

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资 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.....	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明...	12
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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	12
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.....	16
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
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.....	32
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.....	39
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	41
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.	41

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	41
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	41
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.	41
7.11	投资组合报告附注.....	41
8	基金份额持有人信息.....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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...	42
9	开放式基金份额变动.....	43
10	重大事件揭示.....	43
10.1	基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8	其他重大事件.....	45
11	备查文件目录.....	48
11.1	备查文件目录.....	48
11.2	存放地点.....	48
11.3	查阅方式.....	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金
基金简称	易方达标普消费品指数增强（QDII）
基金主代码	118002
交易代码	118002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 4 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,238,201.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以指数化投资为主，并辅以有限度的增强操作。本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股构成及权重为基础，并基于量化模型和基本面研究进行投资组合的构建。在投资组合建立后，基金管理人将适时对投资组合进行调整，力争将投资组合对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8% 以内，从而分享高端消费品行业品牌优势，高盈利所具有的长期投资价值，并力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	标普全球高端消费品指数（净收益指数，使用估值汇率折算）
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险与收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金在控制跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金主要投资于全球高端消费品企业，需承担汇率风险、国家风险和高端消费品企业特有的风险。

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	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
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1 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1 号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	田国立

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	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	无	中国银行(香港)有限公司
注册地址		无	香港中环花园道一号, 中银大厦 14 楼
办公地址		无	香港中环花园道一号, 中银大厦 32 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	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

2.6 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	-533,003.03
本期利润	4,706,192.83
加权平均基金份额本期利润	0.1808
本期加权平均净值利润率	11.60%
本期基金份额净值增长率	14.78%
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	7,725,981.62
期末可供分配基金份额利润	0.1874
期末基金资产净值	67,239,058.03
期末基金份额净值	1.631
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	63.10%

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

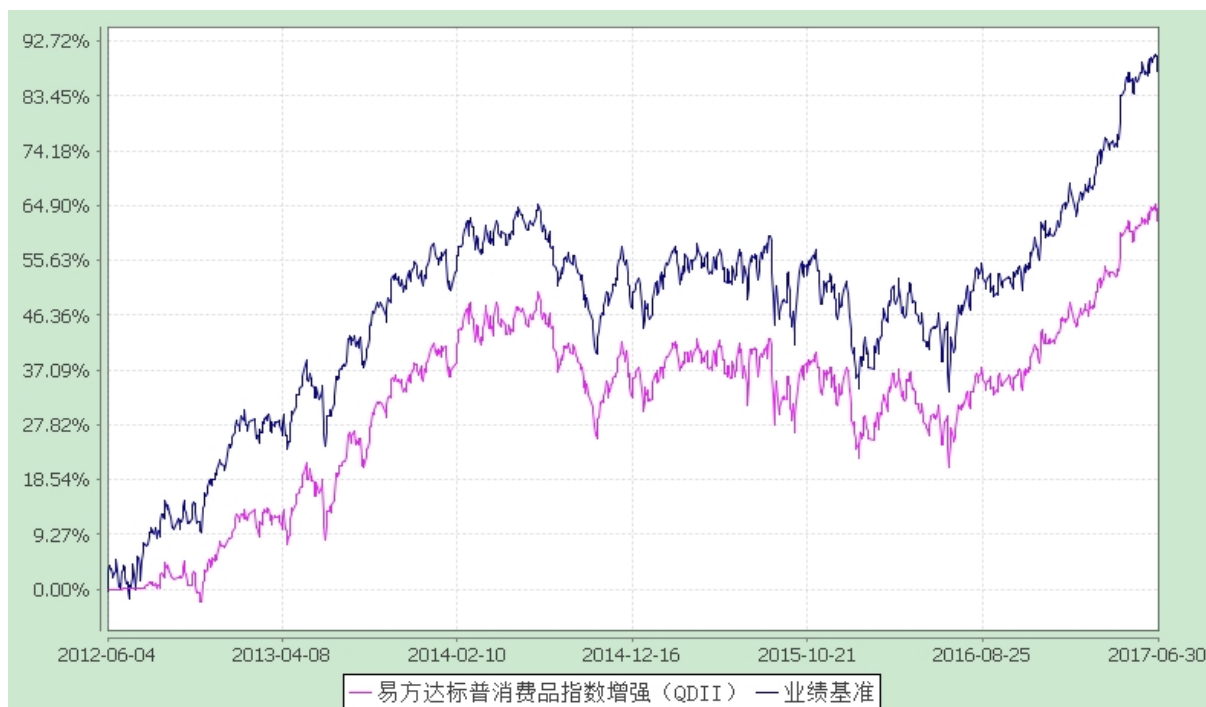
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.99%	0.57%	0.41%	0.63%	0.58%	-0.06%
过去三个月	5.98%	0.56%	6.81%	0.64%	-0.83%	-0.08%
过去六个月	14.78%	0.57%	17.27%	0.61%	-2.49%	-0.04%
过去一年	29.65%	0.63%	34.21%	0.71%	-4.56%	-0.08%
过去三年	10.80%	0.96%	15.33%	0.97%	-4.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	63.10%	0.89%	88.08%	0.95%	-24.98%	-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

