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更新的招募说明书摘要

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
(二〇一八年二月)

重要提示

1、本基金根据2016年2月17日中国证券监督管理委员会《关于进一步推进证券投资基金服务业发展有关事项的通知》(证监发[2015]221号)、以及2016年5月14日《关于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联接基金注册的批复》(证监许可[2016]281号),以及2016年5月14日《关于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募集申请的回函》(机构部函[2016]2194号)进行募集。本基金的基金合同于2017年1月4日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并按照中国证监会颁布、基金合同生效之日现行有效的法律文件,基金投资人自该基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

2、基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值及市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

3、基金管理人保证按照《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等有关规定,履行了应尽的义务。

4、本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%。本基金投资于证券期货市场,基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遭到的主要风险包括:(1)本基金特有的风险,主要包括标的指数的风险、标的指数成份股行业集中风险、标的指数编制方案带来的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金管理人代理申赎投资者证券发生的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资者参与QDII做出投资决策的风险和IOPV计算错误的风险、第三方机构服务的风险、管理风险、创新风险等;(2)投资风险,主要包括市场风险等;(3)证券风险,主要包括操作风险等;(4)不可抗力风险;等等。本基金股票投资期权衍生品、参与融资业务、参与证券借出、债券基金等投资市场基金、本基金跟踪标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,同时保证“跟踪误差”风险等投资风险的特殊风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

5、本基金由易方达基金管理有限公司独立管理,未聘请境外投资顾问。

6、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

7、在目前结算规则下,投资者当日申购的基金份额,通常交收完成后方可卖出赎回,即T日申购的基金份额,T日交收成功后T+1日可卖出赎回,当日买入的基金份额,同日可以赎回或卖出,由于登记结算机构对现金份额不实取申购款算交收模式,当投资者赎回申请被登记结算机构确认后,赎赎回的基金份额即被记减,但此时投资者尚未收到赎回现金替代款,投资者投资基金时需具有证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

8、投资者一旦认购、申购或赎回本基金,即表示对基金认购、申购或赎回所涉及的基金的证券发更登记业务、证券结算业务、证券交易所有关业务、银行存款、货币市场工具、跟踪标的指数所期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,本基金还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,不低于非现金基金资产的80%。

五、基金的投资策略

本基金主要采取相关指数权重配置的策略,并以期货、现金等作为替代投资策略,同时,本基金可适当根据市场情况,以更好实现本基金的投资目标。

(1)组合复制策略

本基金主要采取完全复制法进行投资,即按考中证海外中国互联网50指数的成份股组成及权重构建投资股票投资组合,并根据中证海外中国互联网50指数的成份股组成及权重变动对投资组合进行调整。

(2)替代性策略

当市场流动性不足等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股之外的证券品进行替代。

为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率,本基金可投资货币市场工具、股指期货或国债期货等金融衍生工具。

本基金力争将年化跟踪误差控制在5%以内。

未来,随着投资工具的发展和市场、基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

六、基金的业绩比较基准

中证海外中国互联网50指数

七、基金的风险收益特征

本基金属股票指数基金,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。

八、基金投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同的规定,复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告每天数据的期间为2017年10月1日至2017年12月31日

1、期末资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,230,756,240.73	98.21
	其中:普通股	308,062,186.98	24.58
	存托凭证	922,694,053.75	73.63
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,239,001.75	1.38
8	其他资产	5,197,271.57	0.41
9	合计	1,253,192,514.05	100.00

注:(1)上表中的普通股投资项含可退替代款转借增值,而之和项,的合计项不含可退替代款转借增值。
(2)本基金本报告期末通过跟投渠道参与新机制投资的港股市值为27,055,046.34元,占净值比例2.19%。

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的投资及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	947,929,886.12	76.84
香港	282,827,374.61	22.93
合计	1,230,756,240.73	99.77

