易方达增金宝货币市场基金

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:浙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。

基金托管人浙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

基金简称	易方达增金宝货币
基金主代码	001010
交易代码	001010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月20日
报告期末基金份额总额	14,127,234,800.77份
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将对基金资产组合进行积极管理,在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,按照风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司

§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	306,634,291.84
2.本期利润	306,634,291.84
3.期末基金资产净值	14,127,234,800.77

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

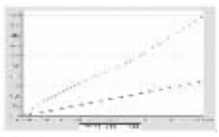
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0647%	0.0010%	0.3418%	0.0000%	0.7129%	0.0010%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达增金宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年1月20日至2018年6月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值收益率为13.8977%,同期业绩比较基准收益率为4.8305%。

§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		
梁莹	本基金的基金经理、易方达掌柜季季金理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型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	2015-01-20	-	8年	硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员,易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金投资部助理,易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2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

二季度债券市场回暖,整个季度来看各期限收益率显著下行。4月份经济数据回落、央行降准操作、资管新规即将落地等内部利好因素持续发酵,加之中美贸易摩擦、叙利亚问题等外部因素令风险资产持续承压,债券市场收益率在4月下行显著。5月份债券市场多空因素交织,一方面信用债违约事件频发、海外债券市场收益率一度走高、部分经济数据反弹使得国内债券市场利率出现短期调整;另一方面中美贸易摩擦风波不断,对于经济下行的预期使得风险偏好持续被抑制,海外债券市场收益率的回落令国内债券市场情绪好转,5月国内市场收益率整体短升长降。6月份流动性整体平稳,经济下行压力得到确认,贸易摩擦及股市下挫带动避险情绪使得债市继续走强,月内无风险收益率大幅回落。货币市场收益率在二季度震荡下行,资金面总体平稳。

操作方面,报告期内基金以同业存单、短期存款和短期逆回购为主要配置资产。根据组合的负债端结构,二季度组合保持了适中的剩余期限和杠杆率。总体来看,组合在二季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额净值收益率为1.0547%;同期业绩比较基准收益率为0.3418%。

§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	固定收益投资	6,083,998,256.01	38.61
	其中:债券	6,083,998,256.01	38.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,578,285,018.33	22.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,882,596,501.58	37.33
4	其他资产	212,338,449.49	1.35
5	合计	15,757,217,225.41	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6.98
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,614,473,135.69	11.43
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	38.35	11.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	1.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	42.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	8.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	20.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.91	11.43

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	228,822,227.31	1.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	567,499,888.80	4.02
	其中:政策性金融债	567,499,888.80	4.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,036,206,360.18	7.33
6	中期票据	90,041,588.92	0.64
7	同业存单	4,161,428,190.80	29.46
8	其他	-	-
9	合计	6,083,998,256.01	43.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111803114	18农业银行CD114	6,000,000	595,237,527.98	4.21
2	111781410	17南京银行CD141	5,500,000	548,828,569.24	3.88
3	111807132	18招商银行CD132	5,000,000	494,161,380.89	3.50
4	111808158	18中信银行CD158	4,000,000	395,805,996.55	2.80
5	111815262	18民生银行CD262	4,000,000	395,606,389.06	2.80
6	111808163	18中信银行CD163	4,000,000	395,289,171.73	2.80
7	111712153	17北京银行CD153	3,000,000	299,290,895.07	2.12
8	111809081	18浦发银行CD081	3,000,000	296,871,719.34	2.10
9	111818158	18华夏银行CD158	3,000,000	296,715,937.88	2.10
10	011800740	18津渤海SCP002	2,500,000	248,582,794.32	1.76

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1725%
报告期内偏离度的最低值	0.0537%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0934%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.9.218中信银行CD158(代码:111808158)、18中信银行CD163(代码:111808163)为易方达增金宝货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月29日,中国保监会针对中信银行股份有限公司信用卡中心存在电话销售欺骗投保人的违法行为,处以人民币12万元行政罚款。

