

# 易方达亚洲精选股票型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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 2017 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.....	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	6
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	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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	11
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	11
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	32
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	33
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权益投资明细... 33	
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动.....	35
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	37
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. 37	
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	37
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金融衍生品投资明 细
	38
7.10	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.
	38
7.11	投资组合报告附注.....
	38
8	基金份额持有人信息.....
	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....
	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....
	39
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...
	39
9	开放式基金份额变动.....
	39
10	重大事件揭示.....
	40
10.1	基金份额持有人大会决议.....
	40
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.....
	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....
	40
10.4	基金投资策略的改变.....
	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....
	40
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.....
	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....
	40
10.8	其他重大事件.....
	43
11	影响投资者决策的其他重要信息.....
	46
11.1	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 .....
	46
12	备查文件目录.....
	46
12.1	备查文件目录.....
	46
12.2	存放地点.....
	46
12.3	查阅方式.....
	47

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达亚洲精选股票型证券投资基金
基金简称	易方达亚洲精选股票（QDII）
基金主代码	118001
交易代码	118001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 1 月 21 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	780,000,167.23 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚洲企业，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将基于对全球及亚洲宏观经济，各类资产的风险与收益水平的综合分析与判断在不同区域和行业间进行积极的资产配置。在构建投资组合方面，本基金坚持价值投资的理念，以自下而上的基本面分析、深入的公司研究、对股票价值的评估作为股票投资的根本依据，辅以自上而下的宏观经济分析、国别/地区因素分析、行业分析，争取获得超越比较基准的回报。固定收益品种与货币市场工具的投资将主要用于回避投资风险、取得稳定回报，同时，保持必要的灵活性，及时把握重大的投资机会。
业绩比较基准	MSCI AC 亚洲除日本指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

### 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	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街 55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	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	易会满

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	无	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 号渣打 银行大厦 32 楼
办公地址		无	香港九龙观塘光观塘路三百八十八号 渣打中心 15 楼
邮政编码		无	无

## 2.5 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	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

## 2.6 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（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-14,193,303.59
本期利润	101,287,420.22
加权平均基金份额本期利润	0.1250
本期加权平均净值利润率	15.32%
本期基金份额净值增长率	16.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-435,621,745.38
期末可供分配基金份额利润	-0.5585
期末基金资产净值	667,243,678.94
期末基金份额净值	0.855
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-14.50%

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	-0.93%	0.71%	0.33%	0.54%	-1.26%	0.17%
过去三个月	5.17%	0.74%	5.69%	0.59%	-0.52%	0.15%
过去六个月	16.96%	0.77%	18.53%	0.58%	-1.57%	0.19%
过去一年	22.32%	0.92%	26.22%	0.73%	-3.90%	0.19%
过去三年	10.47%	1.99%	17.67%	0.92%	-7.20%	1.07%
自基金合同生效起至今	-14.50%	1.57%	26.85%	1.04%	-41.35%	0.53%

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2010 年 1 月 21 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-14.50%，同期业绩比较基准收益率为26.85%。

## 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，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连等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。2012 年 10 月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016 年 12 月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至 2017 年 6 月 30 日，易方达的总资产管理规模达到 11000 亿



元，其中公募基金管理规模 4842 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		
张坤	本基金的基金经理、易方达中小盘混合型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、研究部总经理助理	2014-04-08	-	9 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程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相应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，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

##### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，美国经济呈现持续复苏的态势，全球其他主要经济体也相继复苏。中国方面，宏观经济方面，前期商品房市场的热销拉动房地产投资恢复，带动经济企稳。流动性方面，在实施金融去杠杆政策的背景下，流动性保持在较紧的水平。受经济复苏和流动性紧张的交替影响，工业品价格先涨后跌。

本基金在上半年的股票仓位略微下降，并对结构进行了调整。市场配置方面，增加了美国上市中概股的配置比例。行业方面，增加了互联网、医药等行业的配置，降低了汽车、金融等行业的配置。个股方面，增加了业务模式有特色、估值水平合理的中小市值公司的投资比例。

