

# 易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基 金

## 2018 年年度报告

2018 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：二〇一九年三月二十八日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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。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 2018 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 .....	15
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§ 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	其他信息 .....	17
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任 .....	17
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任 .....	17
§ 7	年度财务报表 .....	19
7.1	资产负债表 .....	19
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 .....	48
8.1	期末基金资产组合情况 .....	48
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
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 .....	49

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12	投资组合报告附注 .....	63
§ 9	基金份额持有人信息 .....	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	64
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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 .....	65
§ 10	开放式基金份额变动 .....	65
§ 11	重大事件揭示 .....	65
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4	基金投资策略的改变 .....	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
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 .....	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8	其他重大事件 .....	68
§ 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 .....	70
13.1	备查文件目录 .....	70
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	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达深证成指 ETF
场内简称	深成指 EF
基金主代码	159950
交易代码	159950
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2017 年 4 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,411,936.00 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
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-42891（集中办公 区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	陈四清

### 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	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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	安永华明会计师事务所（特殊普 通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安 永大楼 17 层 01-12 室
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	2018 年	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	-2,025,647.58	3,804,739.39
本期利润	-7,964,657.60	5,707,016.48
加权平均基金份额本期利润	-0.3720	0.0993
本期加权平均净值利润率	-39.96%	9.53%
本期基金份额净值增长率	-33.87%	12.70%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-8,255,168.94	2,286,682.54
期末可供分配基金份额利润	-0.2547	0.1270
期末基金资产净值	24,156,767.06	20,288,062.54
期末基金份额净值	0.7453	1.1270
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-25.47%	12.70%

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-12.38%	1.77%	-13.82%	1.83%	1.44%	-0.06%
过去六个月	-21.58%	1.58%	-22.81%	1.63%	1.23%	-0.05%
过去一年	-33.87%	1.46%	-34.42%	1.50%	0.55%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-25.47%	1.25%	-29.06%	1.29%	3.59%	-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 2018 年 12 月 31 日)

