

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年八月二十八日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人交通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、净值数据、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达恒生中国企业(ODD1)
基金代码	110000
基金运作方式	契约开放式、指数基金、联接基金
基金合同生效日	2012年02月24日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,469,792,776.65
报告期末基金份额持有人户数	3,262
基金份额持有人户数占基金份额总额比例	0.0002%
报告期末基金资产净值	1,376,243,196.09
报告期末基金份额净值	82.539,001113

注：自2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认为2018年2月12日。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	110000
基金运作方式	契约开放式(ETF)
基金合同生效日	2012年02月24日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,469,792,776.65
报告期末基金份额持有人户数	3,262
基金份额持有人户数占基金份额总额比例	0.0002%
报告期末基金资产净值	1,376,243,196.09
报告期末基金份额净值	82.539,001113

注：自2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认为2018年2月12日。

2.2 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跟踪标的指数的表现，即按照标的指数成份股及其权重构建投资组合进行被动投资。在追求跟踪标的指数的表现的同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例、投资范围、申购赎回规模等要求对跟踪标的指数的表现进行适度调整。本基金将根据标的指数的成份股及其权重构建投资组合进行被动投资。在追求跟踪标的指数的表现的同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例、投资范围、申购赎回规模等要求对跟踪标的指数的表现进行适度调整。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算)收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金，其风险收益特征与恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金相似。
投资范围	本基金主要投资于恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金，并可根据法律法规的要求进行适度调整。本基金还可投资于国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、期权、国债期货、股指期货、期权、国债期货、股指期货、期权、国债期货等金融工具。本基金还可投资于法律法规允许的境外市场。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金，其风险收益特征与恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金相似。

2.3 基金管理人

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	交通银行股份有限公司
负责人	张勇	彭纯
办公地址	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路11号18楼	上海市浦东新区银城中路188号
联系电话	020-85103588	021-58766688
电子邮箱	efund@yfd.com.cn	jtbank@交通银行.com
客户服务热线	400 888 8108	95559
网址	020-85106666	021-62912156

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	无	无
英文名称	无	无
注册地址	无	无
办公地址	无	无
法定代表人	无	无
联系人	无	无
联系电话	无	无
电子邮箱	无	无
传真	无	无

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，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.自2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认为2018年2月12日，增设当期相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额③	①-③	②-③
过去一个月	-3.41%	1.33%	-4.83%	1.30%	-0.00%
过去三个月	-1.68%	1.18%	-2.72%	1.23%	-0.06%
过去六个月	-2.61%	1.33%	-4.33%	1.20%	-0.04%
过去一年	6.09%	1.17%	3.70%	1.20%	2.82%
过去三年	-1.71%	1.29%	-6.03%	1.34%	-6.23%
过去五年	15.15%	1.24%	16.43%	1.32%	-1.28%

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

2.自2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认为2018年2月12日，增设当期相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2012年8月21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2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认为2018年2月12日，增设当期相关数据和指标按实际存续期计算。
3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为15.15%，同期业绩比较基准收益率为16.43%。C类基金份额净值增长率为-2.12%，同期业绩比较基准收益率为-2.75%。

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2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认为2018年2月12日，增设当期相关数据和指标按实际存续期计算。
3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为15.15%，同期业绩比较基准收益率为16.43%。C类基金份额净值增长率为-2.12%，同期业绩比较基准收益率为-2.75%。

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情况
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介
4.3 管理人对于境外投资顾问的情况说明

4.4 公平交易制度的执行情况
4.4.1 公平交易制度的执行情况
4.4.2 异常交易行为的专项说明

4.5 管理人对于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
4.5.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.6 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.6.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.6.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.7 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.7.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.7.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.8 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.8.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.8.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.9 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.9.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.9.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.10 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.10.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.10.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.11 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.11.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.11.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.12 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.12.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.12.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.13 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.13.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.13.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.14 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.14.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.14.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.15 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.15.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.15.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.16 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.16.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.16.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.17 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.17.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.17.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.18 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.18.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.18.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.19 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.19.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.19.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.20 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.20.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.20.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.21 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.21.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.21.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.22 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.22.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.22.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.23 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.23.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.23.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.24 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.24.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.24.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.25 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.25.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.25.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.26 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.26.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.26.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.27 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.27.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.27.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.28 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.28.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.28.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.29 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.29.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.29.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.30 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.30.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.30.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.31 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.31.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.31.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.32 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.32.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.32.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.33 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.33.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.33.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.34 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.34.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.34.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.35 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.35.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.35.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

4.36 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.36.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.36.2 报告期内基金的投资表现和运作分析

注：报告截止日2018年6月30日，A类基金份额净值1.1515元，C类基金份额净值1.1446元；基金份额总额1,468,782,156.81份，下开各级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额1,376,243,196.09份，C类基金份额总额82,539,001.11份。

项目	本期	上期
一、收入	338,043.17	540,528.04
1.利息收入	291,191.17	763,347.36
2.公允价值变动收益	291,191.17	763,347.36
3.其他收入	-	-
二、费用	-	-
1.管理人报酬	-	-
2.托管费	-	-
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	-	-
三、利润总额	338,043.17	540,528.04
四、净利润	338,043.17	540,528.04

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65
二、本期基金份额变动	-	-
三、期末基金份额总额	1,469,792,776.65	1,469,792,776.65

项目	本期	上期
一、期初基金份额总额	1,469,792,776	