

**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
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 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

送出日期：二〇一六年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 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 2016 年 8 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末投资目标基金明细.....	36
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46

7.11	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.13	投资组合报告附注	47
8	基金份额持有人信息	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
9	开放式基金份额变动	49
10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	52
11	备查文件目录	55
11.1	备查文件目录	55
11.2	存放地点	55
11.3	查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式联接
基金主代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 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	3,640,825,902.22 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金主代码	510310
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 25 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	中国建设银行股份有限公司

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	本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，本基金决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在正常市场情况下，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

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。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	沪深 300 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，具有与标的指数所代表的市场组合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
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-11,052,353.76
本期利润	-607,952,460.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1630
本期加权平均净值利润率	-16.07%
本期基金份额净值增长率	-13.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	104,510,447.19
期末可供分配基金份额利润	0.0287
期末基金资产净值	3,745,336,349.41
期末基金份额净值	1.0287
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.87%

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. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

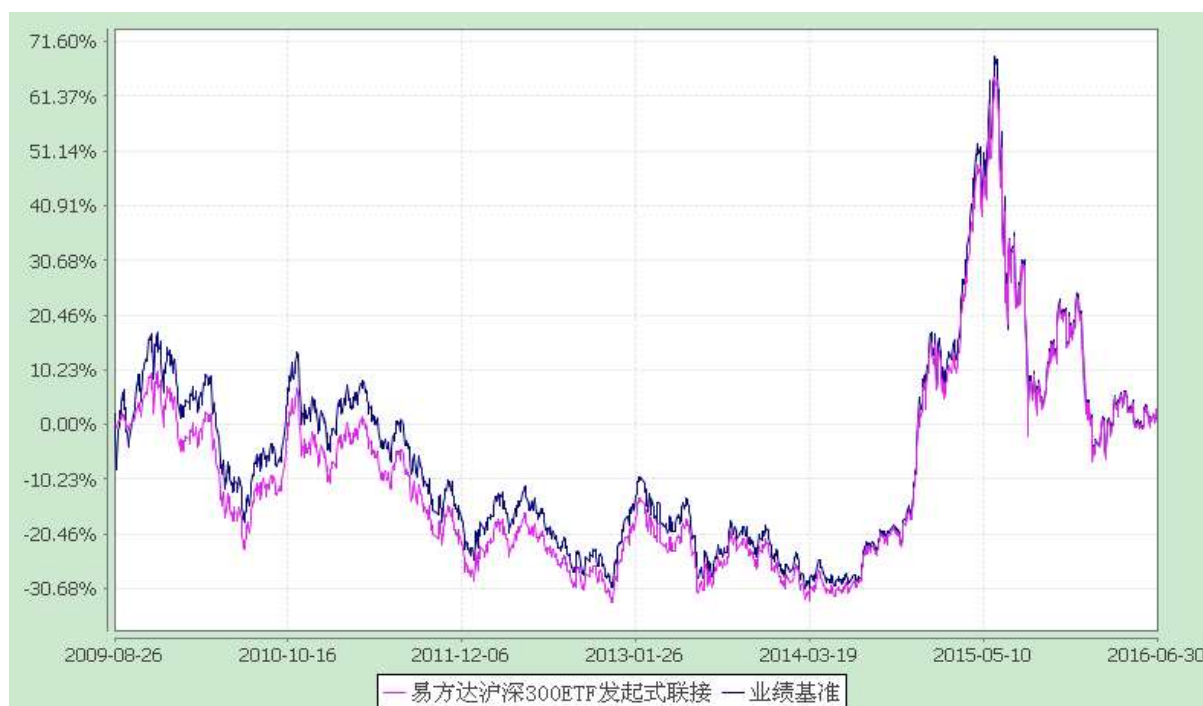
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.24%	0.93%	-0.46%	0.93%	0.70%	0.00%
过去三个月	-1.14%	0.96%	-1.88%	0.96%	0.74%	0.00%
过去六个月	-13.94%	1.73%	-14.66%	1.75%	0.72%	-0.02%
过去一年	-26.44%	2.13%	-28.01%	2.19%	1.57%	-0.06%
过去三年	47.31%	1.71%	41.69%	1.75%	5.62%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.87%	1.50%	2.59%	1.56%	0.28%	-0.06%

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式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

(2009 年 8 月 26 日至 2016 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 2.87%，同期业绩比较基准收益率为 2.59%。

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成立于 2001 年 4 月 17 日，

注册资本 1.2 亿元，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至 2016 年 6 月 30 日，易方达旗下共管理 92 只开放式基金、1 只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，管理公募基金总规模 4056.91 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		
林伟斌	本基金的基金经理、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、易方达黄金交易型开放式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、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2013-11-14	-	8 年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。
余海燕	本基金的基金经理、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、易方达上证 50 指数分级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	2016-04-16	-	11 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、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、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				经理。
--	--	--	--	--	-----

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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% 的交易共有 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 次为不同基金经理管理的非指数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

