易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金

2018年第二季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达黄金ETF联接
基金主代码	000307
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月26日
报告期末基金份额总额	845,217,542.60份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于目标ETF追踪业绩比较基准的表现, 力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内, 年化跟踪误差控制在4%以内。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。在投资运作过程中,本基金将在综合考虑收益、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购、赎回的方式或证券二级市场交易的方式参与易方达黄金ETF交易。为更好地追踪业绩比较基准表现, 当黄金现货实盘合约流动性不足或黄金现货延期交收合约投资成本更低时, 本基金可选当投资于黄金现货延期交收合约。
业绩比较基准	投上海黄金交易所Au(99.99)现货实盘合约收盘价计算的收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为易方达黄金ETF的联接基金。长期来看, 本基金具有与目标ETF及其所代表的国内黄金现货品种的风险收益类似的风险收益特征。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达黄金ETF联接A / 易方达黄金ETF联接C
下属分级基金的交易代码	000307 / 002963
报告期末下属分级基金的份额总额	772,425,619.43份 / 72,791,923.17份

注:自2016年7月1日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2016年7月5日。

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达黄金交易型开放式证券投资基金
基金主代码	159934
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2013年11月29日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年12月16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	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产净值的95%。为紧密追踪业绩比较基准的表现, 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。当黄金现货实盘合约流动性不足或黄金现货延期交收合约投资成本更低时, 本基金可适当投资于黄金现货延期交收合约。为降低基金费用对跟踪偏离度与跟踪误差的影响,本基金可以将持有的黄金现货合约借出给信誉良好的机构, 取得租赁收入。
业绩比较基准	上海黄金交易所Au(99.99)现货实盘合约收盘价
风险收益特征	本基金追踪上海黄金交易所Au(99.99)现货实盘合约收盘价表现,具有与上海黄金交易所Au(99.99)现货实盘合约相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)	
	易方达黄金ETF联接A	易方达黄金ETF联接C
1.本期已实现收益	-3,833,706.27	-583,831.49
2.本期利润	-9,112,723.35	-1,595,087.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0116	-0.0116
4.期末基金资产净值	735,909,118.04	68,961,472.06
5.期末基金份额净值	0.9527	0.9474

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

易方达黄金ETF联接A:

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-1.23%	0.30%	-1.11%	0.30%	-0.12%	0.00%

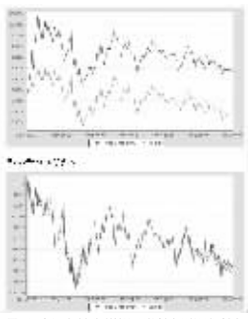
易方达黄金ETF联接C:

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-1.26%	0.30%	-1.11%	0.30%	-0.15%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年5月26日至2018年6月30日)

易方达黄金ETF联接A:



注:1.自2016年7月1日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2016年7月5日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为-4.73%,同期业绩比较基准收益率为3.37%。C类基金份额净值增长率为-7.94%,同期业绩比较基准收益率为-7.32%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
FAN BIN G(范冰)	本基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、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	2017-03-25	-	13年	硕士研究生,曾任皇家加拿大银行托管部核算专员, 美国道富集团Middle Office中台交易支持专员,巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、主管,新加坡金融数据部主管,贝莱德集团金融数据运营部门经理、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“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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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。本基金管理人制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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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27次, 其中26次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易,1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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年二季度,美国与各国的贸易摩擦不断升温,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。一季报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。香港追随美联储加息步伐,香港金管局上调贴现窗基本利率25个基点,至2.25%。欧洲央行决议将在2018年底停止购买债券,但加息“至少要到2019年夏天”。美元指数走强,压制了黄金价格。

作为被动管理型基金,报告期内,本基金紧密跟踪上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约价格,取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为0.9527元,本报告期份额净值增长率为-1.23%;C类基金份额净值为0.9474元,本报告期份额净值增长率为-1.26%;同期业绩比较基准收益率为-1.11%,年化跟踪误差0.166%,在合同规定的目标控制范围之内。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	761,505,781.35	94.27
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	45,784,249.79	5.67
8	其他资产	524,885.98	0.06
9	合计	807,814,917.12	100.00

5.2期末投资目标基金明细

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	易方达黄金交易型开放式证券投资基金	黄金ETF	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	761,505,781.35	94.61

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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。

