易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018年半年度报告摘要

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
送出日期:二〇一八年八月二十八日

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。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	易方达深证100ETF联接	
基金主代码	110019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年12月1日	
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	
报告期末基金份额总额	1,285,953,635.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达深证100ETF联接A	易方达深证100ETF联接C
下属分级基金的交易代码	110019	004742
报告期末下属分级基金的份额总额	1,280,279,028.20份	5,674,607.17份

注:自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月5日。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达深证100交易型开放式指数基金
基金主代码	159901
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年3月24日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月24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	本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争最终将年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。待指数衍生金融产品推出以后,本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	深证100价格指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为深证100ETF的联接基金,主要通过投资于深证100ETF追踪业绩比较基准表现,业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。因此,本基金具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。理论上,本基金预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪目标指数,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。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例,以此构建本基金实际的投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证100价格指数
风险收益特征	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,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、以及标的指数所代表的股票市场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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

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)	
	易方达深证100ETF联接A	易方达深证100ETF联接C
本期已实现收益	38,419,736.51	106,812.76
本期利润	-211,360,776.17	-604,187.35
加权平均基金份额本期利润	-0.1623	-0.1309
本期基金份额净值增长率	-13.52%	-13.33%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	易方达深证100ETF联接A	易方达深证100ETF联接C
期末可供分配基金份额利润	0.0654	0.0673
期末基金资产净值	1,364,028,211.01	6,056,509.72
期末基金份额净值	1.0654	1.0673

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 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

易方达深证100ETF联接A

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	-7.49%	1.53%	-8.09%	1.57%	0.60%	-0.04%
过去三个月	-10.87%	1.29%	-11.38%	1.31%	0.51%	-0.02%
过去六个月	-13.52%	1.32%	-13.93%	1.34%	0.41%	-0.02%
过去一年	-3.82%	1.14%	-4.08%	1.15%	0.26%	-0.01%
过去三年	-17.15%	1.73%	-20.24%	1.63%	3.09%	0.10%
自基金合同生效起至今	6.54%	1.54%	-4.00%	1.52%	10.54%	0.02%

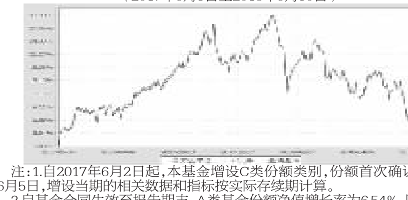
易方达深证100ETF联接C

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	-7.49%	1.53%	-8.09%	1.57%	0.60%	-0.04%
过去三个月	-10.88%	1.29%	-11.38%	1.31%	0.50%	-0.02%
过去六个月	-13.33%	1.33%	-13.93%	1.34%	0.60%	-0.01%
过去一年	-3.65%	1.14%	-4.08%	1.15%	0.43%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.89%	1.13%	4.24%	1.13%	0.65%	0.00%

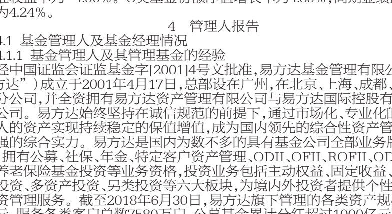
注:自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月5日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达深证100交易型开放式指数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
易方达深证100ETF联接A
(2009年12月1日至2018年6月30日)



易方达深证100ETF联接C
(2017年6月5日至2018年6月30日)



注:1.自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6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6.54%,同期业绩比较基准收益率为-4.00%。C类基金份额净值增长率为4.89%,同期业绩比较基准收益率为4.24%。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
成曦	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、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	2016-05-07	-	10年	硕士研究生,曾任华泰联合证券资产管理部研究员,易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理	2017-07-18	-	11年	硕士研究生,曾任招商银行资产托管部基金会计,易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理。

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 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66次,其中64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;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

