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

2017年第三季度报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达沪深300非银ETF
基金主代码	512070
交易代码	512070
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2014年6月26日
报告期末基金份额总额	924,338,078.00份
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，固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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	沪深300非银行金融指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型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	中国建设银行股份有限公司

§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（2017年7月1日-2017年9月30日）
1.本期已实现收益	62,536,132.60
2.本期利润	162,141,659.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.1700
4.期末基金资产净值	1,856,279,154.02
5.期末基金份额净值	2.0082

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

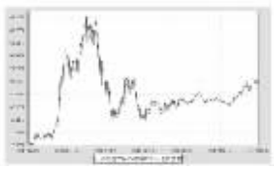
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.14%	1.15%	7.77%	1.16%	1.37%	-0.01%

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

易方达沪深300非银行金融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

（2014年6月26日至2017年9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100.82%，同期业绩比较基准收益率为97.76%。

§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		
金海燕	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发起式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	2014-06-26	-	12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总监。

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7次，均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。

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

2017年三季度国内宏观经济增长延续了前期的复苏态势，国内外需求旺盛、供需格局持续改善，最新公布的宏观数据显示9月份全国制造业PMI为52.4，创2012年5月以来的新高，在经历了7月和8月的低迷态势后中国经济增长表现出了很强的韧性。在流动性方面，季度末央行宣布对普惠金融领域实施定向降准，投资者对于前期偏紧的流动性预期有所改善。三季度人民币对美元即期汇率大幅升值，在岸和离岸美元对人民币即期汇率均一度回落至6.5以下。资本市场方面，A股市场表现良好，最终三季度上证综指以上涨4.90%收官。在风格方面，大小盘齐涨，小盘股一改前期的颓势，本季度上证50指数、沪深300指数、创业板综指、中证500指数分别上涨4.80%、4.63%、4.04%、7.58%；行业方面，有色金属、钢铁、食品饮料、采掘、通信、电子、保险等板块涨幅居前，公用事业、传媒、纺织服装、家用电器、医药生物等板块下跌。报告期内沪深300非银行金融指数上涨7.77%。

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2.0082元，本报告期份额净值增长率为9.14%，同期业绩比较基准收益率为7.77%，日跟踪偏离度的均值为0.03%，年化跟踪误差为0.945%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

§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	权益投资	1,842,257,746.58	99.17
	其中：股票	1,842,257,746.58	99.17
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	15,429,904.14	0.83
7	其他资产	56,901.02	0.00
8	合计	1,857,744,551.74	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	39,793.60	0.00
C	制造业	1,107,435.09	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	1,840,812,761.57	99.17
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	-	-
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	1,842,257,746.58	99.24

5.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	10,350,489	560,582,484.24	30.20
2	600030	中信证券	7,520,727	136,802,024.13	7.37
3	600837	海通证券	7,732,652	114,288,596.56	6.16
4	601601	中国太保	3,003,089	110,904,076.77	5.97
5	601211	国泰君安	4,309,010	93,203,886.30	5.02
6	601688	华泰证券	3,121,003	70,597,087.86	3.80
7	000776	广发证券	2,821,523	53,552,506.54	2.88
8	600958	东方证券	2,975,351	47,784,137.06	2.57
9	600999	招商证券	2,185,568	46,749,299.52	2.52
10	601336	新华保险	796,504	45,137,881.68	2.43

5.4 报告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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据中信证券股份有限公司董事会2017年5月24日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌未按规定向客户提供融资融券服务，被中国证监会予以行政处罚。

根据广发证券股份有限公司董事会2016年11月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会（行政处罚决定书）的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2016年11月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会（行政处罚决定书）的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2017年5月24日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌在提供融资融券业务中未按规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款，被中国证监会予以行政处罚。

根据华泰证券股份有限公司董事会2016年11月29日发布的《关于收到中国证监会（行政处罚决定书）的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

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。除中信证券、广发证券、海通证券、华泰证券外，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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	54,127.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,773.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,901.02

5.11.4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。

5.11.5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	1,030,598,407.00
报告期基金总申购份额	150,739,671.00
减：报告期基金总赎回份额	257,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	924,338,078.00

注：期初基金总份额包含场外份额171,438,510份；期末基金总份额包含场外份额194,178,181份；总申购份额包含场外总申购份额22,739,671份。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司－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	1	2017年07月01日－2017年09月30日	773,716,391.00	333,974,000.00	464,131,000.00	643,559,391.00	69.62%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。						

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2.《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基金合同》；

3.《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托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

9.2 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。

9.3 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

二〇一七年十月二十六日

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

2017年第三季度报告

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：二〇一七年十月二十六日

§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2017年10月23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2017年7月27日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中证全指证券公司ETF
基金主代码	512570
交易代码	512570
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年7月27日
报告期末基金份额总额	45,806,068.00份
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，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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型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

§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（2017年7月27日（基金合同生效日）-2017年9月30日）
1.本期已实现收益	3,177,898.72
2.本期利润	5,283,999.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0328
4.期末基金资产净值	48,260,123.32
5.期末基金份额净值	1.0536

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.本基金合同于2017年7月27日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

