

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基 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 4 月 27 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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	50
8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末上市基金前十名持有人	51
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
9	开放式基金份额变动	52
10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	55
11	影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	57
12.3	查阅方式	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达深证成指 ETF
场内简称	深成指 EF
基金主代码	159950
交易代码	159950
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2017 年 4 月 27 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	57,001,380.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 5 月 10 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。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 内，年化跟踪误差控制在 2% 内。
业绩比较基准	深证成份指数收益率
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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	王永民

负责人	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 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

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 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	474,086.10
本期利润	3,697,203.16
加权平均基金份额本期利润	0.0256
本期加权平均净值利润率	2.54%
本期基金份额净值增长率	6.51%
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	1,573,461.15
期末可供分配基金份额利润	0.0276
期末基金资产净值	60,713,299.70

期末基金份额净值	1.0651
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	6.51%

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。

4.本基金合同于 2017 年 4 月 27 日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	6.44%	0.78%	6.74%	0.83%	-0.30%	-0.05%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.51%	0.73%	3.18%	0.86%	3.33%	-0.13%

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

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

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

(2017年4月27日至2017年6月30日)



注：1.本基金合同于2017年4月27日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(第十四部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为6.51%,同期业绩比较基准收益率为3.18%。

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		
成曦	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理	2017-04-27	-	9 年	硕士研究生，曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。
刘树荣	本基金的基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理助理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理	2017-05-11	-	10 年	本科学士，曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，成曦的“任职日期”为基金合同生效之日，刘树荣的“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

本基金跟踪的标的指数为深证成指，深证成指由深圳证券市场规模大、流动性好、最具代表性的 500 只股票组成，对深圳整体股票市场的覆盖度高，剪表性强。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而进行相应调整。

2017 年上半年，经济方面：中国二季度 GDP 同比 6.9%，持平一季度前值 6.9%，高于预期。总体来看，上半年国民经济稳中向好，其中房地产开发增速放缓；零售增长加快，尤其是网上零售业务增速高企；进出口快速增长，外贸结构开始改善；居民消费价格涨幅较为温和，并未出现明显

的通货膨胀。

市场方面：2017 年初在人民币短期快速贬值，金融去杠杆严格执行，及对经济增速低预期的情况下，A 股出现了大幅急速调整行情，随后二季度投资者风险偏好降低，资金主要集中在大盘蓝筹和稳定成长的消费类股票上面，以上证 50 为代表的大盘价值指数和消费行业表现出色。深证成指作为深市中代表，其中含有相当权重的中小创，因此 2017 上半年涨幅为 4.2%，低于上证 50（11.5%）为代表的大盘蓝筹系列指数表现，但是高于创业板指（-7.3%）。

报告期内本基金为建仓期，在操作中，我们采用组合交易形式进行建仓，降低建仓动作对市场的冲击。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 1.0651 元，本报告期份额净值增长率为 6.51%，同期业绩比较基准收益率为 3.18%。日跟踪偏离度的均值为 0.15%，年化跟踪误差 5.67%，建仓期内略高于合同规定的目标控制范围，预计将建仓期结束后回落至目标控制范围。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济：2016 年实现了经济总量稳定增长，但随之带来了房价上涨，汇率承压等结果。预计 2017 年宏观政策任务主要集中在抑制地产泡沫，防范金融风险 and 深化供给侧改革上，同时预期货币政策还将保持稳健中性以预防较高的通货膨胀。

证券市场：市场整体增速保持平稳，但结构性差异较大，中小创在经过 2015、2016 两年的业绩高速增长后，将在 2017 年有所回落，再加上中性的货币流动性，可能机会更多来源于市场调整带来的阶段性低估。大盘蓝筹由于其高分红，低估值的特征将继续受到低风险资金的偏好。

行业走势：深证成指指数基本反映了深圳市场走势，其中包含深市主板，中小板，创业板三个板块的核心个股，深市作为中国市场成长股的集中地，深证成指也完整的反应了整个深市的走势。鉴于中国经济转型期的大背景和新兴产业的发展前景，深证成指数的投资价值将进一步突出。

作为被动投资的基金，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，致力于为投资者提供分享中国经济增长红利的优质指数产品。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金(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：易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,246,715.66
结算备付金		9,635,607.09
存出保证金		83,934.22
交易性金融资产	6.4.7.2	49,936,952.53
其中：股票投资		49,936,952.53
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	4,289.82
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	54,576.28
资产总计		61,962,075.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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		740,425.79
应付赎回款		-
应付管理人报酬		38,857.27
应付托管费		7,771.47
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	356,123.58
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	105,597.79
负债合计		1,248,775.90
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	57,001,380.00
未分配利润	6.4.7.10	3,711,919.70
所有者权益合计		60,713,299.70
负债和所有者权益总计		61,962,075.60

注：1.本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0651 元，基金份额总额 57,001,380.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		4,392,022.19
1.利息收入		290,628.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,617.45
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		204,011.37
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		868,388.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	226,568.74
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	641,819.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,223,117.06
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	9,887.99
减：二、费用		694,819.03
1. 管理人报酬		128,652.57
2. 托管费		25,730.54
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	419,922.29
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	120,513.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,697,203.16
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,697,203.16

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）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）	381,001,380.00	-	381,001,380.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,697,203.16	3,697,203.16
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）	-324,000,000.00	14,716.54	-323,985,283.46
其中：1.基金申购款	87,000,000.00	-2,666.30	86,997,333.70
2.基金赎回款	-411,000,000.00	17,382.84	-410,982,617.16

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）	57,001,380.00	3,711,919.70	60,713,299.70

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2301 号《关于准予易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，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《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 381,001,380.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 25,380.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2017 年 3 月 27 日至 2017 年 4 月 21 日，募集金额总额为人民币 381,001,380.00 元，其中：有效净认购金额为人民币 380,976,000.00 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 25,380.00 元，经安永华明 (2017) 验字第 60468000_G07 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露

管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权;

(2) 本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红;

(3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上,基金管理人可进行收益分配;

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定:使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配无需以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值;