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金
 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

(2012 年 6 月 4 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 63.10%，同期业绩比较基准收益率为 88.08%。

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		
张胜记	本基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达 50 指数证券投资基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部副总经理	2014-09-13	-	12 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、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、指数与量化投资部总经理助理。
FAN BING(范冰)	本基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)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、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标	2017-03-25	-	12 年	硕士研究生，曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团 Middle Office 中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、主管，新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融

	普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理			数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。
--	--	--	--	---------------------------------------

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 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

2017 年一季度，对美国市场乃至全球市场影响最大的两个因素是特朗普上任后的政策进展和美联储的货币政策。整体来看，2016 年 12 月美联储鹰派加息之后，对特朗普新政的预期和对经济基本面向好的信心推动美股上涨。在经历了 1 月 20 日特朗普上任后密集的政策兑现期后，“特朗普

行情”动能开始出现放缓甚至局部逆转的迹象。3月16日美联储再度加息，符合市场预期，美联储主席耶伦的言论较为温和，在对未来加息路径的前瞻指引上也偏鸽派。欧洲方面，欧元区经济筑底回升，通胀回暖，货币政策由宽松向收紧的转化已经被提上日程。香港市场在深港通开通后，受到南下资金的追捧，基本面优秀的公司投资价值进一步被市场认可；林郑月娥3月当选香港新特首，进一步稳定市场情绪。

2017年二季度以来，美国经济整体保持温和扩张的态势，劳动力市场保持稳健，失业率维持低位，商业投资部分也有企稳复苏的迹象。过去三个月非农数据稳步提升，家庭收入与家庭支出有所复苏，但消费者信心指数从4月开始有所回落。六月份的FOMC议息会议后，美联储宣布将联邦基金利率目标区间提升0.25%至1%-1.25%的水平。进入二季度后，“特朗普交易”逐渐逆转。一方面，特朗普的核心政策迟迟没有实质性进展；另一方面，二季度部分地区地缘政治风险升温，导致市场转向避险，也加剧了市场的波动。欧洲方面，受益于马克龙当选新任法国总统和欧元区整体向好的趋势，虽然仍存在中长期结构性挑战，但短期政治风险减弱，经济步入复苏轨道。新兴市场方面，增长改善、政策红利释放以及价值洼地等因素，继续吸引资金流入，但是各国分化依然显著。

本基金是跟踪标普全球高端消费品指数的增强型指数基金，股票仓位根据合同要求保持在90%以上。在行业配置上，基本与指数权重分布一致，科技行业有所超配。在国别配置上，与指数权重分布基本一致，低配韩国市场，同时超配香港市场。

