

# 易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

## 金

### 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 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：二〇一八年三月三十日

## § 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 2018 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 4 月 27 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	18,001,380.00 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 负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,804,739.39
本期利润	5,707,016.48
加权平均基金份额本期利润	0.0993
本期基金份额净值增长率	12.70%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1270
期末基金资产净值	20,288,062.54
期末基金份额净值	1.1270

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. 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
过去三个月	-0.28%	0.99%	-0.42%	0.99%	0.14%	0.00%
过去六个月	5.81%	0.89%	4.85%	0.90%	0.96%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.70%	0.85%	8.19%	0.89%	4.51%	-0.04%

#### 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12月31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。

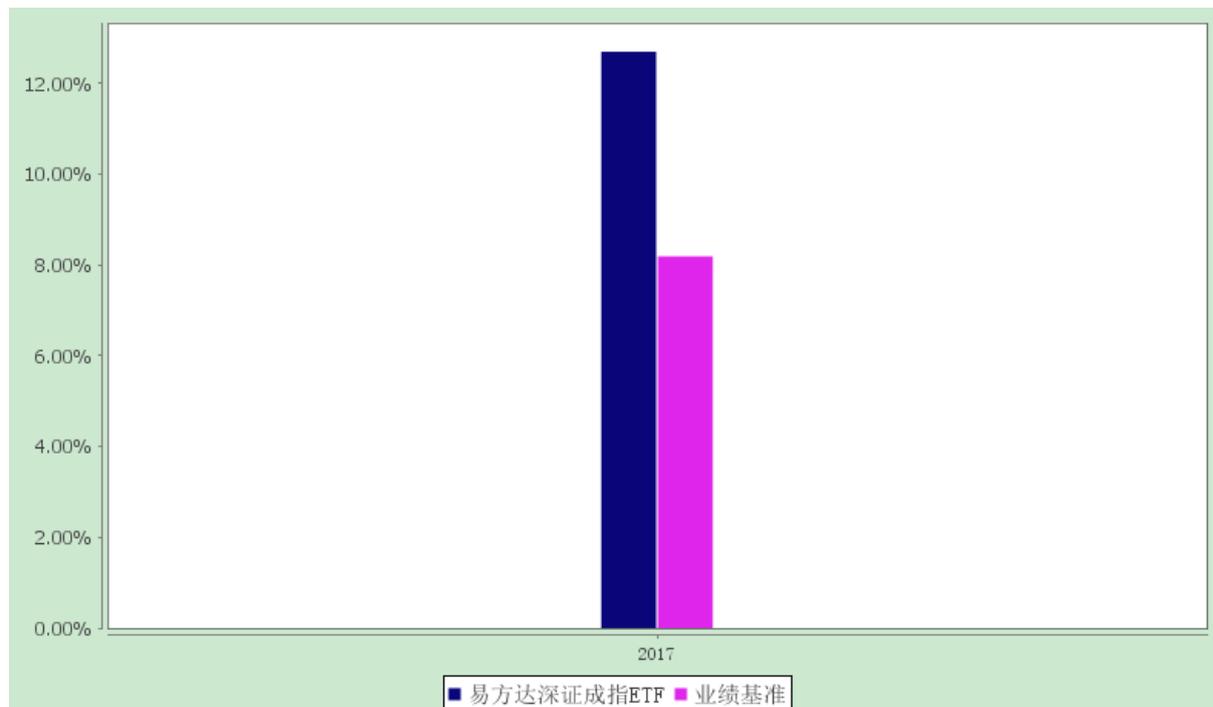
2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 12.70%，同期业绩比较基准收益率为 8.19%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2017 年 4 月 27 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部

业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至 2017 年 12 月 31 日，易方达旗下管理的各类资产规模总计 12338 亿元，其中公募基金规模 6077 亿元；服务各类客户总数 6703 万户，公募基金累计分红 931 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、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	2017-07-18	-	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。

<p>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、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理助理（自 2016 年 9 月 1 日至 2017 年 7 月 17 日）、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理（自 2017 年 5 月 11 日至 2017 年 7 月 17 日）、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（自 2017 年 5 月 11 日至 2017 年 7 月 17 日）</p>				
--	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对

我司旗下所有投资组合 2017 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本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 36 次，其中 33 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间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。

