易方达证券公司指数分级证券投资基金 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	易方达证券公司分级		
基金主代码	502010		
交易代码	502010		
基金运作方式	契约型开放式、分级基金		
基金合同生效日	2015年7月8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	609,626,179.96份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015年7月15日		
下属分级基金的基金简称	易方达证券公司分级	易方达证券公司分级A	易方达证券公司分级B
下属分级基金场内简称	证券分级	证券A	证券B
下属分级基金的交易代码	502010	502011	502012
报告期末下属分级基金的份额总额	533,155,145.96份	38,235,517.00份	38,235,517.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密追踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资,即完全按照标的指数的成份股组成及权重构建基金投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。		
业绩比较基准	95%×中证全指证券公司指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现,其风险收益特征与标的指数相似。长期而言,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;A类份额具有预期风险、收益较低的特征;B类份额具有预期风险、收益较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	基础份额为股票型基金,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。	与基础份额相比,A类份额的预期收益和预期风险低于基础份额。	与基础份额相比,B类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。

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	-752,560.99
本期利润	-108,825,616.47
加权平均基金份额本期利润	-0.2436
本期基金份额净值增长率	-19.81%
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	-0.7134
期末基金资产净值	516,708,445.54
期末基金份额净值	0.8476

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。

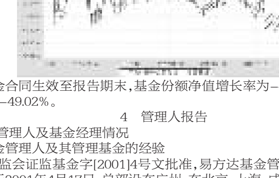
3.2 基金净值表现

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	-8.84%	1.85%	-9.36%	1.86%	0.52%	-0.01%
过去三个月	-14.58%	1.54%	-15.22%	1.55%	0.64%	-0.01%
过去六个月	-19.81%	1.64%	-20.67%	1.66%	0.86%	-0.02%
过去一年	-23.78%	1.43%	-26.71%	1.45%	2.93%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-45.70%	2.01%	-49.02%	2.18%	3.32%	-0.17%

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

易方达证券公司指数分级证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年7月8日至2018年6月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-45.70%,同期业绩比较基准收益率为-49.02%。

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
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联接基金的基金经理、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	2015-07-08	-	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。

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年上半年国内宏观经济增长在一季度保持了稳健回升的态势后在二季度增长动能有所减弱,前期货币、财政政策收紧的效果开始逐步传导到实体经济。宏观数据显示二季度国内实际GDP同比增速6.7%,较一季度回落0.1个百分点;名义GDP同比增速9.8%,较一季度回落0.4个百分点。二季度规模以上工业增加值同比增速6.6%,较一季度回落0.2个百分点,其中6月份同比增速6.0%,较5月份大幅下滑0.8个百分点。2018年6月份中国制造业采购经理指数(PMI)为51.5%,比上月回落0.4个百分点。二季度以来社会融资大幅下滑,经济下行压力加大,央行定向降准,货币政策逐步转向中性偏松。人民币对美元即期汇率在一季度保持升值态势,二季度伴随实体经济下行风险的增加,叠加中美贸易摩擦升级的影响,人民币汇率贬值预期增强,在半年末一度出现快速贬值态势,在岸和离岸美元对人民币即期汇率均贬至6.6以上。资本市场方面,上半年A股市场在经历了年初的快速上涨后转为颓势,面临去杠杆、财政及金融环境收紧、贸易摩擦、人民币贬值、债券信用风险暴露速度加快、股权质押等风险因素影响,上半年上证综指以下跌13.90%收官;在市场风格方面,大小盘齐跌,上证50指数、沪深300指数、创业板综指分别下跌13.30%、12.90%、11.92%;行业方面,休闲服务、医药生物、食品饮料等板块涨幅居前,通信、电气设备、机械设备、有色金属、建筑装饰、国防军工等板块跌幅较大。报告期内中证证券公司指数下跌21.72%。