(5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的,从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,对上述原则进行修改或调整,而无需召开基金份额持有人大会审议。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 营业税、增值税、企业所得税

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。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收

流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	2,246,715.66
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	2,246,715.66

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	46,713,835.47	49,936,952.53	3,223,117.06
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	46,713,835.47	49,936,952.53	3,223,117.06

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	350.20
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	3,905.60
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	34.02
合计	4,289.82

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	54,576.28
合计	54,576.28

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	356,123.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	356,123.58

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	67,349.10
应付替代款	-
可退替代款	2,534.40
其他应付款	35,714.29
合计	105,597.79

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	381,001,380.00	381,001,380.00
本期申购	87,000,000.00	87,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-411,000,000.00	-411,000,000.00
本期末	57,001,380.00	57,001,380.00

注：本基金合同于 2017 年 4 月 27 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 381,001,380.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 25,380.00 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	474,086.10	3,223,117.06	3,697,203.16
本期基金份额交易产生的变动数	1,099,375.05	-1,084,658.51	14,716.54
其中：基金申购款	-1,018,466.40	1,015,800.10	-2,666.30
基金赎回款	2,117,841.45	-2,100,458.61	17,382.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,573,461.15	2,138,458.55	3,711,919.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	70,784.62
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	15,727.05
其他	105.78
合计	86,617.45

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 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-40,423.48
股票投资收益——赎回差价收入	266,992.22
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	226,568.74

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4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
卖出股票成交总额	28,727,400.76
减：卖出股票成本总额	28,767,824.24
买卖股票差价收入	-40,423.48

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4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	410,982,617.16
减：现金支付赎回款总额	39,517,065.16
减：赎回股票成本总额	371,198,559.78
赎回差价收入	266,992.22

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

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4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	641,819.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	641,819.58

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4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
1.交易性金融资产	3,223,117.06
——股票投资	3,223,117.06
——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	3,223,117.06

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	9,887.99
其他	-
合计	9,887.99

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购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4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
交易所市场交易费用	419,922.29
银行间市场交易费用	-
合计	419,922.29

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
审计费用	15,662.40
信息披露费	51,686.70
银行汇划费	1,626.52
上市费	15,423.72
指数使用费	35,714.29
其他	400.00
合计	120,513.63

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
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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
易方达深证成指交易型开放式指数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

本基金本报告期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
	2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	128,652.57
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 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
	2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,730.54

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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

本基金本报告期末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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	39,000,000.00	68.42%

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期	
	2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	2,246,715.66	70,784.62

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 4 月 27 日 (基金合同生效日) 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	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00

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。

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
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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000061	农产品	2017-06-28	重大事项停牌	9.06	-	-	6,400	56,708.38	57,984.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项停牌	24.93	-	-	1,200	33,210.05	29,916.00	-
002010	传化智联	2017-06-30	重大事项停牌	15.26	2017-07-04	16.77	3,372	54,199.17	51,456.72	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项停牌	10.33	2017-08-02	11.36	1,950	20,104.45	20,143.50	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项停牌	17.02	2017-07-12	16.68	1,157	19,748.62	19,692.14	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项停牌	2.44	2017-08-02	2.44	4,000	10,201.62	9,760.00	-
002619	巨龙管业	2017-05-24	重大事项停牌	6.37	-	-	1,280	9,097.36	8,153.60	-

002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项停牌	12.59	2017-07-03	12.70	3,400	43,768.74	42,806.00	-
300075	数字政通	2017-06-29	重大事项停牌	20.94	2017-07-17	18.86	1,846	43,153.48	38,655.24	-
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项停牌	18.50	2017-07-07	18.88	3,261	58,544.71	60,328.50	-
300098	高新兴	2017-06-22	重大事项停牌	12.90	2017-07-03	13.18	4,976	60,486.24	64,190.40	-
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项停牌	11.46	-	-	1,200	13,776.00	13,752.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	重大事项停牌	16.59	2017-07-04	16.80	4,965	83,375.34	82,369.35	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本金属股票基金，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、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和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%。

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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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	2,246,715.66	-	-	-	2,246,715.66
结算备付金	9,635,607.09	-	-	-	9,635,607.09
存出保证金	83,934.22	-	-	-	83,934.22
交易性金融资产	-	-	-	49,936,952.53	49,936,952.53
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	-	-	-	4,289.82	4,289.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	54,576.28	54,576.28
资产总计	11,966,256.97	-	-	49,995,818.63	61,962,075.60
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	-	-	-	740,425.79	740,425.79
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	38,857.27	38,857.27
应付托管费	-	-	-	7,771.47	7,771.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	356,123.58	356,123.58
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	105,597.79	105,597.79
负债总计	-	-	-	1,248,775.90	1,248,775.90
利率敏感度缺口	11,966,256.97	-	-	48,747,042.73	60,713,299.70

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 2017年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	49,936,952.53	82.25
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	49,936,952.53	82.25

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
	1.业绩比较基准上升 5%	2,533,834.62
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,533,834.62

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 49,437,745.08 元,属于第二层次的余额为 499,207.45 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。

(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	49,936,952.53	80.59
	其中: 股票	49,936,952.53	80.59
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	11,882,322.75	19.18
7	其他各项资产	142,800.32	0.23
8	合计	61,962,075.60	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	1,179,125.40	1.94
B	采矿业	539,160.00	0.89
C	制造业	30,320,623.42	49.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	829,445.00	1.37
E	建筑业	1,052,713.03	1.73
F	批发和零售业	1,245,330.93	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	251,770.00	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,256,275.74	8.66
J	金融业	3,410,509.58	5.62
K	房地产业	2,658,479.82	4.38
L	租赁和商务服务业	701,938.50	1.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,001,340.60	1.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	415,632.68	0.68
R	文化、体育和娱乐业	900,948.33	1.48
S	综合	173,659.50	0.29