注:(1)国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定。
(2)ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
炼油	-	-
材料	-	-
工业	4,339,075.04	0.35
非必需消费品	207,497,273.64	16.82
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	16,897,022.53	1.37
信息技术	1,002,082,869.52	81.23
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	1,230,756,240.73	99.77

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

4、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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	278,400	230,234,247.29	18.91
2	Baidu Inc	百度股份有限公司	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	157,640	241,248,312.16	19.56
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	213,484	240,530,737.56	19.50
4	NetEase Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	60,796	137,080,169.73	11.11
5	JD.com Inc	京东集团	JD US	纳斯达克证券交易所	美国	447,982	121,244,789.93	9.83
6	Ctrip.com International Ltd	携程旅行网	CTRP US	纳斯达克证券交易所	美国	199,329	57,438,289.83	4.66
7	Silicon Inc	硅谷城网	WUBA US	纽约证券交易所	美国	52,305	24,488,633.32	1.99
8	SINA Corp	新浪公司	SINA US	纳斯达克证券交易所	美国	32,313	21,179,413.74	1.72
9	Vipshop Holdings Ltd	唯品会控股有限公司	VIPS US	纽约证券交易所	美国	216,922	16,612,065.52	1.35
10	Weibo Corp	新浪微博	WB US	纳斯达克证券交易所	美国	19,671	13,298,153.32	1.08

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5、报告期末按债券品种明细的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,或者报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,192,009.07
3	应收股利	-
4	应收利息	5,262.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,197,271.57

(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)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。

九、基金的业绩

基金管理人承诺根据相关法律法规,诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表未来表现。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,谨慎投资。

本基金合同生效以为2017年1月4日,基金合同生效以来(截至2017年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

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)
基金合同生效至2017年12月31日	49.81%	1.12%	59.34%	1.14%	-9.53%	-0.02%

注:(1)同期业绩比较基准已经换算为以人民币计价。
(2)上述净值表现数据按照《证券投资基金信息披露编报规则第2号(基金净值表现的编制及披露)》的相关规定编制。

十、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

1、基金管理人:易方达基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-certificate

办公地址: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

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会,证监基金字[2001]14号

法定代表人:刘晓艳

设立日期:2001年4月17日

组织形式:有限责任公司

注册资本:12,000万元人民币

存续期限:持续经营

联系人:贺晋

联系电话:400 881 8088

2、股权结构:

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
融通投控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
合计	100%

(二)主要人员情况

1、董事、监事及高级管理人员

章宗勇先生,上海财经大学硕士,董事长,曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理;平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理(主持工作)、国信证券总经理(主持工作)、国泰君安证券总经理、总经理、中国平安保险股份有限公司证券投资部副总经理(主持工作);全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长;易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士,经济学硕士,副董事长、总裁,曾任广发证券有限责任公司投资银行部副总经理、总经理、证券投资部副总经理、基金管理部总经理、投资管理总经理、总经理助理、证券投资部总经理、规划管理部总经理、投资管理部总经理、公司总经理助理、副总经理;广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。现任广发证券股份有限公司执行董事、劳伦斯投资(香港)有限公司董事。

吴宗敏先生,理学博士,工商管理(MBA)硕士,董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问室科员、工商银行珠海分行法律顾问室办事处主任、工商银行深圳分行法律顾问室主任、工商银行总行法律事务部行政法律事务处处长、法律事务部副总经理、总经理、法律顾问、法律事务部总经理兼法律室副主任、资产风险管理部总经理、招商银行总行法律事务部行政、工商银行珠海分行资产风险管理总经理兼特殊资产管理部负责人、公司业务部总经理、顺德分支行行长、党委书记、纪委书记、广东粤财信托有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总经理、董事。

刘菊先生,经济学硕士,董事,曾任国海证券股份有限公司证券投资部副总经理、证券投资部总经理、证券投资部总经理兼证券研究部主任、证券投资部总经理兼证券研究部主任、证券投资部总经理兼证券研究部主任