17北京银行CD153(代码:111712153)为易方达增金宝货币市场基金的前十大持仓证券。2017年8月8日,北京银监局针对北京银行未经核准提前授权部分人员实际履行高管人员职责,责令北京银行改正,并对其给予100万元罚款的行政处罚。

18浦发银行CD081(代码:111809081)为易方达增金宝货币市场基金的前十大持仓证券。根据上海浦东发展银行股份有限公司董事会2018年1月19日发布的《关于成都分行处罚事项的公告》,四川银监局对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,并执行罚款46,175万元人民币。2018年2月12日,中国银监会针对上海浦东发展银行股份有限公司的如下事由罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;(三)通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节;(四)理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求;(五)提供不实说明材料、不配合调查取证;(六)以贷转存,虚增存贷款;(七)票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严;(八)国内信用证业务贸易背景审查不严;(九)贷款管理严重缺失,导致大额不良贷款;(十)违规通过同业投资转存款方式,虚增存款;(十一)票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理;(十二)对代理收付资金的信托计划提供保本承诺;(十三)以存放同业业务名义开办委托定向投资业务,并少计风险资产;(十四)投资多款同业理财产品未尽职审查,涉及金额较大;(十五)修改总行理财合同标准文本,导致理财资金实际投向与合同约定不符;(十六)为非保本理财产品出具保本承诺函;(十七)票据贴现业务,但未提供实质性服务,明显质价不符;(十九)收费超过服务价格目录,向客户转嫁成本。2018年3月19日,上海银监局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心2016年至2017年部分信用卡现金分期资金被用于证券交易,2015年至2017年部分信用卡分期资金被用于非消费领域,严重违反审慎经营规则的违法违规事实,责令改正,罚没合计人民币1751651.7元。

18招商银行CD132(代码:111807132)为易方达增金宝货币市场基金的前十大持仓证券。2018年2月12日,中国银监会针对招商银行股份有限公司的如下事由罚款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。

17南京银行CD141(代码:111781410)为易方达增金宝货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月9日,人民银行南京分行营业管理部针对南京银行的如下事由对南京银行给予警告并处罚款人民币30万元:(一)下属支行作为异地存款银行的开户银行,涉及47户银行同业账户;(二)未见存款银行经营范围批准文件,涉及48户银行同业账户;(三)未采取多种措施对开户证明文件的真实性、完整性和合规性以及存款银行开户意愿真实性进行审核,涉及48户银行同业账户;(四)对账地址(联系地址)不是存款银行经营所在地或工商注册地址,涉及34户银行同业账户;(五)未执行开户生效日制度,涉及1户银行同业账户;(六)未执行久悬制度,涉及6户银行同业账户。2018年1月9日,江苏银监局针对南京银行股份有限公司镇江分行违法违规办理票据业务,严重违反审慎经营规则的违法违规事实处以人民币3230万元的行政处罚。

本基金投资18中信银行CD158、18中信银行CD163、17北京银行CD153、18浦发银行CD081、18招商银行CD132、17南京银行CD141的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除18中信银行CD158、18中信银行CD163、17北京银行CD153、18浦发银行CD081、18招商银行CD132、17南京银行CD141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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	123,423,714.38
3	应收利息	88,660,711.61
4	应收申购款	253,633.50
5	其他应收款	390.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	212,338,449.49

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	33,431,560,901.64
报告期基金总申购份额	49,617,980,766.51
报告期基金总赎回份额	68,922,306,867.38
报告期期末基金份额总额	14,127,234,800.77

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2018-04-16	68,696.50	68,696.50	-
2	红利再投资	2018-05-15	61,354.30	61,354.30	-
3	红利再投资	2018-06-15	64,259.81	64,259.81	-
合计			194,310.61	194,310.61	

§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增金宝货币市场基金募集的文件;

2.《易方达增金宝货币市场基金基金合同》;

