

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	11
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 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 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	45
7.7 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	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
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权证投资明细	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	投资组合报告附注	46
8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末上市基金前十名持有人	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4	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	48
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	48
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	49
10.4	基金投资策略的改变	49
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	51
11	影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	53

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
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式
基金主代码	510310
交易代码	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	2,436,307,415.00 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

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	24,046,872.61
本期利润	412,990,119.78
加权平均基金份额本期利润	0.1620
本期加权平均净值利润率	11.23%

本期基金份额净值增长率	11.78%
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	1,328,260,906.95
期末可供分配基金份额利润	0.5452
期末基金资产净值	3,764,568,321.95
期末基金份额净值	1.5452
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	54.52%

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。

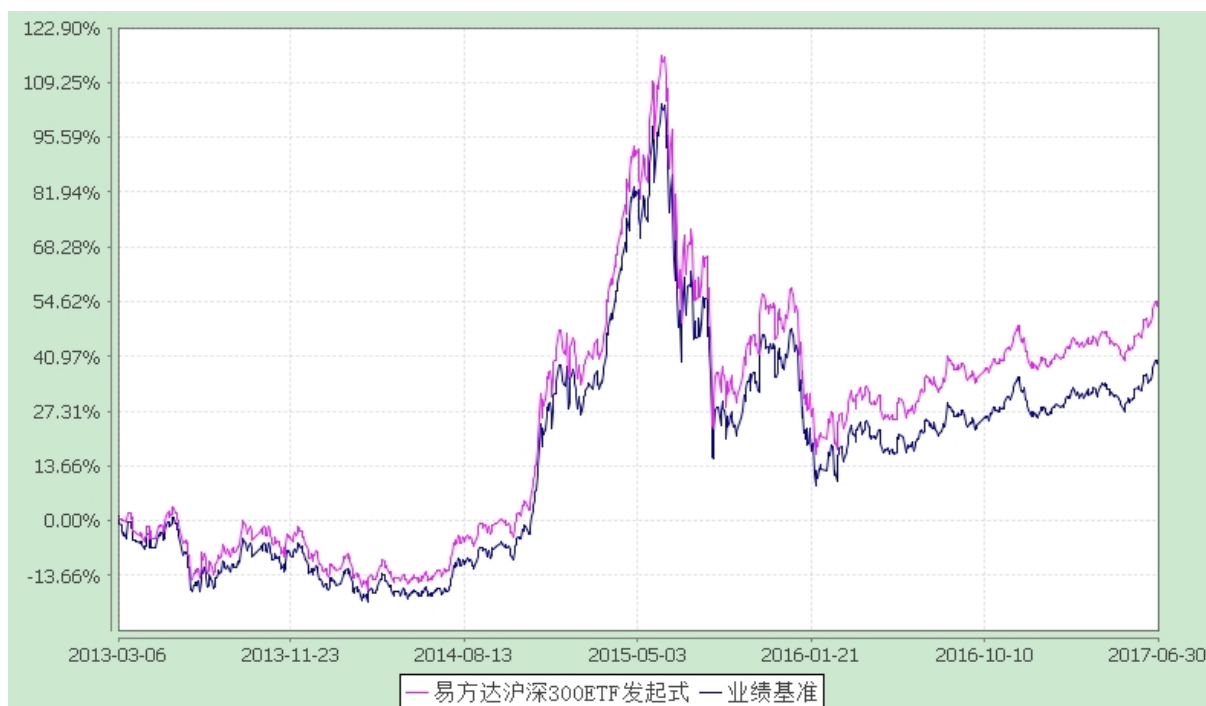
3.2 基金净值表现

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	5.52%	0.65%	4.98%	0.68%	0.54%	-0.03%
过去三个月	6.91%	0.61%	6.10%	0.62%	0.81%	-0.01%
过去六个月	11.78%	0.56%	10.78%	0.57%	1.00%	-0.01%
过去一年	19.01%	0.66%	16.26%	0.67%	2.75%	-0.01%
过去三年	77.92%	1.74%	69.36%	1.75%	8.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	54.52%	1.59%	39.80%	1.61%	14.72%	-0.02%

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
 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
 （2013 年 3 月 6 日至 2017 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 54.52%，同期业绩比较基准收益率为 39.80%。

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		
林伟斌	本基金的基金经理、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（自 2015 年 08 月 27 日至 2017 年 06 月 22 日）、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、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2013 年 11 月 14 日至 2017 年 06 月 22 日）、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、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、量化基金组合部副总经理	2013-03-06	2017-06-23	9 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、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达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联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放	2016-04-16	-	12 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

	式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式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	2017-06-23	-	8 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，林伟斌的“任职日期”为基金合同生效之日，余海燕、杨俊的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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。

4.3 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 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的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