#### 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，国内宏观经济平稳发展，国内经济在供给侧改革等系列政策带动下，展现出了较强的韧性与活力。宏观数据显示，全年 GDP 同比增长 6.9%，超过政府工作报告中 6.5% 的增长目标，规模以上工业增加值比上年增长 6.6%，固定资产投资累计同比增长 7.20%，社会消费品零售总额同比 10.2%。另外，2017 年规模以上工业企业利润总额 75187 亿元，同比增速 21%，较 2016 年上升 12.5 个百分点，为 2012 年以来最快增速。受益于宏观经济平稳发展以及企业经营情况改善，证券市场上大盘蓝筹股普遍上涨，其中上证 50 指数全年上涨 25.1%，本基金所跟踪的深证成指全年上涨 8.5%。

深证成指 500 个成份股平均市值约 290 亿，成份股覆盖市值超千亿的大盘蓝筹如万科 A、美的集团等，也包含近百个低于百亿市值的小盘成长股，风格较均衡兼具了价值股与成长股的特性。深证成指行业分布与实体经济较为贴合，金融行业合计 13%，占比较低；前三大行业电子、家用电器、医药生物权重合计 59%，2017 年分别上涨 13%、43%、4%，另外行业占比 10% 的食品饮料也上涨 54%；而计算机、传媒行业则分布下跌 11%、23%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事

项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差由于本报告期包含建仓期原因略高于合同规定的目标控制范围。

#### 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 1.1270 元，本报告期份额净值增长率为 12.70%，同期业绩比较基准收益率为 8.19%。日跟踪偏离度的均值为 0.06%，年化跟踪误差 2.97%，建仓期原因略高于合同规定的目标控制范围。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，供给侧改革从“量”转向“质”，继续深入推进。金融强监管仍将继续，在金融服务实体以及范化解重大风险、精准脱贫、污染防治三大攻坚战等相关主题政策带动下，实体经济仍有望得更进一步的发展，经济结构有望进一步优化，宏观经济将继续保持平稳发展。

2018 年的证券市场上，业绩驱动因素仍起着关键的作用。与此同时，估值相对合理且有业绩支撑的行业板块应受到重点关注。深证成指约 27 倍 PE 的估值水平处于历史均值附近，处于合理区间，并且先进制造主题、消费升级等政策导向对其权重行业有利，2018 年将有积极的配置意义。

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、中国证券投资基金业协会相关指引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，公司首席运营官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，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在易方达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 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注, 并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	875,347.37
结算备付金	820.50
存出保证金	4,871.08
交易性金融资产	19,720,423.15
其中：股票投资	19,715,823.15
基金投资	-
债券投资	4,600.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
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	151.38
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>20,601,613.48</b>
	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>	

短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	210,236.14
应付赎回款	-
应付管理人报酬	8,536.66
应付托管费	1,707.33
应付销售服务费	-
应付交易费用	3,070.81
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	90,000.00
<b>负债合计</b>	<b>313,550.94</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	18,001,380.00
未分配利润	2,286,682.54
<b>所有者权益合计</b>	<b>20,288,062.54</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>20,601,613.48</b>

注：1.本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 12 月 31 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 12 月 31 日，基金份额净值 1.1270 元，基金份额总额 18,001,380.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>6,642,863.36</b>
1.利息收入	298,703.22
其中：存款利息收入	94,690.07
债券利息收入	1.78
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）	4,431,995.06
其中：股票投资收益	3,615,895.62
基金投资收益	-
债券投资收益	844.49
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	815,254.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,902,277.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	9,887.99
<b>减：二、费用</b>	<b>935,846.88</b>
1. 管理人报酬	204,601.30
2. 托管费	40,920.26
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	435,600.45
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-

6. 其他费用	254,724.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>5,707,016.48</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>5,707,016.48</b>

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 12 月 31 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。

### 7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 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）	-	5,707,016.48	5,707,016.48
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）	-363,000,000.00	-3,420,333.94	-366,420,333.94
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	-450,000,000.00	-3,417,667.64	-453,417,667.64
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)	18,001,380.00	2,286,682.54	20,288,062.54

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 12 月 31 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 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

### 7.4.2 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 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。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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。

##### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人

可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2017）6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称“估值业务指引”），自2017年12月15日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 7.4.6 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）增值税、企业所得税

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、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人
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、申赎代办券商
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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。

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 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。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	204,601.30
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。

#### 7.4.8.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	40,920.26

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。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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。

##### 7.4.8.4.2 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 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
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	13,645,790.00	75.80%

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。

#### 7.4.8.5 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12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	875,347.37	76,243.26

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。

#### 7.4.8.6 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12月31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

