

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券 投资基金

2017 年年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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 1 月 1 日起至 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计意见	16
6.2	形成审计意见的基础	17
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	50
8.1	期末基金资产组合情况	50
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3	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	51
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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	61
8.7	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	61
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	61
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	61
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12	投资组合报告附注	61
§ 9	基金份额持有人信息	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2	期末上市基金前十名持有人	63
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	64
§ 10	开放式基金份额变动	64
§ 11	重大事件揭示	64
11.1	基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4	基金投资策略的改变	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8	其他重大事件	66
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
§ 13	备查文件目录	69
13.1	备查文件目录	69
13.2	存放地点	70
13.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300ETF 发起式
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,380,307,415.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益

	特征。
--	-----

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号 楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊 普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广 州银行大厦 40-43 楼

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

§ 3 主要财务指标、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	2016 年	2015 年
本期已实现收益	70,945,095.52	-198,029,389.17	2,236,234,116.27
本期利润	810,208,522.66	-469,355,249.77	482,582,272.79
加权平均基金份额本期利润	0.3282	-0.1569	0.1434
本期加权平均净值利润率	21.22%	-11.80%	9.19%
本期基金份额净值增长率	23.77%	-9.14%	6.42%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	1,602,900,568.86	1,015,375,143.17	1,483,907,287.88
期末可供分配基金份额利润	0.6734	0.3823	0.5214
期末基金资产净值	4,072,353,515.82	3,671,206,283.17	4,329,738,427.88
期末基金份额净值	1.7109	1.3823	1.5214
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	71.09%	38.23%	52.14%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.76%	0.79%	5.07%	0.80%	-0.31%	-0.01%
过去六个月	10.72%	0.69%	9.93%	0.70%	0.79%	-0.01%
过去一年	23.77%	0.63%	21.78%	0.64%	1.99%	-0.01%
过去三年	19.68%	1.67%	14.07%	1.68%	5.61%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	71.09%	1.52%	53.68%	1.54%	17.41%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

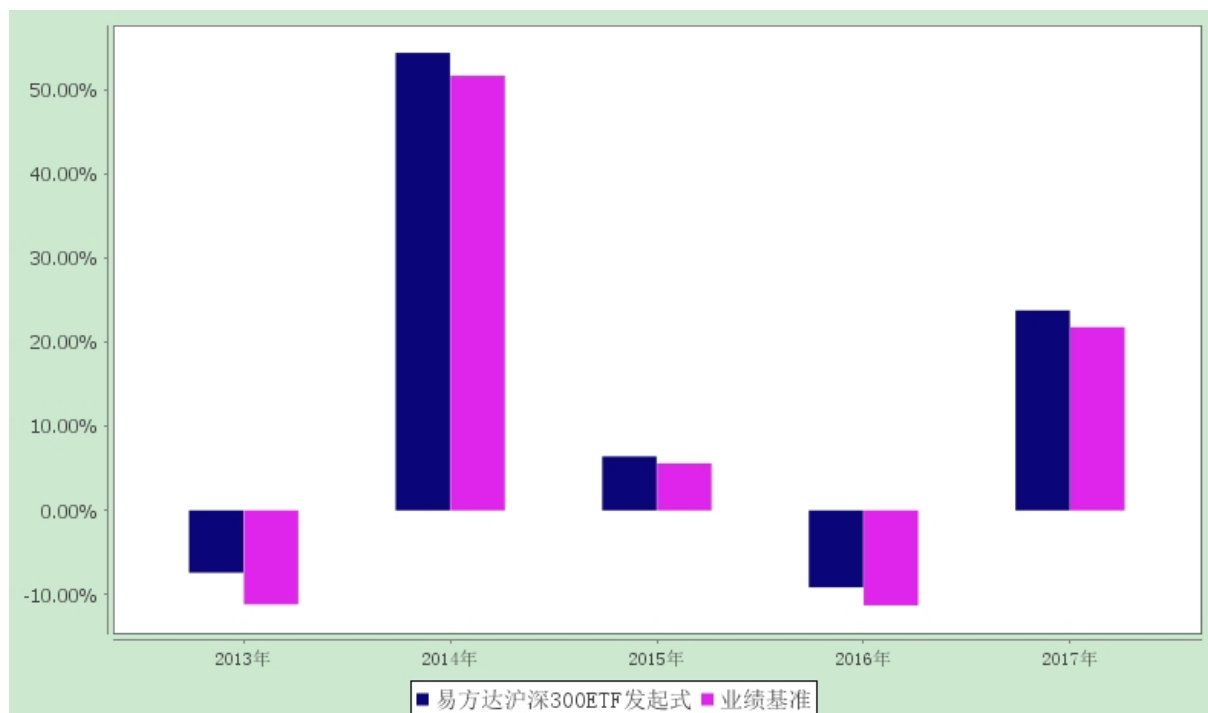
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013 年 3 月 6 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 71.09%，同期业绩比较基准收益率为 53.68%。

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
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 2013 年 3 月 6 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

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自 2015 年 08 月 27 日至 2017 年 06 月 22 日）、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2016 年 05 月 26 日至 2017 年 07 月 06 日）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理（自 2013 年 11 月 29 日至 2017 年 07 月 06 日）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理（自 2013 年 11 月 14 日至 2017 年 06 月 22 日）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、量化基金组合部副总经理	2013-03-06	2017-06-23	9 年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司	2016-04-16	-	12 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

	指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理				
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-06-23	-	8 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 and 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

在产能出清、库存回补带动内需企稳, 全球经济回暖拉动外需持续向好的背景下, 2017 年中国宏观经济延续了 2016 年以来的企稳态势, 经济韧性增强。全年 GDP 增速达 6.9%, 较 2016 年提高 0.2 个百分点; 其中社会消费品零售总额增长 10.2%, 较 2016 年回落 0.2 个百分点, 固定资产投资增长 7.2%, 较 2016 年回落 0.9 个百分点, 工业增加值增长 6.6%, 较 2016 年回升 0.6 个百分点, 出口额增长 7.9%, 较 2016 年大幅回升 15.6 个百分点。防范金融风险 and 去杠杆主导了 2017 年央行的货币政策基调, 叠加美联储加息和缩表的影响, 全年宏观流动性整体维持偏紧格局。本年度人民币兑美元汇率稳中有升扭转了过去三年以来的走低趋势, 截至年末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均回落至 6.5 附近。资本市场方面, A 股市场震荡走高, 最终上证综指以上涨 6.56% 收官。在风格方面, 大小盘分化明显, 个股表现之间“二八”分化特征显著, 本年度上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 25.08%、21.78%, 而创业板综指、中证 500 指数分别下跌 15.32%、0.20%; 行业方面, 保险、食品饮料、家用电器、钢铁、有色金属、电子、银行等板块涨幅居前, 纺织服装、传媒、国防军工等板块跌幅较大。作为被动型指数基金, 报告期内本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深 300 指数, 取得与标的指数基本一致的业绩表现。