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1.631元，本报告期份额净值增长率为14.78%，同期业绩比较基准收益率为17.27%，年化跟踪误差4.755%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济将延续复苏的脚步，从大类资产的角度看，目前的风险偏好也更利于股市。下半年预计美国会开始缩表，但是会采取“摸着石头过河”的谨慎态度。欧洲和新兴市场有望持续吸引资金流入。

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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自本报告期初至 2017 年 5 月 8 日，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自本报告期初至 2017 年 5 月 8 日，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的

规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,355,435.29	2,950,764.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	63,791,930.97	20,721,483.94
其中：股票投资		63,791,930.97	20,721,483.94
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	648.87	307.16
应收股利		32,244.24	13,735.76
应收申购款		1,116,290.87	57,688.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		70,296,550.24	23,743,980.33
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2017年6月30日	2016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		755,785.11	457,321.73
应付赎回款		1,597,708.98	359,496.32
应付管理人报酬		63,376.18	21,758.35
应付托管费		18,484.72	6,346.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	622,137.22	320,079.36
负债合计		3,057,492.21	1,165,001.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,238,201.06	15,894,812.82
未分配利润	6.4.7.10	26,000,856.97	6,684,165.55
所有者权益合计		67,239,058.03	22,578,978.37
负债和所有者权益总计		70,296,550.24	23,743,980.33

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.631 元，基金份额总额 41,238,201.06 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

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
一、收入		5,425,690.78	-1,036,712.47
1.利息收入		7,105.28	2,424.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,105.28	2,424.50
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）		343,526.45	318,770.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-102,519.62	125,145.30

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	446,046.07	193,625.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,239,195.86	-1,373,488.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-185,231.60	12,537.06
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	21,094.79	3,044.44
减：二、费用		719,497.95	453,443.49
1. 管理人报酬		237,906.24	103,802.72
2. 托管费		69,389.32	30,275.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	69,825.17	1,699.97
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	342,377.22	317,665.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,706,192.83	-1,490,155.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,706,192.83	-1,490,155.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

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）	15,894,812.82	6,684,165.55	22,578,978.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,706,192.83	4,706,192.83
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）	25,343,388.24	14,610,498.59	39,953,886.83
其中：1.基金申购款	38,408,964.13	21,904,957.77	60,313,921.90
2.基金赎回款	-13,065,575.89	-7,294,459.18	-20,360,035.07
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）	41,238,201.06	26,000,856.97	67,239,058.03
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）	13,088,754.28	4,836,958.22	17,925,712.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,490,155.96	-1,490,155.96
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）	1,333,137.65	369,494.93	1,702,632.58
其中：1.基金申购款	3,927,299.89	1,151,444.40	5,078,744.29
2.基金赎回款	-2,594,162.24	-781,949.47	-3,376,111.71
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）	14,421,891.93	3,716,297.19	18,138,189.12

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

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金(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[2011]2013号《关于核准易方达标普全球高端消费品指数增强型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《易方达标普全球高端消费品指数增强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2012年6月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为384,051,169.28份基金份额，其中认购资金利息折合15,734.95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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司。

自 2014 年 3 月 28 日起，本基金增设美元现汇基金份额（基金代码：000593），份额申购首次确认日为 2014 年 3 月 31 日。

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》、《易方达标普全球高端消费品指数增强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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	5,355,435.29
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	5,355,435.29

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	58,372,275.63	63,791,930.97	5,419,655.34
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	58,372,275.63	63,791,930.97	5,419,655.34

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	648.87
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	648.87

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

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	5,773.04
预提费用	616,364.18
合计	622,137.22

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	15,894,812.82	15,894,812.82
本期申购	38,408,964.13	38,408,964.13
本期赎回（以“-”号填列）	-13,065,575.89	-13,065,575.89
本期末	41,238,201.06	41,238,201.06

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	3,412,105.26	3,272,060.29	6,684,165.55
本期利润	-533,003.03	5,239,195.86	4,706,192.83
本期基金份额交易产生的	4,846,879.39	9,763,619.20	14,610,498.59