### 4.5.2 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 0.855 元，本报告期份额净值增长率为 16.96%，同期业绩比较基准收益率为 18.53%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球来看，各个主要经济体呈现经济复苏的态势，中国经济的尾部风险已经基本消除，美国市场和香港市场集中了一批代表中国“新经济”的优质企业，例如互联网、教育、医药等行业，值得进行深入的自下而上的研究，配置优秀企业，分享优秀企业的成长。长期来看，国内资金的海外资产配置需求不断加强，海外的优质公司有望持续迎来增量资金。

在此背景下，本基金计划采取攻守均衡的策略，力求以精选行业和个股为根本来获取超额收益。行业方面，选择市场空间广阔、竞争格局稳定的行业；个股方面，重点选择长期逻辑清晰、竞争壁垒高和管理优秀的两类企业：一是经过时间考验的行业龙头公司，二是经营模式有特色的中小公司。通过分享这些优秀企业的成长为投资者带来回报。

## 4.7 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，公司常务副总裁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。

#### **4.8 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**

本报告期内，本基金托管人在对易方达亚洲精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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**

本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达亚洲精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 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：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	104,330,378.78	39,378,752.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	569,377,347.20	568,948,257.57
其中：股票投资		569,377,347.20	568,948,257.57
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,396,523.06	2,378,062.19
应收利息	6.4.7.5	801.83	1,569.74
应收股利		1,696,902.14	-
应收申购款		227,940.52	230,568.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>678,029,893.53</b>	<b>610,937,210.76</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		6,342,078.93	-
应付赎回款		3,210,238.47	250,818.07
应付管理人报酬		839,235.61	778,481.04
应付托管费		195,821.68	181,645.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,994.14	11,994.14

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	186,845.76	365,745.25
负债合计		10,786,214.59	1,588,684.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	780,000,167.23	833,426,661.32
未分配利润	6.4.7.10	-112,756,488.29	-224,078,134.65
所有者权益合计		667,243,678.94	609,348,526.67
负债和所有者权益总计		678,029,893.53	610,937,210.76

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.855 元，基金份额总额 780,000,167.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>109,437,093.82</b>	<b>-79,849,843.54</b>
1.利息收入		31,024.65	30,185.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,024.65	30,185.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,517,182.16	-38,059,662.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,825,510.74	-46,346,701.83
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,308,328.58	8,287,038.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	115,480,723.81	-42,838,556.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,637,746.65	950,060.95
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	80,274.17	68,130.14
<b>减：二、费用</b>		<b>8,149,673.60</b>	<b>6,312,754.59</b>

1. 管理人报酬		4,900,230.67	4,612,696.51
2. 托管费		1,143,387.27	1,076,295.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,888,653.70	371,227.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	217,401.96	252,534.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>101,287,420.22</b>	<b>-86,162,598.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>101,287,420.22</b>	<b>-86,162,598.13</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	833,426,661.32	-224,078,134.65	609,348,526.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,287,420.22	101,287,420.22
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）	-53,426,494.09	10,034,226.14	-43,392,267.95
其中：1.基金申购款	80,142,003.87	-14,522,401.60	65,619,602.27
2.基金赎回款	-133,568,497.96	24,556,627.74	-109,011,870.22
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）	780,000,167.23	-112,756,488.29	667,243,678.94
项目	上年度可比期间 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）	917,604,744.60	-190,557,008.11	727,047,736.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-86,162,598.13	-86,162,598.13

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）	-33,221,946.75	10,741,976.41	-22,479,970.34
其中：1.基金申购款	50,320,216.80	-15,695,254.43	34,624,962.37
2.基金赎回款	-83,542,163.55	26,437,230.84	-57,104,932.71
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）	884,382,797.85	-265,977,629.83	618,405,168.02

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金(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[2008]1064 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2009]367 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的批复》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《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2010 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 592,067,217.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 107,302.70 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，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为渣打银行（香港）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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。