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.8.7.1 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。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	配股 流通受限	11.06	53.21	270	2,986.20	14,366.70	-

##### 7.4.9.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123003	蓝思转债	2017-12-08	2018-01-17	新发流通受限	100.00	100.00	23	2,300.00	2,300.00	-
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	新发流通受限	100.00	100.00	23	2,300.00	2,300.00	-

## 7.4.9.2 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
000006	深振业 A	2017-09-11	重大事项停牌	9.85	2018-03-08	8.87	2,900	23,924.50	28,565.00	-
000031	中粮地产	2017-07-24	重大事项停牌	8.00	-	-	2,800	20,248.97	22,400.00	-
000034	神州数码	2017-09-29	重大事项停牌	21.60	-	-	800	14,421.62	17,280.00	-
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项停牌	11.40	-	-	1,389	20,561.13	15,834.60	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	7.35	-	-	8,100	51,938.44	59,535.00	-
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项停牌	10.83	-	-	3,000	31,018.78	32,490.00	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项停牌	4.78	-	-	1,400	9,141.37	6,692.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项停牌	12.89	-	-	2,600	34,776.73	33,514.00	-
000592	平潭发展	2017-08-09	重大事项停牌	5.75	2018-01-29	5.70	3,800	19,855.69	21,850.00	-
000615	京汉股份	2017-12-26	重大事项停牌	9.76	2018-01-10	10.74	1,200	16,733.91	11,712.00	-
000766	通化金马	2017-11-24	重大事项停牌	13.60	-	-	1,200	18,397.11	16,320.00	-
000806	银河生物	2017-07-18	重大事项停牌	10.76	2018-01-18	10.01	1,355	15,877.55	14,579.80	-
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项停牌	10.89	2018-01-10	11.98	2,400	28,847.50	26,136.00	-
000930	中粮生化	2017-10-24	重大事项停牌	13.34	-	-	2,500	26,405.66	33,350.00	-

000939	凯迪生态	2017-11-16	重大事项停牌	4.99	-	-	4,900	24,996.27	24,451.00	-
000979	中弘股份	2017-09-07	重大事项停牌	1.94	2018-02-14	1.75	12,820	24,071.39	24,870.80	-
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项停牌	6.73	2018-03-14	7.30	3,700	29,381.62	24,901.00	-
002130	沃尔核材	2017-12-25	重大事项停牌	5.76	2018-01-10	6.15	2,800	18,028.45	16,128.00	-
002358	森源电气	2017-12-07	重大事项停牌	14.86	2018-03-07	15.05	1,257	20,425.72	18,679.02	-
002366	台海核电	2017-12-06	重大事项停牌	26.45	-	-	1,692	37,973.89	44,753.40	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项停牌	9.15	2018-02-09	8.24	4,200	29,946.03	38,430.00	-
002512	达华智能	2017-12-06	重大事项停牌	18.07	2018-03-06	16.26	1,300	19,716.42	23,491.00	-
002625	光启技术	2017-12-20	重大事项停牌	28.07	2018-01-04	30.88	400	14,040.00	11,228.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	1,100	59,588.35	57,244.00	-
300010	立思辰	2017-11-17	重大事项停牌	11.17	2018-02-22	10.05	1,400	18,387.91	15,638.00	-
300090	盛运环保	2017-12-01	重大事项停牌	9.24	-	-	2,700	24,598.79	24,948.00	-
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大事项停牌	7.62	-	-	1,700	16,721.30	12,954.00	-
300134	大富科技	2017-12-18	重大事项停牌	16.45	2018-03-19	14.81	1,200	21,036.00	19,740.00	-
300156	神雾环保	2017-07-17	重大事项停牌	24.16	2018-01-17	21.74	1,500	47,160.00	36,240.00	-
300159	新研股份	2017-11-23	重大事项停牌	10.40	2018-03-22	9.36	2,600	38,704.74	27,040.00	-
300216	千山药机	2017-12-25	重大事项停牌	15.95	2018-01-18	14.36	716	17,134.31	11,420.20	-
300292	吴通控股	2017-12-04	重大事项停牌	5.67	2018-03-05	5.72	1,900	12,211.63	10,773.00	-
300364	中文在线	2017-12-28	重大事项停牌	9.23	2018-01-05	10.00	1,100	16,389.36	10,153.00	-
300383	光环新网	2017-11-07	重大事项停牌	13.19	2018-03-19	14.51	2,700	34,206.78	35,613.00	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10 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 12 月 31 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 18,891,469.33 元，属于第二层次的余额为 828,953.82 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 12 月 31 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	19,715,823.15	95.70
	其中：股票	19,715,823.15	95.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,600.00	0.02
	其中：债券	4,600.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	876,167.87	4.25
8	其他各项资产	5,022.46	0.02
9	合计	20,601,613.48	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而8.2的合计项不含可退替代款估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	453,081.62	2.23
B	采矿业	202,338.00	1.00
C	制造业	12,386,567.01	61.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	273,600.00	1.35
E	建筑业	439,139.05	2.16
F	批发和零售业	497,005.23	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	146,630.80	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,827,072.66	9.01
J	金融业	1,226,884.57	6.05
K	房地产业	1,039,000.78	5.12
L	租赁和商务服务业	328,972.70	1.62
M	科学研究和技术服务业	16,340.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	329,772.60	1.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	172,161.04	0.85
R	文化、体育和娱乐业	328,120.59	1.62
S	综合	49,136.50	0.24
	合计	19,715,823.15	97.18