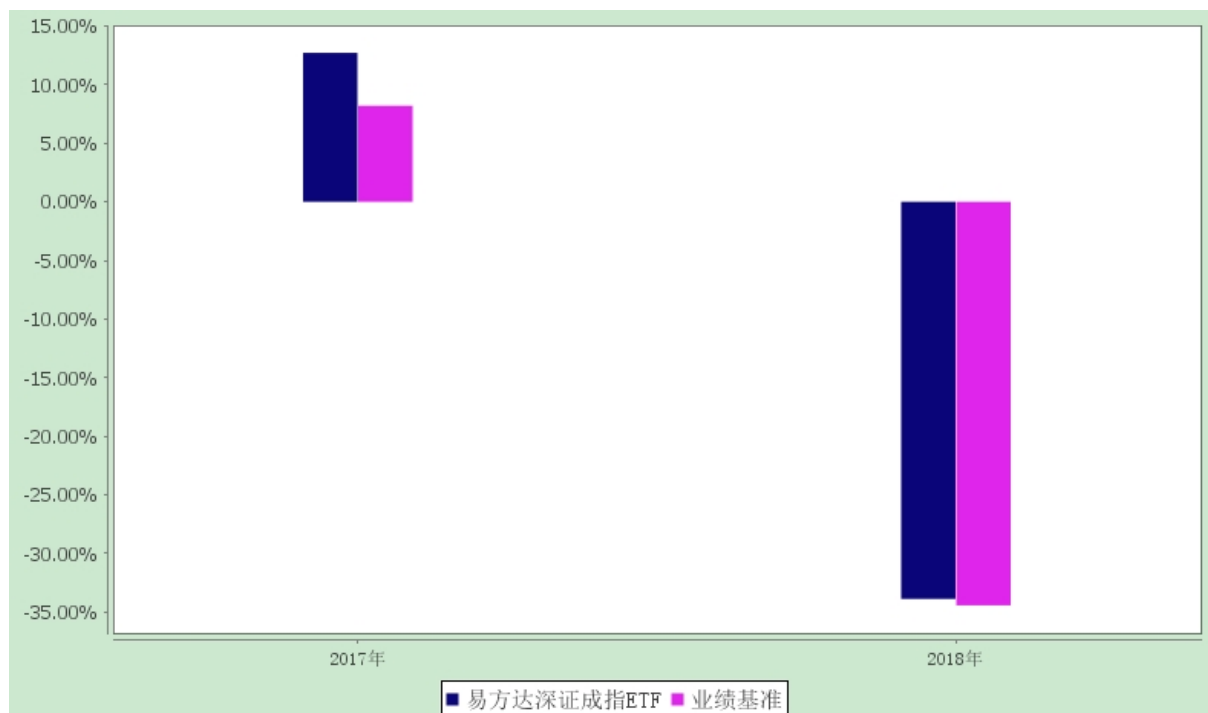


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-25.47%，同期业绩比较基准收益率为-29.06%。

### 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、深圳等地设有分公司或子公司，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，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一，在主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资等领域全面布局。截至 2018 年 12 月 31 日，易方达总资产管理规模超过 1.2 万亿元，服务近 8000 万客户，自成立以来仅公募基金累计分红达 1150 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、易方达原油证券投资基金(QDII)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、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达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、易方达MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2017-04-27	-	10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、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达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	2017-07-18	-	11年	硕士研究生，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、基金经理助理。

<p>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、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达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、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</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《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 2018 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 131 次，其中 127 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，4 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，既包含了市值超千亿的大盘蓝筹，也包含中小板、创业板中的小盘成长股，兼具了价值股与成长股的特性，风格较均衡，深圳整体股票市场代表性强。报告期内，本基金主要采取完全复制法投资策略，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。

2018 年进入四季度之后，信用收缩叠加中美贸易摩擦使得经济数据仍在温和回落过程中，同期政府的多项对冲政策陆续落实，但从政策底到经济底的过渡依然需要时间。整个市场结构分化的特征较为明显，部分业绩稳定、调整充分的公司已经开始受到资金重新重视。

市场体现出两类趋势：一种是伴随着经济下行，传统行业都出现份额向龙头集中的趋势，另一种是经济结构也在向创新产业切换，成长风格预计将在下一阶段得到加强。

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，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

### 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 0.7453 元，本报告期份额净值增长率为-33.87%，同期业绩比较基准收益率为-34.42%。

本报告期，本基金日跟踪偏离度的均值为 0.04%，年化跟踪误差 0.92%，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 2019 年，可以看到 2018 年压制市场的多个因素正逐步缓和。首先，中美贸易摩擦走向缓和，双方重新回到谈判讨论，并且投资者已经对摩擦的长期性有充分的预期，体现在二级市场的定价中；其次，中国货币及流动性环境稳步改善中，从“去杠杆”到“稳杠杆”，货币整体投放稳中有放，但是货币扩张受汇率、利率、地产等约束，导致整个信用传导机制并不顺畅，信用回升过程相对缓慢；此外，预计中国经济增速仍有可能小幅下行，但多项货币、财政、产业等政策的推出，确保经济增长不会失速。经济结构正在实现从高增长向高质量的切换。

A 股市场 2018 年整体表现不佳，各类风格都经历了杀估值的过程，但也充分释放了风险。随着各项政策的及时调整，我们认为中国的经济发展、产业升级及国民收入仍保持在健康通道中，但市场全面复苏的概率较低。传统产业中龙头公司和有增长空间的创新行业，可能成为 2019 年的投资主线。行业中的“马太效应”将在经济下行背景下愈加明显。长期投资者可以考虑在市场的下行过

程中逐渐布局优质企业，通过公司业绩增长对冲经济周期波动。

#### 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，有效保障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) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等新法规、相关监管要求以及公司业务发展实际，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和监管要求，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，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实流动性风险管理规定、债券交易业务新规的各项控制要求，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) 持续督促落实投资者适当性管理法规，不断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) 深入践行“风险为本”的工作方法，落实反洗钱最新法规和监管要求，夯实反洗钱工作基础，加强客户身份识别，建立受益所有人识别机制，开展洗钱风险评估，完善洗钱风险控制措施，做好反洗钱宣传培训、系统支持、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，持续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) 进一步深入落实《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》，不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2018 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 2017 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、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总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，具备投资、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限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。