2016 年上半年国内宏观经济基本面下行压力犹存，1-2 月份工业增速延续了前期的下滑态势，

随后在财政和信贷政策的支持、补库存、房地产回暖的推动下，3 月份宏观经济企稳回升，景气度明显改善，3 月制造业 PMI 大幅回升至 50.2，随后货币政策重心转向供给侧改革以及工业去产能、企业去杠杆仍持续的背景下，制造业投资继续疲弱，二季度房地产投资较上季度有所放缓，经济增长动能有所减弱，宏观数据显示 6 月财新中国制造业 PMI 降至 48.6，2 季度 GDP 同比增速为 6.7%，创 2009 年 2 季度以来新低。资本市场方面，2016 年伊始 A 股市场大幅波动。年初人民币兑美元即期汇率贬值以及叠加宽松货币政策会收紧的预期，A 股市场在一月份连续大幅下挫；随后中国创历史记录的信贷数据出炉，市场对政府宽松刺激的预期升温，同时在人民币兑美元即期汇率止跌回升、美联储加息趋缓以及中国经济基本面数据好转带动市场风险偏好修复的背景下，A 股市场主要股指自 2 月份开始迎来了反弹。进入二季度后海外市场风险事件不断，期间美联储加息预期不断反复，美联储一度尝试以出售资产的方式收缩其资产负债表，临近半年末出现黑天鹅事件——英国公投脱欧，导致全球避险情绪持续攀升，美日欧等发达股市暴跌，英镑和欧元大幅贬值，美元指数急升，黄金、日元等避险资产大涨。相较海外市场的不平静，A 股市场在二季度维持窄幅震荡行情，市场波动较前期大幅减弱，期间虽然遭遇权威人士表态“中国经济走势是长期 L 型”、A 股被纳入 MSCI 指数落空、英国公投脱欧等诸多利空因素，在震荡博弈中 A 股市场表现相对较为平稳。最终上半年上证综指以下跌 17.22% 收官，在风格方面，报告期内沪深 300 指数下跌 15.47%，创业板综指下跌 13.89%；行业方面，仅食品饮料行业录得正收益，有色金属、银行、电子、家用电器等板块跌幅相对较小，传媒、交通运输、商业贸易、休闲服务等板块跌幅较大。

本基金是沪深 300ETF 的联接基金，作为被动型指数基金，报告期内本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深 300 指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

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 1.0287 元，本报告期份额净值增长率为-13.94%，同期业绩比较基准收益率为-14.66%，日跟踪偏离度的均值为 0.03%，年化跟踪误差为 0.716%，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，宏观经济增速依然面临下行风险。随着当前政策重心逐步回归“供给侧改革”，前期稳增长措施效果将逐步淡化，房地产增速预计将缓慢回落，下半年经济增长可能会重回增速缓降的局面。A 股市场未来中短期表现及风险方面我们需要关注：经济继续下行带来的信用风险；各

种改革措施能否加大力度推进；英国脱欧事件开启的逆全球化浪潮带来的外围不确定性增加；中国货币政策基调和汇率政策目标将由于海外市场动荡加剧而受到更大的挑战。从中长期看改革与创新仍然值得期待，在就业与坏账压力之下，财政政策有望加码，而改革进程，包括国企、财税、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推进；通过供给侧改革、提高全要素生产率，将是中国经济长期可持续发展的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。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 股市场不必太悲观。通过资本市场盘活存量、促进创新创业，把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业并购、重组，改善上市公司业绩，A 股市场和产业发展的正反馈仍将重现。

目前以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于相对合理的位置，具有中长期投资价值。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，为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

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，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、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，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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关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：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	83,412,450.14	111,610,747.24
结算备付金		58,497,355.99	72,588,916.46
存出保证金		68,574.20	15,060,877.28
交易性金融资产	6.4.7.2	3,598,485,312.76	4,183,894,893.49
其中：股票投资		45,205,484.52	13,667,546.00
基金投资		3,503,279,828.24	4,030,022,347.49

债券投资		50,000,000.00	140,205,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,716,479.87	-
应收利息	6.4.7.5	1,369,499.17	2,085,869.98
应收股利		-	-
应收申购款		393,842.81	1,481,598.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	176,189.20	-
资产总计		3,753,119,704.14	4,386,722,902.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,162,305.53	3,142,469.45
应付管理人报酬		40,641.97	61,742.51
应付托管费		20,320.97	30,871.27
应付销售服务费		306,687.36	377,094.97
应付交易费用	6.4.7.7	62,287.82	522,056.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	191,111.08	346,806.38
负债合计		7,783,354.73	4,481,040.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,640,825,902.22	3,666,184,583.67
未分配利润	6.4.7.10	104,510,447.19	716,057,278.25
所有者权益合计		3,745,336,349.41	4,382,241,861.92
负债和所有者权益总计		3,753,119,704.14	4,386,722,902.87

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0287 元，基金份额总额 3,640,825,902.22 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-605,233,336.26	1,117,617,118.95
1.利息收入		2,151,789.11	5,191,768.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	489,513.16	504,240.81
债券利息收入		1,662,275.95	4,687,527.80
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）		-11,153,693.00	1,668,220,201.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,115,400.57	10,519,511.03
基金投资收益	6.4.7.13	-4,097,284.58	1,657,257,650.42
债券投资收益	6.4.7.14	119,160.00	-8,948.81
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-8,714,070.00	237,160.00
股利收益	6.4.7.16	423,101.01	214,829.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-596,900,107.08	-563,314,985.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	668,674.71	7,520,134.08
减：二、费用		2,719,124.58	7,413,300.18
1. 管理人报酬		291,778.53	441,831.92
2. 托管费		145,889.21	165,215.93
3. 销售服务费		1,881,325.35	2,095,200.10
4. 交易费用	6.4.7.19	200,424.70	4,416,706.91
5. 利息支出		-	51,290.25
其中：卖出回购金融资产支出		-	51,290.25
6. 其他费用	6.4.7.20	199,706.79	243,055.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-607,952,460.84	1,110,203,818.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-607,952,460.84	1,110,203,818.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	3,666,184,583.67	716,057,278.25	4,382,241,861.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-607,952,460.84	-607,952,460.84
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）	-25,358,681.45	-3,594,370.22	-28,953,051.67
其中：1.基金申购款	569,772,051.32	9,887,197.86	579,659,249.18
2.基金赎回款	-595,130,732.77	-13,481,568.08	-608,612,300.85
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）	3,640,825,902.22	104,510,447.19	3,745,336,349.41
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	6,512,632,583.06	781,045,346.56	7,293,677,929.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,110,203,818.77	1,110,203,818.77
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）	-3,326,137,858.65	-621,731,450.84	-3,947,869,309.49
其中：1.基金申购款	3,919,061,455.56	1,385,480,947.53	5,304,542,403.09
2.基金赎回款	-7,245,199,314.21	-2,007,212,398.37	-9,252,411,712.58
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）	3,186,494,724.41	1,269,517,714.49	4,456,012,438.90