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000333	美的集团	12,500	692,875.00	3.42
2	000651	格力电器	13,300	581,210.00	2.86

3	000858	五粮液	5,100	407,388.00	2.01
4	000725	京东方 A	69,700	403,563.00	1.99
5	002415	海康威视	9,211	359,229.00	1.77
6	000002	万科 A	11,211	348,213.66	1.72
7	000001	平安银行	23,300	309,890.00	1.53
8	300498	温氏股份	10,337	247,054.30	1.22
9	000063	中兴通讯	6,600	239,976.00	1.18
10	002304	洋河股份	1,555	178,825.00	0.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn) 网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	10,697,067.89	52.73
2	000651	格力电器	10,084,048.00	49.70
3	000725	京东方 A	6,615,941.73	32.61
4	000858	五粮液	5,741,208.60	28.30
5	000002	万科 A	5,308,826.84	26.17
6	300498	温氏股份	5,139,813.51	25.33
7	000001	平安银行	5,137,668.00	25.32
8	002415	海康威视	4,892,664.96	24.12
9	000776	广发证券	4,146,692.00	20.44
10	002450	康得新	3,273,852.03	16.14
11	002304	洋河股份	2,822,251.70	13.91
12	000063	中兴通讯	2,678,483.60	13.20
13	002024	苏宁云商	2,662,343.00	13.12
14	000166	申万宏源	2,477,895.98	12.21
15	000423	东阿阿胶	2,450,750.00	12.08
16	000568	泸州老窖	2,354,445.00	11.61
17	001979	招商蛇口	2,336,763.82	11.52
18	300072	三聚环保	2,323,140.50	11.45
19	000538	云南白药	2,259,299.87	11.14
20	000783	长江证券	2,202,052.60	10.85
21	002456	欧菲科技	2,118,070.35	10.44
22	300059	东方财富	2,033,897.00	10.03
23	002241	歌尔股份	2,026,604.00	9.99
24	002008	大族激光	1,996,342.46	9.84

25	300070	碧水源	1,984,359.00	9.78
26	002142	宁波银行	1,962,644.00	9.67
27	000413	东旭光电	1,952,012.90	9.62
28	002594	比亚迪	1,941,171.64	9.57
29	000625	长安汽车	1,930,324.00	9.51
30	002230	科大讯飞	1,892,141.09	9.33
31	002466	天齐锂业	1,818,232.40	8.96
32	000338	潍柴动力	1,808,029.70	8.91
33	002236	大华股份	1,807,824.38	8.91
34	300136	信维通信	1,790,819.80	8.83
35	300024	机器人	1,787,693.00	8.81
36	002475	立讯精密	1,773,264.13	8.74
37	000069	华侨城 A	1,725,462.00	8.50
38	000768	中航飞机	1,714,557.00	8.45
39	002673	西部证券	1,677,973.45	8.27
40	300408	三环集团	1,668,734.00	8.23
41	002460	赣锋锂业	1,650,041.00	8.13
42	000728	国元证券	1,620,811.00	7.99
43	002202	金风科技	1,614,555.50	7.96
44	000839	中信国安	1,583,072.00	7.80
45	000661	长春高新	1,519,845.10	7.49
46	300124	汇川技术	1,516,639.00	7.48
47	002736	国信证券	1,486,978.46	7.33
48	002739	万达电影	1,413,339.61	6.97
49	000793	华闻传媒	1,412,487.00	6.96
50	002572	索菲亚	1,408,188.67	6.94
51	000157	中联重科	1,404,209.18	6.92
52	000623	吉林敖东	1,402,385.00	6.91
53	000895	双汇发展	1,381,796.00	6.81
54	002007	华兰生物	1,350,540.02	6.66
55	002310	东方园林	1,344,542.00	6.63
56	000709	河钢股份	1,309,444.00	6.45
57	300017	网宿科技	1,304,169.13	6.43
58	000826	启迪桑德	1,296,854.02	6.39
59	300156	神雾环保	1,271,782.00	6.27
60	002065	东华软件	1,270,720.58	6.26
61	000503	海虹控股	1,248,981.00	6.16
62	002508	老板电器	1,242,823.00	6.13
63	000540	中天金融	1,240,132.00	6.11
64	300003	乐普医疗	1,237,765.00	6.10
65	000963	华东医药	1,231,126.98	6.07
66	000066	中国长城	1,193,504.00	5.88
67	000630	铜陵有色	1,184,065.00	5.84
68	000876	新希望	1,166,853.54	5.75