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

自 2018 年 1 月 30 日至 2018 年 9 月 21 日，本基金均存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

自 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 9 月 21 日，本基金均存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。鉴于基金份额持有人数量的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在易方达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(2019)审字第 60468000\_G48 号

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。



## 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

## 6.3 其他信息

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估易方达深证成指交易型开放式指数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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 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：

(1)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。

(2)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。

(3)评价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。

(4)对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深证成指交易型开放式指数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深证成指交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5)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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 李明明

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2019 年 3 月 25 日

## § 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,142,968.33	875,347.37
结算备付金		9,823.84	820.50
存出保证金		2,232.68	4,871.08
交易性金融资产	7.4.7.2	22,434,824.65	19,720,423.15
其中：股票投资		22,434,824.65	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	382.00	151.38
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>24,590,231.50</b>	<b>20,601,613.48</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		344,865.93	210,236.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,125.20	8,536.66
应付托管费		2,025.05	1,707.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,448.26	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	7.4.7.8	70,000.00	90,000.00
<b>负债合计</b>		<b>433,464.44</b>	<b>313,550.94</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	32,411,936.00	18,001,380.00
未分配利润	7.4.7.10	-8,255,168.94	2,286,682.54
<b>所有者权益合计</b>		<b>24,156,767.06</b>	<b>20,288,062.54</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>24,590,231.50</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。

2.报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7453 元，基金份额总额 32,411,936.00 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	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>-7,524,981.85</b>	<b>6,642,863.36</b>
1.利息收入		6,829.34	298,703.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,828.25	94,690.07
债券利息收入		1.09	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）		-1,568,325.03	4,431,995.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,781,928.20	3,615,895.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	399.58	844.49
资产支持证券投资		-	-
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	213,203.59	815,254.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,939,010.02	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）	7.4.7.17	-24,476.14	9,887.99
<b>减：二、费用</b>		<b>439,675.75</b>	<b>935,846.88</b>
1. 管理人报酬		99,347.37	204,601.30
2. 托管费		19,869.43	40,920.26
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	18,378.95	435,600.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-

7. 其他费用	7.4.7.19	302,080.00	254,724.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,964,657.60</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>-7,964,657.60</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。

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	18,001,380.00	2,286,682.54	20,288,062.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,964,657.60	-7,964,657.60
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）	14,410,556.00	-2,577,193.88	11,833,362.12
其中：1.基金申购款	21,267,911.00	-4,068,587.06	17,199,323.94
2.基金赎回款	-6,857,355.00	1,491,393.18	-5,365,961.82
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)	32,411,936.00	-8,255,168.94	24,156,767.06
项目	上年度可比期间		
	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。

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：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

#### 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。

#### 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。

##### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 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。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

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。

### （4）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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 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	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	2,142,968.33	875,347.37
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,142,968.33	875,347.37

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	26,471,557.58	22,434,824.65	-4,036,732.93
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		26,471,557.58	22,434,824.65	-4,036,732.93
项目		上年度末		
		2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		17,813,546.06	19,715,823.15	1,902,277.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,600.00	4,600.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,600.00	4,600.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		17,818,146.06	19,720,423.15	1,902,277.09

#### 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	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	376.60	148.35

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	4.40	0.30
应收债券利息	-	0.53
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.00	2.20
合计	382.00	151.38

#### 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	6,448.26	3,070.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	6,448.26	3,070.81

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	20,000.00	40,000.00
其他应付款	50,000.00	50,000.00
合计	70,000.00	90,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元



项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,001,380.00	18,001,380.00
本期申购	21,267,911.00	21,267,911.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,857,355.00	-6,857,355.00
本期末	32,411,936.00	32,411,936.00