5.11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。

5.12投资组合报告附注

5.12.1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。

5.12.2本基金本报告期末未持有股票。

5.12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,125.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,668.00
5	应收申购款	516,092.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	524,885.98

5.12.4报告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。

5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达黄金ETF联接A	易方达黄金ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	814,171,493.46	133,280,870.96
本报告期基金总申购份额	47,544,171.99	99,281,566.18
减:本报告期基金总赎回份额	89,290,046.02	159,770,513.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	772,425,619.43	72,791,923.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会注册易方达黄金交易型开放式证券投资基金及其联接基金募集的文件;

2.《易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》;

3.《易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2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。

8.3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
二〇一八年七月十九日

易方达黄金主题证券投资基金(LOF)

2018年第二季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达黄金主题(QDII-LOF-FOF)
场内简称	易基黄金
基金主代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	394,261,775.97份
投资目标	本基金追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要通过对国际黄金价格中长期趋势的判断,深入研究黄金价格趋势、黄金采掘企业盈利和估值水平变化,以及考察其他品种的风险收益特征的基础上,进行黄金ETF、黄金股票类资产以及其他资产的比例配置。
业绩比较基准	以伦敦黄金市场下午定盘价计价的国际现货黄金(经汇率折算)
风险收益特征	基金管理人根据对黄金价格走势的判断,在黄金基金、黄金采掘公司股票及其他资产之间进行主动配置。本基金的表现与黄金价格相关性较高,本基金是预期收益与预期风险较高的基金品种。此外,本基金主要投资海外,存在汇率风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:无
	中文名称:无
境外资产托管人	英文名称:The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文名称:香港上海汇丰银行有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-804,731.91
2.本期利润	3,273,887.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0081
4.期末基金资产净值	273,169,526.79
5.期末基金份额净值	0.693

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。

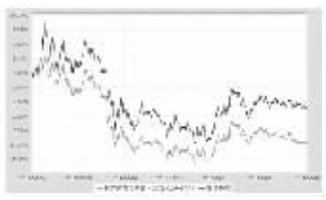
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	1.17%	0.43%	-0.74%	0.46%	1.91%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达黄金主题证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年5月6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-30.70%,同期业绩比较基准收益率为-15.58%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周宇	本基金的基金经理	2017-04-21	-	7年	硕士研究生,曾任古根海姆投资管理公司全球宏观策略师,中国平安人寿保险总部投资管理中心策略经理,上海国泰君安证券资产管理有限公司研究发展部大类资产配置高级研究员。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金没有聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

二季度以来,全球经济同步复苏的趋势出现了分化。在历史罕见的顺周期财政刺激下,美国经济继续保持强劲增长势头,但欧洲、日本、中国与主要新兴市场均出现不同程度的放缓。全球经济增长的分化导致货币政策预期的分化,并推动美元重新走强。而美国税改之后美国跨国公司海外利润的回流与美联储的缩表计划加剧了离岸美元流动性的紧缩。在此背景下,美元与美元资产一枝独秀,非美市场表现不佳。对全球增长与流动性环境最为敏感的新兴市场遭受大幅抛售。而黄金则受美元走强所累继续走低。

本基金在二季度对所持有的非黄金仓位进行了调整, 提高了美股的配置比重, 在美元升值的背景下起到了良好的对冲黄金价格下跌的作用。展望下半年,我们认为尽管贸易战等担忧持续打压风险偏好, 但全球经济增长依然保持强劲,而美联储的加息周期并未结束,利率仍然偏低。总体而言风险资产的表现仍可期待,尤其是经济动能与流动性环境最佳的美股。我们相信继续维持当前的资产配置思路有助于分散基金的投资风险并提升收益。

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0.693元, 本报告期份额净值增长率为1.17%,同期业绩比较基准收益率为-0.74%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	25,091,842.29	8.67
	其中:普通股	25,091,842.29	8.67
	存托凭证	-	-
2	基金投资	233,237,057.11	80.59
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	30,786,292.51	10.64
8	其他资产	305,257.46	0.11
9	合计	289,420,449.37	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	25,091,842.29	9.19
合计	25,091,842.29	9.19

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。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	15,704,271.16	5.75
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	9,387,571.13	3.44
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	25,091,842.29	9.19

