15,104	103,009.28	0.00
143	600415	小商品城	23,900	103,009.00	0.00
144	600583	海油工程	19,400	102,044.00	0.00
145	600188	兖州煤业	7,800	101,712.00	0.00
146	600663	陆家嘴	6,440	101,687.60	0.00
147	601216	君正集团	29,600	99,752.00	0.00
148	600118	中国卫星	5,200	99,320.00	0.00
149	600346	恒力股份	6,700	98,222.00	0.00
150	600820	隧道股份	16,600	98,106.00	0.00
151	600157	永泰能源	54,400	96,832.00	0.00
152	601992	金隅集团	29,200	95,776.00	0.00
153	600369	西南证券	24,800	95,480.00	0.00
154	601228	广州港	16,300	94,703.00	0.00
155	601881	中国银河	11,300	91,869.00	0.00
156	600909	华安证券	15,900	90,948.00	0.00
157	600008	首创股份	21,100	89,042.00	0.00
158	601021	春秋航空	2,500	87,575.00	0.00
159	601118	海南橡胶	12,300	81,426.00	0.00
160	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
161	600376	首开股份	11,300	79,439.00	0.00
162	600704	物产中大	15,155	79,260.65	0.00
163	601898	中煤能源	16,100	77,763.00	0.00
164	600688	上海石化	12,900	73,401.00	0.00
165	600959	江苏有线	13,600	69,360.00	0.00
166	601866	中远海发	27,800	69,222.00	0.00
167	600061	国投资本	7,400	68,672.00	0.00
168	600339	中油工程	14,700	66,003.00	0.00
169	601991	大唐发电	21,700	65,751.00	0.00

170	601238	广汽集团	5,700	63,498.00	0.00
171	600373	中文传媒	4,900	62,965.00	0.00
172	600682	南京新百	3,800	62,472.00	0.00
173	601718	际华集团	15,400	61,908.00	0.00
174	600372	中航电子	4,700	61,382.00	0.00
175	601611	中国核建	6,900	54,510.00	0.00
176	601958	金钼股份	8,500	53,295.00	0.00
177	603160	汇顶科技	800	51,912.00	0.00
178	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
179	601808	中海油服	5,200	49,608.00	0.00
180	002252	上海莱士	2,300	49,358.00	0.00
181	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
182	600025	华能水电	15,800	48,032.00	0.00
183	601828	美凯龙	2,800	42,784.00	0.00
184	600233	圆通速递	3,000	39,600.00	0.00
185	601108	财通证券	3,500	39,480.00	0.00
186	600390	五矿资本	4,600	35,650.00	0.00
187	601838	成都银行	3,500	30,625.00	0.00
188	601212	白银有色	7,400	30,266.00	0.00
189	601878	浙商证券	3,300	27,720.00	0.00
190	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
191	002601	龙鳞佰利	1,700	21,981.00	0.00
192	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
193	000415	渤海金控	600	3,120.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	42,694,388.38	1.02
2	600036	招商银行	19,516,036.10	0.46
3	600519	贵州茅台	18,370,569.05	0.44
4	601166	兴业银行	12,758,349.00	0.30
5	600016	民生银行	11,575,542.25	0.28
6	600887	伊利股份	10,972,543.65	0.26
7	601328	交通银行	10,625,195.00	0.25
8	601398	工商银行	9,225,449.00	0.22
9	601288	农业银行	9,163,744.00	0.22
10	600030	中信证券	9,048,782.72	0.22

11	600000	浦发银行	8,395,113.66	0.20
12	601668	中国建筑	8,042,131.00	0.19
13	600276	恒瑞医药	7,909,085.32	0.19
14	600104	上汽集团	7,116,165.75	0.17
15	601601	中国太保	7,095,889.84	0.17
16	600900	长江电力	6,529,039.75	0.16
17	600048	保利地产	6,265,079.00	0.15
18	601169	北京银行	6,143,213.67	0.15
19	600837	海通证券	6,085,195.00	0.14
20	601988	中国银行	5,160,421.00	0.12

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

7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	25,919,038.50	0.62
2	600519	贵州茅台	11,980,376.46	0.29
3	600036	招商银行	11,653,392.60	0.28
4	601166	兴业银行	7,303,885.00	0.17
5	600016	民生银行	6,649,193.00	0.16
6	600887	伊利股份	6,237,306.11	0.15
7	601328	交通银行	5,958,017.73	0.14
8	600030	中信证券	5,593,584.13	0.13
9	601398	工商银行	5,562,292.00	0.13
10	601288	农业银行	5,246,139.00	0.12
11	600276	恒瑞医药	4,856,196.55	0.12
12	600000	浦发银行	4,845,130.16	0.12
13	601668	中国建筑	4,564,967.00	0.11
14	600104	上汽集团	4,214,392.86	0.10
15	601601	中国太保	3,994,861.00	0.10
16	600837	海通证券	3,742,849.32	0.09
17	600900	长江电力	3,677,019.27	0.09
18	601169	北京银行	3,575,626.96	0.09
19	600048	保利地产	3,403,452.97	0.08
20	601988	中国银行	2,934,407.00	0.07

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

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	470,905,597.95
卖出股票收入（成交）总额	284,152,356.03

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

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,015,000.00	1.27
	其中：政策性金融债	50,015,000.00	1.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,015,000.00	1.27

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170410	17 农发 10	500,000	50,015,000.00	1.27

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 2018 年 3 月 26 日，中国人民银行福州中心支行针对兴业银行股份有限公司违反国库管理规定的违法行为，给予警告并处罚款 5 万元人民币。

2018 年 4 月 19 日，中国银保监会针对兴业银行的如下事由罚款 5870 万元：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。

2018 年 2 月 12 日，中国银监会针对招商银行的如下事由罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承

兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除兴业银行、招商银行外，本基金的目标 ETF 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。除兴业银行、招商银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	189,588.10
2	应收证券清算款	12,686.52
3	应收股利	-
4	应收利息	1,698,844.43
5	应收申购款	5,219,521.30
6	其他应收款	567,652.40
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,688,292.75

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
138,019	23,909.83	1,363,232,913.27	41.31%	1,936,778,203.88	58.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	151,433.24	0.0046%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年8月26日）基金份额总额	16,746,252,366.35
本报告期期初基金份额总额	3,116,211,051.13
本报告期基金总申购份额	948,362,197.73
减：本报告期基金总赎回份额	764,562,131.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,300,011,117.15

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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	109,103,212.29	14.47%	87,282.52	12.76%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	593,998,770.62	78.80%	553,235.31	80.88%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	7,788,148.50	1.03%	6,230.55	0.91%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	20,012,585.26	2.65%	16,009.94	2.34%	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	22,870,833.75	3.03%	21,299.49	3.11%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增南京证券股份有限公司一个交易单元，新增长城证券股份有限公司两个交易单元。

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

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

的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	805,209.50	0.87%
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	17,495.40	54.37%	-	-	-	-	92,081,960.18	99.13%
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	14,681.34	45.63%	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
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
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
8	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-02-02
9	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-02-07
10	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-02-10
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加兴业银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-02-28
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兴业银行“钱大掌柜”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	2018-02-28
13	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-07
14	易方达基金管理有限公司关于易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金修订基金合同、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
15	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
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

17	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
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
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
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
21	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
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南洋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	2018-04-19
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加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
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
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
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
27	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2018-06-08
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商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	2018-06-25
29	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
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加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
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2018-06-30

额投资费率优惠活动的公告	理人网站	
--------------	------	--

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01月01日~2018年06月30日	1,206,158,344.25	-	-	1,206,158,344.25	36.55%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日