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：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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（原名易方达沪深 300 指数证券投资基金，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 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》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《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,539,280.61 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。

根据中国证监会 2013 年 9 月 17 日下发的《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2013]812 号），易方达沪深 300 指数证券投资基金自 2013 年 9 月 17 日起变更为易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金，修改基金合同中基金的名称、投资范围、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会等条款。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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。

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	83,412,450.14
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	83,412,450.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,785,028.44	45,205,484.52	1,420,456.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	50,015,150.00	50,000,000.00
	合计	50,015,150.00	50,000,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	3,679,729,945.52	3,503,279,828.24	-176,450,117.28
其他	-	-	-
合计	3,773,530,123.96	3,598,485,312.76	-175,044,811.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,314.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10,577.70
应收债券利息	1,343,579.23
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	27.72
合计	1,369,499.17

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
其他应收款	176,189.20
待摊费用	-
合计	176,189.20

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	62,287.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	62,287.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,040.36
预提费用	169,070.72
合计	191,111.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,666,184,583.67	3,666,184,583.67
本期申购	569,772,051.32	569,772,051.32
本期赎回（以“-”号填列）	-595,130,732.77	-595,130,732.77
本期末	3,640,825,902.22	3,640,825,902.22

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,096,392,329.39	-380,335,051.14	716,057,278.25
本期利润	-11,052,353.76	-596,900,107.08	-607,952,460.84
本期基金份额交易产生的变动数	-7,392,882.95	3,798,512.73	-3,594,370.22
其中：基金申购款	169,167,767.39	-159,280,569.53	9,887,197.86
基金赎回款	-176,560,650.34	163,079,082.26	-13,481,568.08
本期已分配利润	-	-	-

本期末	1,077,947,092.68	-973,436,645.49	104,510,447.19
-----	------------------	-----------------	----------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	243,098.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	244,939.96
其他	1,474.79
合计	489,513.16

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,004,449.14
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	110,951.43
合计	1,115,400.57

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	60,618,061.60
减：卖出股票成本总额	59,613,612.46
买卖股票差价收入	1,004,449.14

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	15,120,000.00
减：现金支付申购款总额	4,562,612.28
减：申购股票成本总额	10,446,436.29
申购差价收入	110,951.43

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出/赎回基金成交总额	88,128,733.84
减：卖出/赎回基金成本总额	92,226,018.42
基金投资收益	-4,097,284.58

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	92,367,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	89,880,840.00
减：应收利息总额	2,367,000.00
买卖债券差价收入	119,160.00

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股指期货投资收益	-8,714,070.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	423,101.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	423,101.01

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-597,197,587.08
——股票投资	934,037.08
——债券投资	-324,160.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-597,807,464.16
——贵金属投资	-
2.衍生工具	297,480.00
——权证投资	-
——股指期货	297,480.00
3.其他	-
合计	-596,900,107.08

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	668,674.71
其他	-
合计	668,674.71

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	181,859.85
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	18,564.85
合计	200,424.70

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	12,036.07
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	199,706.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达海外投资(深圳)有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	235,934,579.03	9.46%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券	-	-	371,277,202.88	9.40%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	214,793.93	9.46%	214,793.93	21.49%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	291,778.53	441,831.92
其中：支付销售机构的客户维护费	420,474.66	1,339,323.15

注：1.本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理人的管理费每日计提，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，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐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。

2.客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	145,889.21	165,215.93

注：本基金托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

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，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐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。

6.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	1,040,486.03
中国建设银行	175,985.11
广发证券	10,937.11
合计	1,227,408.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	496,070.66
中国建设银行	342,866.20
广发证券	13,505.07
合计	852,441.93

注：根据本基金基金合同的约定，“本基金销售服务费的年费率在 0 至 0.5% 的范围内，具体费率由基金管理人与基金托管人协商一致并公告后实施”。自 2015 年 2 月 1 日起，经与基金托管人协商一致，本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。其计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	94,419,798.25
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.4 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达资产管理有限公司	-	-	1,476,505.04	0.04%
易方达海外投资(深圳)有限公司	1,133,656.96	0.03%	1,133,656.96	0.03%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	83,412,450.14	243,098.41	268,807,396.53	432,227.89

注：本基金的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。

6.4.10.6 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	300518	盛讯达	新股网下	1,306	29,019.32

			发行		
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	2,793	28,460.67
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
-	-	-	-	-	-

6.4.10.7 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 2,713,196,893 份和 2,648,890,724 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 93.11% 和 93.08%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

6.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	12,000	230,168.00	264,840.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.29	-	-	6,100	54,113.00	50,569.00	-
000629	*ST 钒钛	2016-05-26	重大事项停牌	2.39	-	-	33,000	94,130.00	78,870.00	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项停牌	16.72	2016-07-08	17.37	6,800	115,857.80	113,696.00	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项停牌	12.44	-	-	8,300	113,433.96	103,252.00	-
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项停牌	14.36	-	-	8,200	118,835.88	117,752.00	-
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	2.76	-	-	22,300	64,607.41	61,548.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	4.90	-	-	27,200	142,081.50	133,280.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合, 全面管理、专业分工”的思路, 将风险控制嵌入到全公司的组织架构中, 对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看, 投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控, 并根据其不同权限实施风险控制; 从岗位职能的分工上看, 基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理; 从投资管理的流程看, 已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后