在产能出清、库存回补带动内需企稳，外需持续向好的背景下，2017 年上半年国内宏观经济增长延续了前期的回暖趋势，最新公布的宏观数据显示二季度 GDP 增速为 6.9%，上半年出口增速 8.5%，进口增速高达 18.9%，6 月份工业增速跳升至 7.6%，固定资产投资增速 6 月份同比回升至 8.8%。金融去杠杆主导了 2017 年以来央行的货币政策基调，叠加美联储加息和缩表的影响，宽松货币政策周期或已接近尾声，宏观流动性在二季度有所收紧。上半年人民币对美元汇率稳中有升扭转了去年四季度以来的走低趋势，半年末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均回落到 6.8 以下。资本市场方面，上证综指呈“N”型走势，最终以上涨 2.86% 收官。在风格方面，大小盘分化明显，上半年上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 11.50%、10.78%，而创业板综指、中证 500 指数分别下跌 10.12%、2.00%；行业方面，保险、家用电器、食品饮料、银行等板块涨幅居前，农林牧渔、纺织服装、传媒、商业贸易、国防军工等板块下跌。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 1.5452 元，本报告期份额净值增长率为 11.78%，同期业绩比较基准收益率为 10.78%，日跟踪偏离度的均值为 0.01%，年化跟踪误差为 0.382%，各项指标均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，金融强监管下流动性收紧、房地产市场降温对经济增长的负面影响以及宏观政策与改革力图稳增长是影响未来 A 股市场最值得关注的因素。从经济增长的角度来看，考虑到房地产投资在去库存超预期的背景下依然稳健增长、制造业产能周期已经见底并逐步回升、出口也稳步回升，下半年经济增长无需过度担忧。从金融监管政策来看，全国金融工作会议在监管方面传递的信号表明未来金融去杠杆将更依赖监管规则升级而非持续紧缩流动性。如果当前经济增长的回暖趋势能够延续、货币政策适度并使物价水平不出现大的波动，同时各项改革措施稳步推进的背景下，考虑到目前 A 股市场的估值风险已经很大程度上释放，下半年 A 股市场的机会将大于风险。

从长期来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，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。

4.7 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

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	32,712,236.59	37,062,527.54
结算备付金		105,848.79	73,703.87
存出保证金		100,508.33	54,857.80
交易性金融资产	6.4.7.2	3,733,426,085.16	3,636,514,101.84
其中：股票投资		3,733,426,085.16	3,636,514,101.84
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		1,001,778.50	884,045.37
应收利息	6.4.7.5	7,812.58	8,662.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,767,354,269.95	3,674,597,899.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 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		749,915.05	800,389.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		602,994.57	650,446.35
应付托管费		301,497.29	325,223.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	212,464.71	89,993.43
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	919,076.38	1,525,563.22
负债合计		2,785,948.00	3,391,616.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,436,307,415.00	2,655,831,140.00
未分配利润	6.4.7.10	1,328,260,906.95	1,015,375,143.17
所有者权益合计		3,764,568,321.95	3,671,206,283.17
负债和所有者权益总计		3,767,354,269.95	3,674,597,899.29

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5452 元，基金份额总额 2,436,307,415.00 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

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		420,011,804.35	-706,361,820.89
1.利息收入		132,297.65	311,578.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	131,848.83	311,363.13
债券利息收入		448.82	215.47
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）		30,632,228.88	-219,648,227.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-380,048.76	-255,324,700.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	161,044.98	210,523.08
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	30,851,232.66	35,465,949.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	388,943,247.17	-489,566,383.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	304,030.65	2,541,212.17
减：二、费用		7,021,684.57	8,871,971.28
1. 管理人报酬		3,645,062.88	4,050,837.80
2. 托管费		1,822,531.44	2,025,418.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	774,827.83	1,949,194.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	779,262.42	846,520.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		412,990,119.78	-715,233,792.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		412,990,119.78	-715,233,792.17

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

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

第 15 页共 54 页

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）	2,655,831,140.00	1,015,375,143.17	3,671,206,283.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	412,990,119.78	412,990,119.78
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）	-219,523,725.00	-100,104,356.00	-319,628,081.00
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	3,497,263.02	11,497,263.02
2.基金赎回款	-227,523,725.00	-103,601,619.02	-331,125,344.02
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）	2,436,307,415.00	1,328,260,906.95	3,764,568,321.95
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）	2,845,831,140.00	1,483,907,287.88	4,329,738,427.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-715,233,792.17	-715,233,792.17
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）	68,000,000.00	100,721,835.83	168,721,835.83
其中：1.基金申购款	1,185,082,946.00	371,523,756.11	1,556,606,702.11
2.基金赎回款	-1,117,082,946.00	-270,801,920.28	-1,387,884,866.28
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）	2,913,831,140.00	869,395,331.54	3,783,226,471.54

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(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[2012]1762 号《关于核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式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 交易型开放式指数发起式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 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 43,605.00 份基金份额。本基金为交易型开放式(ETF)、发起式基金,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。

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[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 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	32,712,236.59
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	32,712,236.59	

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	3,449,683,221.71	3,733,426,085.16	283,742,863.45
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	3,449,683,221.71	3,733,426,085.16	283,742,863.45

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	7,726.18
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	45.63
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	40.77
合计	7,812.58

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	212,464.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	212,464.71

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	-
预提费用	230,092.63
应付替代款	360,421.74
可退替代款	58,948.30
其他应付款	269,613.71
合计	919,076.38

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	2,655,831,140.00	2,655,831,140.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-227,523,725.00	-227,523,725.00
本期末	2,436,307,415.00	2,436,307,415.00

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	1,711,467,028.69	-696,091,885.52	1,015,375,143.17
本期利润	24,046,872.61	388,943,247.17	412,990,119.78
本期基金份额交易产生的变动数	-142,196,660.52	42,092,304.52	-100,104,356.00
其中：基金申购款	5,195,759.93	-1,698,496.91	3,497,263.02
基金赎回款	-147,392,420.45	43,790,801.43	-103,601,619.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,593,317,240.78	-265,056,333.83	1,328,260,906.95

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	125,786.56
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	5,341.37
其他	720.90
合计	131,848.83

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,648,999.08
股票投资收益——赎回差价收入	3,268,950.32
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-380,048.76

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	488,474,414.17
减：卖出股票成本总额	492,123,413.25
买卖股票差价收入	-3,648,999.08

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	155,479,628.96
减：现金支付赎回款总额	45,988,600.96
减：赎回股票成本总额	106,222,077.68
赎回差价收入	3,268,950.32

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,815,493.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,654,000.00
减：应收利息总额	448.82
买卖债券差价收入	161,044.98