	合计	49,936,952.53	82.25
--	----	---------------	-------

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	000651	格力电器	39,000	1,605,630.00	2.64
2	000333	美的集团	36,000	1,549,440.00	2.55
3	000725	京东方 A	208,300	866,528.00	1.43
4	002415	海康威视	26,311	849,845.30	1.40
5	000858	五粮液	15,200	846,032.00	1.39
6	000002	万科 A	33,311	831,775.67	1.37
7	300498	温氏股份	31,137	729,851.28	1.20
8	000001	平安银行	69,100	648,849.00	1.07
9	000776	广发证券	29,900	515,775.00	0.85
10	000063	中兴通讯	19,400	460,556.00	0.76
11	002450	康得新	18,900	425,628.00	0.70
12	002304	洋河股份	4,655	404,100.55	0.67
13	000538	云南白药	3,700	347,245.00	0.57
14	001979	招商蛇口	16,100	343,896.00	0.57
15	002230	科大讯飞	8,400	335,160.00	0.55
16	002024	苏宁云商	28,700	322,875.00	0.53
17	000423	东阿阿胶	4,300	309,127.00	0.51
18	000166	申万宏源	54,000	302,400.00	0.50
19	002236	大华股份	13,100	298,811.00	0.49
20	000568	泸州老窖	5,900	298,422.00	0.49
21	002241	歌尔股份	15,400	296,912.00	0.49
22	300059	东方财富	24,400	293,288.00	0.48
23	002466	天齐锂业	5,300	288,055.00	0.47
24	002456	欧菲光	15,600	283,452.00	0.47
25	002142	宁波银行	14,500	279,850.00	0.46
26	300072	三聚环保	7,350	272,317.50	0.45
27	000069	华侨城 A	26,500	266,590.00	0.44
28	000338	潍柴动力	19,700	260,040.00	0.43
29	000413	东旭光电	23,100	259,182.00	0.43
30	300136	信维通信	6,400	256,128.00	0.42
31	000783	长江证券	26,900	254,743.00	0.42
32	000625	长安汽车	17,600	253,792.00	0.42
33	002008	大族激光	7,100	245,944.00	0.41
34	002594	比亚迪	4,700	234,765.00	0.39

35	300070	碧水源	12,500	233,125.00	0.38
36	002673	西部证券	15,800	224,676.00	0.37
37	000839	中信国安	22,200	221,778.00	0.37
38	300124	汇川技术	8,626	220,308.04	0.36
39	002475	立讯精密	7,396	216,259.04	0.36
40	002202	金风科技	13,567	209,881.49	0.35
41	002027	分众传媒	14,700	202,272.00	0.33
42	000768	中航飞机	10,900	200,996.00	0.33
43	002736	国信证券	15,053	199,452.25	0.33
44	300024	机器人	10,200	198,900.00	0.33
45	002460	赣锋锂业	4,200	194,250.00	0.32
46	002085	万丰奥威	9,960	193,722.00	0.32
47	000895	双汇发展	8,000	190,000.00	0.31
48	002739	万达电影	3,700	188,589.00	0.31
49	000728	国元证券	15,400	188,188.00	0.31
50	300408	三环集团	8,900	186,811.00	0.31
51	000963	华东医药	3,700	183,890.00	0.30
52	002572	索菲亚	4,400	180,400.00	0.30
53	000157	中联重科	39,100	175,559.00	0.29
54	002508	老板电器	3,971	172,659.08	0.28
55	002007	华兰生物	4,600	167,900.00	0.28
56	002044	美年健康	9,800	166,600.00	0.27
57	000623	吉林敖东	7,260	166,181.40	0.27
58	300003	乐普医疗	7,500	165,825.00	0.27
59	002271	东方雨虹	4,400	163,240.00	0.27
60	002797	第一创业	17,480	160,990.80	0.27
61	000540	中天金融	22,900	159,155.00	0.26
62	300156	神雾环保	4,800	157,248.00	0.26
63	002065	东华软件	7,200	156,888.00	0.26
64	000661	长春高新	1,214	156,739.54	0.26
65	000793	华闻传媒	15,400	155,848.00	0.26
66	000826	启迪桑德	4,400	154,528.00	0.25
67	300017	网宿科技	12,800	154,496.00	0.25
68	000050	深天马 A	7,500	154,275.00	0.25
69	002310	东方园林	9,200	153,824.00	0.25
70	000709	河钢股份	36,600	153,354.00	0.25
71	300266	兴源环境	4,900	150,528.00	0.25
72	000630	铜陵有色	52,500	149,100.00	0.25
73	002558	巨人网络	3,200	147,904.00	0.24
74	000060	中金岭南	13,100	146,720.00	0.24
75	002340	格林美	24,060	145,563.00	0.24
76	300315	掌趣科技	17,800	145,248.00	0.24
77	002146	荣盛发展	14,700	145,089.00	0.24
78	000066	中国长城	15,800	142,358.00	0.23

79	002465	海格通信	13,200	141,768.00	0.23
80	000998	隆平高科	6,406	141,060.12	0.23
81	000876	新希望	17,000	139,740.00	0.23
82	000425	徐工机械	36,900	138,375.00	0.23
83	002405	四维图新	7,000	138,320.00	0.23
84	300115	长盈精密	4,455	129,996.90	0.21
85	000009	中国宝安	16,050	129,844.50	0.21
86	002500	山西证券	13,500	129,330.00	0.21
87	000750	国海证券	23,500	129,250.00	0.21
88	000997	新大陆	5,600	127,064.00	0.21
89	000046	泛海控股	14,512	126,689.76	0.21
90	002081	金螳螂	11,500	126,270.00	0.21
91	002074	国轩高科	3,964	125,064.20	0.21
92	000039	中集集团	6,900	124,407.00	0.20
93	002280	联络互动	11,400	124,032.00	0.20
94	000559	万向钱潮	11,589	123,075.18	0.20
95	000686	东北证券	12,200	122,610.00	0.20
96	000581	威孚高科	4,700	121,730.00	0.20
97	000778	新兴铸管	18,100	121,270.00	0.20
98	300296	利亚德	6,435	120,978.00	0.20
99	000402	金融街	10,300	120,716.00	0.20
100	002092	中泰化学	9,500	120,650.00	0.20
101	000792	盐湖股份	11,400	119,130.00	0.20
102	300433	蓝思科技	4,080	118,687.20	0.20
103	300144	宋城演艺	5,600	116,872.00	0.19
104	002195	二三四五	16,100	115,115.00	0.19
105	000983	西山煤电	13,100	114,887.00	0.19
106	002223	鱼跃医疗	4,842	114,658.56	0.19
107	002050	三花智控	6,965	113,668.80	0.19
108	002385	大北农	17,900	112,591.00	0.19
109	000786	北新建材	7,100	112,464.00	0.19
110	000970	中科三环	7,500	110,850.00	0.18
111	000917	电广传媒	9,800	110,740.00	0.18
112	002294	信立泰	3,086	110,046.76	0.18
113	300027	华谊兄弟	13,500	109,215.00	0.18
114	300383	光环新网	7,800	105,768.00	0.17
115	300033	同花顺	1,700	105,757.00	0.17
116	000008	神州高铁	14,500	105,560.00	0.17
117	002183	怡亚通	12,200	105,286.00	0.17
118	002179	中航光电	3,370	105,110.30	0.17
119	000999	华润三九	3,300	104,775.00	0.17
120	300015	爱尔眼科	4,500	104,670.00	0.17
121	300182	捷成股份	10,900	104,204.00	0.17
122	002311	海大集团	5,700	104,139.00	0.17