的风险评估”的健全的风险监控体系。

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，采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于沪深 300 E T F，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此本基金具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	51,343,579.23	142,253,303.28
合计	51,343,579.23	142,253,303.28

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	83,412,450.14	-	-	-	83,412,450.14
结算备付金	58,497,355.99	-	-	-	58,497,355.99
存出保证金	68,574.20	-	-	-	68,574.20
交易性金融资产	50,000,000.00	-	-	3,548,485,312.76	3,598,485,312.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,716,479.87	10,716,479.87
应收利息	-	-	-	1,369,499.17	1,369,499.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	393,842.81	393,842.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	176,189.20	176,189.20
资产总计	191,978,380.33	-	-	3,561,141,323.81	3,753,119,704.14
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,162,305.53	7,162,305.53
应付管理人报酬	-	-	-	40,641.97	40,641.97
应付托管费	-	-	-	20,320.97	20,320.97
应付销售服务费	-	-	-	306,687.36	306,687.36
应付交易费用	-	-	-	62,287.82	62,287.82
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	191,111.08	191,111.08
负债总计	-	-	-	7,783,354.73	7,783,354.73
					3
利率敏感度缺口	191,978,380.33	-	-	3,553,357,969.08	3,745,336,349.41
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	111,610,747.24	-	-	-	111,610,747.24
结算备付金	72,588,916.46	-	-	-	72,588,916.46
存出保证金	15,060,877.28	-	-	-	15,060,877.28
交易性金融资产	140,205,000.00	-	-	4,043,689,893.49	4,183,894,893.49
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	-	-	-	2,085,869.98	2,085,869.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,481,598.42	1,481,598.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	339,465,540.98	-	-	4,047,257,361.89	4,386,722,902.87
负债					

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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,142,469.45	3,142,469.45
应付管理人报酬	-	-	-	61,742.51	61,742.51
应付托管费	-	-	-	30,871.27	30,871.27
应付销售服务费	-	-	-	377,094.97	377,094.97
应付交易费用	-	-	-	522,056.37	522,056.37
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	346,806.38	346,806.38
负债总计	-	-	-	4,481,040.95	4,481,040.95
利率敏感度缺口	339,465,540.98	-	-	4,042,776,320.94	4,382,241,861.92

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
1.市场利率下降25个基点		5,799.71	158,874.26
2.市场利率上升25个基点		-5,798.37	-158,508.13

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	45,205,484.52	1.21	13,667,546.00	0.31
交易性金融资产—基金投资	3,503,279,828.24	93.54	4,030,022,347.49	91.96
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,548,485,312.76	94.74	4,043,689,893.49	92.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	191,691,540.65	226,513,700.90
	2.业绩比较基准下降 5%	-191,691,540.65	-226,513,700.90

6.4.14 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 2016 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 43,506,403.24 元，属于第二层次的余额为 3,554,978,909.52 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 4,030,022,347.49 元，第二层次 153,872,546.00 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。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 2016 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(2015 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	45,205,484.52	1.20
	其中：股票	45,205,484.52	1.20
2	基金投资	3,503,279,828.24	93.34
3	固定收益投资	50,000,000.00	1.33
	其中：债券	50,000,000.00	1.33
	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	141,909,806.13	3.78

8	其他各项资产	12,724,585.25	0.34
9	合计	3,753,119,704.14	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	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)、发起式	易方达基金管理有限公司	3,503,279,828.24	93.54

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	34,658.00	0.00
B	采矿业	1,581,463.96	0.04
C	制造业	14,686,326.00	0.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,781,115.00	0.05
E	建筑业	2,245,357.28	0.06
F	批发和零售业	944,457.20	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,367,148.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,735,817.40	0.07
J	金融业	16,268,669.50	0.43
K	房地产业	1,529,464.00	0.04
L	租赁和商务服务业	478,690.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	316,277.64	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	76,713.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	849,518.44	0.02
S	综合	289,683.00	0.01
	合计	45,205,484.52	1.21

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	57,400	1,839,096.00	0.05
2	600016	民生银行	125,200	1,118,036.00	0.03
3	601166	兴业银行	70,600	1,075,944.00	0.03
4	600036	招商银行	60,400	1,057,000.00	0.03
5	601328	交通银行	145,500	819,165.00	0.02
6	600519	贵州茅台	2,700	788,184.00	0.02
7	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
8	600030	中信证券	45,700	741,711.00	0.02
9	600837	海通证券	47,100	726,282.00	0.02
10	600000	浦发银行	45,830	713,573.10	0.02
11	601398	工商银行	151,500	672,660.00	0.02
12	601288	农业银行	202,400	647,680.00	0.02
13	601169	北京银行	53,700	556,869.00	0.01
14	600887	伊利股份	32,100	535,107.00	0.01
15	601601	中国太保	16,600	448,864.00	0.01
16	601766	中国中车	48,500	444,745.00	0.01
17	600900	长江电力	34,900	435,901.00	0.01
18	601668	中国建筑	79,400	422,408.00	0.01
19	000333	美的集团	16,900	400,868.00	0.01
20	601688	华泰证券	20,800	393,536.00	0.01
21	601988	中国银行	111,600	358,236.00	0.01
22	600104	上汽集团	17,500	355,075.00	0.01
23	000858	五粮液	10,000	325,300.00	0.01
24	600999	招商证券	19,300	318,450.00	0.01
25	601818	光大银行	84,300	316,968.00	0.01
26	000001	平安银行	36,400	316,680.00	0.01
27	601989	中国重工	48,600	307,638.00	0.01
28	600048	保利地产	35,600	307,228.00	0.01
29	600276	恒瑞医药	7,500	300,825.00	0.01