(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

#### 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 2017年6月30日
活期存款	104,330,378.78
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	104,330,378.78

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	522,180,047.20	569,377,347.20	47,197,300.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	522,180,047.20	569,377,347.20	47,197,300.00

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

##### 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 2017年6月30日
应收活期存款利息	801.83
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	-
应收债券利息	-
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	-
合计	801.83

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	11,994.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,994.14

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,845.76
预提费用	181,000.00
合计	186,845.76

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	833,426,661.32	833,426,661.32
本期申购	80,142,003.87	80,142,003.87

本期赎回（以“-”号填列）	-133,568,497.96	-133,568,497.96
本期末	780,000,167.23	780,000,167.23

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	-452,902,987.34	228,824,852.69	-224,078,134.65
本期利润	-14,193,303.59	115,480,723.81	101,287,420.22
本期基金份额交易产生的变动数	31,474,545.55	-21,440,319.41	10,034,226.14
其中：基金申购款	-46,283,379.57	31,760,977.97	-14,522,401.60
基金赎回款	77,757,925.12	-53,201,297.38	24,556,627.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-435,621,745.38	322,865,257.09	-112,756,488.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	30,782.86
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	-
其他	241.79
合计	31,024.65

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	621,339,624.50
减：卖出股票成本总额	629,165,135.24
买卖股票差价收入	-7,825,510.74

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,308,328.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,308,328.58

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	115,480,723.81
——股票投资	115,480,723.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	115,480,723.81

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	80,055.88
其他	218.29
合计	80,274.17

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,888,653.70
银行间市场交易费用	-
合计	1,888,653.70

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	148,767.52

银行汇划费	2,421.30
其他	33,980.66
合计	217,401.96

注：“其他”主要包含支付给交易所的结算服务费用和存托凭证托管机构的存托服务费用。

#### 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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
渣打银行(香港)有限公司(以下简称“渣打银行”)	境外资产托管人
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会

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

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。

###### 6.4.10.1.2 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 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。

##### 6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,900,230.67	4,612,696.51
其中：支付销售机构的客户	719,957.92	763,232.50

维护费		
-----	--	--

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,143,387.27	1,076,295.82

注：本基金的托管费（包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。

#### 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
报告期初持有的基金份额	222,261,977.48	222,261,977.48
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	222,261,977.48	222,261,977.48
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.50%	25.13%

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。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2017年6月30日		2016年12月31日	
	持有的	持有的基金	持有的	持有的基金份

	基金份额	份额占基金总份额的比例	基金份额	额占基金总份额的比例
广东省易方达教育基金会	20,160,282.26	2.58%	20,160,282.26	2.42%

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	
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2016年1月1日至2016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
中国工商银行—活期存款	4,886,974.94	18,398.41	3,594,958.01	26,767.72
渣打银行—活期存款	99,443,403.84	12,384.45	47,789,878.22	3,386.42

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和渣打银行（香港）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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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（2017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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
940 HK	中国动物保健品	2015-03-30	重大事项停牌	0.45	-	-	850,000	3,230,137.15	383,620.64	-
967 HK	桑德国际	2016-04-13	重大事项停牌	2.59	-	-	300,000	1,741,184.48	775,920.48	-

##### 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 2017 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 2017 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。

本金属股票基金，投资于股票及其他权益类证券占基金资产的比例不低于 60%，其中投资于在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外），合计不低于股票资产的 80%（亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业）。理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

##### 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（本基金为进行避险和组合的有效管理可以投资衍生品），或者基金所投资证券之发行人出现违约（包括国家信用风险）、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投资备选库制度和交易对手备选库制度及分散化投资方式防范信用风险。于 2017 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%（2016 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日



A-1	0.00	0.00
A-1 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 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 2017年6月30日	上年度末 2016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

