易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金

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

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	易方达现代服务业混合
基金主代码	001857
交易代码	001857
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月22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	1,926,613,216.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,考虑宏观经济走势和市场估值与流动性进行资产配置。股票投资方面,本基金综合考虑行业景气度及可持续性、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势、政策变化等因素在现代服务产业中进行子行业配置,同时在公司基本面评价、估值水平分析等基础上进行股票组合的构建。在债券投资方面,本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	65%×中证800指数收益率+35%×一年期人民币定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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

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)
本期已实现收益	-9,684,002.21
本期利润	-32,298,341.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0151
本期基金份额净值增长率	-2.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0194
期末基金资产净值	1,889,307,683.50
期末基金份额净值	0.981

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。

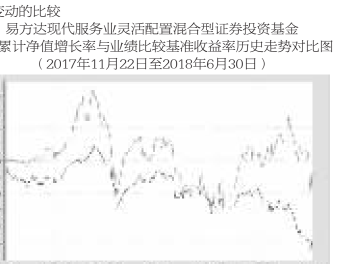
3.2 基金净值表现

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

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	-4.20%	1.71%	-5.25%	0.90%	1.05%	0.81%
过去三个月	1.66%	1.49%	-7.21%	0.75%	8.87%	0.74%
过去六个月	-2.97%	1.48%	-8.82%	0.76%	5.85%	0.72%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.90%	1.35%	-11.19%	0.73%	9.29%	0.62%

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

易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金
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
(2017年11月22日至2018年6月30日)



注:1.本基金合同于2017年11月22日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.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,建仓期结束时投资于现代服务业相关资产占非现金资产的比例不达标,本基金已在法规规定的期限内调整完毕。建仓期结束时其他各项资产配置比例符合本基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-1.90%,同期业绩比较基准收益率为-11.19%。

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		
萧楠	本基金的基金经理、易方达消费行业股票型证券投资基金的基金经理、易方达瑞恒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达大健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017-11-22	-	12年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值成长混合型证券投资基金基金经理助理。

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 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

2018年,经历过年初的大幅上行后,市场逐步走低。尤其在二季度,面对复杂多变的经济形势,市场情绪较为悲观。内部经济增速换挡,外部贸易环境日益严峻,市场在不断走弱。上半年上证综指下跌13.90%,上证50指数下跌13.30%,创业板指数下跌8.33%。本报告期内中证内地消费指数跌5.66%,略强于市场。在消费行业各子行业中,仅免税店行业一枝独秀,食品饮料、医药商业、专业零售勉强录得正收益,而黑电、传媒、农业板块表现较差。

本基金去年年底的重仓股在今年普遍表现较弱,但上半年本基金仍取得了正收益,主要是得益于一季度开始布局的一些基本面未被市场充分认知的优质公司。拖累本基金上半年业绩表现的主要是家电、家具板块——这些行业相对于宏观周期较为敏感。在目前的市场环境中,本基金的表现已经算是差强人意了。

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0.981元,本报告期份额净值增长率为-2.97%,同期业绩比较基准收益率为-8.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

必须承认,在未来可见的2至4个季度,宏观经济各项指标可能不断走低,同时,外部国际形势也并不乐观。不过,正因为市场短期内自上而下找不到突破口,我们更应该坚持自下而上精选个股的投资理念,坚持投资质地优秀的公司。我们同时也相信,当前的危机也是机遇,我们曾经经历过许多更加困难的时期,我们的投资策略从来不会低估中国经济增长的潜力和韧性。

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:易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金
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	208,293,521.29	1,334,558,719.49
结算备付金	699,954.34	2,167,184.39
存出保证金	718,507.44	35,452.42
交易性金融资产	1,684,630,334.09	1,489,212,589.53
其中:股票投资	1,684,630,334.09	1,489,212,589.53
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	110,976.83	18,984,072.72
应收利息	38,182.41	285,903.11
应收股利	-	-
应收申购款	2,807,901.39	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,897,299,377.79	2,845,243,921.66
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	-	62,215,870.28
应付赎回款	3,916,311.78	-
应付管理人报酬	2,476,076.75	3,511,613.69
应付托管费	412,679.44	585,268.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	979,926.99	1,325,923.03
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	206,699.33	24,000.00
负债合计	7,991,694.29	67,662,675.95
所有者权益:		
实收基金	1,926,613,216.52	2,746,264,844.18
未分配利润	-37,305,533.02	31,316,401.53
所有者权益合计	1,889,307,683.50	2,777,581,245.71
负债和所有者权益总计	1,897,299,377.79	2,845,243,921.66