69	002044	美年健康	1,140,331.96	5.62
70	002271	东方雨虹	1,135,420.00	5.60
71	002465	海格通信	1,125,653.04	5.55
72	000750	国海证券	1,104,240.00	5.44
73	000998	隆平高科	1,091,830.62	5.38
74	002085	万丰奥威	1,075,514.62	5.30
75	000778	新兴铸管	1,066,202.00	5.26
76	000425	徐工机械	1,050,675.37	5.18
77	000997	新大陆	1,040,454.00	5.13
78	002340	格林美	1,038,112.00	5.12
79	000009	中国宝安	1,034,548.49	5.10
80	000060	中金岭南	1,033,762.00	5.10
81	000686	东北证券	1,032,968.40	5.09
82	300296	利亚德	1,027,813.74	5.07
83	002027	分众传媒	1,018,776.00	5.02
84	300115	长盈精密	1,014,231.44	5.00
85	300027	华谊兄弟	975,046.13	4.81
86	002405	四维图新	973,884.00	4.80
87	000402	金融街	961,097.00	4.74
88	000917	电广传媒	939,033.00	4.63
89	002179	中航光电	935,157.00	4.61
90	002092	中泰化学	916,208.33	4.52
91	002081	金螳螂	911,605.00	4.49
92	000559	万向钱潮	903,157.90	4.45
93	000970	中科三环	898,792.00	4.43
94	000028	国药一致	896,170.98	4.42
95	002385	大北农	889,671.00	4.39
96	002500	山西证券	886,995.00	4.37
97	000581	威孚高科	883,573.00	4.36
98	002354	天神娱乐	880,316.55	4.34
99	300516	久之洋	880,181.00	4.34
100	000786	北新建材	876,427.24	4.32
101	002223	鱼跃医疗	867,190.80	4.27
102	002311	海大集团	864,005.32	4.26
103	002146	荣盛发展	860,700.00	4.24
104	000415	渤海金控	853,340.00	4.21
105	002183	怡亚通	852,859.00	4.20
106	002407	多氟多	845,724.00	4.17
107	002422	科伦药业	838,787.00	4.13
108	300015	爱尔眼科	838,138.86	4.13
109	002273	水晶光电	827,475.00	4.08
110	000513	丽珠集团	818,056.00	4.03
111	300144	宋城演艺	817,475.00	4.03
112	002573	清新环境	797,283.00	3.93