123	002038	双鹭药业	3,571	104,094.65	0.17
124	002407	多氟多	4,700	103,353.00	0.17
125	002573	清新环境	5,400	101,628.00	0.17
126	002185	华天科技	13,982	101,229.68	0.17
127	000961	中南建设	15,400	100,408.00	0.17
128	002410	广联达	5,300	99,640.00	0.16
129	000415	渤海金控	14,800	99,604.00	0.16
130	300159	新研股份	7,500	99,300.00	0.16
131	300142	沃森生物	8,000	98,880.00	0.16
132	002366	台海核电	2,096	98,323.36	0.16
133	002422	科伦药业	5,900	97,468.00	0.16
134	000400	许继电气	5,400	96,984.00	0.16
135	300197	铁汉生态	7,300	96,944.00	0.16
136	300113	顺网科技	3,600	96,840.00	0.16
137	000488	晨鸣纸业	7,400	95,460.00	0.16
138	002174	游族网络	3,000	95,280.00	0.16
139	300355	蒙草生态	8,840	94,941.60	0.16
140	000028	国药一致	1,167	94,410.30	0.16
141	002217	合力泰	9,500	93,860.00	0.15
142	300058	蓝色光标	12,000	93,840.00	0.15
143	300418	昆仑万维	4,100	93,767.00	0.15
144	002030	达安基因	4,300	93,697.00	0.15
145	000977	浪潮信息	5,400	93,528.00	0.15
146	000566	海南海药	7,000	92,820.00	0.15
147	000878	云南铜业	7,036	92,804.84	0.15
148	002470	金正大	12,300	92,619.00	0.15
149	300055	万邦达	5,000	92,000.00	0.15
150	000960	锡业股份	6,700	91,187.00	0.15
151	002273	水晶光电	4,400	90,772.00	0.15
152	002176	江特电机	10,400	90,688.00	0.15
153	002583	海能达	5,587	89,894.83	0.15
154	000418	小天鹅 A	1,900	88,901.00	0.15
155	300168	万达信息	6,100	88,755.00	0.15
156	300166	东方国信	6,580	88,369.40	0.15
157	000598	兴蓉环境	15,700	88,234.00	0.15
158	300146	汤臣倍健	6,400	87,936.00	0.14
159	002773	康弘药业	1,667	87,184.10	0.14
160	000690	宝新能源	14,500	86,710.00	0.14
161	002384	东山精密	3,500	86,450.00	0.14
162	000547	航天发展	8,200	85,690.00	0.14
163	300002	神州泰岳	10,200	85,068.00	0.14
164	002400	省广股份	10,550	84,716.50	0.14
165	000513	丽珠集团	1,239	84,375.90	0.14
166	000883	湖北能源	16,800	84,336.00	0.14

167	002051	中工国际	4,060	84,163.80	0.14
168	002004	华邦健康	10,700	83,781.00	0.14
169	002138	顺络电子	4,500	83,610.00	0.14
170	300244	迪安诊断	2,638	82,991.48	0.14
171	002640	跨境通	3,900	82,875.00	0.14
172	300271	华宇软件	4,965	82,369.35	0.14
173	002244	滨江集团	11,900	82,348.00	0.14
174	000825	太钢不锈	18,900	82,215.00	0.14
175	002439	启明星辰	4,400	81,840.00	0.13
176	002001	新和成	4,200	81,522.00	0.13
177	002292	奥飞娱乐	4,800	81,120.00	0.13
178	002019	亿帆医药	4,855	80,981.40	0.13
179	002108	沧州明珠	6,060	80,901.00	0.13
180	000671	阳光城	13,900	80,898.00	0.13
181	000988	华工科技	5,516	80,478.44	0.13
182	002343	慈文传媒	2,119	80,225.34	0.13
183	300287	飞利信	8,700	79,866.00	0.13
184	002152	广电运通	9,600	79,776.00	0.13
185	000930	中粮生化	7,400	79,772.00	0.13
186	002131	利欧股份	24,200	79,618.00	0.13
187	000926	福星股份	6,500	79,300.00	0.13
188	002635	安洁科技	2,188	79,249.36	0.13
189	002714	牧原股份	2,900	78,938.00	0.13
190	002491	通鼎互联	5,800	77,952.00	0.13
191	000697	炼石有色	3,800	77,786.00	0.13
192	000938	紫光股份	1,270	77,622.40	0.13
193	000627	天茂集团	9,600	77,568.00	0.13
194	000738	航发控制	3,949	77,281.93	0.13
195	000078	海王生物	12,800	77,184.00	0.13
196	002373	千方科技	5,600	76,384.00	0.13
197	000059	华锦股份	7,600	76,076.00	0.13
198	002444	巨星科技	4,842	75,438.36	0.12
199	300324	旋极信息	4,110	74,966.40	0.12
200	002221	东华能源	6,869	74,940.79	0.12
201	000089	深圳机场	8,000	74,800.00	0.12
202	000758	中色股份	10,600	74,306.00	0.12
203	002408	齐翔腾达	6,700	74,236.00	0.12
204	002078	太阳纸业	10,100	74,235.00	0.12
205	002624	完美世界	2,164	74,225.20	0.12
206	002555	三七互娱	2,900	74,153.00	0.12
207	300122	智飞生物	3,872	73,993.92	0.12
208	000718	苏宁环球	12,600	73,836.00	0.12
209	000732	泰禾集团	4,400	73,392.00	0.12
210	002250	联化科技	5,100	72,930.00	0.12