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	30,851,232.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	30,851,232.66

6.4.7.16 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	388,943,247.17
——股票投资	388,943,247.17
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	388,943,247.17

6.4.7.17 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	255,940.22
基金申购费收入	-
替代损益收入	48,090.43
其他	-
合计	304,030.65

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.18 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	774,827.83
银行间市场交易费用	-
合计	774,827.83

注：交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 194,311.99 元。

6.4.7.19 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	51,572.33
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	2,410.40
上市费	29,752.78
指数使用费	546,759.39
其他	-
合计	779,262.42

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
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、申购赎回代办证券公司
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	该基金是本基金的联接基金

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 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	
	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	270,887,915.52	35.65%	67,356,598.28	2.04%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	116,840.92	50.99%	112,468.66	52.94%
关联方名称	上年度可比期间 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
广发证券	29,050.83	32.35%	27,803.02	45.90%

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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	3,645,062.88
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与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，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
	当期发生的基金应支付的托管费	1,822,531.44

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与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，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。

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	2,363,363,693.00	97.01%	2,471,463,693.00	93.06%
广发证券	1,391,165.00	0.06%	659,252.00	0.02%

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	
	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-活期存款	32,712,236.59	125,786.56	66,332,238.33	282,396.19

注：本基金的上述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
2017 年 1 月 1 日至 2017 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	002841	视源股份	新股网下发行	1,680	32,020.80
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	3,155	22,211.20
广发证券	300625	三雄极光	新股网下发行	3,934	75,926.20
广发证券	300627	华测导航	新股网下发行	1,498	19,129.46
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
广发证券	300647	超频三	新股网下发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下发行	1,110	21,545.10
广发证券	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00
广发证券	600089	特变电工	配股发行	186,704	1,338,667.68
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,206	30,089.70
上年度可比期间 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	002790	瑞尔特	新股网下	3,022	50,104.76

			发行		
广发证券	300518	盛讯达	新股网下发行	1,306	29,019.32
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

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，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，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票建设银行。

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

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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603330	旭升	2017-	2017-	新股	11.26	11.26	1,351	15,212	15,212	-

5	股份	06-30	07-10	流通受限				.26	.26	
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

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
000100	TCL 集团	2017-04-21	重大事项停牌	3.43	2017-07-26	3.72	2,700,504	11,026,623.15	9,262,728.72	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项停牌	24.93	-	-	265,559	8,315,458.05	6,620,385.87	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项停牌	30.82	2017-07-17	27.74	142,317	4,804,398.34	4,386,209.94	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.27	-	-	710,626	8,848,306.10	5,876,877.02	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项停牌	20.24	-	-	366,057	6,822,007.63	7,408,993.68	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项停牌	7.68	-	-	674,600	6,549,645.72	5,180,928.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	30.68	-	-	434,927	23,538,354.18	13,343,560.36	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项停牌	7.47	2017-08-21	8.22	3,119,216	16,511,763.20	23,300,543.52	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项停牌	14.12	-	-	644,384	8,752,921.28	9,098,702.08	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.59	-	-	553,677	14,076,540.29	8,078,147.43	-
600654	*ST 中安	2017-06-07	重大事项停牌	13.48	-	-	275,578	5,308,913.79	3,714,791.44	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项停牌	17.40	-	-	269,387	5,268,986.38	4,687,333.80	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项停牌	3.60	-	-	4,335,677	16,460,768.81	15,608,437.20	-

600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项停牌	10.57	-	-	549,202	7,023,151.77	5,805,065.14	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项停牌	22.29	-	-	727,796	12,468,836.89	16,222,572.84	-
601608	中信重工	2017-04-19	重大事项停牌	5.54	2017-07-26	5.26	466,898	3,038,559.82	2,586,614.92	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项停牌	7.57	2017-07-03	7.54	1,113,541	12,767,350.65	8,429,505.37	-
601872	招商轮船	2017-05-02	重大事项停牌	5.16	-	-	782,399	5,119,465.92	4,037,178.84	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大事项停牌	5.35	2017-07-26	5.89	1,384,100	12,099,754.23	7,404,935.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项停牌	6.21	-	-	3,334,161	29,370,943.77	20,705,139.81	-

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，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、以及标的指数所代表的股票市场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。

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。

6.4.13.2.2 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。

本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型的基金。

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 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	32,712,236.59	-	-	-	32,712,236.59
结算备付金	105,848.79	-	-	-	105,848.79
存出保证金	100,508.33	-	-	-	100,508.33
交易性金融资产	-	-	-	3,733,426,085.16	3,733,426,085.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,001,778.50	1,001,778.50
应收利息	-	-	-	7,812.58	7,812.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,918,593.71	-	-	3,734,435,676.24	3,767,354,269.95
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	-	-	-	749,915.05	749,915.05
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	602,994.57	602,994.57
应付托管费	-	-	-	301,497.29	301,497.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	212,464.71	212,464.71
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	919,076.38	919,076.38
负债总计	-	-	-	2,785,948.00	2,785,948.00
利率敏感度缺口	32,918,593.71	-	-	3,731,649,728.24	3,764,568,321.95
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	37,062,527.54	-	-	-	37,062,527.54
结算备付金	73,703.87	-	-	-	73,703.87
存出保证金	54,857.80	-	-	-	54,857.80
交易性金融资产	-	-	-	3,636,514,101.84	3,636,514,101.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	884,045.37	884,045.37
应收利息	-	-	-	8,662.87	8,662.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,191,089.21	-	-	3,637,406,810.08	3,674,597,899.29
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	-	-	-	800,389.94	800,389.94
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	650,446.35	650,446.35
应付托管费	-	-	-	325,223.18	325,223.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	89,993.43	89,993.43
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,525,563.22	1,525,563.22
负债总计	-	-	-	3,391,616.12	3,391,616.12
利率敏感度缺口	37,191,089.21	-	-	3,634,015,193.96	3,671,206,283.17