报告期内本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

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0.8476元,本报告期份额净值增长率为-19.81%,同期业绩比较基准收益率为-20.67%,日跟踪偏离度的均值为0.02%,年化跟踪误差为0.486%,各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,中美贸易争端叠加全球经济复苏放缓将对出口带来冲击、房地产市场降温对经济增长的负面影响以及宏观政策与改革力图稳增长依然是影响未来A股市场最值得关注的因素。内外部的环境可能使得下半年宏观政策更加注重平稳、提振内需,为改革创造稳定环境。货币政策为了实现全年中性的目标会有更加灵活的空间,财政政策也可能会更加积极。从海外因素来看,中美贸易摩擦依然存在升级风险,但市场对中国出口到美国的商品关税提升已有一定的预期,未来市场反应上可能会逐步钝化;政策协调性增加后经济企稳预期的提升也将有助于缓和人民币汇率的波动。考虑到政策潜在的灵活性及新经济的韧性,在宏观政策的"预调微调"下,下半年经济仍然有望实现平稳增长。如果未来货币政策适度并使物价水平不出现大的波动,同时各项改革措施稳步推进的背景下,考虑到当前A股市场整体估值水平仍偏低,未来A股市场的机会仍将大于风险。从长期来看改革与创新仍然值得期待,中国新老经济的结构转换仍在深化中,消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点。A股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地,因此在战略上对于当前A股市场不必悲观。通过资本市场把社会资金、资源更有效率地配置,促进产业升级,改善上市公司业绩,实现A股市场和产业发展的正反馈。在宏观经济转型大背景下,金融市场从间接融资走向直接融资的大变革中,券商将是制度红利释放的最大受益者。

作为被动型投资基金,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,为投资者提供质地优良的指数投资工具,既为短期投资者提供"高弹性、高波动"的投资工具,又为长期看好证券行业投资前景的投资者提供方便、高效的投资工具。

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

根据《易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的约定,分级运作期内,本基金(包括证券公司分级基础份额、证券公司A类份额、证券公司B类份额)不进行收益分配。

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:易方达证券公司指数分级证券投资基金

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	31,537,454.24	24,173,029.13
结算备付金	424,728.08	147,505.46
存出保证金	87,336.94	50,652.42
交易性金融资产	488,222,609.75	322,667,418.79
其中:股票投资	488,222,609.75	322,667,418.79
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	-	-
应收利息	6,070.88	4,931.54
应收股利	-	-
应收申购款	1,509,186.51	949,419.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	521,787,386.40	347,992,956.58
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	-	1,282,014.67
应付赎回款	3,918,103.16	5,012,126.29
应付管理人报酬	413,099.43	277,186.13
应付托管费	90,881.87	60,980.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	183,926.47	130,414.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	472,929.93	428,581.85
负债合计	5,078,940.86	7,191,304.48
所有者权益:		
实收基金	951,597,515.05	503,275,619.19
未分配利润	-434,889,069.51	-162,473,967.09
所有者权益合计	516,708,445.54	340,801,652.10
负债和所有者权益总计	521,787,386.40	347,992,956.58

注:报告截止日2018年6月30日,易方达证券公司分级份额净值0.8476元,易方达证券公司分级A份额参考净值1.0441元,易方达证券公司分级B份额参考净值0.6511元;基金份额总额609,626,179.96份,下属分级基金的份额总份别为:易方达证券公司分级基金份额总额533,155,145.96份,易方达证券公司分级A基金份额总额38,235,517.00份,易方达证券公司分级B基金份额总额38,235,517.00份。

6.2 利润表

会计主体:易方达证券公司指数分级证券投资基金

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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-105,402,093.75	-5,561,056.48
1.利息收入	111,208.29	77,847.48
其中:存款利息收入	110,993.78	72,008.58
债券利息收入	214.51	5,838.90
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)	2,070,871.25	-2,027,719.51
其中:股票投资收益	-161,602.70	-3,545,321.10
基金投资收益	-	-
债券投资收益	101,088.30	1,000.00
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	2,131,385.65	1,516,601.59
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-108,073,055.48	-3,846,493.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	488,882.19	235,308.98
减:二、费用	3,423,522.72	2,621,911.34
1. 管理人报酬	2,188,022.32	1,635,823.84
2. 托管费	481,364.91	359,881.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	430,534.89	304,046.43
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	323,600.60	322,159.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-108,825,616.47	-8,182,967.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-108,825,616.47	-8,182,967.82

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达证券公司指数分级证券投资基金

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)	503,275,619.19	-162,473,967.09	340,801,652.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-108,825,616.47	-108,825,616.47
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)	448,321,895.86	-163,589,485.95	284,732,409.91
其中:1.基金申购款	1,005,795,848.93	-352,060,476.12	653,735,372.81
2.基金赎回款	-557,473,953.07	188,470,990.17	-369,002,962.90
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)	951,597,515.05	-434,889,069.51	516,708,445.54