变动数			
其中：基金申购款	7,337,967.39	14,566,990.38	21,904,957.77
基金赎回款	-2,491,088.00	-4,803,371.18	-7,294,459.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,725,981.62	18,274,875.35	26,000,856.97

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	6,942.85
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	162.43
合计	7,105.28

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	3,111,913.00
减：卖出股票成本总额	3,214,432.62
买卖股票差价收入	-102,519.62

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	446,046.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	446,046.07

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	5,239,195.86
——股票投资	5,239,195.86
——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	5,239,195.86

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	21,094.79
其他	-
合计	21,094.79

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	69,825.17
银行间市场交易费用	-
合计	69,825.17

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	9,916.99
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	22,965.62
指数使用费	103,390.82
指数数据费	55,141.65
其他	2,194.62
合计	342,377.22

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
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人
中国银行(香港)有限公司（以下简称“中国银行（香港）”）	境外资产托管人

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	237,906.24	103,802.72
其中：支付销售机构的客户维护费	88,336.44	34,849.93

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 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	69,389.32	30,275.80

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付托管费给基金托管人。

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

无。

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行—活期存款	4,625,952.05	6,942.85	1,711,462.38	2,415.92
中国银行（香港）—活期存款	729,483.24	-	296,071.22	-

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和中国银行(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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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。

本基金为股票基金，其预期风险与收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金在控制跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。本基金主要投资于全球高端消费品企业，需承担汇率风险、国家风险和高端消费品企业特有的风险。

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	5,355,435.29	-	-	-	5,355,435.29
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	63,791,930.97	63,791,930.97
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	-	-	-	648.87	648.87
应收股利	-	-	-	32,244.24	32,244.24
应收申购款	176,286.33	-	-	940,004.54	1,116,290.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,531,721.62	-	-	64,764,828.62	70,296,550.24
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	-	-	-	755,785.11	755,785.11
应付赎回款	-	-	-	1,597,708.98	1,597,708.98
应付管理人报酬	-	-	-	63,376.18	63,376.18
应付托管费	-	-	-	18,484.72	18,484.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	622,137.22	622,137.22
负债总计	-	-	-	3,057,492.21	3,057,492.21
利率敏感度缺口	5,531,721.62	-	-	61,707,336.41	67,239,058.03

上年度末 2016 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	2,950,764.61	-	-	-	2,950,764.61
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	20,721,483.94	20,721,483.94
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	-	-	-	307.16	307.16
应收股利	-	-	-	13,735.76	13,735.76
应收申购款	1,898.25	-	-	55,790.61	57,688.86
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,952,662.86	-	-	20,791,317.47	23,743,980.33
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	-	-	-	457,321.73	457,321.73
应付赎回款	-	-	-	359,496.32	359,496.32
应付管理人报酬	-	-	-	21,758.35	21,758.35
应付托管费	-	-	-	6,346.20	6,346.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	320,079.36	320,079.36
负债总计	-	-	-	1,165,001.96	1,165,001.96
利率敏感度缺口	2,952,662.86	-	-	19,626,315.51	22,578,978.37

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
以外币计价的资产				
银行存款	1,881,753.00	3,713.20	4,634.89	1,890,101.09
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	25,604,962.87	5,329,531.88	32,857,436.22	63,791,930.97
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	20.46	-	-	20.46
应收股利	29,927.60	190.94	2,125.70	32,244.24
应收申购款	188,587.92	-	-	188,587.92
其他资产	-	-	-	-
资产合计	27,705,251.85	5,333,436.02	32,864,196.81	65,902,884.68
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	755,785.11	755,785.11
应付赎回款	448,472.05	-	-	448,472.05
其他负债	1,664.54	-	-	1,664.54
负债合计	450,136.59	-	755,785.11	1,205,921.70
资产负债表 外汇风险敞	27,255,115.26	5,333,436.02	32,108,411.70	64,696,962.98