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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	1.市场利率下降 25 个基点	-	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-	-

注：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	上年度末
----	-----	------

	2017 年 6 月 30 日		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	3,733,426,085.16	99.17	3,636,514,101.84	99.06
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	3,733,426,085.16	99.17	3,636,514,101.84	99.06

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%	185,990,199.74	181,833,561.16
	2.业绩比较基准下降 5%	-185,990,199.74	-181,833,561.16

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 3,551,667,434.18 元，属于第二层次的余额为 181,758,650.98 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 3,533,747,669.23 元，第二层次 102,766,432.61 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

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	3,733,426,085.16	99.10
	其中：股票	3,733,426,085.16	99.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	32,818,085.38	0.87
7	其他各项资产	1,110,099.41	0.03
8	合计	3,767,354,269.95	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,901,580.00	0.24
B	采矿业	115,169,282.00	3.06
C	制造业	1,353,086,494.36	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,111,429.02	2.69
E	建筑业	171,685,124.12	4.56
F	批发和零售业	80,066,809.44	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	108,407,982.97	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	194,623,407.09	5.17
J	金融业	1,274,193,353.16	33.85
K	房地产业	197,544,775.22	5.25
L	租赁和商务服务业	32,476,155.05	0.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,631,394.17	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,323,600.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	42,742,687.39	1.14
S	综合	15,462,006.77	0.41
	合计	3,733,426,080.76	99.17

7.3 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	3,855,530	191,272,843.30	5.08
2	600036	招商银行	3,670,972	87,772,940.52	2.33
3	600519	贵州茅台	179,059	84,488,989.15	2.24
4	601166	兴业银行	4,436,341	74,796,709.26	1.99
5	000651	格力电器	1,712,969	70,522,933.73	1.87
6	000333	美的集团	1,611,035	69,338,946.40	1.84
7	600016	民生银行	8,414,340	69,165,874.80	1.84

8	000002	万科 A	2,422,771	60,496,591.87	1.61
9	601328	交通银行	9,778,757	60,237,143.12	1.60
10	601668	中国建筑	5,338,064	51,672,459.52	1.37
11	600000	浦发银行	4,001,121	50,614,180.65	1.34
12	601288	农业银行	13,605,693	47,892,039.36	1.27
13	600030	中信证券	2,801,490	47,681,359.80	1.27
14	600887	伊利股份	2,163,657	46,713,354.63	1.24
15	600837	海通证券	2,880,138	42,770,049.30	1.14
16	002415	海康威视	1,313,928	42,439,874.40	1.13
17	601398	工商银行	7,676,725	40,302,806.25	1.07
18	601169	北京银行	4,329,830	39,704,541.10	1.05
19	600104	上汽集团	1,247,724	38,741,830.20	1.03
20	601601	中国太保	1,118,936	37,898,362.32	1.01
21	000858	五粮液	675,448	37,595,435.68	1.00
22	600900	长江电力	2,348,916	36,126,328.08	0.96
23	000725	京东方 A	8,458,323	35,186,623.68	0.93
24	601766	中国中车	3,463,393	35,049,537.16	0.93
25	601211	国泰君安	1,605,223	32,923,123.73	0.87
26	600276	恒瑞医药	601,594	30,434,640.46	0.81
27	000001	平安银行	3,055,846	28,694,393.94	0.76
28	601988	中国银行	7,501,248	27,754,617.60	0.74
29	600048	保利地产	2,532,460	25,248,626.20	0.67
30	600050	中国联通	3,119,216	23,300,543.52	0.62
31	601390	中国中铁	2,653,312	23,004,215.04	0.61
32	600518	康美药业	1,056,369	22,965,462.06	0.61
33	601818	光大银行	5,667,683	22,954,116.15	0.61
34	600028	中国石化	3,741,231	22,185,499.83	0.59
35	600019	宝钢股份	3,146,821	21,115,168.91	0.56
36	600015	华夏银行	2,281,828	21,038,454.16	0.56
37	601688	华泰证券	1,162,425	20,807,407.50	0.55
38	601989	中国重工	3,334,161	20,705,139.81	0.55
39	000063	中兴通讯	846,806	20,103,174.44	0.53
40	002450	康得新	879,551	19,807,488.52	0.53
41	601186	中国铁建	1,637,577	19,700,051.31	0.52
42	002304	洋河股份	214,507	18,621,352.67	0.49
43	000776	广发证券	1,053,372	18,170,667.00	0.48
44	001979	招商蛇口	843,989	18,027,605.04	0.48
45	601006	大秦铁路	2,116,418	17,756,747.02	0.47
46	000538	云南白药	185,152	17,376,515.20	0.46
47	600703	三安光电	871,111	17,160,886.70	0.46
48	600690	青岛海尔	1,085,148	16,331,477.40	0.43
49	601088	中国神华	727,796	16,222,572.84	0.43
50	600585	海螺水泥	711,749	16,178,054.77	0.43
51	601628	中国人寿	592,939	15,997,494.22	0.42