## 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	2,600,948.57	-314,266.03	2,286,682.54
本期利润	-2,025,647.58	-5,939,010.02	-7,964,657.60
本期基金份额交易产生的变动数	1,459,025.67	-4,036,219.55	-2,577,193.88
其中：基金申购款	2,212,940.85	-6,281,527.91	-4,068,587.06
基金赎回款	-753,915.18	2,245,308.36	1,491,393.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,034,326.66	-10,289,495.60	-8,255,168.94

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,607.55	76,243.26
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	203.25	17,715.82
其他	17.45	730.99

合计	6,828.25	94,690.07
----	----------	-----------

#### 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 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合 同生效日）至2017年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-895,589.76	405,461.95
股票投资收益——赎回差价收入	-886,338.44	3,210,433.67
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,781,928.20	3,615,895.62

##### 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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合 同生效日）至2017年12月31 日
卖出股票成交总额	3,179,293.62	31,416,121.88
减：卖出股票成本总额	4,074,883.38	31,010,659.93
买卖股票差价收入	-895,589.76	405,461.95

##### 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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合 同生效日）至2017年12 月31日
赎回基金份额对价总额	4,581,920.58	453,417,667.64
减：现金支付赎回款总额	-32,645.42	40,802,241.64
减：赎回股票成本总额	5,500,904.44	409,404,992.33
赎回差价收入	-886,338.44	3,210,433.67

##### 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 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合 同生效日）至2017年12月31 日
----	---------------------------------	--

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,401.20	7,945.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,000.00	7,099.95
减：应收利息总额	1.62	1.30
买卖债券差价收入	399.58	844.49

#### 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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	213,203.59	815,254.95
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	213,203.59	815,254.95

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-5,939,010.02	1,902,277.09
——股票投资	-5,939,010.02	1,902,277.09
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-5,939,010.02	1,902,277.09

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同生效日）至 2017年12月31日
基金赎回费收入	1,176.06	-
基金申购费收入	5,072.50	-
替代损益收入	-30,724.70	9,887.99
其他	-	-
基金申购费收入	-	-
合计	-24,476.14	9,887.99

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

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同生效日）至 2017年12月31日
交易所市场交易费用	18,378.95	435,600.45
银行间市场交易费用	-	-
合计	18,378.95	435,600.45

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00

信息披露费	-	20,000.00
银行汇划费	1,080.00	2,610.58
银行间账户维护费	21,000.00	6,000.00
上市费	60,000.00	70,000.00
指数使用费	200,000.00	135,714.29
其他	-	400.00
合计	302,080.00	254,724.87

#### 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。

#### 7.4.10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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 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	99,347.37	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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 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	19,869.43	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。

**7.4.10.3 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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 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	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	26,410,556.00	81.48%	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。

## 7.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	2,142,968.33	6,607.55	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。

## 7.4.10.6 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	总金额

				位：股/张)	
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

#### 7.4.10.7 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。

#### 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（2018 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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	4.87	2019-01-02	4.38	12,150	53,661.44	59,170.50	-
000987	越秀金控	2018-12-25	重大事项停牌	7.97	2019-01-10	8.77	1,344	12,050.46	10,711.68	-
002183	怡亚通	2018-12-25	重大事项停牌	5.01	2019-01-02	4.96	6,800	46,836.15	34,068.00	-

##### 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 2018 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 2018 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、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。于 2018 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 0.00%(2017 年 12 月 31 日：0.02%)。

##### 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 2018年12月31日	上年度末 2017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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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

#### 7.4.13.2.4 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	4,600.53
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	4,600.53

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**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。

于 2018 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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 2018年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,142,968.33	-	-	-	2,142,968.33
结算备付金	9,823.84	-	-	-	9,823.84
存出保证金	2,232.68	-	-	-	2,232.68
交易性金融资产	-	-	-	22,434,824.65	22,434,824.65
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	-	-	-	382.00	382.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,155,024.85	-	-	22,435,206.65	24,590,231.50
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	-	-	-	344,865.93	344,865.93
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,125.20	10,125.20
应付托管费	-	-	-	2,025.05	2,025.05