口净额				
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	1,742,046.70	637.33	36,295.06	1,778,979.09
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	7,647,610.04	2,507,724.80	10,566,149.10	20,721,483.94
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	24.77	-	-	24.77
应收股利	11,287.33	-	2,448.43	13,735.76
应收申购款	685.44	-	-	685.44
其他资产	-	-	-	-
资产合计	9,401,654.28	2,508,362.13	10,604,892.59	22,514,909.00
以外币计价的负债				
应付证券清算款	457,321.73	-	-	457,321.73
应付赎回款	3,725.72	-	-	3,725.72
其他负债	11.86	-	-	11.86
负债合计	461,059.31	-	-	461,059.31
资产负债表 外汇风险敞 口净额	8,940,594.97	2,508,362.13	10,604,892.59	22,053,849.69

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		
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 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	-3,234,848.15	-1,102,692.48

	值 5%		
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	3,234,848.15	1,102,692.48

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	63,791,930.97	94.87	20,721,483.94	91.77
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	63,791,930.97	94.87	20,721,483.94	91.77

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	3,189,596.54	1,036,074.19
2.业绩比较基准下降 5%	-3,189,596.54	-1,036,074.19	

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 63,791,930.97 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 20,721,483.94 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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	63,791,930.97	90.75
	其中：普通股	61,744,162.84	87.83
	存托凭证	1,319,670.74	1.88
	优先股	728,097.39	1.04
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	5,355,435.29	7.62
8	其他各项资产	1,149,183.98	1.63
9	合计	70,296,550.24	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（%）
美国	25,604,962.87	38.08
法国	11,082,784.71	16.48
德国	8,030,318.95	11.94
香港	5,329,531.88	7.93
英国	5,171,721.04	7.69
瑞士	4,402,217.11	6.55
意大利	1,573,774.58	2.34
日本	1,517,641.24	2.26
澳大利亚	840,676.30	1.25
新加坡	238,302.29	0.35
合计	63,791,930.97	94.87

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	-	-
非必需消费品	49,675,858.26	73.88
必需消费品	10,533,276.17	15.67
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	3,582,796.54	5.33
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	63,791,930.97	94.87

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	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	-	MC FP	巴黎纽 约泛欧 证券交 易所	法国	3,099	5,242,695.07	7.80
2	Daimler AG	-	DAI GR	德国证 券交易 所 Xetra 交易平 台	德国	9,869	4,846,588.45	7.21
3	Diageo plc	-	DGE LN	伦敦证 券交易 所	英国	22,716	4,542,170.15	6.76
4	NIKE, Inc.	-	NKE US	纽约证 券交易	美国	10,960	4,380,598.02	6.51

				所				
5	Compagnie Financiere Richemont SA	-	CFR VX	瑞士证券交易所	瑞士	5,923	3,316,970.03	4.93
6	Tesla Inc.	-	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,232	3,018,019.05	4.49
7	Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft	-	BMW GR	德国证券交易所 Xetra 交易平台	德国	3,443	2,168,702.62	3.23
8	Carnival Corporation	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	4,733	2,102,386.33	3.13
9	Pernod Ricard SA	-	RI FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	2,306	2,095,325.22	3.12
10	Kering SA	-	KER FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	817	1,888,030.40	2.81
11	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	7,500	1,817,424.48	2.70
12	Las Vegas Sands Corp.	-	LVS US	纽约证券交易所	美国	4,065	1,759,398.73	2.62
13	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港证券交易所	香港	40,386	1,661,456.13	2.47
14	The Estee Lauder Companies Inc.	-	EL US	纽约证券交易所	美国	2,433	1,581,953.42	2.35
15	V.F. Corporation	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	3,677	1,434,785.40	2.13
16	Royal Caribbean	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	1,823	1,348,961.14	2.01