52	600795	国电电力	4,335,677	15,608,437.20	0.41
53	600958	东方证券	1,108,129	15,414,074.39	0.41
54	601336	新华保险	297,159	15,273,972.60	0.41
55	002024	苏宁云商	1,325,456	14,911,380.00	0.40
56	601939	建设银行	2,390,196	14,699,705.40	0.39
57	601901	方正证券	1,465,058	14,548,025.94	0.39
58	601009	南京银行	1,293,818	14,503,699.78	0.39
59	600340	华夏幸福	420,484	14,119,852.72	0.38
60	600999	招商证券	814,189	14,020,334.58	0.37
61	600309	万华化学	486,634	13,937,197.76	0.37
62	002230	科大讯飞	346,004	13,805,559.60	0.37
63	600089	特变电工	1,332,529	13,765,024.57	0.37
64	600741	华域汽车	560,986	13,598,300.64	0.36
65	002142	宁波银行	693,948	13,393,196.40	0.36
66	000423	东阿阿胶	186,049	13,375,062.61	0.36
67	300104	乐视网	434,927	13,343,560.36	0.35
68	601857	中国石油	1,729,132	13,297,025.08	0.35
69	600660	福耀玻璃	499,136	12,997,501.44	0.35
70	601985	中国核电	1,661,927	12,979,649.87	0.34
71	601669	中国电建	1,633,447	12,936,900.24	0.34
72	600009	上海机场	342,937	12,794,979.47	0.34
73	601899	紫金矿业	3,693,131	12,667,439.33	0.34
74	000568	泸州老窖	249,647	12,627,145.26	0.34
75	002241	歌尔股份	653,373	12,597,031.44	0.33
76	300070	碧水源	669,115	12,478,994.75	0.33
77	601377	兴业证券	1,668,456	12,396,628.08	0.33
78	002456	欧菲光	676,448	12,291,060.16	0.33
79	000166	申万宏源	2,141,457	11,992,159.20	0.32
80	601607	上海医药	410,861	11,865,665.68	0.32
81	300072	三聚环保	319,039	11,820,394.95	0.31
82	002236	大华股份	516,104	11,772,332.24	0.31
83	000069	华侨城 A	1,168,141	11,751,498.46	0.31
84	002736	国信证券	875,723	11,603,329.75	0.31
85	002466	天齐锂业	212,318	11,539,483.30	0.31
86	600886	国投电力	1,449,223	11,448,861.70	0.30
87	000338	潍柴动力	862,068	11,379,297.60	0.30
88	000783	长江证券	1,180,758	11,181,778.26	0.30
89	600196	复星医药	357,945	11,092,715.55	0.29
90	600031	三一重工	1,362,959	11,080,856.67	0.29
91	600068	葛洲坝	983,450	11,053,978.00	0.29
92	300059	东方财富	915,786	11,007,747.72	0.29
93	600029	南方航空	1,249,964	10,874,686.80	0.29
94	600010	包钢股份	4,867,180	10,659,124.20	0.28
95	601600	中国铝业	2,340,328	10,578,282.56	0.28

96	002008	大族激光	303,700	10,520,168.00	0.28
97	601888	中国国旅	347,484	10,473,167.76	0.28
98	600066	宇通客车	472,764	10,386,625.08	0.28
99	601788	光大证券	695,178	10,379,007.54	0.28
100	600637	东方明珠	470,092	10,186,893.64	0.27
101	600606	绿地控股	1,299,246	10,160,103.72	0.27
102	000625	长安汽车	694,102	10,008,950.84	0.27
103	000839	中信国安	976,684	9,757,073.16	0.26
104	601099	太平洋	2,426,101	9,752,926.02	0.26
105	002594	比亚迪	193,535	9,667,073.25	0.26
106	601933	永辉超市	1,362,677	9,647,753.16	0.26
107	601555	东吴证券	854,310	9,593,901.30	0.25
108	600535	天士力	230,717	9,583,984.18	0.25
109	601618	中国中冶	1,906,239	9,550,257.39	0.25
110	600893	航发动力	346,826	9,468,349.80	0.25
111	000413	东旭光电	834,660	9,364,885.20	0.25
112	000100	TCL 集团	2,700,504	9,262,728.72	0.25
113	600383	金地集团	803,118	9,211,763.46	0.24
114	600522	中天科技	764,100	9,207,405.00	0.24
115	600406	国电南瑞	518,854	9,157,773.10	0.24
116	600100	同方股份	644,384	9,098,702.08	0.24
117	000768	中航飞机	492,805	9,087,324.20	0.24
118	300124	汇川技术	355,620	9,082,534.80	0.24
119	600705	中航资本	1,597,561	9,026,219.65	0.24
120	002673	西部证券	623,342	8,863,923.24	0.24
121	600109	国金证券	753,613	8,832,344.36	0.23
122	002475	立讯精密	301,694	8,821,532.56	0.23
123	600816	安信信托	649,044	8,820,507.96	0.23
124	600111	北方稀土	776,088	8,793,077.04	0.23
125	601800	中国交建	543,398	8,634,594.22	0.23
126	002202	金风科技	556,834	8,614,221.98	0.23
127	000963	华东医药	173,207	8,608,387.90	0.23
128	002739	万达电影	167,384	8,531,562.48	0.23
129	601727	上海电气	1,113,541	8,429,505.37	0.22
130	000895	双汇发展	352,340	8,368,075.00	0.22
131	600570	恒生电子	176,124	8,221,468.32	0.22
132	600271	航天信息	397,997	8,214,658.08	0.22
133	600485	信威集团	553,677	8,078,147.43	0.21
134	601018	宁波港	1,406,447	7,946,425.55	0.21
135	600023	浙能电力	1,452,285	7,929,476.10	0.21
136	600739	辽宁成大	435,491	7,851,902.73	0.21
137	600177	雅戈尔	765,051	7,742,316.12	0.21
138	600352	浙江龙盛	810,529	7,724,341.37	0.21
139	600674	川投能源	783,253	7,691,544.46	0.20