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,448.26	6,448.26
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债总计	-	-	-	433,464.44	433,464.44
利率敏感度缺口	2,155,024.85	-	-	22,001,742.21	24,156,767.06
<b>上年度末</b>					
<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	875,347.37	-	-	-	875,347.37
结算备付金	820.50	-	-	-	820.50
存出保证金	4,871.08	-	-	-	4,871.08
交易性金融资产	-	-	4,600.00	19,715,823.15	19,720,423.15
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	151.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	881,038.95	-	4,600.00	19,715,974.53	20,601,613.48
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	-	-	-	210,236.14	210,236.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,536.66	8,536.66
应付托管费	-	-	-	1,707.33	1,707.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,070.81	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	90,000.00
负债总计	-	-	-	313,550.94	313,550.94
利率敏感度缺口	881,038.95	-	4,600.00	19,402,423.59	20,288,062.54

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

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。

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	上年度末
		2018年12月31日	2017年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-	-
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	-	-

#### 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		上年度末	
	2018年12月31日		2017年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,434,824.65	92.87	19,715,823.15	97.18
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	22,434,824.65	92.87	19,715,823.15	97.18

#### 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,128,661.22	1,005,563.10
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,128,661.22	-1,005,563.10

#### 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 2018 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 22,330,874.47 元，属于第二层次的余额为 103,950.18 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 18,891,469.33 元，第二层次 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 2018 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	22,434,824.65	91.23
	其中：股票	22,434,824.65	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,152,792.17	8.75
8	其他各项资产	2,614.68	0.01
9	合计	24,590,231.50	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	609,854.46	2.52
B	采矿业	189,920.80	0.79
C	制造业	14,107,399.10	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	276,319.00	1.14
E	建筑业	207,726.80	0.86
F	批发和零售业	561,714.67	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	231,250.40	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,131,549.30	8.82
J	金融业	1,535,654.69	6.36
K	房地产业	1,235,881.64	5.12
L	租赁和商务服务业	314,650.72	1.30
M	科学研究和技术服务业	80,855.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	166,869.80	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	335,407.16	1.39
R	文化、体育和娱乐业	412,058.61	1.71
S	综合	37,712.50	0.16
	合计	22,434,824.65	92.87

### 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	000651	格力电器	21,600	770,904.00	3.19
2	000333	美的集团	20,800	766,688.00	3.17

3	300498	温氏股份	17,237	451,264.66	1.87
4	000002	万科 A	18,311	436,168.02	1.81
5	000858	五粮液	8,300	422,304.00	1.75
6	002415	海康威视	15,811	407,291.36	1.69
7	000001	平安银行	37,900	355,502.00	1.47
8	000725	京东方 A	117,000	307,710.00	1.27
9	002304	洋河股份	2,755	260,953.60	1.08
10	300059	东方财富	17,680	213,928.00	0.89
11	000063	中兴通讯	10,800	211,572.00	0.88
12	002142	宁波银行	12,150	197,073.00	0.82
13	002594	比亚迪	3,800	193,800.00	0.80
14	002027	分众传媒	34,628	181,450.72	0.75
15	002230	科大讯飞	7,150	176,176.00	0.73
16	000776	广发证券	13,600	172,448.00	0.71
17	000338	潍柴动力	21,500	165,550.00	0.69
18	000661	长春高新	914	159,950.00	0.66
19	002024	苏宁易购	15,900	156,615.00	0.65
20	000538	云南白药	2,100	155,316.00	0.64
21	002475	立讯精密	10,882	153,000.92	0.63
22	001979	招商蛇口	8,800	152,680.00	0.63
23	000568	泸州老窖	3,300	134,178.00	0.56
24	002008	大族激光	4,100	124,476.00	0.52
25	000166	申万宏源	29,900	121,693.00	0.50
26	000100	TCL 集团	48,900	119,805.00	0.50
27	000895	双汇发展	4,400	103,796.00	0.43
28	300142	沃森生物	5,300	101,230.00	0.42
29	300015	爱尔眼科	3,800	99,940.00	0.41
30	002466	天齐锂业	3,370	98,808.40	0.41
31	002044	美年健康	6,600	98,670.00	0.41
32	002202	金风科技	9,717	97,072.83	0.40
33	000783	长江证券	18,600	95,790.00	0.40
34	000069	华侨城 A	15,000	95,250.00	0.39
35	300124	汇川技术	4,526	91,153.64	0.38
36	000423	东阿阿胶	2,300	90,965.00	0.38
37	002422	科伦药业	4,300	88,795.00	0.37
38	002007	华兰生物	2,700	88,560.00	0.37
39	300003	乐普医疗	4,200	87,402.00	0.36
40	002236	大华股份	7,500	85,950.00	0.36
41	300122	智飞生物	2,172	84,186.72	0.35
42	002736	国信证券	10,053	84,143.61	0.35
43	002456	欧菲科技	9,100	83,629.00	0.35
44	300408	三环集团	4,900	82,908.00	0.34
45	000963	华东医药	3,100	82,026.00	0.34
46	000413	东旭光电	18,100	81,450.00	0.34