	Cruises Ltd.			所				
17	Alibaba Group Holding Limited	-	BABA US	纽约证券交易所	美国	1,134	1,082,417.70	1.61
18	Christian Dior SE	-	CDIT FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	544	1,055,421.12	1.57
19	Shiseido Company, Limited	-	4911 JP	东京证券交易所	日本	4,150	1,002,544.92	1.49
20	Coach, Inc.	-	COH US	纽约证券交易所	美国	2,910	933,237.28	1.39
21	The Swatch Group AG	-	UHR VX	瑞士证券交易所	瑞士	313	785,675.10	1.17
22	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	香港证券交易所	香港	25,191	781,629.87	1.16
23	Ferrari NV	-	RACE IM	意大利证券交易所	意大利	1,300	757,097.17	1.13
24	Wynn Resorts, Limited	-	WYNN US	纳斯达克证券交易所	美国	822	746,854.84	1.11
25	Porsche Automobil Holding SE	-	PAH3 GR	德国证券交易所 Xetra 交易平台	德国	1,910	728,097.39	1.08
26	Apple Inc.	-	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	700	682,954.36	1.02
27	Tiffany & Co.	-	TIF US	纽约证券交易所	美国	1,037	659,441.71	0.98
28	PVH Corp.	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	844	654,664.47	0.97
29	Brown-Forman Corporation	-	BF/B US	纽约证券交易所	美国	1,979	651,557.73	0.97

	on							
30	Harley-Davidson, Inc.	-	HOG US	纽约证券交易所	美国	1,740	636,758.37	0.95
31	Burberry Group plc	-	BRBY LN	伦敦证券交易所	英国	4,300	629,550.89	0.94
32	Hermes International	-	RMS FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	187	626,985.65	0.93
33	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	-	NCLH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,525	560,867.82	0.83
34	Luxottica Group S.p.A.	-	LUX IM	意大利证券交易所	意大利	1,307	513,020.03	0.76
35	Treasury Wine Estates Limited	-	TWE AU	Australian Securities Exchange	Australia	6,627	454,362.26	0.68
36	Nikon Corporation	-	7731 JP	东京证券交易所	日本	3,600	391,071.82	0.58
37	Nordstrom, Inc.	-	JWN US	纽约证券交易所	美国	1,204	390,119.54	0.58
38	Polaris Industries Inc.	-	PII US	纽约证券交易所	美国	624	389,877.02	0.58
39	Michael Kors Holdings Limited	-	KORS US	纽约证券交易所	美国	1,536	377,198.59	0.56
40	Toll Brothers, Inc.	-	TOL US	纽约证券交易所	美国	1,303	348,756.48	0.52
41	Signet Jewelers Limited	-	SIG US	纽约证券交易所	美国	745	319,167.73	0.47
42	Dufry AG	-	DUFN VX	瑞士证券交易所	瑞士	269	299,571.98	0.45

43	Ralph Lauren Corporation	-	RL US	纽约证券交易所	美国	577	288,471.57	0.43
44	HUGO BOSS AG	-	BOSS GR	德国证券交易所 Xetra 交易平台	德国	604	286,930.49	0.43
45	Williams-Sonoma, Inc.	-	WSM US	纽约证券交易所	美国	751	246,747.36	0.37
46	Genting Singapore PLC	-	GENS SP	新加坡证券交易所	新加坡	44,700	238,302.29	0.35
47	Melco Resorts & Entertainment Limited	-	MLCO US	纳斯达克证券交易所	美国	1,560	237,253.04	0.35
48	Tempur Sealy International, Inc.	-	TPX US	纽约证券交易所	美国	610	220,627.98	0.33
49	Crown Resorts Limited	-	CWN AU	Australian Securities Exchange	Australia	3,313	211,957.70	0.32
50	Wynn Macau, Limited	永利澳门有限公司	1128 HK	香港证券交易所	香港	13,300	210,550.45	0.31
51	Melco International Development Limited	新濠国际发展有限公司	200 HK	香港证券交易所	香港	11,000	199,534.81	0.30
52	The Star Entertainment Group Limited	-	SGR AU	Australian Securities Exchange	Australia	6,627	174,356.34	0.26
53	Remy Cointreau SA	-	RCO FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	220	174,327.25	0.26