流动性风险指基金在短时间内购买以及售出金融工具，成交价格较远地偏离了真实价值。当某国/地区的资本市场规模较小，金融市场不发达，某金融品种流通市值较低，参与机构数量较少，成交不活跃，以及基金需要在短时间内进行大量交易时，有可能发生流动性风险，导致基金难以快速建仓，或在出现大额赎回时，被迫在不利价格大量抛售证券，使基金净值遭受不利影响。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，主要投资的交易所流动性较好，因此本基金面临的流动性风险较小。

#### 6.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。

##### 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 2017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	104,330,378.78	-	-	-	104,330,378.78
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	569,377,347.20	569,377,347.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,396,523.06	2,396,523.06
应收利息	-	-	-	801.83	801.83
应收股利	-	-	-	1,696,902.14	1,696,902.14
应收申购款	52,995.16	-	-	174,945.36	227,940.52
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	104,383,373.94	-	-	573,646,519.59	678,029,893.53
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	-	-	-	6,342,078.93	6,342,078.93
应付赎回款	-	-	-	3,210,238.47	3,210,238.47
应付管理人报酬	-	-	-	839,235.61	839,235.61
应付托管费	-	-	-	195,821.68	195,821.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,994.14	11,994.14
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	186,845.76	186,845.76

负债总计	-	-	-	10,786,214.59	10,786,214.59
利率敏感度缺口	104,383,373.94	-	-	562,860,305.00	667,243,678.94
<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	39,378,752.90	-	-	-	39,378,752.90
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	568,948,257.57	568,948,257.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,378,062.19	2,378,062.19
应收利息	-	-	-	1,569.74	1,569.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	396.75	-	-	230,171.61	230,568.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,379,149.65	-	-	571,558,061.11	610,937,210.76
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	-	-	-	250,818.07	250,818.07
应付管理人报酬	-	-	-	778,481.04	778,481.04
应付托管费	-	-	-	181,645.59	181,645.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,994.14	11,994.14
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	365,745.25	365,745.25
负债总计	-	-	-	1,588,684.09	1,588,684.09
利率敏感度缺口	39,379,149.65	-	-	569,969,377.02	609,348,526.67

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

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>				
银行存款	10,824,151.90	88,620,406.39	42.80	99,444,601.09
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	187,818,885.12	381,558,462.08	-	569,377,347.20
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	2,396,523.06	-	2,396,523.06
应收利息	30.08	36.92	-	67.00
应收股利	-	1,696,902.14	-	1,696,902.14
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>198,643,067.10</b>	<b>474,272,330.59</b>	<b>42.80</b>	<b>672,915,440.49</b>
<b>以外币计价</b>				

的负债				
应付证券清算款	6,342,078.93	-	-	6,342,078.93
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	<b>6,342,078.93</b>	-	-	<b>6,342,078.93</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>192,300,988.17</b>	<b>474,272,330.59</b>	<b>42.80</b>	<b>666,573,361.56</b>
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	72,212.23	32,757,036.93	41.50	32,829,290.66
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	61,796,599.62	507,151,657.95	-	568,948,257.57
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	2,378,062.19	-	2,378,062.19
应收利息	0.21	13.65	0.07	13.93
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>61,868,812.06</b>	<b>542,286,770.72</b>	<b>41.57</b>	<b>604,155,624.35</b>
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	-	-	-	-
<b>资产负债表 外汇风险敞</b>	<b>61,868,812.06</b>	<b>542,286,770.72</b>	<b>41.57</b>	<b>604,155,624.35</b>

口净额				
-----	--	--	--	--

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变			
	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）		
分析		本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日	
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-33,328,668.08	-30,207,781.22	
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	33,328,668.08	30,207,781.22	

#### 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 2017年6月30日		上年度末 2016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	569,377,347.2 0	85.33	568,948,257.5 7	93.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	569,377,347.2 0	85.33	568,948,257.5 7	93.37

#### 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	上年度末
		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	28,468,867.32	28,447,412.83
2.业绩比较基准下降 5%	-28,468,867.32	-28,447,412.83	