30	000725	京东方 A	125,800	290,598.00	0.01
31	600015	华夏银行	28,300	279,887.00	0.01
32	000651	格力电器	12,000	264,840.00	0.01
33	600028	中国石化	55,700	262,904.00	0.01
34	300104	乐视网	4,900	259,259.00	0.01
35	300059	东方财富	11,260	249,972.00	0.01
36	600518	康美药业	16,400	249,116.00	0.01
37	600958	东方证券	14,000	235,340.00	0.01
38	002450	康得新	13,594	232,457.40	0.01
39	002304	洋河股份	3,200	230,144.00	0.01
40	002736	国信证券	13,000	224,250.00	0.01
41	002024	苏宁云商	19,700	213,942.00	0.01
42	002415	海康威视	9,700	208,162.00	0.01
43	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
44	601390	中国中铁	29,600	206,312.00	0.01
45	000783	长江证券	17,600	204,160.00	0.01
46	601006	大秦铁路	31,500	202,860.00	0.01
47	002594	比亚迪	3,300	201,333.00	0.01
48	002739	万达院线	2,500	199,750.00	0.01
49	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
50	000166	申万宏源	23,600	198,476.00	0.01
51	002673	西部证券	7,400	191,364.00	0.01
52	601857	中国石油	25,700	185,811.00	0.00
53	601377	兴业证券	24,800	183,272.00	0.00
54	601628	中国人寿	8,800	183,216.00	0.00
55	600795	国电电力	62,400	182,832.00	0.00
56	601186	中国铁建	18,300	182,268.00	0.00
57	601009	南京银行	19,260	180,851.40	0.00
58	000538	云南白药	2,800	180,040.00	0.00
59	001979	招商蛇口	12,600	179,550.00	0.00
60	000063	中兴通讯	12,500	179,250.00	0.00
61	601336	新华保险	4,400	177,760.00	0.00
62	600570	恒生电子	2,600	173,602.00	0.00
63	600050	中国联通	44,900	171,069.00	0.00
64	600637	东方明珠	7,000	169,890.00	0.00
65	601899	紫金矿业	50,200	169,174.00	0.00
66	601985	中国核电	24,700	168,701.00	0.00
67	300017	网宿科技	2,500	168,000.00	0.00
68	601901	方正证券	21,800	166,988.00	0.00
69	600011	华能国际	22,200	166,944.00	0.00
70	000625	长安汽车	11,900	162,673.00	0.00
71	002230	科大讯飞	4,800	157,680.00	0.00
72	600585	海螺水泥	10,600	154,124.00	0.00
73	600111	北方稀土	11,500	153,065.00	0.00

74	000503	海虹控股	3,800	152,798.00	0.00
75	002142	宁波银行	10,300	152,234.00	0.00
76	601555	东吴证券	11,100	148,740.00	0.00
77	000423	东阿阿胶	2,800	147,924.00	0.00
78	600010	包钢股份	51,700	147,862.00	0.00
79	600547	山东黄金	3,800	147,858.00	0.00
80	601088	中国神华	10,500	147,735.00	0.00
81	601099	太平洋	24,100	147,733.00	0.00
82	300024	机器人	5,760	146,246.40	0.00
83	601211	国泰君安	8,100	144,099.00	0.00
84	600690	青岛海尔	16,200	143,856.00	0.00
85	600893	中航动力	4,100	142,065.00	0.00
86	600100	同方股份	9,400	140,624.00	0.00
87	600271	航天信息	5,900	140,420.00	0.00
88	600705	中航资本	23,800	139,944.00	0.00
89	300027	华谊兄弟	10,296	139,407.84	0.00
90	600066	宇通客车	7,000	138,600.00	0.00
91	002241	歌尔股份	4,800	137,664.00	0.00
92	600703	三安光电	6,700	133,799.00	0.00
93	600019	宝钢股份	27,200	133,280.00	0.00
94	600009	上海机场	5,100	132,855.00	0.00
95	600029	南方航空	18,600	131,316.00	0.00
96	601198	东兴证券	5,300	129,532.00	0.00
97	600109	国金证券	9,600	129,408.00	0.00
98	000100	TCL 集团	38,800	127,652.00	0.00
99	002202	金风科技	8,300	125,579.00	0.00
100	601669	中国电建	21,800	124,478.00	0.00
101	000839	中信国安	5,800	123,598.00	0.00
102	600383	金地集团	11,900	123,284.00	0.00
103	300070	碧水源	8,228	122,432.64	0.00
104	600535	天士力	3,400	121,584.00	0.00
105	600115	东方航空	18,000	118,980.00	0.00
106	600886	国投电力	18,000	118,800.00	0.00
107	601727	上海电气	15,600	117,936.00	0.00
108	600649	城投控股	8,200	117,752.00	0.00
109	600089	特变电工	13,700	116,724.00	0.00
110	000768	中航飞机	5,900	116,171.00	0.00
111	600196	复星医药	6,100	116,022.00	0.00
112	000009	中国宝安	8,400	115,080.00	0.00
113	600340	华夏幸福	4,700	114,586.00	0.00
114	601888	中国国旅	2,600	114,348.00	0.00
115	000728	国元证券	6,800	113,696.00	0.00
116	002456	欧菲光	3,800	112,100.00	0.00
117	600177	雅戈尔	8,100	111,699.00	0.00