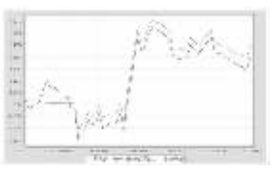
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.36%	1.18%	4.26%	1.29%	1.10%	-0.11%

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

易方达中证全指证券公司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7月27日至2017年9月30日）



注：1.本基金合同于2017年7月27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，自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为5.36%，同期业绩比较基准收益率为4.26%。

§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		
金海燕	本基金的基金经理、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	2017-07-27	-	12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 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7次，均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。

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

2017年三季度国内宏观经济增长延续了前期的复苏态势，国内外需求旺盛、供需格局持续改善，最新公布的宏观数据显示9月份全国制造业PMI为52.4，创2012年5月以来的新高，在经历了7月和8月的低迷态势后中国经济增长表现出了很强的韧性。在流动性方面，季度末央行宣布对普惠金融领域实施定向降准，投资者对于前期偏紧的流动性预期有所改善。三季度人民币对美元即期汇率大幅升值，在岸和离岸美元对人民币即期汇率均一度回落至6.5以下。资本市场方面，A股市场表现良好，最终三季度上证综指以上涨4.90%收官。在风格方面，大小盘齐涨，小盘股一改前期的颓势，本季度上证50指数、沪深300指数、创业板综指、中证500指数分别上涨4.80%、4.63%、4.04%、7.58%；行业方面，有色金属、钢铁、食品饮料、采掘、通信、电子、保险等板块涨幅居前，公用事业、传媒、纺织服装、家用电器、医药生物等板块下跌。报告期内中证证券公司指数上涨7.70%。

本报告期涵盖了基金的建仓期，中证全指证券公司ETF成立于2017年7月27日，基于建仓期内对大盘、证券行业基本面以及市场情绪的短期判断，本基金采取了相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下完成了基金的建仓工作，并于8月11日在上海证券交易所上市交易暨开放日常申购赎回。本基金自成立以来，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，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1.0536元，本报告期份额净值增长率为5.36%，同期业绩比较基准收益率为4.26%，日跟踪偏离度的均值为0.20%，年化跟踪误差为5.937%，因本报告期包含了基金合同规定的建仓期，故跟踪误差等指标仍在调整之中。

§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	权益投资	43,935,394.80	90.12
	其中：股票	43,935,394.80	90.12
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	4,716,026.94	9.67
7	其他资产	102,028.38	0.21
8	合计	48,753,450.12	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	136,925,814.97	0.25
C	制造业	3,795,773,876.39	6.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	772,154,577.67	1.41
E	建筑业	270,038,573.87	0.49
F	批发和零售业	513,952,412.18	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	428,152,859.62	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	405,578,966.43	0.74
J	金融业	526,014,673.04	0.96
K	房地产业	421,463,850.65	0.77
L	租赁和商务服务业	1,643,116.50	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	108,852,165.61	0.20
S	综合	88,584,888.29	0.16
	合计	7,627,525,461.22	13.88

5.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	11,892,060	450,709,074.00	0.82
2	601328	交通银行	35,994,859	227,487,508.88	0.41
3	600572	康恩贝	25,815,798	182,517,691.86	0.33
4	000661	长春高新	1,149,150	170,706,232.50	0.31
5	000998	隆平高科	6,091,911	158,389,686.00	0.29
6	600335	国机汽车	10,758,611	150,943,312.33	0.27
7	000006	深振业A	14,598,400	143,794,240.00	0.26
8	600122	宏图高科	14,038,400	143,191,680.00	0.26
9	000002	万科A	5,405,620	141,897,761.25	0.26
10	600056	中国医药	5,619,131	137,443,944.26	0.25

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	306,907.92	0.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	23,741.90	0.05
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	17,054.83	0.04
J	金融业	43,578,312.00	90.30
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	-	-
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	9,378.15	0.02
S	综合	-	-
	合计	43,935,394.80	91.04

5.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	313,500	5,702,565.00	11.82
2	600837	海通证券	322,600	4,768,028.00	9.88
3	601211	国泰君安	180,500	3,904,215.00	8.09
4	601688	华泰证券	131,000	2,963,220.00	6.14
5	000776	广发证券	118,900	2,256,722.00	4.68
6	600958	东方证券	124,100	1,993,046.00	4.13
7	600999	招商证券	91,300	1,952,907.00	4.05
8	601377	兴业证券	187,200	1,585,584.00	3.29
9	601901	方正证券	163,600	1,406,960.00	2.92
10	000166	申万宏源	239,900	1,398,617.00	2.90

5.4 报告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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1根据中信证券股份有限公司董事会2017年5月24日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌未按规定向客户提供融资融券服务，被中国证监会予以行政处罚。

根据广发证券股份有限公司董事会2016年11月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会（行政处罚决定书）的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2016年11月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会（行政处罚决定书）的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2017年5月24日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌在提供融资融券业务中未按规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款，被中国证监会予以行政处罚。

根据华泰证券股份有限公司董事会2016年11月29日发布的《关于收到中国证监会（行政处罚决定书）的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

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。除中信证券、广发证券、海通证券、华泰证券、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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,271.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,757.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,028.38

5.11.4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。

5.11.5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

基金合同生效日基金份额总额	352,806,068.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	313,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	45,806,068.00

注：本基金合同生效日为2017年7月27日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|---