本基金跟踪的标的指数为深证100指数,深证100指数由深圳证券市场规模大、流动性好、最具代表性的100只股票组成,以综合反映深圳证券市场最具影响力的一批龙头企业的整体状况。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而进行相应调整。

2018年上半年,国内宏观经济在多重压力下仍保持了较为稳健的增长,2季度GDP同比增长6.7%,较前值略回落0.1个百分点。A股市场整体下跌,深100指数下跌14.7%。深100指数年初开局较好,1月份上涨3.5%,2月初,在中美贸易摩擦冲突的担忧下,股票市场出现一波急速下跌,虽然在2月中开始了近一个月的反弹,但伴随着资管新规对股票市场的冲击、债务违约引发的信用危机、中美之间贸易摩擦扩大的恐慌、股票质押风险加大以及人民币贬值等的不利影响下,深100指数在二季度呈现加速下跌的态势。

深100指数是深市成长性蓝筹的核心代表,成份股性质多为民营企业,优势源于在充分竞争中形成管理,技术,人员护城河。相对而言,对冲经济周期波动能力较强,同时还保证了较高的成长性。本报告期间,深证100指数下跌主要受电子、房地产、非银行金融以及传媒行业的拖累,上述行业分别下跌21%、19%、20%、21%。

本基金是易方达深证100ETF的联接基金。基金运作层面,报告期内,本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项,保障基金的正常运作,基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

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1.0654元,本报告期份额净值增长率为-13.52%;C类基金份额净值为1.0673元,本报告期份额净值增长率为-13.33%;同期业绩比较基准收益率为-13.93%。本报告期,本基金日跟踪偏离度的均值为0.03%,年化跟踪误差1.11%,在合同规定的控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国内金融去杠杆、国外中美贸易摩擦的大环境很难有大的转变,宏观经济存在着一定的下行压力,稳增长依将是政策重点。国内经济在"稳健的货币政策要松紧适度,保持适度的社会融资规模和流动性合理充裕"以及"积极的财政政策要更加积极"的协同配合下,继续着力扩大内需、稳定经济增长与优化经济结构。

A股市场的结构伴随着互联互通的发展发生了较大变化。一方面,市场对优质股的追捧成为投资的主流方式,另一方面国内外的蓝筹股定价思路开始趋向一致。在互联互通中,北上的资金在沪市集中投资以上证50为代表蓝筹股,在深市,更多选择估值盈利比更为合适的特色龙头股票。市场结构的变化叠加前期市场大幅回调加速部分行业的内部分化:龙头企业市占持续扩张,边缘企业生存难度加大。

在经历了上半年大幅调整后,市场风险已有所释放,同时政策基调也逐渐由去杠杆逐步向稳杠杆过渡,前期恐慌情绪得到明显缓解。目前,A股的整体估值水平明显回落,多数核心指数的估值已经回到低估区域。与此同时,我们观察到市场的投资行为有了以下变化:主流的投资思路已经由短中期的轮动策略(例如:大小盘轮动,价值成长轮动)向买入并长期持有投资策略转移。整个权益市场的投资久期在拉长。当前的指数低估值区域也为投资者提供了一个合适的长期窗口。

综合来看,现阶段是长期资金逐步建仓的良好时机,一类是基本面持续向好并且估值合理的白马蓝筹,另一类是前期调整充分并已重新进入快速发展通道的中小创类股票,而深100是这两者的集中营。

作为被动投资的基金,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,致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