140	000728	国元证券	629,318	7,690,265.96	0.20
141	601992	金隅股份	1,187,200	7,681,184.00	0.20
142	600547	山东黄金	264,514	7,652,390.02	0.20
143	300024	机器人	388,895	7,583,452.50	0.20
144	000623	吉林敖东	330,983	7,576,200.87	0.20
145	601225	陕西煤业	1,067,762	7,549,077.34	0.20
146	600221	海航控股	2,339,889	7,534,442.58	0.20
147	002252	上海莱士	366,057	7,408,993.68	0.20
148	601919	中远海控	1,384,100	7,404,935.00	0.20
149	002508	老板电器	169,100	7,352,468.00	0.20
150	002044	美年健康	430,800	7,323,600.00	0.19
151	600018	上港集团	1,154,568	7,319,961.12	0.19
152	002065	东华软件	335,260	7,305,315.40	0.19
153	000793	华闻传媒	718,090	7,267,070.80	0.19
154	002007	华兰生物	198,563	7,247,549.50	0.19
155	600804	鹏博士	402,822	7,150,090.50	0.19
156	600115	东方航空	1,047,179	7,120,817.20	0.19
157	000157	中联重科	1,563,602	7,020,572.98	0.19
158	600415	小商品城	968,747	7,013,728.28	0.19
159	603993	洛阳钼业	1,383,022	6,998,091.32	0.19
160	000540	中天金融	1,003,287	6,972,844.65	0.19
161	601111	中国国航	709,103	6,913,754.25	0.18
162	600208	新湖中宝	1,530,277	6,886,246.50	0.18
163	601998	中信银行	1,090,822	6,861,270.38	0.18
164	600085	同仁堂	195,190	6,823,842.40	0.18
165	600820	隧道股份	671,341	6,780,544.10	0.18
166	601198	东兴证券	392,821	6,772,234.04	0.18
167	000503	海虹控股	265,559	6,620,385.87	0.18
168	002465	海格通信	611,012	6,562,268.88	0.17
169	600436	片仔癀	107,400	6,555,696.00	0.17
170	600153	建发股份	504,663	6,525,292.59	0.17
171	000826	启迪桑德	182,258	6,400,900.96	0.17
172	000630	铜陵有色	2,247,884	6,383,990.56	0.17
173	002310	东方园林	381,232	6,374,199.04	0.17
174	000709	河钢股份	1,511,580	6,333,520.20	0.17
175	600157	永泰能源	1,768,977	6,315,247.89	0.17
176	600362	江西铜业	369,367	6,227,527.62	0.17
177	300017	网宿科技	514,024	6,204,269.68	0.16
178	002081	金螳螂	564,367	6,196,749.66	0.16
179	000009	中国宝安	765,221	6,190,637.89	0.16
180	600663	陆家嘴	261,135	6,173,231.40	0.16
181	000060	中金岭南	551,130	6,172,656.00	0.16
182	000876	新希望	750,390	6,168,205.80	0.16
183	600489	中金黄金	614,208	6,160,506.24	0.16

184	600061	国投安信	394,624	6,136,403.20	0.16
185	002146	荣盛发展	619,164	6,111,148.68	0.16
186	600170	上海建工	1,584,716	6,053,615.12	0.16
187	603160	汇顶科技	60,200	6,038,060.00	0.16
188	601229	上海银行	235,100	6,004,454.00	0.16
189	002027	分众传媒	435,191	5,988,228.16	0.16
190	601155	新城控股	321,425	5,959,219.50	0.16
191	002074	国轩高科	187,259	5,908,021.45	0.16
192	002129	中环股份	710,626	5,876,877.02	0.16
193	601216	君正集团	1,201,374	5,874,718.86	0.16
194	600118	中国卫星	210,391	5,857,285.44	0.16
195	600332	白云山	200,096	5,810,787.84	0.15
196	600959	江苏有线	549,202	5,805,065.14	0.15
197	600682	南京新百	157,000	5,793,300.00	0.15
198	002500	山西证券	604,132	5,787,584.56	0.15
199	000750	国海证券	1,050,249	5,776,369.50	0.15
200	600297	广汇汽车	763,728	5,750,871.84	0.15
201	601633	长城汽车	428,997	5,701,370.13	0.15
202	600008	首创股份	858,015	5,645,738.70	0.15
203	600369	西南证券	1,004,820	5,637,040.20	0.15
204	300315	掌趣科技	690,241	5,632,366.56	0.15
205	000425	徐工机械	1,496,726	5,612,722.50	0.15
206	600150	中国船舶	245,347	5,611,085.89	0.15
207	601333	广深铁路	1,207,108	5,456,128.16	0.14
208	300144	宋城演艺	258,618	5,397,357.66	0.14
209	000559	万向钱潮	490,045	5,204,277.90	0.14
210	000792	盐湖股份	495,949	5,182,667.05	0.14
211	002426	胜利精密	674,600	5,180,928.00	0.14
212	600688	上海石化	779,843	5,154,762.23	0.14
213	000686	东北证券	499,914	5,024,135.70	0.13
214	002195	二三四五	701,632	5,016,668.80	0.13
215	000938	紫光股份	81,700	4,993,504.00	0.13
216	000402	金融街	425,343	4,985,019.96	0.13
217	000983	西山煤电	560,666	4,917,040.82	0.13
218	601117	中国化学	702,300	4,909,077.00	0.13
219	600583	海油工程	786,677	4,908,864.48	0.13
220	600718	东软集团	309,610	4,814,435.50	0.13
221	300027	华谊兄弟	594,909	4,812,813.81	0.13
222	300033	同花顺	76,400	4,752,844.00	0.13
223	002411	必康股份	163,800	4,737,096.00	0.13
224	600649	城投控股	450,108	4,730,635.08	0.13
225	600498	烽火通信	186,020	4,715,607.00	0.13
226	600666	奥瑞德	269,387	4,687,333.80	0.12
227	600895	张江高科	275,738	4,654,457.44	0.12