211	000516	国际医学	13,066	72,777.62	0.12
212	000729	燕京啤酒	10,800	72,576.00	0.12
213	300450	先导智能	1,400	72,478.00	0.12
214	300253	卫宁健康	9,220	72,008.20	0.12
215	000939	凯迪生态	14,100	71,910.00	0.12
216	300014	亿纬锂能	3,951	71,710.65	0.12
217	002431	棕榈股份	6,500	71,630.00	0.12
218	300203	聚光科技	2,541	71,452.92	0.12
219	000933	神火股份	9,800	71,442.00	0.12
220	000800	一汽轿车	7,000	71,190.00	0.12
221	000806	银河生物	5,255	70,942.50	0.12
222	002048	宁波华翔	3,400	70,924.00	0.12
223	000006	深振业 A	8,000	70,480.00	0.12
224	002601	龙蟠佰利	4,300	70,434.00	0.12
225	002191	劲嘉股份	7,500	70,200.00	0.12
226	002424	贵州百灵	3,700	69,782.00	0.11
227	000592	平潭发展	12,600	69,552.00	0.11
228	002501	利源精制	6,100	69,357.00	0.11
229	002665	首航节能	9,600	69,120.00	0.11
230	002352	顺丰控股	1,300	69,108.00	0.11
231	000012	南玻 A	7,400	69,042.00	0.11
232	002701	奥瑞金	10,800	69,012.00	0.11
233	002354	天神娱乐	3,208	68,972.00	0.11
234	002589	瑞康医药	4,465	68,761.00	0.11
235	000600	建投能源	5,600	68,712.00	0.11
236	002595	豪迈科技	3,071	68,268.33	0.11
237	000031	中粮地产	9,000	67,770.00	0.11
238	002389	南洋科技	3,200	67,392.00	0.11
239	300077	国民技术	4,900	67,081.00	0.11
240	000979	中弘股份	25,600	67,072.00	0.11
241	000712	锦龙股份	4,069	66,609.53	0.11
242	300274	阳光电源	6,000	66,540.00	0.11
243	002353	杰瑞股份	4,200	66,444.00	0.11
244	300090	盛运环保	7,000	66,290.00	0.11
245	000898	鞍钢股份	11,700	66,222.00	0.11
246	000860	顺鑫农业	3,300	66,033.00	0.11
247	300207	欣旺达	5,600	66,024.00	0.11
248	000877	天山股份	5,200	65,884.00	0.11
249	300251	光线传媒	8,000	65,520.00	0.11
250	000027	深圳能源	9,700	65,281.00	0.11
251	002544	杰赛科技	2,853	65,048.40	0.11
252	300133	华策影视	5,800	64,960.00	0.11
253	002002	鸿达兴业	8,200	64,206.00	0.11
254	300098	高新兴	4,976	64,190.40	0.11

255	000563	陕国投 A	12,400	64,108.00	0.11
256	300068	南都电源	3,800	63,992.00	0.11
257	002477	雏鹰农牧	14,400	63,792.00	0.11
258	300083	劲胜精密	6,900	63,756.00	0.11
259	002434	万里扬	4,000	63,680.00	0.10
260	000727	华东科技	22,500	63,675.00	0.10
261	000807	云铝股份	8,800	63,536.00	0.10
262	002517	恺英网络	1,800	63,342.00	0.10
263	300257	开山股份	3,000	63,240.00	0.10
264	000975	银泰资源	5,000	63,150.00	0.10
265	002153	石基信息	2,775	63,075.75	0.10
266	300026	红日药业	13,300	62,643.00	0.10
267	300294	博雅生物	1,515	62,478.60	0.10
268	002249	大洋电机	9,455	62,213.90	0.10
269	002522	浙江众成	3,800	62,130.00	0.10
270	300001	特锐德	3,700	62,012.00	0.10
271	002493	荣盛石化	6,350	61,976.00	0.10
272	002506	协鑫集成	13,500	61,965.00	0.10
273	000158	常山股份	3,900	61,620.00	0.10
274	300079	数码视讯	10,500	61,425.00	0.10
275	300347	泰格医药	2,536	61,371.20	0.10
276	002608	江苏国信	4,900	61,201.00	0.10
277	000156	华数传媒	4,089	60,966.99	0.10
278	000088	盐田港	5,800	60,958.00	0.10
279	002043	兔宝宝	4,400	60,896.00	0.10
280	002411	必康股份	2,104	60,847.68	0.10
281	002022	科华生物	3,500	60,795.00	0.10
282	002266	浙富控股	12,400	60,512.00	0.10
283	000518	四环生物	7,900	60,435.00	0.10
284	300085	银之杰	3,261	60,328.50	0.10
285	300009	安科生物	3,673	60,273.93	0.10
286	002281	光迅科技	2,700	59,994.00	0.10
287	002570	贝因美	4,400	59,840.00	0.10
288	300199	翰宇药业	3,866	59,304.44	0.10
289	000667	美好置业	17,900	59,249.00	0.10
290	300474	景嘉微	1,673	59,224.20	0.10
291	002672	东江环保	3,500	59,115.00	0.10
292	002630	华西能源	5,100	59,109.00	0.10
293	002603	以岭药业	3,371	58,857.66	0.10
294	002261	拓维信息	5,000	58,550.00	0.10
295	000685	中山公用	5,340	58,473.00	0.10
296	002643	万润股份	3,950	58,302.00	0.10
297	300020	银江股份	4,200	58,128.00	0.10
298	002602	世纪华通	1,600	58,016.00	0.10