报告期内本基金为正常运作期, 在操作中, 我们严格遵守基金合同, 坚持既定的指数化投资策略, 在指数权重调整和基金申赎变动时, 应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末, 本基金份额净值为 1.7109 元, 本报告期份额净值增长率为 23.77%, 同期业绩比较基准收益率为 21.78%, 日跟踪偏离度的均值为 0.01%, 年化跟踪误差为 0.459%, 各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段, 金融强监管下流动性收紧、房地产市场降温对经济增长的负面影响以及宏观政策与改革力图稳增长依然是影响未来 A 股市场最值得关注的因素。从经济增长的角度来看, 在外需稳健、资本开支周期复苏具有惯性、消费增长有韧性等因素支持下, 预计 2018 年中国经济增长仍将保持稳健回升态势。从金融监管政策传递的信号来看, 金融去杠杆将更依赖监管规则升级而非持续紧缩流动性, 对未来流动性的预期无需过度悲观。从海外市场来看, 全球主要经济体“紧货

币，宽财政”的政策组合对经济增长仍有一定的支持力度，美国税改落地有望进一步提振美国乃至全球的需求。全球主要经济体复苏的共振以及温和的再通胀均有利于股票类资产。如果当前中国经济增长的回暖趋势能够延续、货币政策适度并使物价水平不出现大的波动，同时各项改革措施稳步推进的背景下，考虑到目前 A 股市场整体估值水平仍偏低、上市公司整体盈利继续好转、流动性可能“有惊无险”的背景下，未来 A 股市场的机会仍将大于风险。从长期来看改革与创新仍然值得期待，中国新老经济的结构转换仍在深化中，消费升级、产业升级依然是中国经济未来主要的增长点。各项改革进程，包括国企、财税、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推进；通过供给侧改革、提高全要素生产率，是中国经济长期可持续发展的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必悲观。通过资本市场盘活存量，把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业并购、重组，改善上市公司业绩，实现 A 股市场和产业发展的正反馈。

目前以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于相对合理的位置，具有中长期投资价值。作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等新法规的实施和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发

展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，认真贯彻落实流动性风险管理规定的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 有计划、有重点地对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。

(6) 督促落实投资者适当性管理新规，推动投资者适当性管理制度、相关销售流程规范及系统的修订、更新，持续检讨完善客户投诉处理机制流程，切实保障投资者合法权益。

(7) 深入贯彻落实“风险为本”的监管要求，加强洗钱风险评估和监测防控，围绕“三号令”的落实进一步完善反洗钱可疑交易监测和配套工作机制，探索建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理体系，同时不断夯实反洗钱工作基础，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

(8) 紧跟法规监管要求、市场变化和业务发展，不断优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、规范。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

截至 2017 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21273 号

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

薛竞 周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	19,104,931.47	37,062,527.54
结算备付金		87,041.11	73,703.87
存出保证金		42,006.17	54,857.80
交易性金融资产	7.4.7.2	4,055,884,947.30	3,636,514,101.84
其中：股票投资		4,055,414,748.38	3,636,514,101.84
基金投资		-	-
债券投资		470,198.92	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		595,528.97	884,045.37
应收利息	7.4.7.5	3,908.12	8,662.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,075,718,363.14	3,674,597,899.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,268,096.51	800,389.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		691,549.51	650,446.35
应付托管费		345,774.76	325,223.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	219,630.93	89,993.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	839,795.61	1,525,563.22
负债合计		3,364,847.32	3,391,616.12
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,380,307,415.00	2,655,831,140.00
未分配利润	7.4.7.10	1,692,046,100.82	1,015,375,143.17
所有者权益合计		4,072,353,515.82	3,671,206,283.17
负债和所有者权益总计		4,075,718,363.14	3,674,597,899.29

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7109 元，基金份额总额 2,380,307,415.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
一、收入		824,643,343.70	-453,177,580.12
1.利息收入		246,320.72	506,945.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	245,694.95	506,730.21
债券利息收入		625.77	215.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		84,728,177.46	-185,501,958.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,468,653.37	-270,496,834.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	444,740.47	210,523.08
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	73,814,783.62	84,784,352.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	739,263,427.14	-271,325,860.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	405,418.38	3,143,293.62
减：二、费用		14,434,821.04	16,177,669.65
1. 管理人报酬		7,623,546.34	7,945,082.75
2. 托管费		3,811,773.10	3,972,541.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,391,458.70	2,592,387.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	1,608,042.90	1,667,657.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号		810,208,522.66	-469,355,249.77

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		810,208,522.66	-469,355,249.77

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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）	2,655,831,140.00	1,015,375,143.17	3,671,206,283.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	810,208,522.66	810,208,522.66
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）	-275,523,725.00	-133,537,565.01	-409,061,290.01
其中：1.基金申购款	42,000,000.00	25,389,392.53	67,389,392.53
2.基金赎回款	-317,523,725.00	-158,926,957.54	-476,450,682.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,380,307,415.00	1,692,046,100.82	4,072,353,515.82
项目	上年度可比期间		

	2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	2,845,831,140.00	1,483,907,287.88	4,329,738,427.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-469,355,249.77	-469,355,249.77
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)	-190,000,000.00	823,105.06	-189,176,894.94
其中：1.基金申购款	1,189,082,946.00	373,061,001.74	1,562,143,947.74
2.基金赎回款	-1,379,082,946.00	-372,237,896.68	-1,751,320,842.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,655,831,140.00	1,015,375,143.17	3,671,206,283.17

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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1762 号《关于核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额，其中

认购资金利息折合 43,605.00 份基金份额。本基金为交易型开放式（ETF）、发起式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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。

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中

以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金承担的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金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；或者(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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占基金净值比例计算的金额。未实现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损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购赎回对价现金替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变

动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

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) 在符合基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配最多 4 次，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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 15 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始

投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 15 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和

实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	19,104,931.47	37,062,527.54
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	19,104,931.47	37,062,527.54