47	002460	赣锋锂业	3,650	80,592.00	0.33
48	000768	中航飞机	6,000	79,440.00	0.33
49	300347	泰格医药	1,836	78,489.00	0.32
50	300136	信维通信	3,600	77,796.00	0.32
51	002714	牧原股份	2,700	77,625.00	0.32
52	000157	中联重科	21,200	75,472.00	0.31
53	000656	金科股份	12,000	74,280.00	0.31
54	002311	海大集团	3,200	74,144.00	0.31
55	300024	机器人	5,600	74,032.00	0.31
56	002739	万达电影	3,350	73,130.50	0.30
57	002916	深南电路	900	72,153.00	0.30
58	300144	宋城演艺	3,300	70,455.00	0.29
59	300628	亿联网络	900	69,894.00	0.29
60	000876	新希望	9,500	69,160.00	0.29
61	002352	顺丰控股	2,100	68,775.00	0.28
62	300750	宁德时代	900	66,420.00	0.27
63	002673	西部证券	8,600	65,962.00	0.27
64	000703	恒逸石化	5,620	64,742.40	0.27
65	000425	徐工机械	20,000	64,600.00	0.27
66	002410	广联达	3,100	64,511.00	0.27
67	002146	荣盛发展	8,100	64,395.00	0.27
68	000728	国元证券	9,200	64,216.00	0.27
69	000625	长安汽车	9,700	63,923.00	0.26
70	300253	卫宁健康	5,120	63,795.20	0.26
71	002241	歌尔股份	9,200	63,296.00	0.26
72	002001	新和成	4,210	63,192.10	0.26
73	002179	中航光电	1,870	62,981.60	0.26
74	002065	东华软件	8,900	61,855.00	0.26
75	300146	汤臣倍健	3,600	61,164.00	0.25
76	002821	凯莱英	900	61,065.00	0.25
77	000750	国海证券	13,900	60,604.00	0.25
78	000977	浪潮信息	3,760	59,859.20	0.25
79	002602	世纪华通	2,880	59,472.00	0.25
80	000540	中天金融	12,150	59,170.50	0.24
81	002129	中环股份	8,100	58,563.00	0.24
82	300070	碧水源	7,500	58,500.00	0.24
83	000998	隆平高科	3,906	57,808.80	0.24
84	000860	顺鑫农业	1,800	57,402.00	0.24
85	300017	网宿科技	7,300	57,159.00	0.24
86	000623	吉林敖东	3,960	57,142.80	0.24
87	000401	冀东水泥	4,600	56,948.00	0.24
88	002465	海格通信	7,300	56,940.00	0.24
89	000709	河钢股份	20,000	56,800.00	0.24
90	000630	铜陵有色	28,800	56,736.00	0.23