118	000069	华侨城 A	17,400	111,360.00	0.00
119	600485	信威集团	6,200	110,608.00	0.00
120	601607	上海医药	6,100	110,105.00	0.00
121	600023	浙能电力	21,600	109,944.00	0.00
122	000568	泸州老窖	3,700	109,890.00	0.00
123	600804	鹏博士	6,000	109,380.00	0.00
124	601600	中国铝业	29,000	109,330.00	0.00
125	002252	上海莱士	2,900	109,272.00	0.00
126	000895	双汇发展	5,200	108,576.00	0.00
127	600369	西南证券	14,900	108,174.00	0.00
128	300315	掌趣科技	10,300	108,047.00	0.00
129	600153	建发股份	9,000	108,000.00	0.00
130	000793	华闻传媒	10,900	107,692.00	0.00
131	600061	国投安信	5,900	105,138.00	0.00
132	601788	光大证券	6,200	105,028.00	0.00
133	600352	浙江龙盛	12,100	104,302.00	0.00
134	600118	中国卫星	3,100	104,160.00	0.00
135	600867	通化东宝	5,020	103,863.80	0.00
136	600660	福耀玻璃	7,400	103,600.00	0.00
137	002465	海格通信	8,300	103,252.00	0.00
138	600406	国电南瑞	7,700	102,949.00	0.00
139	002008	大族激光	4,500	102,780.00	0.00
140	601919	中国远洋	20,200	102,616.00	0.00
141	600489	中金黄金	9,104	102,328.96	0.00
142	600208	新潮中宝	24,100	101,943.00	0.00
143	600031	三一重工	20,200	101,404.00	0.00
144	600739	辽宁成大	6,500	101,205.00	0.00
145	002236	大华股份	7,700	100,870.00	0.00
146	601018	宁波港	20,300	100,485.00	0.00
147	000338	潍柴动力	12,800	99,968.00	0.00
148	002500	山西证券	6,000	99,360.00	0.00
149	600221	海南航空	31,300	99,221.00	0.00
150	000917	电广传媒	6,000	99,180.00	0.00
151	300124	汇川技术	5,099	98,920.60	0.00
152	600309	万华化学	5,700	98,610.00	0.00
153	002475	立讯精密	4,950	97,267.50	0.00
154	600718	东软集团	5,300	97,096.00	0.00
155	600446	金证股份	2,700	97,065.00	0.00
156	600674	川投能源	11,700	96,642.00	0.00
157	000157	中联重科	23,300	96,229.00	0.00
158	002183	怡亚通	6,700	95,944.00	0.00
159	000686	东北证券	7,400	95,534.00	0.00
160	601618	中国中冶	25,800	95,202.00	0.00
161	000559	万向钱潮	6,100	95,160.00	0.00

162	000623	吉林敖东	3,800	94,810.00	0.00
163	600741	华域汽车	6,700	93,867.00	0.00
164	000540	中天城投	14,900	92,827.00	0.00
165	601998	中信银行	16,200	91,854.00	0.00
166	000876	新希望	11,000	91,520.00	0.00
167	601111	中国国航	13,500	91,260.00	0.00
168	000630	铜陵有色	35,400	89,916.00	0.00
169	600415	小商品城	14,400	88,992.00	0.00
170	601933	永辉超市	21,500	88,795.00	0.00
171	002385	大北农	10,900	87,854.00	0.00
172	600018	上港集团	17,200	87,720.00	0.00
173	600663	陆家嘴	3,840	87,360.00	0.00
174	600839	四川长虹	19,600	86,632.00	0.00
175	600085	同仁堂	2,900	86,391.00	0.00
176	000060	中金岭南	8,200	85,526.00	0.00
177	603993	洛阳钼业	20,600	85,490.00	0.00
178	601800	中国交建	8,100	85,293.00	0.00
179	600068	葛洲坝	14,600	84,972.00	0.00
180	002081	金螳螂	8,400	84,168.00	0.00
181	000046	泛海控股	8,300	83,913.00	0.00
182	300003	乐普医疗	4,600	83,904.00	0.00
183	000750	国海证券	11,200	82,768.00	0.00
184	000826	启迪桑德	2,700	82,485.00	0.00
185	000792	盐湖股份	3,900	82,290.00	0.00
186	000413	东旭光电	9,500	81,605.00	0.00
187	000963	华东医药	1,200	80,880.00	0.00
188	002292	奥飞娱乐	2,700	80,865.00	0.00
189	600583	海油工程	11,700	80,847.00	0.00
190	600398	海澜之家	7,100	80,230.00	0.00
191	600150	中国船舶	3,600	80,136.00	0.00
192	600816	安信信托	4,700	79,289.00	0.00
193	000629	*ST 钒钛	33,000	78,870.00	0.00
194	600157	永泰能源	19,700	77,618.00	0.00
195	300144	宋城演艺	3,100	77,221.00	0.00
196	000402	金融街	7,900	76,788.00	0.00
197	300015	爱尔眼科	2,100	76,713.00	0.00
198	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
199	600588	用友网络	3,900	76,362.00	0.00
200	002007	华兰生物	2,420	75,988.00	0.00
201	000977	浪潮信息	3,200	75,040.00	0.00
202	600060	海信电器	4,200	74,256.00	0.00
203	600895	张江高科	4,100	74,128.00	0.00
204	600074	保千里	4,900	73,108.00	0.00
205	601106	中国一重	13,800	71,898.00	0.00