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)	475,441,169.28	-130,578,669.64	344,862,499.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,182,967.82	-8,182,967.82
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)	-80,116,285.69	25,093,537.61	-55,022,748.08
其中:1.基金申购款	189,921,904.98	-53,289,567.40	136,632,337.58
2.基金赎回款	-270,038,190.67	78,383,105.01	-191,655,085.66
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)	395,324,883.59	-113,668,099.85	281,656,783.74

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

易方达证券公司指数分级证券投资基金(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]670号《关于准予易方达证券公司指数分级证券投资基金注册的批复》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《易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同》于2015年7月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为211,788,445.10份基金份额,其中认购资金利息折合20,322.06份基金份额。根据《易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的约定,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》、《易方达证券公司指数分级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、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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	2,188,022.32	1,635,823.84
其中:支付销售机构的客户维护费	624,847.65	218,417.64

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.0%÷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、休息日等,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	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	481,364.91	359,881.27

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.22%÷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、休息日等,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

易方达证券公司分级

无。

易方达证券公司分级A

无。

易方达证券公司分级B

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
中国建设银行-活期存款	31,537,454.24	104,083.46	17,008,208.47	69,961.68

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

上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	002841	视源股份	新股网下发行	1,428	27,217.68
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	3,344	64,539.20
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
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,045	26,072.75

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

为更好地实现基金合同所规定的投资目标,紧密跟踪标的指数,提高基金运作效率,本基金根据基金合同约定的投资策略,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,经基金托管人审核同意,在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券。

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488,222,609.75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322,604,357.78元,第二层次63,061.01元,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	488,222,609.75	93.57
	其中:股票	488,222,609.75	93.57
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	31,962,182.32	6.13
8	其他各项资产	1,602,594.33	0.31
9	合计	521,787,386.40	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	191,454.74	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	487,878,369.02	94.42
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	488,222,609.75	94.49

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	600030	中信证券	4,332,961	71,797,163.77	13.90
2	600837	海通证券	5,260,026	49,812,446.22	9.64
3	601211	国泰君安	2,442,786	36,006,665.64	6.97
4	601688	华泰证券	2,123,153	31,783,600.41	6.15
5	000776	广发证券	1,923,829	25,529,210.83	4.94
6	600958	东方证券	2,327,063	21,246,085.19	4.11
7	600999	招商证券	1,487,047	20,342,802.96	3.94
8	000166	申万宏源	4,394,573	19,204,284.01	3.72
9	601901	方正证券	2,675,550	17,899,429.50	3.46
10	601377	兴业证券	3,016,162	15,895,173.74	3.08

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	600030	中信证券	50,840,212.86	14.92
2	600837	海通证券	32,917,447.43	9.66
3	601211	国泰君安	23,155,598.99	6.79
4	601688	华泰证券	20,118,802.00	5.90
5	000776	广发证券	16,639,151.13	4.88
6	600958	东方证券	16,466,803.89	4.83
7	000166	申万宏源	14,773,229.85	4.33
8	600999	招商证券	13,377,385.32	3.93
9	601377	兴业证券	10,669,838.69	3.13
10	000783	长江证券	9,417,154.60	2.76
11	002736	国信证券	9,232,630.02	2.71
12	601901	方正证券	9,160,401.45	2.69
13	601788	光大证券	8,632,037.00	2.53
14	601198	东兴证券	7,992,260.78	2.35
15	601099	太平洋	7,009,316.00	2.06
16	601555	东吴证券	6,908,884.00	2.03
17	000728	国元证券	6,471,881.02	1.90
18	600109	国金证券	6,269,737.00	1.84
19	002797	第一创业	6,009,897.20	1.76
20	002673	西部证券	5,997,570.06	1.76

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	600030	中信证券	18,995,974.00	5.57
2	000166	申万宏源	3,925,458.26	1.15
3	600837	海通证券	3,876,987.00	1.14
4	601211	国泰君安	2,680,450.00	0.79
5	601688	华泰证券	2,375,581.00	0.70
6	000776	广发证券	1,937,406.00	0.57
7	600958	东方证券	1,739,432.00	0.51
8	600999	招商证券	1,536,564.00	0.45
9	601377	兴业证券	1,240,284.00	0.36
10	000783	长江证券	1,099,417.00	0.32
11	002736	国信证券	1,061,907.00	0.31
12	601901	方正证券	1,047,051.00	0.31
13	601788	光大证券	996,626.39	0.29
14	601099	太平洋	858,397.00	0.25
15	601555	东吴证券	818,718.00	0.24
16	000728	国元证券	773,025.00	0.23
17	600109	国金证券	728,742.00	0.21
18	002797	第一创业	726,432.00	0.21
19	002673	西部证券	725,359.00	0.21
20	300750	宁德时代	662,860.60	0.19