				易所				
54	SJM Holdings Limited	澳门博彩控股有限公司	880 HK	香港证券交易所	香港	23,700	169,288.66	0.25
55	Moncler S.p.A.	-	MONC IM	意大利证券交易所	意大利	1,018	161,726.40	0.24
56	Sotheby's	-	BID US	纽约证券交易所	美国	436	158,521.77	0.24
57	MGM China Holdings Limited	美高梅中国控股有限公司	2282 HK	香港证券交易所	香港	10,300	155,191.04	0.23
58	Shangri-La Asia Limited	香格里拉(亚洲)有限公司	69 HK	香港证券交易所	香港	12,000	137,895.13	0.21
59	Deckers Outdoor Corporation	-	DECK US	纽约证券交易所	美国	242	111,905.77	0.17
60	PRADA S.p.A.	-	1913 HK	香港证券交易所	香港	4,000	100,852.30	0.15
61	Select Comfort Corporation	-	SCSS US	纳斯达克证券交易所	美国	319	76,695.08	0.11
62	Yoox Net-A-Porter Group S.p.A.	-	YNAP IM	意大利证券交易所	意大利	381	71,511.91	0.11
63	Resorttrust, Inc.	-	4681 JP	东京证券交易所	日本	500	62,601.98	0.09
64	H.I.S. Co., Ltd.	-	9603 JP	东京证券交易所	日本	300	61,422.52	0.09
65	Callaway Golf Company	-	ELY US	纽约证券交易所	美国	651	56,361.52	0.08
66	Belmond Ltd.	-	BEL US	纽约证券交易所	美国	590	53,158.72	0.08

67	Chow Tai Fook Jewellery Group Limited	周大福珠宝集团有限公司	1929 HK	香港证券交易所	香港	7,200	51,679.43	0.08
68	Luk Fook Holdings (International) Limited	六福集团(国际)有限公司	590 HK	香港证券交易所	香港	1,900	44,029.58	0.07
69	TOD'S S.p.A.	-	TOD IM	意大利证券交易所	意大利	98	41,466.56	0.06
70	Ethan Allen Interiors Inc.	-	ETH US	纽约证券交易所	美国	184	40,261.61	0.06
71	Inter Parfums, Inc.	-	IPAR US	纳斯达克证券交易所	美国	125	31,035.22	0.05
72	Salvatore Ferragamo S.p.A.	-	SFER IM	意大利证券交易所	意大利	160	28,952.51	0.04
73	Movado Group, Inc.	-	MOV US	纽约证券交易所	美国	140	23,947.50	0.04

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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	Daimler AG	DAI GR	3,047,372.04	13.50
2	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	MC FP	2,964,739.44	13.13
3	Diageo plc	DGE LN	2,829,915.38	12.53
4	NIKE, Inc.	NKE US	2,623,440.93	11.62
5	Compagnie Financière Richemont SA	CFR VX	2,402,275.74	10.64
6	Tencent Holdings Limited	700 HK	1,604,260.82	7.11

7	Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft	BMW GR	1,591,024.88	7.05
8	Tesla Inc.	TSLA US	1,416,177.61	6.27
9	Carnival Corporation	CCL US	1,407,373.70	6.23
10	Kering SA	KER FP	1,195,349.97	5.29
11	Las Vegas Sands Corp.	LVS US	1,152,156.55	5.10
12	The Estee Lauder Companies Inc.	EL US	1,016,001.63	4.50
13	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	955,601.82	4.23
14	V.F. Corporation	VFC US	942,069.15	4.17
15	Royal Caribbean Cruises Ltd.	RCL US	925,426.82	4.10
16	The Swatch Group AG	UHR VX	834,756.68	3.70
17	Pernod Ricard SA	RI FP	797,577.21	3.53
18	Apple Inc.	AAPL US	698,729.82	3.09
19	Ferrari N V	RACE IM	666,814.40	2.95
20	Christian Dior SE	CDI FP	627,874.37	2.78
21	Coach, Inc.	COH US	613,038.18	2.72
22	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	NCLH US	546,093.06	2.42
23	Shiseido Company, Limited	4911 JP	540,518.87	2.39
24	Wynn Resorts, Limited	WYNN US	505,476.36	2.24