206	300058	蓝色光标	7,400	71,854.00	0.00
207	002422	科伦药业	4,600	70,886.00	0.00
208	600688	上海石化	11,600	70,760.00	0.00
209	601333	广深铁路	18,000	70,380.00	0.00
210	600820	隧道股份	8,300	69,637.00	0.00
211	600642	申能股份	12,100	69,454.00	0.00
212	600332	白云山	2,800	68,992.00	0.00
213	000425	徐工机械	22,500	68,850.00	0.00
214	601098	中南传媒	3,800	68,818.00	0.00
215	600256	广汇能源	16,600	68,060.00	0.00
216	300002	神州泰岳	6,300	67,032.00	0.00
217	002470	金正大	8,300	66,815.00	0.00
218	601866	中海集运	16,800	66,528.00	0.00
219	601258	庞大集团	24,000	66,000.00	0.00
220	600376	首开股份	5,900	65,608.00	0.00
221	600027	华电国际	12,900	63,855.00	0.00
222	600252	中恒集团	14,700	63,798.00	0.00
223	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
224	000738	中航动控	2,400	63,360.00	0.00
225	601718	际华集团	8,200	62,648.00	0.00
226	600737	中粮屯河	5,400	62,370.00	0.00
227	000709	河钢股份	22,500	62,325.00	0.00
228	600875	东方电气	6,300	61,866.00	0.00
229	601991	大唐发电	15,900	61,851.00	0.00
230	600005	武钢股份	22,300	61,548.00	0.00
231	600873	梅花生物	9,900	61,479.00	0.00
232	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
233	600373	中文传媒	2,900	60,175.00	0.00
234	600362	江西铜业	4,400	59,312.00	0.00
235	600170	上海建工	15,100	57,833.00	0.00
236	601021	春秋航空	1,200	57,528.00	0.00
237	601117	中国化学	10,400	57,512.00	0.00
238	300133	华策影视	3,680	57,297.60	0.00
239	000729	燕京啤酒	7,500	56,925.00	0.00
240	600704	物产中大	6,070	56,815.20	0.00
241	600037	歌华有线	3,700	56,277.00	0.00
242	000039	中集集团	3,900	55,263.00	0.00
243	601179	中国西电	10,900	55,263.00	0.00
244	601225	陕西煤业	10,600	54,802.00	0.00
245	000061	农产品	4,500	54,720.00	0.00
246	600372	中航电子	2,800	54,516.00	0.00
247	300251	光线传媒	4,700	54,332.00	0.00
248	601633	长城汽车	6,400	54,016.00	0.00
249	000778	新兴铸管	11,600	53,824.00	0.00

250	002027	分众传媒	3,200	52,832.00	0.00
251	300146	汤臣倍健	3,900	52,806.00	0.00
252	601872	招商轮船	11,200	52,416.00	0.00
253	601992	金隅股份	6,600	51,150.00	0.00
254	000999	华润三九	2,100	50,862.00	0.00
255	002129	中环股份	6,100	50,569.00	0.00
256	601898	中煤能源	9,700	50,052.00	0.00
257	601216	君正集团	6,700	50,049.00	0.00
258	000712	锦龙股份	2,400	49,824.00	0.00
259	600008	首创股份	12,800	49,792.00	0.00
260	600038	中直股份	1,200	49,776.00	0.00
261	600827	百联股份	4,100	49,528.00	0.00
262	002195	二三四五	4,000	49,160.00	0.00
263	603000	人民网	2,900	48,169.00	0.00
264	000883	湖北能源	10,300	47,689.00	0.00
265	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
266	000800	一汽轿车	4,300	46,784.00	0.00
267	600863	内蒙华电	15,400	46,508.00	0.00
268	002146	荣盛发展	6,900	46,368.00	0.00
269	600021	上海电力	4,500	46,215.00	0.00
270	600959	江苏有线	3,200	44,672.00	0.00
271	002294	信立泰	1,600	43,520.00	0.00
272	000156	华数传媒	2,300	42,665.00	0.00
273	002153	石基信息	1,600	42,208.00	0.00
274	601928	凤凰传媒	4,000	42,160.00	0.00
275	300085	银之杰	1,400	41,860.00	0.00
276	600666	奥瑞德	1,200	41,712.00	0.00
277	601958	金钼股份	5,100	41,565.00	0.00
278	600600	青岛啤酒	1,400	40,698.00	0.00
279	000027	深圳能源	6,300	40,194.00	0.00
280	600582	天地科技	8,800	39,600.00	0.00
281	600648	外高桥	2,000	39,420.00	0.00
282	000825	太钢不锈	12,100	38,236.00	0.00
283	002424	贵州百灵	2,200	37,840.00	0.00
284	601808	中海油服	3,100	37,665.00	0.00
285	000898	鞍钢股份	9,800	37,534.00	0.00
286	601608	中信重工	6,900	37,053.00	0.00
287	600871	石化油服	9,600	36,864.00	0.00
288	601118	海南橡胶	6,200	34,658.00	0.00
289	600317	营口港	10,300	34,608.00	0.00
290	002399	海普瑞	1,980	34,570.80	0.00
291	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
292	600098	广州发展	4,300	33,626.00	0.00
293	600685	中船防务	1,300	32,968.00	0.00

294	600783	鲁信创投	1,500	32,415.00	0.00
295	600578	京能电力	7,300	31,244.00	0.00
296	600998	九州通	1,700	29,767.00	0.00
297	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
298	600188	兖州煤业	2,000	21,880.00	0.00
299	600022	山东钢铁	8,900	21,093.00	0.00
300	600606	绿地控股	1,900	20,558.00	0.00
301	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
302	002568	百润股份	900	19,800.00	0.00
303	603885	吉祥航空	700	18,375.00	0.00
304	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
305	601016	节能风电	1,100	10,923.00	0.00
306	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
307	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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	601318	中国平安	2,429,220.00	0.06
2	600016	民生银行	1,898,160.00	0.04
3	601166	兴业银行	1,463,506.00	0.03
4	600036	招商银行	1,291,420.01	0.03
5	600000	浦发银行	1,258,030.18	0.03
6	601328	交通银行	999,581.35	0.02
7	600030	中信证券	968,853.00	0.02
8	600837	海通证券	878,119.84	0.02
9	601288	农业银行	843,879.00	0.02
10	600519	贵州茅台	821,243.00	0.02
11	601398	工商银行	810,144.00	0.02
12	601169	北京银行	721,011.00	0.02
13	601766	中国中车	656,090.00	0.01
14	600887	伊利股份	620,729.00	0.01
15	600900	长江电力	588,528.00	0.01
16	601668	中国建筑	588,246.00	0.01
17	601601	中国太保	564,665.00	0.01
18	601988	中国银行	502,874.00	0.01
19	000333	美的集团	489,002.30	0.01
20	000725	京东方 A	467,170.00	0.01