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

易方达深证100ETF联接A:本报告期内未实施利润分配。

易方达深证100ETF联接C: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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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:易方达深证100交易型开放式指数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	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	79,551,831.16	101,327,198.34
结算备付金	-	-
存出保证金	35,764.37	79,364.16
交易性金融资产	1,294,980,035.54	1,611,478,842.44
其中:股票投资	44,344,105.07	47,342,991.40
基金投资	1,250,635,930.47	1,564,123,751.04
债券投资	-	12,100.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
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	14,519.58	20,535.56
应收股利	-	-
应收申购款	1,056,566.73	4,009,136.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	1,584.80	-
资产总计	1,375,640,302.18	1,716,915,076.87
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,262,701.58	1,648,710.07
应付赎回款	1,316,147.68	2,542,352.61
应付管理人报酬	49,949.22	60,359.10
应付托管费	9,989.85	12,071.81
应付销售服务费	1,217.08	1,436.70
应付交易费用	26,686.36	39,735.52
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	888,889.68	879,486.45
负债合计	5,555,581.45	5,184,152.26
所有者权益:		
实收基金	1,285,953,635.37	1,389,385,158.06
未分配利润	84,131,085.36	322,345,766.55
所有者权益合计	1,370,084,720.73	1,711,730,924.61
负债和所有者权益总计	1,375,640,302.18	1,716,915,076.87

注:报告截止日2018年6月30日,A类基金份额净值1.0654元,C类基金份额净值1.0673元;基金份额总额1,285,953,635.37份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额1,280,279,028.20份,C类基金份额总额5,674,607.17份。

6.2 利润表

会计主体:易方达深证100交易型开放式指数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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-211,058,720.91	210,460,853.31
1.利息收入	319,593.69	432,637.58
其中:存款利息收入	319,563.68	316,394.09
债券利息收入	30.01	116,243.49
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)	38,901,889.62	26,795,632.38
其中:股票投资收益	2,971,966.30	4,280,934.74
基金投资收益	35,585,832.32	21,967,826.55
债券投资收益	15,513.24	-11,250.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	328,577.76	558,121.09
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-250,491,512.79	183,130,047.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	211,308.57	102,535.98
减:二、费用	906,242.61	773,073.64
1. 管理人报酬	343,577.50	404,955.47
2. 托管费	68,715.56	80,991.10
3. 销售服务费	6,801.35	126.06
4. 交易费用	255,040.69	51,941.69
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	1,697.88	-
7. 其他费用	230,409.63	235,059.32
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-211,964,963.52	209,687,779.67
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-211,964,963.52	209,687,779.67

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达深证100交易型开放式指数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)	1,389,385,158.06	322,345,766.55	1,711,730,924.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-211,964,963.52	-211,964,963.52
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)	-103,431,522.69	-26,249,717.67	-129,681,240.36
其中:1.基金申购款	209,800,171.89	43,820,401.03	253,620,572.92
2.基金赎回款	-313,231,694.58	-70,070,118.70	-383,301,813.28
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)	1,285,953,635.37	84,131,085.36	1,370,084,720.73
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)	1,741,285,769.09	-34,314,792.09	1,706,970,977.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	209,687,779.67	209,687,779.67
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)	-194,746,754.83	-8,818,871.95	-203,565,626.78
其中:1.基金申购款	137,463,606.13	3,664,138.42	141,127,744.55
2.基金赎回款	-332,210,360.96	-12,483,010.37	-344,693,371.33
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)	1,546,539,014.26	166,554,115.63	1,713,093,129.89

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

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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947号《关于核准易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的批复》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《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2009年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为18,924,975,988.28份基金份额,其中认购资金利息折合4,124,004.79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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月5日。

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》、《易方达深证100交易型开放式指数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 关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2 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
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	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
易方达深证100交易型开放式指数基金	本基金是该基金的联接基金

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	137,167,634.02	100.00%	21,745,166.13	100.00%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3基金交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券	23,544,965.87	100.00%	228,369,495.19	100.00%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	127,744.26	100.00%	26,686.36	100.00%
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 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	20,251.50	100.00%	13,643.40	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	343,577.50	404,955.47
其中:支付销售机构的客户维护费	895,213.03	938,463.85

注:1.基金管理费按调整后的前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.5%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值-本基金持有的深证100ETF前一日公允价值,金额为负时以零计。

基金管理费每日计提,按月支付;由基金托管人于次月前10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2.客户维护费按日提,按季支付,具体公式如下:

H= E×R/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

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托管费	68,715.56	80,991.10

注:基金托管费按调整后的前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.1%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值-本基金持有的深证100ETF前一日公允价值,金额为负时以零计。

基金托管费每日计提,按月支付;由基金托管人于次月前10个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.2.3 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 易方达深证100ETF联接A	易方达深证100ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	6,801.35	6,801.35
中国银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	6,801.35	6,801.35
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 易方达深证100ETF联接A	易方达深证100ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	126.06	126.06
中国银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	126.06	126.06

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%,按C类基金份额前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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

易方达深证100ETF联接A

无。

易方达深证100ETF联接C

无。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	79,551,831.16	316,387.54	82,244,116.93	293,970.97

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

6.4.8.6 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

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
本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
广发证券	002927	泰永长征	新股网下发行	961	14,203.58
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
广发证券	002841	视源股份	新股网下发行	1,680	32,020.80
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	3,155	22,211.20
广发证券	300625	三雄极光	新股网下发行	3,934	75,926.20
广发证券	300627	华测导航	新股网下发行	1,498	19,129.46
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
广发证券	300647	超频三	新股网下发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下发行	1,110	21,545.10
广发证券	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 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291,367,316份和312,668,416份目标ETF基金份额,占其总份额的比例分别为37.13%和38.92%。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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	38,000	222,077.36	197,600.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	4.87	-	-	220,300	1,055,126.91	1,072,861.00	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项停牌	21.46	-	-	12,400	244,627.79	266,104.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	15.03	-	-	8,400	155,211.75	126,252.00	-
002450	康得新	2018-06-04	重大事项停牌	15.40	-	-	59,542	1,218,814.98	916,946.80	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	38.03	-	-	20,038	1,136,950.79	762,045.14	-
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项停牌	23.28	2018-07-10	24.00	5,700	185,085.54	132,696.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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1,291,505,530.60元,属于第二层次的余额为3,474,504.94元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次45,976,984.42元,第二层次1,565,287,981.02元,第三层次213,877.00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	44,344,105.07	3.22
	其中:股票	44,344,105.07	3.22
2	基金投资	1,250,635,930.47	90.91
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	79,551,831.16	5.78
8	其他各项资产	1,108,435.48	0.08
9	合计	1,375,640,302.18	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	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	1,250,635,930.47	91.28

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	1,301,028.00	0.09
B	采矿业	156,959.00	0.01
C	制造业	29,100,150.95	2.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	314,425.10	0.02
F	批发和零售业	1,081,807.72	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	148,500.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,654,301.14	0.19
J	金融业	3,232,650.24	0.24
K	房地产业	3,524,006.67	0.26
L	租赁和商务服务业	749,597.60	0.05
M	科学研究和技术服务业	58,086.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	471,437.51	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	789,110.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	762,045.14	0.06
S	综合	-	-
	合计	44,344,105.07	3.24

7.4 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

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	000333	美的集团	60,603	3,164,688.66	0.23
2	000651	格力电器	63,000	2,970,450.00	0.22
3	000858	五 粮 液	24,213	1,840,188.00	0.13
4	002415	海康威视	46,127	1,712,695.51	0.13
5	000002	万 科A	53,241	1,309,728.60	0.10
6	000725	京东方A	341,625	1,209,352.50	0.09
7	300498	温氏股份	50,200	1,105,404.00	0.08
8	000540	中天金融	220,300	1,072,861.00	0.08
9	000001	平安银行	110,437	1,003,872.33	0.07
10	002304	洋河股份	7,416	975,945.60	0.07