注:1. 本基金合同生效日为2017年11月22日,2017年度实际报告期间为2017年11月22日至2017年12月31日。

2.报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.981元,基金份额总额1,926,613,216.52份。

6.2 利润表

会计主体:易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金
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
一、收入	-10,278,753.09
1.利息收入	1,188,506.11
其中:存款利息收入	1,188,506.11
债券利息收入	-
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)	4,444,517.55
其中:股票投资收益	-10,005,185.62
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	14,449,703.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-22,614,339.08
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,702,562.33
减:二、费用	22,019,588.20
1. 管理人报酬	16,021,317.52
2. 托管费	2,670,219.58
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	3,128,454.03
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	199,597.07
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-32,298,341.29
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-32,298,341.29

注:本基金合同生效日为2017年11月22日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金
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)	2,746,264,844.18	31,316,401.53	2,777,581,245.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,298,341.29	-32,298,341.29
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)	-819,651,627.66	-36,323,593.26	-855,975,220.92
其中:1.基金申购款	937,404,644.89	51,971,126.08	989,375,770.97
2.基金赎回款	-1,757,056,272.55	-88,294,719.34	-1,845,350,991.89
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)	1,926,613,216.52	-37,305,533.02	1,889,307,683.50

注:本基金合同生效日为2017年11月22日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]2019号《关于准予易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2017]1091号《关于同意易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集,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《易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年11月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,746,264,844.18份基金份额,其中认购资金利息折合935,179.58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。

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》、《易方达现代服务业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具,按其估值日不加调整的报价确定公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2)不存在活跃市场的金融工具,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的,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。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(3)同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(4)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)于2017年12月15日前,对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月15日起,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3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

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
广发证券	70,953,076.66	3.14%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 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	56,762.34	2.97%	56,762.34	5.79%

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
当期发生的基金应支付的管理费	16,021,317.52
其中:支付销售机构的客户维护费	7,440,104.22

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,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5个工作日内,按照指定的账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、公休日等,支付日期顺延。

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
当期发生的基金应支付的托管费	2,670,219.58

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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5个工作日内,按照指定的账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、公休日等,支付日期顺延。

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

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
中国建设银行-活期存款	208,293,521.29	1,152,873.40

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。

6.4.8.6 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

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
广发证券	002927	泰永长征	新股网下发行	961	14,203.58

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

无。

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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1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	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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1,684,630,334.09元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次1,489,212,589.53元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额)。

(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。

(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	1,684,630,334.09	88.79
	其中:股票	1,684,630,334.09	88.79
2	基金投资	-	-
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	208,993,475.63	11.02
8	其他各项资产	3,675,568.07	0.19
9	合计	1,897,299,377.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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	38,678,599.44	2.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,372,991,582.27	72.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	37,223,608.00	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	111,854,393.08	5.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	107,234,496.96	5.68
K	房地产业	16,044,710.40	0.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	450,157.95	0.02
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,684,630,334.09	89.17

7.3 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	600519	贵州茅台	248,779	181,971,887.34	9.63
2	000858	五粮液	2,315,613	175,986,588.00	9.31
3	000568	泸州老窖	2,820,898	171,679,852.28	9.09
4	000333	美的集团	2,716,925	141,877,823.50	7.51
5	600009	上海机场	2,016,121	111,854,393.08	5.92
6	601318	中国平安	1,827,132	107,033,392.56	5.67
7	000860	顺鑫农业	2,629,145	98,592,937.50	5.22
8	002415	海康威视	2,392,100	88,818,673.00	4.70
9	002572	索菲亚	2,540,088	81,740,031.84	4.33
10	000418	小天鹅A	974,387	67,573,738.45	3.58