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,421,351,704.96	4,055,414,748.38	634,063,043.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	470,198.92	470,198.92	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	470,198.92	470,198.92	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,421,821,903.88	4,055,884,947.30	634,063,043.42
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,741,714,485.56	3,636,514,101.84	-105,200,383.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,741,714,485.56	3,636,514,101.84	-105,200,383.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,826.40	8,608.77
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	39.10	29.40
应收债券利息	23.72	-
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	18.90	24.70
合计	3,908.12	8,662.87

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	219,630.93	89,993.43
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	219,630.93	89,993.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	400,000.00	404,000.00
应付替代款	122,733.35	721,094.96
可退替代款	9,815.90	107,840.50
其他应付款	307,246.36	292,627.76
合计	839,795.61	1,525,563.22

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,655,831,140.00	2,655,831,140.00
本期申购	42,000,000.00	42,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-317,523,725.00	-317,523,725.00
本期末	2,380,307,415.00	2,380,307,415.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,711,467,028.69	-696,091,885.52	1,015,375,143.17
本期利润	70,945,095.52	739,263,427.14	810,208,522.66
本期基金份额交易产生的变动数	-179,511,555.35	45,973,990.34	-133,537,565.01
其中：基金申购款	28,125,392.01	-2,735,999.48	25,389,392.53
基金赎回款	-207,636,947.36	48,709,989.82	-158,926,957.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,602,900,568.86	89,145,531.96	1,692,046,100.82

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

	月 31 日	12 月 31 日
活期存款利息收入	234,253.02	470,563.96
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	10,199.49	26,711.95
其他	1,242.44	9,454.30
合计	245,694.95	506,730.21

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,592,326.41	-251,785,022.33
股票投资收益——赎回差价收入	14,060,979.78	-18,711,812.37
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	10,468,653.37	-270,496,834.70

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	810,027,640.90	2,006,467,427.01
减：卖出股票成本总额	813,619,967.31	2,258,252,449.34
买卖股票差价收入	-3,592,326.41	-251,785,022.33

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	296,025,718.08	472,807,320.76
减：现金支付赎回款总额	87,247,237.08	132,546,363.76
减：赎回股票成本总额	194,717,501.22	358,972,769.37
赎回差价收入	14,060,979.78	-18,711,812.37

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,719,343.60	2,123,699.54
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,273,999.13	1,912,883.37
减：应收利息总额	604.00	293.09
买卖债券差价收入	444,740.47	210,523.08

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	73,814,783.62	84,784,352.80
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	73,814,783.62	84,784,352.80

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	739,263,427.14	-271,325,860.60
——股票投资	739,263,427.14	-271,325,860.60
——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	739,263,427.14	-271,325,860.60
----	----------------	-----------------

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	255,940.22	2,013,509.81
替代损益收入	149,478.16	570,057.80
其他	-	-
基金申购费收入	-	559,726.01
合计	405,418.38	3,143,293.62

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,391,458.70	2,592,387.52
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	-	-
合计	1,391,458.70	2,592,387.52

注：本期交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 194,311.99 元，上年度可比期间交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 1,481,012.62 元。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	100,000.00	104,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	4,510.98	5,695.57

上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	1,143,531.92	1,191,762.41
其他	-	200.00
银行间账户维护费	-	6,000.00
合计	1,608,042.90	1,667,657.98

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申赎代办券商
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、基金发起人
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
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	545,915,358.46	39.77%	193,247,023.08	4.71%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	235,467.17	47.72%	100,974.31	45.97%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	83,347.85	37.57%	36,144.12	40.16%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,623,546.34
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,811,773.10	3,972,541.40

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金	2,287,454,593.00	96.10%	2,471,463,693.00	93.06%
广发证券	2,032,759.00	0.09%	659,252.00	0.02%

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

7.4.10.5 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1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	19,104,931.47	234,253.02	37,062,527.54	470,563.96

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年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	002841	视源股份	新股网下发行	1,680	32,020.80
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	002919	名臣健康	新股网下发行	821	10,311.76
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	3,155	22,211.20
广发证券	300625	三雄极光	新股网下发行	3,934	75,926.20
广发证券	300627	华测导航	新股网下发行	1,498	19,129.46
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
广发证券	300647	超频三	新股网下发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下发行	1,110	21,545.10
广发证券	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00
广发证券	300697	电工合金	新股网下	1,630	12,436.90

			发行		
广发证券	300723	一品红	新股网下发行	1,561	26,615.05
广发证券	300726	宏达电子	新股网下发行	1,548	17,275.68
广发证券	300735	光弘科技	新股网下发行	3,764	37,602.36
广发证券	600089	特变电工	配股发行	186,704	1,338,667.68
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603458	勘设股份	新股网下发行	1,320	38,755.20
广发证券	603507	振江股份	新股网下发行	1,093	28,691.25
广发证券	603535	嘉诚国际	新股网下发行	1,340	20,327.80
广发证券	603557	起步股份	新股网下发行	1,664	12,862.72
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,206	30,089.70
广发证券	603683	晶华新材	新股网下发行	1,095	10,227.30
广发证券	603848	好太太	新股网下发行	1,377	10,864.53
上年度可比期间					
2016 年 1 月 1 日至 2016 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	002790	瑞尔特	新股网下发行	3,022	50,104.76
广发证券	300518	盛讯达	新股网下	1,306	29,019.32

			发行		
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603036	如通股份	新股网下发行	2,114	14,459.76
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67
广发证券	603239	浙江仙通	新股网下发行	924	20,180.16
广发证券	603313	恒康家居	新股网下发行	3,371	51,947.11
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	2,793	28,460.67
广发证券	603585	苏利股份	新股网下发行	1,041	27,888.39

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 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和托管行发行的股票建设银行。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	配股流通受限	11.06	53.21	30,753	340,128.18	1,636,367.13	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股 流通 受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股 流通 受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股 流通 受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

7.4.12.1.2 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
110042	航电转债	2017-12-26	2018-01-15	新发 流通 受限	100.00	100.00	2,470	246,998.92	246,998.92	-
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	新发 流通 受限	100.00	100.00	2,232	223,200.00	223,200.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	7.35	-	-	993,287	8,173,256.59	7,300,659.45	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项停牌	9.15	2018-02-09	8.24	554,719	4,895,900.43	5,075,678.85	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	167,184	14,091,084.99	8,700,255.36	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	3.91	2018-01-24	13.80	869,854	23,538,354.18	3,401,129.14	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
600150	中国船舶	2017-09-27	重大事项停牌	24.67	2018-03-21	22.20	244,047	7,499,318.17	6,020,639.49	-
600157	永泰能源	2017-11-21	重大事项停牌	3.36	-	-	1,745,177	7,251,280.54	5,863,794.72	-
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项	37.94	-	-	481,234	7,809,662.00	18,258,017.9	-