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	332,136,281.55
卖出股票收入(成交)总额	58,346,432.41

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

7.12.12018年3月26日,上海证券交易所针对方正证券未按规定履行信息披露义务予以公开谴责。

本基金为指数型基金,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。除方正证券外,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。

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	87,336.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,070.88
5	应收申购款	1,509,186.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,602,594.33

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

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
易方达证券公司分级	55,130	9,670.87	2,016,133.59	0.38%	531,139,012.37	99.62%
易方达证券公司分级A	234	163,399.65	20,124,170.00	52.63%	18,111,347.00	47.37%
易方达证券公司分级B	2,969	12,878.25	1,974,007.00	5.16%	36,261,510.00	94.84%
合计	58,333	10,450.79	24,114,310.59	3.96%	585,511,869.37	96.04%

注:对于分级基金,下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额,对于合计数,比例的分母采用下属基金份额的合计数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

易方达证券公司分级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	丁碧霞	4,078,852.00	30.82%
2	吴琪	1,091,551.00	8.25%
3	胡永智	781,300.00	5.90%
4	董桂芳	344,588.00	2.60%
5	张军	235,438.00	1.78%
6	柳海苗	215,800.00	1.63%
7	甘利红	205,620.00	1.55%
8	姚崇德	204,029.00	1.54%
9	张晓峰	170,411.00	1.29%
10	徐菲	156,600.00	1.18%

易方达证券公司分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品－013C	5,500,000.00	14.38%
2	中国人寿保险股份有限公司	4,119,231.00	10.77%
3	凌岗	3,961,200.00	10.36%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	3,934,381.00	10.29%
5	丁碧霞	3,840,300.00	10.04%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－个人分红	2,264,762.00	5.92%
7	富国基金－广发银行－中信证券股份有限公司	1,851,772.00	4.84%
8	廖孝平	1,756,100.00	4.59%
9	太平洋资管－建设银行－太平洋第三极稳定增值混合型产品	1,686,850.00	4.41%
10	李怡名	855,900.00	2.24%

易方达证券公司分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈广明	2,894,093.00	7.57%
2	中国人寿再保险有限责任公司	1,001,841.00	2.62%
3	陈如胜	942,800.00	2.47%
4	中国人寿保险股份有限公司	938,166.00	2.45%
5	丁碧霞	640,845.00	1.68%
6	徐刚	602,490.00	1.58%
7	李萍	500,000.00	1.31%
8	王志刚	500,000.00	1.31%
9	陈雄	404,856.00	1.06%
10	田子跃	401,813.00	1.05%

注:(1)本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人;

(2)对于易方达证券公司分级基础份额、易方达证券公司分级A、易方达证券公司分级B前十名持有人份额比例的分母采用各自级别的份额。

8.3 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	易方达证券公司分级	83,582.14	0.0157%
	易方达证券公司分级A	0.00	0.0000%
	易方达证券公司分级B	0.00	0.0000%
	合计	83,582.14	0.0137%

8.4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	易方达证券公司分级	0
	易方达证券公司分级A	0
	易方达证券公司分级B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达证券公司分级	0
	易方达证券公司分级A	0
	易方达证券公司分级B	0
	合计	0

9开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达证券公司分级	易方达证券公司分级A	易方达证券公司分级B
基金合同生效日(2015年7月8日)基金份额总额	211,788,445.10	-	-
本报告期期初基金份额总额	231,673,786.69	45,371,217.00	45,371,217.00
本报告期基金总申购份额	644,348,142.70	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	357,138,183.43	-	-
本报告期基金拆分变动份额	14,271,400.00	-7,135,700.00	-7,135,700.00
本报告期期末基金份额总额	533,155,145.96	38,235,517.00	38,235,517.00

注:拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额。

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 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
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	42,823,041.01	11.03%	34,258.39	10.14%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	241,690,432.76	62.27%	225,087.25	66.65%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	11,515,113.94	2.97%	9,211.99	2.73%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	15,155,423.07	3.90%	7,578.17	2.24%	-
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	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	38,157,307.11	9.83%	30,526.00	9.04%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	38,789,862.07	9.99%	31,031.55	9.19%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增南京证券股份有限公司一个交易单元,新增长城证券股份有限公司两个交易单元。

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 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
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	1,630,502.81	100.00%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

11影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《资管新规》)要求,公募产品不得进行份额分级,本基金将在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范,请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日