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	8,800	4,817,043.60	1.76
2	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	3,800	3,178,839.60	1.16
3	Schlumberger Ltd	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	2,600	1,153,127.81	0.42
4	ConocoPhillips	-	COP US	纽约证券交易所	美国	2,000	921,296.38	0.34
5	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	1,100	906,633.89	0.33
6	Occidental Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	1,500	830,515.63	0.30
7	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	820	609,350.48	0.22
8	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	740	542,685.16	0.20
9	Kinder Morgan Inc/DE	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	4,400	514,427.42	0.19
10	Halliburton Co	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	1,500	447,215.99	0.16

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告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。

5.6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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 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。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	8,800	4,817,043.60	1.76
2	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	3,800	3,178,839.60	1.16
3	Schlumberger Ltd	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	2,600	1,153,127.81	0.42
4	ConocoPhillips	-	COP US	纽约证券交易所	美国	2,000	921,296.38	0.34
5	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	1,100	906,633.89	0.33
6	Occidental Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	1,500	830,515.63	0.30
7	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	820	609,350.48	0.22
8	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	740	542,685.16	0.20
9	Kinder Morgan Inc/DE	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	4,400	514,427.42	0.19
10	Halliburton Co	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	1,500	447,215.99	0.16

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告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。

5.6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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 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。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	GAM Precious Metals - Physical Gold Class USD A	ETF	开放式	GAM Investment Management Switzerland AG	53,636,049.30	19.63
2	ETFS Physical Swiss Gold Share	ETF	开放式	ETF Securities US LLC	53,593,059.20	19.62
3	UBS ETF CH-Gold Class USD A-DIS	ETF	开放式	UBS Fund Management Switzerland AG	28,270,600.73	10.35
4	iShares Gold Trust	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	23,330,813.51	8.54
5	SPDR Gold Shares	ETF	开放式	SSgA Funds Management Inc	23,317,839.94	8.54
6	Vanguard S&P 500 ETF	ETF	开放式	Vanguard Group Inc	13,274,960.15	4.86
7	SPDR S&P 500 ETF Trust	ETF	开放式	SSgA Funds Management Inc	13,256,714.97	4.85
8	iShares Silver Trust	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	9,874,087.49	3.61
9	iShares Russell 2000 ETF	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	8,981,965.22	3.29
10	VanEck Vectors Gold Miners ETF	ETF	开放式	Van Eck Associates Corp	5,701,976.60	2.09

5.10 投资组合报告附注

5.10.1埃克森美孚(XOM)为易方达黄金主题证券投资基金的前十大重仓证券之一。在报告编制日前一年内,埃克森美孚公司因违反乌克兰相关制裁规定被美国财政部海外资产控制办公室处以200万美元的民事罚款。

本基金投资埃克森美孚(XOM)的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除埃克森美孚(XOM)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。

5.10.2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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	144,846.83
4	应收利息	1,169.33
5	应收申购款	159,241.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,257.46

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	409,014,231.90
报告期基金总申购份额	10,794,259.65
减:报告期基金总赎回份额	25,546,715.58
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	394,261,775.97

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达黄金主题证券投资基金(LOF)募集的文件;

2.《易方达黄金主题证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《易方达黄金主题证券投资基金(LOF)托管协议》;

4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2 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。

8.3 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
二〇一八年七月十九日

易方达货币市场基金

2018年第二季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达货币
基金主代码	110006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年2月2日
报告期末基金份额总额	30,153,017,196.73份
投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下,追求超过基准的回报。
投资策略	在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。
业绩比较基准	税后活期存款利率(税活期存款利率×(1-利息税率))
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达货币A / 易方达货币B / 易方达货币E
下属分级基金场内简称	- / - / 易货币
下属分级基金的交易代码	110006 / 110016 / 511800
报告期末下属分级基金的份额总额	1,405,470,528.95份 / 27,956,450,542.26份 / 791,096,125.52份

注:1.易方达货币市场基金E类基金份额上市交易。

2.自2014年11月21日起,易方达货币市场基金增设E类份额类别,基金份额面值为100元,本表所列E类份额数据面值已折算为1元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)		
	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
1.本期已实现收益	12,119,462.38	449,954,772.00	7,886,983.36
2.本期利润	12,119,462.38	449,954,772.00	7,886,983.36
3.期末基金资产净值	1,405,470,528.95	27,956,450,542.26	791,096,125.52

注:1.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	1.17%	0.43%	-0.74%	0.46