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	601018	宁波港	4,816,039.00	0.11
2	600271	航天信息	3,557,274.39	0.08
3	600690	青岛海尔	2,953,764.82	0.07
4	601318	中国平安	2,401,859.00	0.05
5	600016	民生银行	2,130,802.34	0.05
6	601166	兴业银行	1,425,267.00	0.03
7	600000	浦发银行	1,407,267.00	0.03
8	600036	招商银行	1,299,797.80	0.03
9	600519	贵州茅台	1,160,585.95	0.03
10	600030	中信证券	915,800.04	0.02
11	600837	海通证券	895,163.01	0.02
12	601328	交通银行	881,601.00	0.02
13	601288	农业银行	844,075.00	0.02
14	601169	北京银行	743,511.14	0.02
15	600887	伊利股份	702,727.00	0.02
16	601398	工商银行	670,502.00	0.02
17	601601	中国太保	606,111.00	0.01
18	601766	中国中车	601,149.00	0.01
19	600900	长江电力	568,158.00	0.01
20	601668	中国建筑	563,438.00	0.01

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	60,420,384.19
卖出股票收入（成交）总额	60,618,061.60

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	50,000,000.00	1.33
	其中：政策性金融债	50,000,000.00	1.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,000,000.00	1.33

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150416	15 农发 16	500,000	50,000,000.00	1.33

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计	-
股指期货投资本期收益	-8,714,070.00
股指期货投资本期公允价值变动	297,480.00

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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

7.13.1 根据海通证券股份有限公司 2015 年 9 月 11 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审查、了解客户真实身份违法违规案，被中国证监会予以警告及行政处罚。

2015 年 12 月 3 日，深圳银监局对于招商银行 2014 年 5 月 17 日后仍开展商业承兑汇票的买入返售交易；个人不良信贷资产违规批量转让、个人理财业务资金违规投资于不良信贷资产的行为给予罚款人民币 100 万元的行政处罚。

2015 年 9 月 25 日，福建银监局对于兴业银行信贷资产非真实、完全转让处以 50 万元罚款的行政处罚。

2016 年 6 月 17 日，针对浦发银行在天猫上以虚假价格进行促销的行为，上海市物价局给予警告并处人民币 5000 元罚款的行政处罚。

2016 年 2 月 19 日，北京银监局对于民生银行当事人业务续做不审慎、未对交易背景进行认真审查、管理缺位导致对应车辆完全脱离监控的行为给予罚款人民币 50 万元的行政处罚。

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。除海通证券、招商银行、兴业银行、浦发银行、民生银行外，本基金的目标 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。除海通证券、招商银行、兴业银行、民生银行外，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。

7.13.2 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	68,574.20
2	应收证券清算款	10,716,479.87

3	应收股利	-
4	应收利息	1,369,499.17
5	应收申购款	393,842.81
6	其他应收款	176,189.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,724,585.25

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	601611	中国核建	775,274.28	0.02	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

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
146,601	24,834.93	1,259,093,653.14	34.58%	2,381,732,249.08	65.42%

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	567,971.00	0.0156%
------------------	------------	---------

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 8 月 26 日）基金份额总额	16,746,252,366.35
本报告期期初基金份额总额	3,666,184,583.67
本报告期基金总申购份额	569,772,051.32
减：本报告期基金总赎回份额	595,130,732.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,640,825,902.22

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 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理。

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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	29,372,317.19	24.49%	27,354.96	27.40%	-
国信证券	2	25,702,159.60	21.43%	20,562.18	20.60%	-
中信证券	3	2,785,239.00	2.32%	2,228.23	2.23%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	315,492.83	0.26%	293.80	0.29%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	61,749,642.93	51.49%	49,399.76	49.48%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少国信证券股份有限公司一个交易单元，新增国金证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司各一个交易单元。

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；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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-	106,174,598.10	59.28%

中信 证券	-	-	-	-	-	-	11,596,18 8.70	6.47%
安信 证券	-	-	-	-	-	-	21,066,26 4.20	11.76%
方正 证券	-	-	-	-	-	-	26,004,25 4.18	14.52%
海通 证券	-	-	-	-	-	-	14,253,89 8.30	7.96%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
3	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-08
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加包商银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-20
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-20
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中经北证为销售机构、参加中经北证申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中证金牛为销售机构、参加中证金牛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
9	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-26
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富济财富为销售机构、参加富济财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-08
11	易方达基金管理有限公司关于在大同证券推出旗下部分开放式基金定期定额投资业务的	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-10

	公告	人网站	
12	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-22
13	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏赛福天钢索股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加同花顺费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-30
16	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-31
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-07
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江泰隆商业银行为销售机构、参加浙江泰隆商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
19	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-12
20	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基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-16
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中正达广为销售机构、参加中正达广申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加锦州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-28
24	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
25	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30

26	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
27	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-04
28	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加云南红塔银行为销售机构、参加云南红塔银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-09
30	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南通四方冷链装备股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-12
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加民生银行直销银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-13
32	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加徽商期货为销售机构、参加徽商期货申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-18
33	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-19
34	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
35	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大智慧为销售机构、参加大智慧申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
37	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加川财证券为销售机构、参加川财证券申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-27
38	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大连银行为销售机构、参加大连银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-31
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金为销售机构、参加鼎信汇金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01
40	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海沪工焊接集团股份有限公司首次公开发	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01

	行 A 股的公告	人网站	
41	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-14
42	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加鑫鼎盛费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-20
43	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市盛讯达科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-21
44	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德州银行为销售机构、参加德州银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-23
45	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加余杭农村商业银行作为销售机构、参加余杭农村商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-23
46	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3.《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基金合同》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.《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托管协议》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 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。

11.3 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

二〇一六年八月二十四日