			停牌						6	
600332	白云山	2017-10-31	重大事件 停牌	32.14	2018-01-08	30.15	198,296	5,769,943.49	6,373,233.44	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事件 停牌	14.59	-	-	537,177	13,592,990.10	7,837,412.43	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事件 停牌	17.40	-	-	269,387	5,268,986.38	4,687,333.80	-
600685	中船防务	2017-09-27	重大事件 停牌	26.66	2018-03-21	24.05	116,388	3,037,406.33	3,102,904.08	-
601216	君正集团	2017-12-15	重大事件 停牌	4.71	-	-	1,157,674	5,008,026.66	5,452,644.54	-
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事件 停牌	8.09	2018-02-26	7.28	2,334,828	12,411,271.07	18,888,758.52	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司。

于 2017 年 12 月 31 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 0.01%(2016 年 12 月 31 日：0.00%)。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	247,006.50	0.00
AAA 以下	223,216.14	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	470,222.64	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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,104,931.47	-	-	-	19,104,931.47
结算备付金	87,041.11	-	-	-	87,041.11
存出保证金	42,006.17	-	-	-	42,006.17
交易性金融资产	-	-	470,198.92	4,055,414,748.38	4,055,884,947.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	595,528.97	595,528.97
应收利息	-	-	-	3,908.12	3,908.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	19,233,978.75	-	470,198.92	4,056,014,185.47	4,075,718,363.14
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	-	-	-	1,268,096.51	1,268,096.51
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	691,549.51	691,549.51
应付托管费	-	-	-	345,774.76	345,774.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	219,630.93	219,630.93
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	839,795.61	839,795.61
负债总计	-	-	-	3,364,847.32	3,364,847.32
利率敏感度缺口	19,233,978.75	-	470,198.92	4,052,649,338.15	4,072,353,515.82
上年度末					
2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	37,062,527.54	-	-	-	37,062,527.54
结算备付金	73,703.87	-	-	-	73,703.87
存出保证金	54,857.80	-	-	-	54,857.80
交易性金融资产	-	-	-	3,636,514,101.84	3,636,514,101.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	884,045.37	884,045.37
应收利息	-	-	-	8,662.87	8,662.87
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,191,089.21	-	-	3,637,406,810.08	3,674,597,899.29
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	800,389.94	800,389.94
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	650,446.35	650,446.35
应付托管费	-	-	-	325,223.18	325,223.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	89,993.43	89,993.43
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,525,563.22	1,525,563.22
负债总计	-	-	-	3,391,616.12	3,391,616.12
利率敏感度缺口	37,191,089.21	-	-	3,634,015,193.96	3,671,206,283.17

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	-	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-	-	

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,055,414,748.38	99.58	3,636,514,101.84	99.06
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,055,414,748.38	99.58	3,636,514,101.84	99.06

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	202,188,678.15	181,833,561.16
2.业绩比较基准下降 5%	-202,188,678.15	-181,833,561.16	

7.4.14 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 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 3,954,859,424.51 元，属于第二层次的余额为 97,624,393.65 元，属于第三层次的余额为 3,401,129.14 元(2016 年 12 月 31 日：第一层次 3,533,747,669.23 元，第二层次 102,766,432.61 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次金融工具公允价值为 3,401,129.14 元 (2016 年 12 月 31 日：无)。

上述第三层次金融工具公允价值变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资
2017 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层级	3,401,129.14
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
-计入损益的利得或损失	-
2017 年 12 月 31 日	3,401,129.14
2017 年 12 月 31 日仍持有的	-11,412,494.96

资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	
--	--

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 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(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)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	4,055,414,748.38	99.50
	其中：股票	4,055,414,748.38	99.50
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	470,198.92	0.01
	其中：债券	470,198.92	0.01
	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	19,191,972.58	0.47
8	其他各项资产	641,443.26	0.02
9	合计	4,075,718,363.14	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	9,295,953.51	0.23
B	采矿业	128,965,973.90	3.17
C	制造业	1,613,312,795.25	39.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,789,923.70	2.65
E	建筑业	154,932,440.08	3.80
F	批发和零售业	80,789,539.99	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	129,095,525.57	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	158,916,288.51	3.90
J	金融业	1,358,663,516.63	33.36
K	房地产业	193,177,914.31	4.74
L	租赁和商务服务业	47,221,387.46	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	26,588,286.00	0.65

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,230,283.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	28,635,023.07	0.70
S	综合	3,800,053.40	0.09
	合计	4,055,414,904.38	99.58

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,715,830	260,033,783.40	6.39
2	600519	贵州茅台	172,559	120,358,176.91	2.96
3	600036	招商银行	3,538,172	102,677,751.44	2.52
4	000333	美的集团	1,558,235	86,372,966.05	2.12
5	601166	兴业银行	4,275,241	72,636,344.59	1.78
6	000651	格力电器	1,650,669	72,134,235.30	1.77
7	600016	民生银行	8,108,640	68,031,489.60	1.67
8	600887	伊利股份	2,084,757	67,108,327.83	1.65
9	601328	交通银行	9,423,757	58,521,530.97	1.44
10	000858	五粮液	651,048	52,005,714.24	1.28
11	000002	万科 A	1,667,671	51,797,861.26	1.27
12	600000	浦发银行	4,027,021	50,700,194.39	1.24
13	601288	农业银行	13,111,393	50,216,635.19	1.23
14	002415	海康威视	1,266,128	49,378,992.00	1.21
15	600030	中信证券	2,699,590	48,862,579.00	1.20
16	000725	京东方 A	8,130,023	47,072,833.17	1.16
17	601668	中国建筑	5,144,664	46,404,869.28	1.14
18	601398	工商银行	7,397,825	45,866,515.00	1.13
19	601601	中国太保	1,078,236	44,660,535.12	1.10
20	600276	恒瑞医药	579,694	39,987,292.12	0.98
21	000001	平安银行	2,944,646	39,163,791.80	0.96
22	600104	上汽集团	1,202,324	38,522,460.96	0.95
23	601169	北京银行	5,006,896	35,799,306.40	0.88
24	600837	海通证券	2,775,438	35,719,887.06	0.88
25	600900	长江电力	2,263,816	35,292,891.44	0.87
26	600048	保利地产	2,440,360	34,531,094.00	0.85
27	601766	中国中车	2,503,293	30,314,878.23	0.74
28	000063	中兴通讯	816,006	29,669,978.16	0.73