299	000061	农产品	6,400	57,984.00	0.10
300	002302	西部建设	2,600	57,642.00	0.09
301	000687	华讯方舟	3,800	57,532.00	0.09
302	002155	湖南黄金	6,000	57,420.00	0.09
303	002104	恒宝股份	6,100	57,279.00	0.09
304	000829	天音控股	5,300	57,240.00	0.09
305	002285	世联行	7,126	57,150.52	0.09
306	002709	天赐材料	1,386	57,061.62	0.09
307	000049	德赛电池	1,100	56,991.00	0.09
308	002390	信邦制药	6,543	56,989.53	0.09
309	000937	冀中能源	9,300	56,916.00	0.09
310	002421	达实智能	9,300	56,916.00	0.09
311	300170	汉得信息	5,500	56,705.00	0.09
312	002440	闰土股份	3,700	56,462.00	0.09
313	002368	太极股份	2,039	56,459.91	0.09
314	002383	合众思壮	3,600	56,412.00	0.09
315	000596	古井贡酒	1,100	56,045.00	0.09
316	002468	申通快递	2,200	55,902.00	0.09
317	002018	华信国际	8,100	55,485.00	0.09
318	002396	星网锐捷	2,859	55,321.65	0.09
319	000587	金洲慈航	3,700	55,130.00	0.09
320	002657	中科金财	1,900	55,081.00	0.09
321	002489	浙江永强	8,626	55,033.88	0.09
322	002268	卫士通	3,268	54,967.76	0.09
323	000021	深科技	6,400	54,912.00	0.09
324	002512	达华智能	3,400	54,910.00	0.09
325	000601	韶能股份	7,700	54,901.00	0.09
326	002036	联创电子	3,300	54,450.00	0.09
327	002047	宝鹰股份	6,300	54,432.00	0.09
328	002023	海特高新	5,300	54,431.00	0.09
329	000766	通化金马	3,400	54,332.00	0.09
330	300216	千山药机	2,216	54,181.20	0.09
331	002716	金贵银业	2,800	53,732.00	0.09
332	002299	圣农发展	3,600	53,532.00	0.09
333	002308	威创股份	4,100	53,505.00	0.09
334	300185	通裕重工	20,500	53,505.00	0.09
335	300273	和佳股份	4,400	53,504.00	0.09
336	300053	欧比特	3,976	53,477.20	0.09
337	300073	当升科技	2,142	53,421.48	0.09
338	300118	东方日升	3,771	52,982.55	0.09
339	000848	承德露露	5,300	52,894.00	0.09
340	002277	友阿股份	8,200	52,890.00	0.09
341	300310	宜通世纪	4,000	52,880.00	0.09
342	002130	沃尔核材	8,200	52,726.00	0.09

343	002151	北斗星通	1,885	52,685.75	0.09
344	000543	皖能电力	9,000	52,470.00	0.09
345	002145	中核钛白	8,600	52,288.00	0.09
346	000882	华联股份	14,467	52,225.87	0.09
347	002375	亚厦股份	5,800	51,678.00	0.09
348	002436	兴森科技	8,200	51,660.00	0.09
349	000901	航天科技	1,900	51,604.00	0.08
350	300431	暴风集团	2,160	51,472.80	0.08
351	002010	传化智联	3,372	51,456.72	0.08
352	000777	中核科技	2,567	51,237.32	0.08
353	002668	奥马电器	2,583	50,885.10	0.08
354	300116	坚瑞沃能	4,700	50,525.00	0.08
355	002276	万马股份	5,000	50,450.00	0.08
356	002056	横店东磁	6,700	50,250.00	0.08
357	000973	佛塑科技	6,500	50,180.00	0.08
358	002089	新海宜	7,400	50,098.00	0.08
359	000090	天健集团	4,500	49,950.00	0.08
360	002326	永太科技	3,600	49,896.00	0.08
361	000762	西藏矿业	3,500	49,595.00	0.08
362	000902	新洋丰	5,500	49,500.00	0.08
363	002067	景兴纸业	8,400	49,308.00	0.08
364	002055	得润电子	2,165	49,210.45	0.08
365	300101	振芯科技	3,500	49,000.00	0.08
366	000875	吉电股份	9,700	48,985.00	0.08
367	002123	梦网荣信	4,400	48,884.00	0.08
368	002479	富春环保	4,100	48,790.00	0.08
369	001696	宗申动力	6,441	48,758.37	0.08
370	300352	北信源	8,400	48,468.00	0.08
371	002325	洪涛股份	6,600	48,180.00	0.08
372	000751	锌业股份	9,800	48,118.00	0.08
373	300496	中科创达	1,700	48,110.00	0.08
374	300078	思创医惠	4,483	48,102.59	0.08
375	002437	誉衡药业	6,600	48,048.00	0.08
376	300010	立思辰	3,700	47,915.00	0.08
377	000519	中兵红箭	3,800	47,880.00	0.08
378	000620	新华联	6,700	47,637.00	0.08
379	002237	恒邦股份	4,500	47,205.00	0.08
380	000980	众泰汽车	3,900	47,034.00	0.08
381	002245	澳洋顺昌	5,200	46,904.00	0.08
382	000801	四川九洲	4,900	46,893.00	0.08
383	002106	莱宝高科	4,600	46,598.00	0.08
384	000018	神州长城	6,100	46,177.00	0.08
385	002670	国盛金控	2,900	46,110.00	0.08
386	002703	浙江世宝	1,675	45,878.25	0.08