113	300159	新研股份	796,950.00	3.93
114	300458	全志科技	796,009.02	3.92
115	000983	西山煤电	792,581.00	3.91
116	000039	中集集团	792,290.00	3.91
117	300244	迪安诊断	790,782.00	3.90
118	002074	国轩高科	784,727.51	3.87
119	300033	同花顺	779,822.40	3.84
120	002185	华天科技	771,098.10	3.80
121	002294	信立泰	770,425.00	3.80
122	300324	旋极信息	770,042.00	3.80
123	000050	深天马 A	765,679.00	3.77
124	000049	德赛电池	765,514.10	3.77
125	300203	聚光科技	764,382.00	3.77
126	002030	达安基因	750,374.09	3.70
127	002583	海能达	747,721.10	3.69
128	002004	华邦健康	743,119.00	3.66
129	000547	航天发展	730,294.00	3.60
130	000988	华工科技	727,019.18	3.58
131	000878	云南铜业	726,972.00	3.58
132	000488	晨鸣纸业	726,277.00	3.58
133	300113	顺网科技	724,777.00	3.57
134	000598	兴蓉环境	724,707.00	3.57
135	002138	顺络电子	724,563.79	3.57
136	002470	金正大	724,203.00	3.57
137	000999	华润三九	723,768.00	3.57
138	002668	奥马电器	722,297.00	3.56
139	300142	沃森生物	715,848.00	3.53
140	000516	国际医学	715,685.00	3.53
141	000930	中粮生化	711,413.00	3.51
142	000566	海南海药	708,017.00	3.49
143	000939	凯迪生态	706,644.00	3.48
144	002217	合力泰	705,432.69	3.48
145	002050	三花智控	704,930.14	3.47
146	002001	新 和 成	704,758.55	3.47
147	300058	蓝色光标	701,285.00	3.46
148	000938	紫光股份	699,560.00	3.45
149	300197	铁汉生态	695,439.00	3.43
150	002051	中工国际	695,252.00	3.43
151	300055	万邦达	683,168.00	3.37
152	300347	泰格医药	681,856.00	3.36
153	000883	湖北能源	681,375.00	3.36
154	002366	台海核电	680,448.00	3.35
155	300294	博雅生物	679,966.00	3.35
156	002491	通鼎互联	679,618.70	3.35

157	002131	利欧股份	679,225.00	3.35
158	000977	浪潮信息	678,978.40	3.35
159	002439	启明星辰	678,195.76	3.34
160	000758	中色股份	677,224.00	3.34
161	000059	华锦股份	677,098.40	3.34
162	000400	许继电气	676,237.00	3.33
163	002714	牧原股份	675,732.14	3.33
164	300383	光环新网	670,551.19	3.31
165	002195	二三四五	654,082.60	3.22
166	002292	奥飞娱乐	652,206.17	3.21
167	300271	华宇软件	651,337.08	3.21
168	000825	太钢不锈	648,483.00	3.20
169	002108	沧州明珠	647,993.00	3.19
170	000792	盐湖股份	644,501.00	3.18
171	300418	昆仑万维	642,103.00	3.16
172	300253	卫宁健康	641,593.80	3.16
173	300002	神州泰岳	638,238.00	3.15
174	002353	杰瑞股份	636,794.00	3.14
175	000671	阳光城	635,435.00	3.13
176	002544	杰赛科技	629,543.00	3.10
177	002635	安洁科技	627,859.00	3.09
178	000046	泛海控股	625,153.84	3.08
179	002176	江特电机	622,157.00	3.07
180	000732	泰禾集团	621,841.26	3.07
181	000012	南玻A	621,369.00	3.06
182	002701	奥瑞金	621,057.00	3.06
183	002152	广电运通	618,445.00	3.05
184	002384	东山精密	618,392.00	3.05
185	000712	锦龙股份	612,823.00	3.02
186	002013	中航机电	611,519.00	3.01
187	002410	广联达	610,880.20	3.01
188	002191	劲嘉股份	609,671.74	3.01
189	300037	新宙邦	609,468.00	3.00
190	000008	神州高铁	606,653.00	2.99
191	000807	云铝股份	603,683.01	2.98
192	000729	燕京啤酒	602,301.00	2.97
193	300355	蒙草生态	601,110.00	2.96
194	000078	海王生物	599,777.50	2.96
195	002043	兔宝宝	597,875.00	2.95
196	000156	华数传媒	597,816.65	2.95
197	002555	三七互娱	596,901.27	2.94
198	000031	中粮地产	596,867.00	2.94
199	002373	千方科技	596,819.98	2.94
200	002221	东华能源	596,321.24	2.94