29	601988	中国银行	7,229,048	28,699,320.56	0.70
30	600019	宝钢股份	3,032,321	26,199,253.44	0.64
31	601211	国泰君安	1,289,023	23,872,705.96	0.59
32	002304	洋河股份	206,807	23,782,805.00	0.58
33	002027	分众传媒	1,678,187	23,628,872.96	0.58
34	600518	康美药业	1,017,969	22,761,786.84	0.56
35	601818	光大银行	5,461,883	22,120,626.15	0.54
36	600028	中国石化	3,605,131	22,099,453.03	0.54
37	600703	三安光电	839,411	21,312,645.29	0.52
38	002594	比亚迪	310,835	20,219,816.75	0.50
39	600585	海螺水泥	685,949	20,118,884.17	0.49
40	601336	新华保险	286,259	20,095,381.80	0.49
41	600015	华夏银行	2,198,928	19,790,352.00	0.49
42	601989	中国重工	3,272,061	19,730,527.83	0.48
43	002230	科大讯飞	333,404	19,717,512.56	0.48
44	600690	青岛海尔	1,045,648	19,700,008.32	0.48
45	600050	中国联通	3,111,116	19,693,364.28	0.48
46	601688	华泰证券	1,120,125	19,333,357.50	0.47
47	601600	中国铝业	2,334,828	18,888,758.52	0.46
48	601006	大秦铁路	2,039,818	18,501,149.26	0.45
49	600309	万华化学	481,234	18,258,017.96	0.45
50	000538	云南白药	178,452	18,164,629.08	0.45
51	601857	中国石油	2,221,432	17,971,384.88	0.44
52	601939	建设银行	2,303,196	17,688,545.28	0.43
53	601186	中国铁建	1,578,377	17,583,119.78	0.43
54	601012	隆基股份	479,300	17,465,692.00	0.43
55	600919	江苏银行	2,375,800	17,462,130.00	0.43
56	601628	中国人寿	571,339	17,397,272.55	0.43
57	000776	广发证券	1,015,072	16,931,400.96	0.42
58	000568	泸州老窖	251,247	16,582,302.00	0.41
59	601899	紫金矿业	3,559,131	16,336,411.29	0.40
60	002450	康得新	726,451	16,127,212.20	0.40
61	601390	中国中铁	1,917,812	16,090,442.68	0.40
62	600741	华域汽车	540,586	16,049,998.34	0.39
63	001979	招商蛇口	813,289	15,907,932.84	0.39
64	601088	中国神华	678,696	15,725,386.32	0.39
65	002024	苏宁云商	1,277,256	15,697,476.24	0.39
66	002142	宁波银行	869,533	15,486,382.73	0.38
67	600196	复星医药	344,945	15,350,052.50	0.38
68	600009	上海机场	330,437	14,872,969.37	0.37
69	600958	东方证券	1,067,829	14,800,109.94	0.36
70	601888	中国国旅	334,884	14,530,616.76	0.36
71	002008	大族激光	293,000	14,474,200.00	0.36
72	600029	南方航空	1,204,464	14,357,210.88	0.35

73	600031	三一重工	1,575,359	14,288,506.13	0.35
74	600660	福耀玻璃	480,936	13,947,144.00	0.34
75	000338	潍柴动力	1,661,236	13,854,708.24	0.34
76	002236	大华股份	596,604	13,775,586.36	0.34
77	300136	信维通信	269,800	13,678,860.00	0.34
78	601009	南京银行	1,745,525	13,510,363.50	0.33
79	600999	招商证券	784,589	13,463,547.24	0.33
80	002456	欧菲科技	651,748	13,419,491.32	0.33
81	601933	永辉超市	1,328,477	13,417,617.70	0.33
82	300059	东方财富	1,029,686	13,334,433.70	0.33
83	002202	金风科技	697,754	13,152,662.90	0.32
84	002475	立讯精密	544,091	12,753,493.04	0.31
85	600340	华夏幸福	405,584	12,731,281.76	0.31
86	600089	特变电工	1,275,429	12,639,501.39	0.31
87	600795	国电电力	4,043,977	12,617,208.24	0.31
88	600221	海航控股	3,946,189	12,588,342.91	0.31
89	002460	赣锋锂业	175,200	12,570,600.00	0.31
90	002466	天齐锂业	235,571	12,534,732.91	0.31
91	000413	东旭光电	1,331,260	12,487,218.80	0.31
92	601985	中国核电	1,601,527	11,771,223.45	0.29
93	002241	歌尔股份	667,773	11,585,861.55	0.28
94	601377	兴业证券	1,591,356	11,585,071.68	0.28
95	600010	包钢股份	4,690,480	11,538,580.80	0.28
96	601669	中国电建	1,574,347	11,366,785.34	0.28
97	300070	碧水源	645,115	11,205,647.55	0.28
98	601225	陕西煤业	1,371,862	11,194,393.92	0.27
99	000166	申万宏源	2,063,657	11,081,838.09	0.27
100	600115	东方航空	1,345,879	11,049,666.59	0.27
101	000100	TCL 集团	2,814,004	10,974,615.60	0.27
102	600066	宇通客车	455,664	10,967,832.48	0.27
103	600111	北方稀土	747,788	10,910,226.92	0.27
104	300072	三聚环保	310,039	10,891,670.07	0.27
105	000423	东阿阿胶	179,349	10,809,364.23	0.27
106	000503	海虹控股	246,659	10,645,802.44	0.26
107	600406	国电南瑞	571,654	10,449,835.12	0.26
108	000783	长江证券	1,327,658	10,448,668.46	0.26
109	600522	中天科技	736,300	10,264,022.00	0.25
110	600886	国投电力	1,396,523	10,250,478.82	0.25
111	002252	上海莱士	511,557	10,154,406.45	0.25
112	300124	汇川技术	342,720	9,945,734.40	0.24
113	600383	金地集团	774,118	9,777,110.34	0.24
114	601901	方正证券	1,411,758	9,727,012.62	0.24
115	601607	上海医药	395,861	9,575,877.59	0.24
116	000069	华侨城 A	1,125,641	9,556,692.09	0.23