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.efunds.com.cn网站的半年度报告正文。

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	000651	格力电器	3,457,479.00	0.20
2	300498	温氏股份	1,274,675.50	0.07
3	000333	美的集团	893,914.00	0.05
4	002027	分众传媒	704,982.00	0.04
5	000858	五 粮 液	520,355.00	0.03
6	000100	TCL 集团	512,359.00	0.03
7	000725	京东方A	508,323.00	0.03
8	000002	万 科A	482,880.00	0.03
9	002415	海康威视	471,258.00	0.03
10	000963	华东医药	449,626.65	0.03
11	300003	乐普医疗	448,156.00	0.03
12	300136	信维通信	427,460.00	0.02
13	000661	长春高新	421,279.00	0.02
14	002044	美年健康	418,294.40	0.02
15	000001	平安银行	397,426.00	0.02
16	300408	三环集团	381,664.48	0.02
17	002422	科伦药业	380,312.00	0.02
18	300015	爱尔眼科	349,235.00	0.02
19	002572	索菲亚	329,931.00	0.02
20	002304	洋河股份	314,186.00	0.02

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	7,417,244.54	0.43
2	000651	格力电器	7,032,308.93	0.41
3	000858	五 粮 液	4,943,215.49	0.29
4	000725	京东方A	4,716,301.00	0.28
5	000002	万 科A	4,600,907.00	0.27
6	002415	海康威视	4,129,377.81	0.24
7	000001	平安银行	3,556,669.00	0.21
8	002304	洋河股份	2,903,478.77	0.17
9	300498	温氏股份	2,583,857.40	0.15
10	000063	中兴通讯	2,286,038.00	0.13
11	002230	科大讯飞	1,908,864.00	0.11
12	002027	分众传媒	1,699,844.00	0.10
13	002024	苏宁易购	1,446,683.00	0.08
14	000503	国新健康	1,418,489.00	0.08
15	001979	招商蛇口	1,380,368.76	0.08
16	000568	泸州老窖	1,371,383.00	0.08
17	000776	广发证券	1,367,678.00	0.08
18	000338	潍柴动力	1,359,834.00	0.08
19	002142	宁波银行	1,344,155.00	0.08
20	002594	比亚迪	1,298,097.45	0.08

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	25,305,540.18
卖出股票收入(成交)总额	112,109,873.99

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

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。

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

7.13.12018年2月7日,大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现,贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实,对平安银行处以人民币四十万元行政罚款。

2018年3月14日,中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,给予警告,没收违法所得3,036,061.39元,并处罚款10,308,084.15元,合计处罚金额13,344,145.54元。

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。除平安银行外,本基金目标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。除平安银行外,本基金投资的其他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	35,764.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,519.58
5	应收申购款	1,056,566.73
6	其他应收款	1,584.80
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,108,435.48

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	1,072,861.00	0.08	重大事项停牌

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

份额级别	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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
易方达深证100ETF联接A	60,091	21,305.67	19,612,879.28	1.53%	1,260,666,148.92	98.47%
易方达深证100ETF联接C	223	25,446.67	442,033.10	7.79%	5,232,574.07	92.21%
合计	60,314	21,320.98	20,054,912.38	1.56%	1,265,898,722.99	98.44%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达深证100ETF联接A	81,198.43	0.0063%
	易方达深证100ETF联接C	117.93	0.0021%
	合计	81,316.36	0.0063%

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	份额级别	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	易方达深证100ETF联接A	0
	易方达深证100ETF联接C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达深证100ETF联接A	0
	易方达深证100ETF联接C	0
	合计	0

9开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达深证100ETF联接A	易方达深证100ETF联接C
基金合同生效日(2009年12月1日)基金份额总额	18,924,975,988.28	-
本报告期期初基金份额总额	1,383,463,114.90	5,922,043.16
本报告期基金总申购份额	183,539,328.47	26,260,843.42
减:本报告期基金总赎回份额	286,723,415.17	26,508,279.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,280,279,028.20	5,674,607.17

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国泰君安	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	137,167,634.02	100.00%	127,744.26	100.00%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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服务;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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	174,444.89	100.00%	-	-	-	-	23,544,965.87	100.00%
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日