3.《易方达增金宝货币市场基金托管协议》;

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

易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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

基金简称	易方达中证海外中国互联网50(QDII-ETF)
基金主代码	513050
交易代码	513050
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2017年1月4日
报告期末基金份额总额	741,432,720.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	作为追踪中证海外中国互联网50指数的被动式海外指数基金,本基金主要采取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。
业绩比较基准	中证海外中国互联网50指数
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。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
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	36,672,847.26
2.本期利润	58,335,931.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0687
4.期末基金资产净值	1,106,408,452.14
5.期末基金份额净值	1.4923

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。

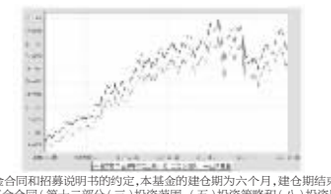
3.2 基金净值表现

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	3.91%	1.42%	4.14%	1.32%	-0.23%	0.10%

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

易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金
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
(2017年1月4日至2018年6月30日)



注:1.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(第十二部分(三)投资范围,(五)投资策略和(八)投资限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为49.23%,同期业绩比较基准收益率为59.80%。

§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		
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	2017-01-04	-	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。
FAN BING(范冰)	本基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达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,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员、易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金投资部助理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。

注:1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期,余海燕的“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。

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 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

回顾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。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”。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。国内CDR上市的相关法规出台,几只战略投资基金也相继发行。主要中概股公司一季报业绩亮眼,但是受宏观因素以及资金流出新兴市场的影响,中概互联二季度股价波动加大。

作为追踪中证海外中国互联网50指数的被动式海外指数基金,我们在操作中严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,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1.4923元,本报告期份额净值增长率为3.91%,同期业绩比较基准收益率为4.14%,年化跟踪误差6.915%。

§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	1,097,643,599.54	98.06
	其中:普通股	291,638,294.01	26.05
	存托凭证	806,005,305.53	72.00
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,058,522.25	1.79
8	其他资产	1,711,077.83	0.15
9	合计	1,119,413,199.62	100.00

注:1.上表中的普通股投资项含可退替代款估值增值,而5.2和5.3的合计项不含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为20,088,105.29元,占净值比例1.82%。

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	834,762,702.88	75.45
香港	262,880,896.66	23.76
合计	1,097,643,599.54	99.21

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	-	-
材料	-	-
工业	8,896,992.60	0.80
非必需消费品	192,332,508.25	17.38
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	20,912,847.67	1.89
信息技术	875,511,251.02	79.13
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	1,097,643,599.54	99.21

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	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	668,042	221,798,481.58	20.05
2	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	168,324	206,630,805.27	18.68
3	Baidu Inc	百度股份有限公司	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	122,273	196,594,662.23	17.77
4	NetEase Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	58,026	97,008,813.90	8.77
5	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	328,400	84,634,121.59	7.65
6	Ctrip.com International Ltd	携程国际有限公司	CTRP US	纳斯达克证券交易所	美国	199,423	62,847,890.82	5.68
7	iQIYI Inc	爱奇艺	IQ US	纳斯达克证券交易所	美国	133,474	28,525,553.41	2.58
8	SINA Corp/China	新浪公司	SINA US	纳斯达克证券交易所	美国	36,032	20,190,896.26	1.82
9	58.com Inc	58同城	WUBA US	纽约证券交易所	美国	38,139	17,497,984.18	1.58
10	Autohome Inc	汽车之家	ATHM US	纽约证券交易所	美国	25,882	17,296,334.96	1.56

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

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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	9,128.51
2	应收证券清算款	1,681,645.63
3	应收股利	1,280.24
4	应收利息	12,023.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,711,077.83

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	879,432,720.00
报告期基金总申购份额	94,000,000.00
减:报告期基金总赎回份额	232,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	741,432,720.00

§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. 中国证监会准予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注册的文件;

2.《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基金合同》;

3.《易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证