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。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000568	泸州老窖	131,409,601.46	4.73
2	002415	海康威视	104,270,602.30	3.75
3	000858	五粮液	99,920,672.00	3.60
4	600519	贵州茅台	82,819,786.44	2.98
5	000860	顺鑫农业	81,597,138.35	2.94
6	000333	美的集团	80,194,604.75	2.89
7	601318	中国平安	68,811,940.77	2.48
8	002572	索菲亚	68,750,684.93	2.48
9	601012	隆基股份	63,405,958.76	2.28
10	000651	格力电器	54,955,727.10	1.98
11	002714	牧原股份	54,139,752.86	1.95
12	603866	桃李面包	52,586,834.87	1.89
13	600690	青岛海尔	42,602,098.98	1.53
14	601933	永辉超市	39,079,469.55	1.41
15	600009	上海机场	36,168,494.17	1.30
16	000089	深圳机场	36,081,876.10	1.30
17	603369	今世缘	31,383,859.45	1.13
18	000002	万科A	27,837,330.00	1.00
19	002027	分众传媒	27,279,410.00	0.98
20	603833	欧派家居	22,188,419.90	0.80

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。

7.4.2 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	000651	格力电器	219,658,192.02	7.91
2	000002	万科A	96,846,064.09	3.49
3	601318	中国平安	87,903,774.12	3.16
4	002027	分众传媒	86,854,826.11	3.13
5	000858	五粮液	80,123,251.72	2.88
6	600741	华域汽车	78,408,875.11	2.82
7	000089	深圳机场	73,242,827.14	2.64
8	600519	贵州茅台	55,835,534.02	2.01
9	601012	隆基股份	54,313,720.76	1.96
10	600690	青岛海尔	40,080,350.33	1.44
11	000596	古井贡酒	29,247,543.40	1.05
12	600511	国药股份	20,994,148.31	0.76
13	002572	索菲亚	15,935,562.05	0.57
14	000568	泸州老窖	14,337,443.05	0.52
15	603589	口子窖	12,313,107.00	0.44
16	002714	牧原股份	9,824,557.15	0.35
17	603833	欧派家居	9,797,187.88	0.35
18	000333	美的集团	7,971,817.73	0.29
19	000418	小天鹅A	7,269,718.00	0.26
20	002415	海康威视	5,903,930.50	0.21

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。

7.4.3 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	1,244,338,884.23
卖出股票收入(成交)总额	1,016,301,614.97

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。

7.5 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。

7.6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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11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。

7.12投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2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。

7.12.3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	718,507.44
2	应收证券清算款	110,976.83
3	应收股利	-
4	应收利息	38,182.41
5	应收申购款	2,807,901.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,675,568.07

7.12.4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。

7.12.5 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
27,180	70,883.49	278,453,295.45	14.45%	1,648,159,921.07	85.55%

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	391,798.37	0.0203%

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	10~50

9开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017年11月22日)基金份额总额	2,746,264,844.18
本报告期期初基金份额总额	2,746,264,844.18
本报告期基金总申购份额	937,404,644.89
减:本报告期基金总赎回份额	1,757,056,272.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,926,613,216.52

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	302,376,860.77	13.39%	241,901.29	12.65%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	344,029,391.26	15.23%	275,223.69	14.40%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	67,305,071.30	2.98%	53,843.93	2.82%	-
国金证券	1	50,498,445.65	2.24%	40,398.78	2.11%	-
兴业证券	2	609,986,677.04	27.01%	542,186.82	28.36%	-
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	70,953,076.66	3.14%	56,762.34	2.97%	-
广州证券	1	36,081,876.10	1.60%	28,865.08	1.51%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	254,552,594.79	11.27%	203,641.96	10.65%	-
国盛证券	1	134,796,742.62	5.97%	107,837.08	5.64%	-
西南证券	1	387,797,764.54	17.17%	361,152.49	18.89%	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中银国际证券股份有限公司各一个交易单元,新增安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各两个交易单元,新增长城证券股份有限公司、中信证券股份有限公司各三个交易单元,新增广发证券股份有限公司四个交易单元。

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		债券回购交易		权证交易	
	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
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日