387	002073	软控股份	5,400	45,792.00	0.08
388	300036	超图软件	2,800	45,780.00	0.08
389	000541	佛山照明	5,000	45,550.00	0.08
390	000426	兴业矿业	5,000	45,100.00	0.07
391	000612	焦作万方	5,600	45,080.00	0.07
392	000680	山推股份	8,200	44,690.00	0.07
393	000615	京汉股份	3,200	44,192.00	0.07
394	000703	恒逸石化	3,100	44,144.00	0.07
395	002099	海翔药业	6,600	43,956.00	0.07
396	000881	中广核技	2,300	43,815.00	0.07
397	002428	云南锗业	4,100	43,788.00	0.07
398	002413	雷科防务	3,900	43,680.00	0.07
399	300376	易事特	4,800	43,536.00	0.07
400	002482	广田集团	4,800	43,152.00	0.07
401	300212	易华录	1,700	42,891.00	0.07
402	002503	搜于特	6,100	42,883.00	0.07
403	002681	奋达科技	3,400	42,806.00	0.07
404	002303	美盈森	5,500	42,460.00	0.07
405	000062	深圳华强	1,600	42,448.00	0.07
406	002041	登海种业	3,200	42,400.00	0.07
407	002224	三力士	3,800	42,180.00	0.07
408	000617	中油资本	2,700	42,120.00	0.07
409	002429	兆驰股份	13,692	42,034.44	0.07
410	000969	安泰科技	4,800	41,904.00	0.07
411	000558	莱茵体育	5,450	41,420.00	0.07
412	002242	九阳股份	2,100	41,307.00	0.07
413	002474	榕基软件	3,800	41,230.00	0.07
414	300043	星辉娱乐	5,000	41,050.00	0.07
415	300377	赢时胜	3,590	40,890.10	0.07
416	002063	远光软件	3,900	40,638.00	0.07
417	000959	首钢股份	5,800	40,542.00	0.07
418	002283	天润曲轴	6,300	40,320.00	0.07
419	002190	成飞集成	1,500	40,200.00	0.07
420	300304	云意电气	4,500	39,915.00	0.07
421	000539	粤电力 A	7,400	39,442.00	0.06
422	002329	皇氏集团	4,100	39,401.00	0.06
423	002481	双塔食品	5,900	39,353.00	0.06
424	000851	高鸿股份	4,300	39,087.00	0.06
425	300037	新宙邦	1,700	39,066.00	0.06
426	300011	鼎汉技术	2,435	38,960.00	0.06
427	002284	亚太股份	3,500	38,850.00	0.06
428	300075	数字政通	1,846	38,655.24	0.06
429	000957	中通客车	3,300	38,610.00	0.06
430	000869	张裕 A	1,030	38,316.00	0.06

431	002371	北方华创	1,600	38,272.00	0.06
432	002563	森马服饰	4,500	38,160.00	0.06
433	300222	科大智能	1,673	37,960.37	0.06
434	002157	正邦科技	8,300	37,765.00	0.06
435	000555	神州信息	2,200	36,740.00	0.06
436	300202	聚龙股份	2,200	36,344.00	0.06
437	002695	煌上煌	1,700	36,312.00	0.06
438	002180	纳思达	1,500	36,240.00	0.06
439	002052	同洲电子	5,700	36,138.00	0.06
440	002120	韵达股份	700	36,120.00	0.06
441	300458	全志科技	1,366	35,980.44	0.06
442	002251	步步高	2,800	34,692.00	0.06
443	300359	全通教育	2,651	34,648.57	0.06
444	002147	新光圆成	2,200	34,188.00	0.06
445	300506	名家汇	1,201	33,904.23	0.06
446	300292	吴通控股	5,000	33,850.00	0.06
447	300369	绿盟科技	3,000	33,180.00	0.05
448	002588	史丹利	4,200	32,298.00	0.05
449	002699	美盛文化	2,340	32,292.00	0.05
450	300379	东方通	1,600	31,360.00	0.05
451	002831	裕同科技	400	30,000.00	0.05
452	000503	海虹控股	1,200	29,916.00	0.05
453	002416	爱施德	2,650	28,593.50	0.05
454	002229	鸿博股份	2,550	28,560.00	0.05
455	000987	越秀金控	2,444	28,423.72	0.05
456	000564	供销大集	4,100	26,691.00	0.04
457	002568	百润股份	1,600	26,592.00	0.04
458	000607	华媒控股	3,500	26,460.00	0.04
459	300317	珈伟股份	1,800	26,280.00	0.04
460	300368	汇金股份	1,800	25,884.00	0.04
461	300386	飞天诚信	1,366	24,301.14	0.04
462	300558	贝达药业	400	23,856.00	0.04
463	002782	可立克	1,000	20,950.00	0.03
464	002110	三钢闽光	1,600	20,512.00	0.03
465	002013	中航机电	1,950	20,143.50	0.03
466	002358	森源电气	1,157	19,692.14	0.03
467	002815	崇达技术	500	16,520.00	0.03
468	002287	奇正藏药	400	16,444.00	0.03
469	002818	富森美	400	15,788.00	0.03
470	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.02
471	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.02
472	300267	尔康制药	1,200	13,752.00	0.02
473	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.02
474	002610	爱康科技	4,000	9,760.00	0.02

475	002619	巨龙管业	1,280	8,153.60	0.01
476	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	10,462,476.89	17.23
2	000651	格力电器	9,843,235.00	16.21
3	000725	京东方 A	6,484,640.73	10.68
4	000858	五粮液	5,629,045.60	9.27
5	000002	万科 A	5,189,672.84	8.55
6	000001	平安银行	5,032,655.00	8.29
7	300498	温氏股份	5,028,659.51	8.28
8	002415	海康威视	4,770,053.96	7.86
9	000776	广发证券	4,146,692.00	6.83
10	002450	康得新	3,201,875.03	5.27
11	002304	洋河股份	2,744,377.70	4.52
12	002024	苏宁云商	2,606,700.00	4.29
13	000063	中兴通讯	2,602,506.60	4.29
14	000166	申万宏源	2,430,168.98	4.00
15	000423	东阿阿胶	2,376,424.00	3.91
16	300072	三聚环保	2,297,885.50	3.78
17	000568	泸州老窖	2,291,719.00	3.77
18	001979	招商蛇口	2,284,329.82	3.76
19	000538	云南白药	2,213,455.87	3.65
20	000783	长江证券	2,147,301.60	3.54
21	002456	欧菲光	2,061,387.35	3.40
22	300059	东方财富	1,984,862.00	3.27
23	002008	大族激光	1,963,010.46	3.23
24	002241	歌尔股份	1,962,377.00	3.23
25	300070	碧水源	1,940,405.00	3.20
26	002142	宁波银行	1,911,851.00	3.15
27	000625	长安汽车	1,887,948.00	3.11
28	000413	东旭光电	1,885,364.90	3.11
29	002594	比亚迪	1,850,627.64	3.05
30	002230	科大讯飞	1,837,160.09	3.03
31	002466	天齐锂业	1,777,618.20	2.93
32	000338	潍柴动力	1,767,989.70	2.91