91	002405	四维图新	4,000	56,440.00	0.23
92	300383	光环新网	4,400	55,748.00	0.23
93	002439	启明星辰	2,700	55,512.00	0.23
94	002271	东方雨虹	4,250	55,037.50	0.23
95	300450	先导智能	1,898	54,928.12	0.23
96	002049	紫光国微	1,900	54,910.00	0.23
97	300760	迈瑞医疗	500	54,610.00	0.23
98	002493	荣盛石化	5,375	54,233.75	0.22
99	000503	国新健康	3,400	53,992.00	0.22
100	000690	宝新能源	8,000	53,840.00	0.22
101	002223	鱼跃医疗	2,742	53,770.62	0.22
102	000786	北新建材	3,900	53,664.00	0.22
103	300296	利亚德	6,852	52,691.88	0.22
104	000778	新兴铸管	12,100	52,151.00	0.22
105	002195	二三四五	14,100	52,029.00	0.22
106	002797	第一创业	9,580	51,923.60	0.21
107	002624	完美世界	1,864	51,912.40	0.21
108	002081	金螳螂	6,400	51,840.00	0.21
109	002384	东山精密	4,550	51,369.50	0.21
110	002340	格林美	12,960	49,766.40	0.21
111	002268	卫士通	2,768	49,436.48	0.20
112	002050	三花智控	3,865	49,046.85	0.20
113	002038	双鹭药业	1,971	48,900.51	0.20
114	002153	石基信息	1,875	48,675.00	0.20
115	000596	古井贡酒	900	48,564.00	0.20
116	002281	光迅科技	1,800	48,348.00	0.20
117	000830	鲁西化工	4,900	48,020.00	0.20
118	002092	中泰化学	6,800	47,940.00	0.20
119	000581	威孚高科	2,700	47,682.00	0.20
120	002032	苏泊尔	900	47,250.00	0.20
121	000961	中南建设	8,400	47,124.00	0.20
122	002572	索菲亚	2,800	46,900.00	0.19
123	002075	沙钢股份	5,800	46,574.00	0.19
124	300601	康泰生物	1,300	46,514.00	0.19
125	002508	老板电器	2,271	45,851.49	0.19
126	000997	新大陆	3,100	45,384.00	0.19
127	002310	东方园林	6,500	45,240.00	0.19
128	000999	华润三九	1,800	44,748.00	0.19
129	002812	恩捷股份	900	44,469.00	0.18
130	002506	协鑫集成	8,800	44,000.00	0.18
131	002500	山西证券	7,400	43,808.00	0.18
132	000418	小天鹅 A	1,000	43,250.00	0.18
133	002507	涪陵榨菜	2,000	43,200.00	0.18
134	300168	万达信息	3,600	43,164.00	0.18

135	000825	太钢不锈	10,400	43,056.00	0.18
136	002470	金正大	6,800	42,976.00	0.18
137	000060	中金岭南	10,850	42,966.00	0.18
138	002085	万丰奥威	5,460	42,315.00	0.18
139	000975	银泰资源	4,120	41,982.80	0.17
140	000686	东北证券	6,700	41,942.00	0.17
141	000839	中信国安	12,400	41,788.00	0.17
142	002127	南极电商	5,550	41,736.00	0.17
143	300315	掌趣科技	11,800	41,654.00	0.17
144	002399	海普瑞	1,800	41,490.00	0.17
145	000039	中集集团	3,900	41,262.00	0.17
146	000066	中国长城	8,700	41,238.00	0.17
147	300226	上海钢联	900	40,977.00	0.17
148	002221	东华能源	5,069	40,856.14	0.17
149	300413	芒果超媒	1,100	40,711.00	0.17
150	002558	巨人网络	2,100	40,677.00	0.17
151	000050	深天马 A	4,100	40,221.00	0.17
152	000028	国药一致	967	40,072.48	0.17
153	002252	上海莱士	5,000	40,050.00	0.17
154	002110	三钢闽光	3,100	39,649.00	0.16
155	000983	西山煤电	7,200	39,528.00	0.16
156	002294	信立泰	1,886	39,398.54	0.16
157	300274	阳光电源	4,400	39,248.00	0.16
158	002013	中航机电	6,025	39,222.75	0.16
159	000671	阳光城	7,500	38,925.00	0.16
160	000008	神州高铁	10,000	38,900.00	0.16
161	002074	国轩高科	3,343	38,645.08	0.16
162	300009	安科生物	2,882	38,503.52	0.16
163	002358	森源电气	2,157	38,394.60	0.16
164	300166	东方国信	3,680	38,124.80	0.16
165	002371	北方华创	1,000	37,760.00	0.16
166	000009	中国宝安	8,750	37,712.50	0.16
167	002138	顺络电子	2,700	37,368.00	0.15
168	300666	江丰电子	900	37,188.00	0.15
169	002078	太阳纸业	6,500	37,050.00	0.15
170	000627	天茂集团	6,600	37,026.00	0.15
171	300203	聚光科技	1,441	36,961.65	0.15
172	300014	亿纬锂能	2,351	36,957.72	0.15
173	300308	中际旭创	900	36,621.00	0.15
174	300088	长信科技	8,800	36,520.00	0.15
175	000932	华菱钢铁	6,000	36,360.00	0.15
176	000547	航天发展	4,800	36,288.00	0.15
177	002831	裕同科技	900	36,054.00	0.15
178	000988	华工科技	3,016	36,011.04	0.15