#### 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 2017 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 568,217,806.08 元，属于第二层次的余额为 775,920.48 元，属于第三层次的余额为 383,620.64 元(2016 年 12 月 31 日：第一层次 564,194,831.43 元，第二层次 4,753,426.14 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

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 383,620.64 元。本基金本期净转入第三层次的金额为 383,620.64 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为-3,570,113.56 元。

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产
--	---------

2010 年 1 月 21 日 (基金合同生效日)	-
购买	-
出售	-
转入第三层级	383,620.64
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
—计入损益的利得或损失	-
2017 年 6 月 30 日	383,620.64
2017 年 6 月 30 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-3,570,113.56

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司盈利预期及市盈率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的盈利预期及市盈率变动，将导致公允价值的正相关变动。

#### (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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(2016 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	569,377,347.20	83.98
	其中：普通股	387,687,939.20	57.18



	存托凭证	181,689,408.00	26.80
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	104,330,378.78	15.39
8	其他各项资产	4,322,167.55	0.64
9	合计	678,029,893.53	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	381,558,462.08	57.18
美国	187,818,885.12	28.15
合计	569,377,347.20	85.33

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。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	111,452,210.96	16.70
非必需消费品	108,427,114.61	16.25
必需消费品	-	-
保健	164,786,988.96	24.70
金融	-	-

信息技术	183,935,112.19	27.57
电信服务	-	-
公用事业	775,920.48	0.12
房地产	-	-
合计	569,377,347.20	85.33

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 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权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资 产净值比 例(%)
1	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	70,000	66,815,907.20	10.01
2	Tencent Holdings Ltd.	腾讯控股 有限公司	700 HK	香港证 券交易 所	香港	270,000	65,427,281.28	9.81
3	Beijing Capital Internatio nal Airport Co. Ltd.	北京首都 国际机场 股份有限 公司	694 HK	香港证 券交易 所	香港	6,800,000	64,920,416.00	9.73
4	Sino Biopharm aceutical Ltd.	中国生物 制药有限 公司	1177 HK	香港证 券交易 所	香港	8,500,000	50,903,508.00	7.63
5	Guangdon g Yueyun Transport ation Co. Ltd.	广东粤运 交通股份 有限公司	3399 HK	香港证 券交易 所	香港	10,350,000	46,531,794.96	6.97
6	CSPC Pharmace utical Group Ltd.	石药集团 有限公司	1093 HK	香港证 券交易 所	香港	4,500,000	44,524,296.00	6.67
7	Sands China Ltd.	金沙中国 有限公司	1928 HK	香港证 券交易 所	香港	1,140,000	35,372,079.60	5.30

8	58.Com, Inc.	58 同城	WUBA US	纽约证券交易所	美国	100,000	29,881,878.40	4.48
9	Ctrip.com International, Ltd.	携程国际有限公司	CTRP US	纳斯达克证券交易所	美国	71,000	25,905,712.06	3.88
10	Baidu, Inc.	百度股份有限公司	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	18,000	21,810,045.31	3.27
11	JD.com, Inc.	京东商城电子商务有限公司	JD US	纳斯达克证券交易所	美国	72,000	19,129,821.70	2.87
12	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	-	EDU US	纽约证券交易所	美国	38,000	18,146,043.33	2.72
13	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co., Ltd.	宜昌东阳光长江药业股份有限公司	1558 HK	香港证券交易所	香港	1,200,000	17,268,136.32	2.59
14	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co. Ltd.	北京同仁堂国药有限公司	8138 HK	香港证券交易所	香港	1,700,000	16,849,798.88	2.53
15	Sinopharm Group Co. Ltd.	国药控股股份有限公司	1099 HK	香港证券交易所	香港	500,000	15,318,788.00	2.30
16	United Laboratories International Holdings Ltd.	联邦制药国际控股有限公司	3933 HK	香港证券交易所	香港	3,000,000	13,409,364.00	2.01
17	Brilliance China Automoti	华晨中国汽车控股有限公司	1114 HK	香港证券交易所	香港	800,000	9,873,457.92	1.48

	ve Holdings Ltd.							
18	China Biologic Products Holdings, Inc.	-	CBPO US	纳斯达克证券交易所	美国	8,000	6,129,477.12	0.92
19	Sound Global Ltd.	桑德国际有限公司	967 HK	香港证券交易所	香港	300,000	775,920.48	0.12
20	China Animal Healthcare Ltd.	中国动物保健品有限公司	940 HK	香港证券交易所	香港	850,000	383,620.64	0.06