228	600827	百联股份	285,674	4,642,202.50	0.12
229	600256	广汇能源	1,115,196	4,616,911.44	0.12
230	600373	中文传媒	196,112	4,610,593.12	0.12
231	002385	大北农	729,839	4,590,687.31	0.12
232	000917	电广传媒	403,818	4,563,143.40	0.12
233	002183	怡亚通	528,177	4,558,167.51	0.12
234	002831	裕同科技	60,200	4,515,000.00	0.12
235	600704	物产中大	613,176	4,470,053.04	0.12
236	002841	视源股份	60,200	4,468,044.00	0.12
237	600588	用友网络	260,688	4,462,978.56	0.12
238	600074	保千里	347,097	4,446,312.57	0.12
239	000415	渤海金控	660,158	4,442,863.34	0.12
240	002049	紫光国芯	142,317	4,386,209.94	0.12
241	000008	神州高铁	599,949	4,367,628.72	0.12
242	603858	步长制药	60,225	4,314,519.00	0.11
243	600060	海信电器	279,567	4,241,031.39	0.11
244	002470	金正大	558,519	4,205,648.07	0.11
245	600376	首开股份	367,292	4,201,820.48	0.11
246	600919	江苏银行	451,900	4,198,151.00	0.11
247	601718	际华集团	468,888	4,121,525.52	0.11
248	601866	中远海发	1,129,448	4,066,012.80	0.11
249	601872	招商轮船	782,399	4,037,178.84	0.11
250	002558	巨人网络	86,360	3,991,559.20	0.11
251	002602	世纪华通	109,700	3,977,722.00	0.11
252	002352	顺丰控股	74,300	3,949,788.00	0.10
253	000959	首钢股份	564,700	3,947,253.00	0.10
254	600909	华安证券	386,800	3,902,812.00	0.10
255	002174	游族网络	122,672	3,896,062.72	0.10
256	601997	贵阳银行	245,500	3,881,355.00	0.10
257	600038	中直股份	83,824	3,836,624.48	0.10
258	002555	三七互娱	148,500	3,797,145.00	0.10
259	300168	万达信息	259,138	3,770,457.90	0.10
260	600977	中国电影	199,300	3,730,896.00	0.10
261	600654	*ST 中安	275,578	3,714,791.44	0.10
262	000977	浪潮信息	213,357	3,695,343.24	0.10
263	600021	上海电力	304,499	3,681,392.91	0.10
264	000627	天茂集团	454,730	3,674,218.40	0.10
265	600037	歌华有线	247,781	3,607,691.36	0.10
266	002152	广电运通	432,518	3,594,224.58	0.10
267	600737	中粮糖业	365,194	3,447,431.36	0.09
268	002714	牧原股份	123,746	3,368,366.12	0.09
269	000671	阳光城	576,331	3,354,246.42	0.09
270	600549	厦门钨业	154,168	3,313,070.32	0.09
271	002131	利欧股份	998,055	3,283,600.95	0.09

272	600372	中航电子	187,664	3,259,723.68	0.09
273	600685	中船防务	116,988	3,203,131.44	0.09
274	000738	航发控制	163,300	3,195,781.00	0.08
275	601118	海南橡胶	559,609	3,178,579.12	0.08
276	000718	苏宁环球	539,847	3,163,503.42	0.08
277	002292	奥飞娱乐	186,027	3,143,856.30	0.08
278	600446	金证股份	178,534	3,138,627.72	0.08
279	600482	中国动力	123,852	3,132,217.08	0.08
280	601877	正泰电器	152,124	3,056,171.16	0.08
281	000156	华数传媒	204,010	3,041,789.10	0.08
282	601375	中原证券	285,700	2,874,142.00	0.08
283	601021	春秋航空	85,386	2,871,531.18	0.08
284	002424	贵州百灵	150,865	2,845,313.90	0.08
285	300133	华策影视	248,765	2,786,168.00	0.07
286	601881	中国银河	229,400	2,720,684.00	0.07
287	002153	石基信息	113,945	2,589,969.85	0.07
288	601608	中信重工	466,898	2,586,614.92	0.07
289	000961	中南建设	396,300	2,583,876.00	0.07
290	300251	光线传媒	313,118	2,564,436.42	0.07
291	601958	金钼股份	344,541	2,470,358.97	0.07
292	600233	圆通速递	120,500	2,360,595.00	0.06
293	002299	圣农发展	158,348	2,354,634.76	0.06
294	601163	三角轮胎	85,400	2,246,020.00	0.06
295	601611	中国核建	186,684	2,234,607.48	0.06
296	600871	石化油服	643,112	2,147,994.08	0.06
297	600926	杭州银行	143,600	2,132,460.00	0.06
298	601966	玲珑轮胎	85,400	1,915,522.00	0.05
299	000555	神州信息	102,855	1,717,678.50	0.05
300	600188	兖州煤业	137,024	1,677,173.76	0.04
301	601127	小康股份	82,600	1,647,870.00	0.04
302	002797	第一创业	137,189	1,263,510.69	0.03
303	002839	张家港行	70,700	1,111,404.00	0.03
304	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
305	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
306	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
307	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
308	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
309	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
310	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
311	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
312	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
313	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
314	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
315	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00