117	002310	东方园林	459,832	9,274,811.44	0.23
118	002736	国信证券	843,823	9,155,479.55	0.22
119	600352	浙江龙盛	781,029	9,145,849.59	0.22
120	600606	绿地控股	1,251,946	9,139,205.80	0.22
121	601155	新城控股	309,825	9,077,872.50	0.22
122	000839	中信国安	941,184	9,025,954.56	0.22
123	000895	双汇发展	339,540	8,997,810.00	0.22
124	601788	光大证券	669,878	8,996,461.54	0.22
125	000963	华东医药	166,907	8,992,949.16	0.22
126	601618	中国中冶	1,836,839	8,890,300.76	0.22
127	600011	华能国际	1,440,700	8,889,119.00	0.22
128	601919	中远海控	1,309,500	8,865,315.00	0.22
129	300003	乐普医疗	366,700	8,859,472.00	0.22
130	002739	万达电影	167,184	8,700,255.36	0.21
131	600705	中航资本	1,539,461	8,497,824.72	0.21
132	601099	太平洋	2,337,901	8,463,201.62	0.21
133	000625	长安汽车	668,902	8,428,165.20	0.21
134	601111	中国国航	683,403	8,419,524.96	0.21
135	600804	鹏博士	491,422	8,368,916.66	0.21
136	002081	金螳螂	543,867	8,332,042.44	0.20
137	600893	航发动力	308,626	8,305,125.66	0.20
138	600271	航天信息	383,497	8,260,525.38	0.20
139	600816	安信信托	625,444	8,180,807.52	0.20
140	603799	华友钴业	101,600	8,151,368.00	0.20
141	601727	上海电气	1,209,341	8,090,491.29	0.20
142	000768	中航飞机	474,905	8,021,145.45	0.20
143	601555	东吴证券	823,210	8,001,601.20	0.20
144	600547	山东黄金	254,914	7,948,218.52	0.20
145	600535	天士力	222,417	7,913,596.86	0.19
146	600177	雅戈尔	860,051	7,886,667.67	0.19
147	600570	恒生电子	169,724	7,875,193.60	0.19
148	600485	信威集团	537,177	7,837,412.43	0.19
149	002508	老板电器	162,900	7,835,490.00	0.19
150	002044	美年健康	356,900	7,805,403.00	0.19
151	600068	葛洲坝	947,650	7,770,730.00	0.19
152	600208	新湖中宝	1,474,577	7,697,291.94	0.19
153	600674	川投能源	755,153	7,687,457.54	0.19
154	002558	巨人网络	208,280	7,664,704.00	0.19
155	000728	国元证券	692,618	7,618,798.00	0.19
156	600637	东方明珠	452,992	7,546,846.72	0.19
157	600023	浙能电力	1,399,485	7,459,255.05	0.18
158	002673	西部证券	600,642	7,399,909.44	0.18
159	600739	辽宁成大	419,691	7,386,561.60	0.18
160	600482	中国动力	297,252	7,374,822.12	0.18

161	000540	中天金融	993,287	7,300,659.45	0.18
162	601018	宁波港	1,355,347	7,196,892.57	0.18
163	600362	江西铜业	355,967	7,179,854.39	0.18
164	000623	吉林敖东	318,983	7,177,117.50	0.18
165	002797	第一创业	720,889	7,064,712.20	0.17
166	300024	机器人	374,695	7,051,759.90	0.17
167	600219	南山铝业	1,903,900	7,006,352.00	0.17
168	002572	索菲亚	190,000	6,992,000.00	0.17
169	600109	国金证券	726,213	6,928,072.02	0.17
170	600018	上港集团	1,033,268	6,871,232.20	0.17
171	600297	广汇汽车	839,628	6,733,816.56	0.17
172	601800	中国交建	523,998	6,707,174.40	0.16
173	000157	中联重科	1,497,402	6,693,386.94	0.16
174	000425	徐工机械	1,442,226	6,677,506.38	0.16
175	000792	盐湖股份	477,849	6,646,879.59	0.16
176	600436	片仔癀	103,500	6,541,200.00	0.16
177	601998	中信银行	1,051,222	6,517,576.40	0.16
178	002294	信立泰	143,600	6,489,284.00	0.16
179	601333	广深铁路	1,163,208	6,479,068.56	0.16
180	300015	爱尔眼科	208,600	6,424,880.00	0.16
181	000060	中金岭南	571,330	6,381,756.10	0.16
182	600332	白云山	198,296	6,373,233.44	0.16
183	000630	铜陵有色	2,166,384	6,325,841.28	0.16
184	601997	贵阳银行	473,100	6,320,616.00	0.16
185	002714	牧原股份	119,246	6,303,343.56	0.15
186	603993	洛阳钼业	910,722	6,265,767.36	0.15
187	601992	金隅股份	1,144,000	6,211,920.00	0.15
188	600085	同仁堂	188,090	6,064,021.60	0.15
189	600150	中国船舶	244,047	6,020,639.49	0.15
190	600100	同方股份	610,084	5,978,823.20	0.15
191	603833	欧派家居	49,700	5,867,085.00	0.14
192	600157	永泰能源	1,745,177	5,863,794.72	0.14
193	600489	中金黄金	591,908	5,853,970.12	0.14
194	600682	南京新百	154,400	5,834,776.00	0.14
195	000826	启迪桑德	175,458	5,793,623.16	0.14
196	002146	荣盛发展	596,564	5,685,254.92	0.14
197	000709	河钢股份	1,456,980	5,682,222.00	0.14
198	600170	上海建工	1,527,116	5,680,871.52	0.14
199	603160	汇顶科技	57,400	5,564,356.00	0.14
200	600498	烽火通信	190,920	5,504,223.60	0.14
201	000983	西山煤电	540,366	5,479,311.24	0.13
202	601216	君正集团	1,157,674	5,452,644.54	0.13
203	601198	东兴证券	378,521	5,450,702.40	0.13
204	600820	隧道股份	646,941	5,408,426.76	0.13