注：1. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2. 本报告期末本基金投资 ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (BABA US) 比例占基金资产净值超过 10%，属于被动超标。

## 7.5 报告期内权益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 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Beijing Capital International Airport Co. Ltd.	694 HK	63,152,709.93	10.36
2	Tencent Holdings Ltd.	700 HK	55,919,962.19	9.18
3	Sino Biopharmaceutical Ltd.	1177 HK	54,144,442.75	8.89
4	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	1093 HK	37,431,641.32	6.14
5	Sands China Ltd.	1928 HK	33,883,434.89	5.56
6	Baidu, Inc.	BIDU US	29,163,111.94	4.79
7	58.Com, Inc.	WUBA US	28,578,765.77	4.69
8	Ctrip.com International, Ltd.	CTRP US	26,978,966.10	4.43
9	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	26,191,270.96	4.30
10	ASM Pacific Technology Ltd.	522 HK	23,775,410.99	3.90

11	JD.com, Inc.	JD US	19,998,865.21	3.28
12	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	EDU US	19,320,435.65	3.17
13	Alibaba Group Holding Ltd.	BABA US	18,717,669.25	3.07
14	United Laboratories International Holdings Ltd.	3933 HK	16,184,160.57	2.66
15	Sinopharm Group Co. Ltd.	1099 HK	15,941,360.78	2.62
16	Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	1114 HK	11,214,522.88	1.84
17	TravelSky Technology Ltd.	696 HK	9,120,946.45	1.50
18	China Everbright Ltd.	165 HK	9,071,120.91	1.49
19	China Biologic Products Holdings, Inc.	CBPO US	6,079,794.45	1.00
20	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	1513 HK	2,852,921.11	0.47

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	ASM Pacific Technology Ltd.	522 HK	74,813,995.66	12.28
2	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	2238 HK	72,390,941.94	11.88
3	Dongjiang Environmental Co. Ltd.	895 HK	53,570,877.99	8.79
4	Haitong International Securities Group Ltd.	665 HK	46,163,831.28	7.58
5	Noah Holdings Ltd.	NOAH US	36,389,152.99	5.97
6	Guotai Junan International Holdings Ltd.	1788 HK	36,095,196.82	5.92
7	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	33,983,461.93	5.58
8	Poly Culture Group Corporation Ltd.	3636 HK	31,403,542.86	5.15
9	Bloomage BioTechnology Corporation Ltd.	963 HK	29,595,950.15	4.86
10	TravelSky Technology Ltd.	696 HK	26,833,258.13	4.40
11	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	25,348,267.10	4.16
12	Technovator International Ltd.	1206 HK	23,680,692.02	3.89
13	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	1513 HK	20,413,225.14	3.35
14	Shanghai Prime Machinery Co. Ltd.	2345 HK	11,945,951.15	1.96
15	United Laboratories International Holdings Ltd.	3933 HK	11,716,823.10	1.92
16	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd.	512 HK	11,674,228.74	1.92
17	Beijing Capital International Airport Co. Ltd.	694 HK	9,780,217.95	1.61
18	China Everbright Ltd.	165 HK	8,963,665.73	1.47
19	Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd.	950 HK	6,993,297.77	1.15

20	Essex Bio-technology Ltd.	1061 HK	6,539,713.94	1.07
----	---------------------------	---------	--------------	------

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	514,113,501.06
卖出收入（成交）总额	621,339,624.50

注：“买入成本”或“卖出收入”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 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 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 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。