316	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
317	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
318	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
319	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
320	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
321	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002456	欧菲光	16,910,920.30	0.46
2	600019	宝钢股份	14,295,095.20	0.39
3	002415	海康威视	10,293,676.74	0.28
4	600522	中天科技	8,928,864.95	0.24
5	601992	金隅股份	8,159,890.00	0.22
6	002508	老板电器	7,680,270.70	0.21
7	002044	美年健康	6,862,017.00	0.19
8	600436	片仔癀	6,132,025.50	0.17
9	601229	上海银行	5,924,276.00	0.16
10	600682	南京新百	5,825,180.00	0.16
11	603160	汇顶科技	5,800,805.00	0.16
12	601117	中国化学	4,783,030.00	0.13
13	002411	必康股份	4,670,617.00	0.13
14	002841	视源股份	4,551,897.56	0.12
15	603858	步长制药	4,531,671.37	0.12
16	002831	裕同科技	4,326,496.50	0.12
17	600919	江苏银行	4,272,468.00	0.12
18	002352	顺丰控股	4,058,153.00	0.11
19	002558	巨人网络	4,031,711.55	0.11
20	600549	厦门钨业	3,921,925.00	0.11

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。

7.4.2 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	002456	欧菲光	17,621,535.30	0.48
2	601318	中国平安	12,536,806.90	0.34

3	601166	兴业银行	10,488,204.30	0.29
4	600519	贵州茅台	9,118,344.54	0.25
5	600867	通化东宝	7,706,862.73	0.21
6	600005	武钢股份	7,566,455.20	0.21
7	000651	格力电器	7,006,988.47	0.19
8	000333	美的集团	6,874,671.34	0.19
9	002085	万丰奥威	6,583,720.30	0.18
10	000002	万科 A	6,348,988.52	0.17
11	600036	招商银行	5,955,146.46	0.16
12	000778	新兴铸管	5,938,562.81	0.16
13	600019	宝钢股份	5,938,465.23	0.16
14	600016	民生银行	5,686,671.91	0.15
15	601258	庞大集团	5,370,893.14	0.15
16	300015	爱尔眼科	5,231,659.64	0.14
17	000039	中集集团	5,093,333.13	0.14
18	600839	四川长虹	4,987,626.81	0.14
19	601328	交通银行	4,798,553.65	0.13
20	300002	神州泰岳	4,639,677.72	0.13

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。

7.4.3 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	298,637,752.08
卖出股票收入（成交）总额	488,474,414.17

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2016 年 10 月 8 日，中国人民银行营业管理部对民生银行违反《征信业管理条例》相关规定处以人民币 40 万元的行政处罚。

2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对民生银行批量转让个人贷款、安排回购条件以及未按规定进行信息披露；违规转让非不良贷款，处以人民币 70 万元的行政处罚。

2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对招商银行批量转让个人贷款，处以人民币 50 万元的行政处罚。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除民生银行、招商银行外，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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	100,508.33
2	应收证券清算款	1,001,778.50
3	应收股利	-
4	应收利息	7,812.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,110,099.41

7.12.4 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。

7.12.5 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		中国建设银行股份有限公司一易方达沪深 300 指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,932	830,937.0 4	2,381,147,6 15.00	97.74%	55,159,800. 00	2.26%	2,363,363,6 93.00	97.01%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行股份有限公司一易方达沪深300指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国信证券股份有限公司	6,755,000.00	0.28%
2	北京中科世通技术服务有限公司	3,562,600.00	0.15%
3	工银瑞信添富股票型养老金产品—中国农业银行股份有限公司	3,349,400.00	0.14%
4	王黎	1,700,000.00	0.07%
5	陈炎	1,633,700.00	0.07%

6	张红	1,500,000.00	0.06%
7	周文雪	1,442,200.00	0.06%
8	广发证券股份有限公司	1,391,165.00	0.06%
9	黄巧君	1,389,714.00	0.06%
10	李洵	1,100,000.00	0.05%
11	中国建设银行股份有限公司—易方达沪深 300 指数证券投资基金联接基金	2,363,363,693.00	97.01%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 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	0.00	0.0000%

8.4 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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额 发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	1,391,165.00	0.0571%	10,002,600.00	0.4106%	3 年

其他	-	-	-	-	-
合计	1,391,165.00	0.0571%	10,002,600.00	0.4106%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,104,307,415.00
本报告期期初基金份额总额	2,655,831,140.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	227,523,725.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,436,307,415.00

注：期初基金总份额包含场外份额 117,523,725 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 117,523,725 份。

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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	207,377,200.69	27.29%	89,441.35	39.04%	-
申万宏源	4	281,620,132.20	37.06%	22,844.86	9.97%	-
广发证券	2	270,887,915.52	35.65%	116,840.92	50.99%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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	
	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
申万宏源	4,815,493.80	100.00%	-	-	-	-

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基金申购海利尔药业集团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	2017-01-06
2	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东翔鹭钨业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	2017-01-10
3	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州视源电子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	2017-01-13
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东雄塑科技集团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	2017-01-14
5	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购浙江正裕工业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	2017-01-20
6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江山欧派门业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	2017-02-03
7	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
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购拉芳家化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	2017-03-04
9	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

10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东三雄极光照明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	2017-03-11
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海华测导航技术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	2017-03-16
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏美思德化学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	2017-03-24
13	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东凯普生物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	2017-04-07
14	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
15	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购周大生珠宝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	2017-04-22
16	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市超频三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	2017-04-26
17	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门延江新材料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	2017-05-20
18	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南京华脉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	2017-05-25
19	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销证券的公告	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
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州酒家集团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	2017-06-21
21	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购杭州沪宁电梯部件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	2017-06-23
22	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	2017-06-23
23	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

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
中国建设银行股份有限公司—易方达沪深300指数证券投资基金联接基金	1	2017年01月01日~2017年06月30日	2,471,463,693.00	3,000,000.00	111,100,000.00	2,363,363,693.00	97.01%
产品特有风险							
<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>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

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沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；
- 2.《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合同》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照；

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