201	300020	银江股份	595,524.00	2.94
202	002444	巨星科技	593,557.82	2.93
203	000960	锡业股份	591,990.00	2.92
204	300122	智飞生物	583,995.52	2.88
205	002501	利源精制	579,020.00	2.85
206	002665	首航节能	575,046.62	2.83
207	000690	宝新能源	574,050.00	2.83
208	002153	石基信息	571,724.30	2.82
209	000738	航发控制	569,488.62	2.81
210	000800	一汽轿车	569,123.00	2.81
211	002048	宁波华翔	566,995.00	2.79
212	002477	雏鹰农牧	566,364.00	2.79
213	300026	红日药业	565,809.00	2.79
214	300079	数码科技	562,254.66	2.77
215	000089	深圳机场	562,109.00	2.77
216	000777	中核科技	560,151.00	2.76
217	002431	棕榈股份	560,091.00	2.76
218	002250	联化科技	557,311.00	2.75
219	300433	蓝思科技	557,254.24	2.75
220	002281	光迅科技	556,683.00	2.74
221	300146	汤臣倍健	552,231.81	2.72
222	300251	光线传媒	550,325.00	2.71
223	002038	双鹭药业	549,524.00	2.71
224	300133	华策影视	548,351.17	2.70
225	002266	浙富控股	546,338.00	2.69
226	000627	天茂集团	542,520.00	2.67
227	300182	捷成股份	539,815.58	2.66
228	002589	瑞康医药	539,104.10	2.66
229	002773	康弘药业	532,988.52	2.63
230	300014	亿纬锂能	527,650.00	2.60
231	300166	东方国信	527,391.00	2.60
232	002643	万润股份	527,350.00	2.60
233	000860	顺鑫农业	527,278.14	2.60
234	000592	平潭发展	526,415.00	2.59
235	002343	慈文传媒	524,953.00	2.59
236	300085	银之杰	522,594.00	2.58
237	000727	华东科技	522,223.00	2.57
238	002570	贝因美	518,712.88	2.56
239	000006	深振业 A	517,849.00	2.55
240	300077	国民技术	517,484.74	2.55
241	000027	深圳能源	516,299.00	2.54
242	300274	阳光电源	515,868.00	2.54
243	000975	银泰资源	514,974.00	2.54
244	002019	亿帆医药	514,810.00	2.54

245	000697	炼石有色	513,573.00	2.53
246	002078	太阳纸业	512,720.56	2.53
247	002595	豪迈科技	511,265.63	2.52
248	000519	中兵红箭	510,353.00	2.52
249	300257	开山股份	510,115.00	2.51
250	300009	安科生物	509,959.00	2.51
251	000718	苏宁环球	505,467.00	2.49
252	300267	尔康制药	505,120.00	2.49
253	300287	飞利信	504,610.85	2.49
254	002709	天赐材料	504,566.00	2.49
255	002375	亚厦股份	502,077.00	2.47
256	300053	欧比特	501,303.00	2.47
257	300226	上海钢联	498,084.00	2.46
258	002751	易尚展示	497,646.00	2.45
259	002155	湖南黄金	496,380.00	2.45
260	002002	鸿达兴业	495,782.00	2.44
261	002396	星网锐捷	494,089.00	2.44
262	000961	中南建设	492,295.00	2.43
263	000600	建投能源	491,125.00	2.42
264	002123	梦网集团	488,623.08	2.41
265	300273	和佳股份	487,932.00	2.41
266	002640	跨境通	486,377.37	2.40
267	002421	达实智能	485,492.00	2.39
268	300068	南都电源	484,476.57	2.39
269	002089	新海宜	483,778.00	2.38
270	300185	通裕重工	481,316.00	2.37
271	000926	福星股份	480,677.00	2.37
272	000518	四环生物	478,498.00	2.36
273	300090	盛运环保	477,531.00	2.35
274	002522	浙江众成	477,312.96	2.35
275	002022	科华生物	476,769.00	2.35
276	000601	韶能股份	475,980.00	2.35
277	000869	张裕 A	474,393.00	2.34
278	002244	滨江集团	474,245.88	2.34
279	002018	华信国际	472,291.01	2.33
280	300011	鼎汉技术	470,823.00	2.32
281	300474	景嘉微	470,712.00	2.32
282	002358	森源电气	469,737.21	2.32
283	000898	鞍钢股份	468,829.00	2.31
284	000937	冀中能源	468,648.15	2.31
285	000667	美好置业	468,636.00	2.31
286	002095	生意宝	466,668.00	2.30
287	002672	东江环保	466,331.50	2.30
288	300207	欣旺达	465,989.00	2.30