### 7.10 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。

### 7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 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。

### 7.11.3 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	-

2	应收证券清算款	2,396,523.06
3	应收股利	1,696,902.14
4	应收利息	801.83
5	应收申购款	227,940.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,322,167.55

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金可以将不高于 20% 的股票资产投资于除在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外）之外的其他企业，本报告期末该部分股票的投资比例为 0。

## 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
19,083	40,874.09	262,422,259.74	33.64%	517,577,907.49	66.36%

### 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	5,908,659.45	0.7575%

## 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	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	>=100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年1月21日）基金份额总额	592,067,217.31
本报告期期初基金份额总额	833,426,661.32
本报告期基金总申购份额	80,142,003.87
减：本报告期基金总赎回份额	133,568,497.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	780,000,167.23

## 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 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。



## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Citigroup Global Markets Limited	1	410,163,574.98	36.12%	252,876.23	28.86%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	242,272,827.41	21.34%	235,343.89	26.86%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	112,453,791.29	9.90%	89,963.11	10.27%	-
Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited	1	111,455,691.38	9.82%	89,164.57	10.18%	-
UBS Securities Asia Limited	1	78,866,287.54	6.95%	78,866.29	9.00%	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	1	46,482,525.62	4.09%	46,482.53	5.31%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	33,308,216.14	2.93%	26,646.57	3.04%	-

GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	53,001,998.77	4.67%	26,501.02	3.02%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	23,697,923.93	2.09%	11,848.99	1.35%	-
Goldman Sachs	1	11,732,104.79	1.03%	9,385.65	1.07%	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	7,007,444.41	0.62%	5,605.97	0.64%	-
KGI Institutional Equities	1	5,010,522.28	0.44%	3,507.36	0.40%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
Shin Han Investment Corp.	1	-	-	-	-	-
Hyundai Securities (Asia) Limited	1	-	-	-	-	-
Daishin Securities (Asia) Ltd	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	1	-	-	-	-	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	1	-	-	-	-	-

CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
BOBOM International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Daewoo Securities	1	-	-	-	-	-
Woori Investment & Securities	1	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Ltd.	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，无新增交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

## 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	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2017 年 1 月 16 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-11
2	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	2017-02-09
3	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2017 年 2 月 20 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-15
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交通银行手机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	2017-02-23
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龙江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	2017-03-10
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龙江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	2017-03-10
7	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	2017-03-10
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广东南粤银行为销售机构、参加广东南粤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	2017-03-15
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加朝阳永续为销售机构、参加朝阳永续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	2017-03-15
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加招商证券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	2017-03-20
11	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信期货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	2017-03-20
12	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信证券（山东）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	2017-03-20
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华龙证券定期定额投资费率优惠	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-03-22

	活动的公告	理人网站	
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宜信普泽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	2017-03-22
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济安财富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	2017-03-27
16	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	2017-03-30
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华林证券为销售机构、参加华林证券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	2017-03-31
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券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	2017-04-10
19	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2017 年 4 月 14 日和 4 月 17 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-11
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构、参加瑞安农商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	2017-04-13
21	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	2017-04-19
22	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手机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	2017-04-22
23	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2017 年 5 月 3 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-27
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳新兰德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	2017-05-02
25	易方达亚洲精选股票型证券投资基金在非直销销售机构及网上直销系统恢复大额申购、大额转换转入业务以及在直销中心恢复申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-08
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加财通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	2017-05-15
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加川财证券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	2017-05-15

		理人网站	
28	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	2017-06-07
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏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	2017-06-12
30	易方达基金管理有限公司关于在中银国际证券开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加中银国际证券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	2017-06-19
31	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
32	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2017 年 7 月 4 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-29
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商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	2017-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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
机构	1	2017年01月01日~2017年06月30日	222,261,977.48	-	-	222,261,977.48	28.50%
<b>产品特有风险</b>							
<p>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六十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。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的文件；
- 3.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 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。

### 12.3 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

二〇一七年八月二十九日