33	002236	大华股份	1,761,176.38	2.90
34	300024	机器人	1,759,028.00	2.90
35	300136	信维通信	1,747,499.80	2.88
36	002475	立讯精密	1,712,374.13	2.82
37	000069	华侨城 A	1,687,239.00	2.78
38	000768	中航飞机	1,676,865.00	2.76
39	300408	三环集团	1,645,130.00	2.71
40	002673	西部证券	1,637,531.45	2.70
41	000728	国元证券	1,592,814.00	2.62
42	002202	金风科技	1,585,928.50	2.61
43	002460	赣锋锂业	1,578,566.00	2.60
44	000839	中信国安	1,544,794.00	2.54
45	300124	汇川技术	1,489,795.00	2.45
46	002736	国信证券	1,458,905.46	2.40
47	000661	长春高新	1,433,003.10	2.36
48	002739	万达电影	1,413,339.61	2.33
49	000793	华闻传媒	1,390,408.00	2.29
50	000623	吉林敖东	1,386,776.00	2.28
51	000157	中联重科	1,377,379.18	2.27
52	002572	索菲亚	1,361,403.67	2.24
53	000895	双汇发展	1,349,692.00	2.22
54	002007	华兰生物	1,323,352.02	2.18
55	002310	东方园林	1,299,656.00	2.14
56	000709	河钢股份	1,285,128.00	2.12
57	300017	网宿科技	1,278,106.13	2.11
58	000826	启迪桑德	1,261,426.02	2.08
59	300156	神雾环保	1,252,372.00	2.06
60	002065	东华软件	1,251,654.58	2.06
61	002508	老板电器	1,226,098.00	2.02
62	000503	海虹控股	1,218,800.00	2.01
63	000540	中天金融	1,216,396.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	3,143,865.30	5.18
2	002304	洋河股份	1,838,644.09	3.03
3	002202	金风科技	1,034,968.54	1.70
4	002736	国信证券	948,363.60	1.56
5	300516	久之洋	726,672.37	1.20
6	300115	长盈精密	655,820.48	1.08

7	000028	国药一致	598,358.03	0.99
8	300294	博雅生物	503,277.68	0.83
9	000333	美的集团	445,359.15	0.73
10	002773	康弘药业	373,856.20	0.62
11	002038	双鹭药业	362,753.11	0.60
12	000046	泛海控股	361,826.64	0.60
13	002595	豪迈科技	331,787.64	0.55
14	002019	亿帆医药	318,105.36	0.52
15	002699	美盛文化	265,987.22	0.44
16	002285	世联行	265,098.98	0.44
17	000858	五粮液	263,348.00	0.43
18	000776	广发证券	242,428.04	0.40
19	000882	华联股份	240,827.43	0.40
20	000725	京东方 A	239,638.00	0.39

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	366,637,892.10
卖出股票收入（成交）总额	28,727,400.76

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 根据广发证券股份有限公司董事会 2016 年 11 月 28 日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会<行政处罚决定书>的公告》，因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为，被中国证监会予以行政处罚。

2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对平安银行内控管理严重违反审慎经营规则；非真实转让信贷资产；销售对公非保本理财产品出具回购承诺、承诺保本；为同业投资业务提供第三方信用担保；未严格审查贸易背景真实性办理票据承兑、贴现业务，处以人民币 1670 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。除广发证券、平安银行外，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	83,934.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,289.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	54,576.28
8	其他	-
9	合计	142,800.32

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		中国银行股份有限公司 一易方达深证成指交易 型开放式指数证券投资 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
403	141,442.6 3	39,500,041. 00	69.30%	17,501,339. 00	30.70%	39,000,000. 00	68.42%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国银行股份有限公司一易方达深证成指交易型开放式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	何凤珍	1,361,700.00	2.39%
2	安建军	1,000,068.00	1.75%
3	胡锡祥	1,000,048.00	1.75%
4	安泽栋	840,057.00	1.47%
5	包承宽	599,011.00	1.05%
6	谢明	500,034.00	0.88%
7	田竑	500,024.00	0.88%
8	孙璞	500,009.00	0.88%
9	杨兆利	500,009.00	0.88%
10	谢菲菲	500,009.00	0.88%
11	中国银行股份有限公司一易方达深证成	39,000,000.00	68.42%

指交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
---------------------	--	--

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年4月27日）基金份额总额	381,001,380.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	87,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	411,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	57,001,380.00

注：本基金合同生效日为2017年04月27日。

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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	303,603,171.78	76.80%	282,746.34	79.40%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	800,205.00	0.20%	640.28	0.18%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	90,920,605.23	23.00%	72,736.96	20.42%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司各一个交易单元，新增海通证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司各两个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务

和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
中泰证券	-	-	1,500,000,000.00	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	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-28
2	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-05
3	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-05
4	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-10
5	易方达基金管理有限公司关于增加易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-10
6	易方达基金管理有限公司关于增加国信证券为易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-11
7	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-05-11

		理人网站	
8	易方达基金管理有限公司关于增加申万宏源西部证券为易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-19
9	易方达基金管理有限公司关于增加国联证券为易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	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
10	易方达基金管理有限公司关于增加招商证券为易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-07
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 基金增加湘财证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-08
12	易方达基金管理有限公司关于增加易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-22
13	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
14	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
中国银行股份有限公司一易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2017年05月25日~2017年06月30日	-	81,000,000.00	42,000,000.00	39,000,000.00	68.42%
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</p>							

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。

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.中国证监会准予易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达深证成指交易型开放式指数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。

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