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	Kingsoft Corp Ltd	3888 HK	609,126.50	2.70
2	Tencent Holdings Limited	700 HK	595,318.15	2.64
3	Tesla Inc.	TSLA US	406,317.73	1.80
4	Harman International Industrie	HAR US	214,801.04	0.95
5	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	MC FP	142,121.40	0.63
6	Daimler AG	DAI GR	133,105.25	0.59
7	Diageo plc	DGE LN	123,664.20	0.55
8	NIKE, Inc.	NKE US	105,407.12	0.47
9	Compagnie Financiere Richemont SA	CFR VX	89,756.80	0.40
10	Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft	BMW GR	62,041.70	0.27
11	Pernod Ricard SA	RI FP	56,600.12	0.25
12	Carnival Corporation	CCL US	54,571.37	0.24
13	Kering SA	KER FP	48,920.84	0.22

14	Las Vegas Sands Corp.	LVS US	42,564.29	0.19
15	The Estee Lauder Companies Inc.	EL US	41,934.83	0.19
16	V.F. Corporation	VFC US	36,764.74	0.16
17	Royal Caribbean Cruises Ltd.	RCL US	36,508.16	0.16
18	Christian Dior SE	CDI FP	30,953.00	0.14
19	Coach, Inc.	COH US	27,121.22	0.12
20	The Swatch Group AG	UHR VX	24,661.78	0.11

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	41,045,683.79
卖出收入（成交）总额	3,111,913.00

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	-
3	应收股利	32,244.24
4	应收利息	648.87
5	应收申购款	1,116,290.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,149,183.98

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。

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
5,390	7,650.87	2,448.24	0.01%	41,235,752.82	99.99%

注：持有人户数及结构含易方达标普消费品指数增强（QDII）人民币、美元现汇合计数。

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	89,962.16	0.2182%

注：基金管理人的从业人员持有的本基金份额含易方达标普消费品指数增强（QDII）人民币、美元现汇份额。

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	0
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（2012年6月4日）基金份额总额	384,051,169.28
本报告期期初基金份额总额	15,894,812.82
本报告期基金总申购份额	38,408,964.13
减：本报告期基金总赎回份额	13,065,575.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,238,201.06

注：本基金份额变动含易方达标普消费品指数增强（QDII）人民币、美元现汇份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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	32,677,141.35	74.36%	20,402.81	68.08%	-
Goldman Sachs	1	8,505,586.24	19.36%	6,804.75	22.71%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	2,760,068.21	6.28%	2,760.07	9.21%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
BOBOM	1	-	-	-	-	-

International Securities Limited						
----------------------------------	--	--	--	--	--	--

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	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加郑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	2017-01-11
2	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 1 月 16 日暂停申购、赎回、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
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及	中国证券报、上海证券	2017-02-09

	时更新身份证件或者身份证明文件的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
4	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 2 月 20 日暂停申购、赎回、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
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
6	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
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
8	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
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
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
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
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	易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资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	2017-03-25
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
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2017-03-30

	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	报、证券时报及基金管理人网站	
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	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 4 月 14 日、2017 年 4 月 17 日暂停申购、赎回、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	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 5 月 3 日暂停申购、赎回、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
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、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
27	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、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	2017-05-22
28	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 6 月 5 日暂停申购、赎回、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	2017-05-31
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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-06-19

	务、参加中银国际证券定期定额投资费率优惠活动的公告	理人网站	
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	易方达基金管理有限公司关于易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金 2017 年 7 月 4 日暂停申购、赎回、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 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标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.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

二〇一七年八月二十九日