289	002104	恒宝股份	464,878.00	2.29
290	000061	农产品	464,609.00	2.29
291	002023	海特高新	463,103.00	2.28
292	002036	联创电子	463,009.00	2.28
293	002276	万马股份	462,847.00	2.28
294	002624	完美世界	459,356.00	2.26
295	000088	盐田港	459,144.37	2.26
296	002268	卫士通	458,425.02	2.26
297	002489	浙江永强	458,236.50	2.26
298	300036	超图软件	455,762.00	2.25
299	002630	华西能源	453,363.00	2.23
300	000543	皖能电力	453,336.07	2.23
301	002429	兆驰股份	451,124.00	2.22
302	000959	首钢股份	450,309.00	2.22
303	002424	贵州百灵	445,957.00	2.20
304	300098	高新兴	442,085.00	2.18
305	002657	中科金财	440,819.00	2.17
306	300170	汉得信息	439,937.00	2.17
307	002174	游族网络	439,598.00	2.17
308	002517	恺英网络	438,154.89	2.16
309	300001	特锐德	436,138.00	2.15
310	002797	第一创业	435,438.00	2.15
311	002716	金贵银业	431,821.00	2.13
312	000685	中山公用	431,421.40	2.13
313	002261	拓维信息	431,204.00	2.13
314	002699	美盛文化	424,854.00	2.09
315	002303	美盈森	422,559.00	2.08
316	300377	赢时胜	422,439.00	2.08
317	002047	宝鹰股份	421,449.00	2.08
318	000687	华讯方舟	419,542.00	2.07
319	002285	世联行	419,504.20	2.07
320	000021	深科技	417,783.00	2.06
321	002411	必康股份	415,815.00	2.05
322	002428	云南锗业	413,338.00	2.04
323	300199	翰宇药业	411,975.00	2.03
324	002440	闰土股份	409,929.00	2.02
325	002329	皇氏集团	408,394.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	3,165,383.30	15.60
2	002304	洋河股份	1,850,404.09	9.12
3	002202	金风科技	1,040,617.54	5.13
4	002736	国信证券	952,667.60	4.70
5	300516	久之洋	726,672.37	3.58
6	300115	长盈精密	655,820.48	3.23
7	000028	国药一致	604,303.03	2.98
8	300294	博雅生物	503,277.68	2.48
9	000333	美的集团	473,664.15	2.33
10	002773	康弘药业	373,856.20	1.84
11	002038	双鹭药业	369,125.11	1.82
12	000046	泛海控股	366,284.64	1.81
13	002595	豪迈科技	331,787.64	1.64
14	002019	亿帆医药	318,105.36	1.57
15	000858	五粮液	301,046.00	1.48
16	002699	美盛文化	284,512.22	1.40
17	000776	广发证券	277,839.04	1.37
18	002285	世联行	268,812.98	1.32
19	000651	格力电器	267,851.00	1.32
20	000725	京东方 A	267,622.00	1.32

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。

#### 8.4.3 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	378,186,870.93
卖出股票收入（成交）总额	31,416,121.88

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,600.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,600.00	0.02

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123003	蓝思转债	23	2,300.00	0.01
1	128028	赣锋转债	23	2,300.00	0.01

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 根据中兴通讯股份有限公司董事会 2017 年 3 月 7 日《关于重大事项进展公告》，公司违反了美国进出口法律管制，并在调查过程中因提供信息及其他行为违反了相关美国法律法规，被美国相关机构处以罚款。

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。除平安银行、中兴通讯外，本基金投资的其他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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	4,871.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	151.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,022.46

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	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

	金份额					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
200	90,006.9 0	13,845,79 9.00	76.92%	4,155,581. 00	23.08%	13,645,79 0.00	75.80%

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。

## 9.2 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	田竑	500,024.00	2.78%
2	广东联合金地不动产评估勘测设计有限公司	200,009.00	1.11%
3	钱中明	198,048.00	1.10%
4	杨凤玲	197,912.00	1.10%
5	包承宽	179,711.00	1.00%
6	赵勇	150,013.00	0.83%
7	安建军	114,968.00	0.64%
8	王世君	111,919.00	0.62%
9	杨璐	110,005.00	0.61%
10	汪南英	100,019.00	0.56%
11	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	13,645,790.00	75.80%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

## 9.3 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%

## 9.4 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

## § 10 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	450,000,000.00
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	18,001,380.00

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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）。

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

#### 11.4 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。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 20,000.00 元。

#### 11.6 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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	
中信建投	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	303,603,171.78	74.15%	282,746.34	76.86%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	3,323,363.23	0.81%	3,095.02	0.84%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	101,721,280.72	24.84%	81,377.60	22.12%	-
光大证券	1	800,205.00	0.20%	640.28	0.17%	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

#### 11.7.2 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
中信建投	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	7,945.74	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	1,500,000, 000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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—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 12 月 31 日	-	88,665,490.00	75,019,700.00	13,645,790.00	75.80 %
产品特有风险							
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。

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。

易方达基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日