205	600153	建发股份	486,263	5,407,244.56	0.13
206	600415	小商品城	933,447	5,395,323.66	0.13
207	000876	新希望	723,090	5,387,020.50	0.13
208	002500	山西证券	582,132	5,367,257.04	0.13
209	600588	用友网络	251,188	5,312,626.20	0.13
210	002465	海格通信	553,912	5,312,016.08	0.13
211	002065	东华软件	646,220	5,299,004.00	0.13
212	300017	网宿科技	495,324	5,270,247.36	0.13
213	002074	国轩高科	233,937	5,207,437.62	0.13
214	002007	华兰生物	191,363	5,143,837.44	0.13
215	600118	中国卫星	202,791	5,120,472.75	0.13
216	002470	金正大	554,719	5,075,678.85	0.12
217	000008	神州高铁	580,049	5,075,428.75	0.12
218	300027	华谊兄弟	571,009	4,984,908.57	0.12
219	000750	国海证券	1,012,049	4,959,040.10	0.12
220	000559	万向钱潮	472,245	4,793,286.75	0.12
221	600663	陆家嘴	251,635	4,788,614.05	0.12
222	601633	长城汽车	413,397	4,749,931.53	0.12
223	600666	奥瑞德	269,387	4,687,333.80	0.12
224	600583	海油工程	758,377	4,664,018.55	0.11
225	300144	宋城演艺	249,218	4,650,407.88	0.11
226	300122	智飞生物	164,800	4,625,936.00	0.11
227	601117	中国化学	676,700	4,567,725.00	0.11
228	000402	金融街	410,243	4,557,799.73	0.11
229	002624	完美世界	135,400	4,530,484.00	0.11
230	600369	西南证券	968,220	4,482,858.60	0.11
231	000671	阳光城	555,631	4,372,815.97	0.11
232	600959	江苏有线	532,802	4,358,320.36	0.11
233	601991	大唐发电	1,028,300	4,267,445.00	0.10
234	002385	大北农	703,239	4,261,628.34	0.10
235	600008	首创股份	826,715	4,249,315.10	0.10
236	000686	东北证券	481,714	4,224,631.78	0.10
237	300315	掌趣科技	756,941	4,208,591.96	0.10
238	601229	上海银行	294,390	4,174,450.20	0.10
239	002841	视源股份	57,400	4,161,500.00	0.10
240	000938	紫光股份	57,400	4,134,522.00	0.10
241	600376	首开股份	442,392	4,109,821.68	0.10
242	002426	胜利精密	704,100	4,104,903.00	0.10
243	000961	中南建设	636,400	4,079,324.00	0.10
244	000627	天茂集团	508,530	4,068,240.00	0.10
245	600704	物产中大	590,876	4,029,774.32	0.10
246	000898	鞍钢股份	632,900	4,018,915.00	0.10
247	600977	中国电影	256,200	3,945,480.00	0.10
248	601877	正泰电器	147,724	3,862,982.60	0.09

249	600549	厦门钨业	149,168	3,839,584.32	0.09
250	600061	国投资本	290,124	3,823,834.32	0.09
251	600649	城投控股	433,708	3,816,630.40	0.09
252	002352	顺丰控股	75,600	3,807,216.00	0.09
253	600895	张江高科	265,738	3,800,053.40	0.09
254	600038	中直股份	80,824	3,760,740.72	0.09
255	600827	百联股份	275,274	3,713,446.26	0.09
256	601866	中远海发	1,088,348	3,711,266.68	0.09
257	300033	同花顺	73,700	3,683,526.00	0.09
258	000415	渤海金控	636,558	3,666,574.08	0.09
259	002602	世纪华通	105,700	3,591,686.00	0.09
260	601898	中煤能源	627,900	3,591,588.00	0.09
261	300104	乐视网	869,854	3,401,129.14	0.08
262	600074	ST 保千里	339,597	3,351,822.39	0.08
263	002601	龙麟佰利	209,100	3,349,782.00	0.08
264	002174	游族网络	147,872	3,297,545.60	0.08
265	000959	首钢股份	544,200	3,254,316.00	0.08
266	002831	裕同科技	57,400	3,207,512.00	0.08
267	600373	中文传媒	189,012	3,199,973.16	0.08
268	601872	招商轮船	727,199	3,192,403.61	0.08
269	600688	上海石化	503,243	3,185,528.19	0.08
270	300251	光线传媒	301,818	3,153,998.10	0.08
271	600685	中船防务	116,388	3,102,904.08	0.08
272	601021	春秋航空	82,286	3,066,799.22	0.08
273	601718	际华集团	451,888	3,041,206.24	0.07
274	600021	上海电力	330,599	3,021,674.86	0.07
275	601118	海南橡胶	539,209	2,992,609.95	0.07
276	002153	石基信息	109,845	2,928,467.70	0.07
277	603858	步长制药	57,425	2,920,635.50	0.07
278	000723	美锦能源	422,400	2,910,336.00	0.07
279	601966	玲珑轮胎	164,800	2,877,408.00	0.07
280	002411	必康股份	105,300	2,808,351.00	0.07
281	601611	中国核建	270,284	2,775,816.68	0.07
282	600909	华安证券	372,700	2,709,529.00	0.07
283	002468	申通快递	105,000	2,592,450.00	0.06
284	002292	奥飞娱乐	179,227	2,561,153.83	0.06
285	600372	中航电子	180,964	2,477,397.16	0.06
286	601608	中信重工	595,398	2,453,039.76	0.06
287	000738	航发控制	157,300	2,405,117.00	0.06
288	601958	金钼股份	332,041	2,400,656.43	0.06
289	601881	中国银河	221,100	2,323,761.00	0.06
290	002555	三七互娱	110,500	2,269,670.00	0.06
291	002608	江苏国信	223,200	2,267,712.00	0.06
292	002424	贵州百灵	145,365	2,238,621.00	0.05

293	601878	浙商证券	125,800	2,090,796.00	0.05
294	600233	圆通速递	116,300	1,948,025.00	0.05
295	600188	兖州煤业	132,024	1,916,988.48	0.05
296	601212	白银有色	263,200	1,779,232.00	0.04
297	601375	中原证券	275,300	1,698,601.00	0.04
298	601163	三角轮胎	82,300	1,677,274.00	0.04
299	600871	石化油服	619,712	1,654,631.04	0.04
300	600926	杭州银行	138,400	1,595,752.00	0.04
301	601228	广州港	255,000	1,558,050.00	0.04
302	600390	五矿资本	115,800	1,366,440.00	0.03
303	002839	张家港行	68,100	798,132.00	0.02
304	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.00
305	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
306	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
307	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
308	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
309	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
310	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
311	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
312	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
313	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
314	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.00
315	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
316	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
317	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
318	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600919	江苏银行	19,543,921.67	0.53
2	002456	欧菲科技	17,300,528.30	0.47
3	002027	分众传媒	17,206,071.45	0.47
4	601012	隆基股份	16,136,207.51	0.44
5	600019	宝钢股份	14,598,548.20	0.40
6	300136	信维通信	14,291,067.83	0.39
7	002460	赣锋锂业	12,085,828.36	0.33
8	002415	海康威视	11,422,300.74	0.31
9	600011	华能国际	9,472,510.00	0.26

10	600522	中天科技	9,029,823.95	0.25
11	002558	巨人网络	8,818,058.55	0.24
12	300003	乐普医疗	8,578,035.15	0.23
13	603799	华友钴业	8,292,139.16	0.23
14	601992	金隅股份	8,256,432.00	0.22
15	002594	比亚迪	7,870,177.96	0.21
16	002508	老板电器	7,801,824.70	0.21
17	000413	东旭光电	7,327,972.00	0.20
18	601997	贵阳银行	7,249,863.90	0.20
19	002044	美年健康	7,072,254.00	0.19
20	002572	索菲亚	6,841,919.06	0.19

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	30,085,666.54	0.82
2	601318	中国平安	19,582,756.42	0.53
3	002456	欧菲科技	18,550,496.30	0.51
4	601766	中国中车	13,402,844.00	0.37
5	601166	兴业银行	12,482,805.30	0.34
6	600519	贵州茅台	11,866,999.54	0.32
7	000333	美的集团	11,448,584.33	0.31
8	000651	格力电器	11,424,171.47	0.31
9	601211	国泰君安	8,924,598.21	0.24
10	600036	招商银行	8,654,718.46	0.24
11	000793	华闻传媒	8,381,054.93	0.23
12	601390	中国中铁	8,123,198.70	0.22
13	600867	通化东宝	7,706,862.73	0.21
14	600016	民生银行	7,616,062.73	0.21
15	600005	武钢股份	7,566,455.20	0.21
16	002129	中环股份	7,089,055.48	0.19
17	002049	紫光国芯	6,735,792.08	0.18
18	000858	五粮液	6,683,967.75	0.18
19	000009	中国宝安	6,643,882.21	0.18
20	000725	京东方A	6,637,383.30	0.18

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	618,556,080.75
卖出股票收入（成交）总额	810,027,640.90

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）	470,198.92	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	470,198.92	0.01

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	110042	航电转债	2,470	246,998.92	0.01
2	128028	赣锋转债	2,232	223,200.00	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。

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 2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对招商银行、交通银行批量转让个人贷款，对上述两银行分别处以人民币 50 万元、20 万元的行政处罚。

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

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。除招商银行、交通银行、民生银行外，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。

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	42,006.17
2	应收证券清算款	595,528.97
3	应收股利	-
4	应收利息	3,908.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	641,443.26

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)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国建设银行股份有 限公司—易方达沪深 300 指数证券投资基金 联接基金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
3,729	638,323.2 5	2,303,115,4 61.00	96.76%	77,191,954. 00	3.24%	2,287,454, 593.00	96.10%

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

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	中信证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	9,070,678.00	0.38%
2	国信证券股份有限公司	4,033,300.00	0.17%
3	北京中科世通技术服务有限公司	3,562,600.00	0.15%
4	工银瑞信添富股票型养老金产品—中国农业银行股份有限公司	3,349,400.00	0.14%
5	广发证券股份有限公司	2,032,759.00	0.09%
6	陈炎	1,633,700.00	0.07%
7	国元证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,190,600.00	0.05%
8	李洵	1,100,000.00	0.05%
9	蒋黎	1,000,000.00	0.04%

10	广发证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	955,300.00	0.04%
11	中国建设银行股份有限公司－易方达沪深 300 指数证券投资基金联接基金	2,287,454,593.00	96.10%

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

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	10,002,600.00	0.4202%	3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,002,600.00	0.4202%	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 3 月 6 日)基金份额总额	1,104,307,415.00
本报告期期初基金份额总额	2,655,831,140.00
本报告期基金总申购份额	42,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	317,523,725.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,380,307,415.00

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

§ 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 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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连续 5 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 100,000.00 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	344,887,959.33	25.13%	50,133.15	10.16%	-
平安证券	2	481,752,634.74	35.10%	207,783.37	42.11%	-
广发证券	2	545,915,358.46	39.77%	235,467.17	47.72%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	4,815,493.80	71.67%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,903,849.80	28.33%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购海利尔药业集团股份有限公司首次公开发行	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-01-06

	A 股的公告	理人网站	
2	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东翔鹭钨业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-10
3	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州视源电子科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-13
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东雄塑科技集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-14
5	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购浙江正裕工业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-20
6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江山欧派门业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-03
7	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-09
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购拉芳家化股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-04
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东三雄极光照明股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-11
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海华测导航技术股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-16
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏美思德化学股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-24
13	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东凯普生物科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-07
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19
15	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购周大生珠宝股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-22
16	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购	中国证券报、上海证券	2017-04-26

	深圳市超频三科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
17	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门延江新材料股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-20
18	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南京华脉科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-25
19	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-12
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州酒家集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-21
21	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购杭州沪宁电梯部件股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
22	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
23	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
24	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州市嘉诚国际物流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	2017-08-02
25	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购贵州省交通规划勘察设计研究院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	2017-08-03
26	易方达基金管理有限公司关于直销中心收款银行账户信息的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-08-04
27	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购起步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	2017-08-12
28	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江阴电工合金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	2017-08-30
29	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海晶华胶粘新材料股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-10-14
30	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏振江新能源装备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	2017-10-28

31	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购一品红药业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-11-10
32	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购株洲宏达电子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	2017-11-15
33	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东好太太科技集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-11-25
34	易方达基金管理有限公司关于易方达资产管理有限公司股权结构等事项变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-02
35	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-11
36	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购名臣健康用品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	2017-12-13
37	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购惠州光弘科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-23
38	易方达基金管理有限公司关于公司旗下证券投资基金执行增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-30

§ 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
中国建设银行股份有限公司—易方达沪深300 指数证券投资基金联接基金	1	2017 年 01 月 01 日~2017 年 12 月 31 日	2,471,463,693.00	48,600,000.00	232,609,100.00	2,287,454,593.00	96.10 %
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</p>							

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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。

13.3 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

二〇一八年三月三十日