179	300676	华大基因	600	36,000.00	0.15
180	000513	丽珠集团	1,420	35,713.00	0.15
181	002640	跨境通	3,300	35,640.00	0.15
182	002217	合力泰	7,600	35,568.00	0.15
183	300271	华宇软件	2,365	35,498.65	0.15
184	000402	金融街	5,500	35,420.00	0.15
185	002176	江特电机	6,000	35,220.00	0.15
186	300001	特锐德	2,000	35,060.00	0.15
187	000516	国际医学	7,066	34,976.70	0.14
188	300418	昆仑万维	2,700	34,722.00	0.14
189	300027	华谊兄弟	7,400	34,706.00	0.14
190	000598	兴蓉环境	8,600	34,658.00	0.14
191	000488	晨鸣纸业	6,150	34,501.50	0.14
192	002353	杰瑞股份	2,300	34,500.00	0.14
193	300073	当升科技	1,242	34,390.98	0.14
194	300033	同花顺	900	34,380.00	0.14
195	000960	锡业股份	3,600	34,344.00	0.14
196	000089	深圳机场	4,400	34,276.00	0.14
197	000826	启迪桑德	3,280	34,079.20	0.14
198	002183	怡亚通	6,800	34,068.00	0.14
199	000046	泛海控股	7,212	33,680.04	0.14
200	000732	泰禾集团	2,400	33,648.00	0.14
201	002168	深圳惠程	3,400	33,626.00	0.14
202	002174	游族网络	1,800	33,462.00	0.14
203	300251	光线传媒	4,400	33,440.00	0.14
204	000887	中鼎股份	3,300	33,396.00	0.14
205	002373	千方科技	3,000	33,360.00	0.14
206	002341	新纶科技	2,800	33,264.00	0.14
207	000040	东旭蓝天	4,600	33,258.00	0.14
208	002589	瑞康医药	4,765	33,212.05	0.14
209	002601	龙麟佰利	2,700	33,210.00	0.14
210	000738	航发控制	2,749	33,152.94	0.14
211	300036	超图软件	1,800	32,994.00	0.14
212	000898	鞍钢股份	6,400	32,832.00	0.14
213	000729	燕京啤酒	5,800	32,712.00	0.14
214	000681	视觉中国	1,400	32,648.00	0.14
215	002185	华天科技	7,982	32,406.92	0.13
216	300699	光威复材	900	32,220.00	0.13
217	300012	华测检测	4,900	32,095.00	0.13
218	002180	纳思达	1,400	32,088.00	0.13
219	002191	劲嘉股份	4,100	32,021.00	0.13
220	002396	星网锐捷	1,859	32,011.98	0.13
221	002385	大北农	10,000	32,000.00	0.13
222	000883	湖北能源	8,700	31,929.00	0.13

223	002019	亿帆医药	2,955	31,618.50	0.13
224	002583	海能达	3,987	31,457.43	0.13
225	000938	紫光股份	998	31,197.48	0.13
226	002273	水晶光电	3,250	31,070.00	0.13
227	002463	沪电股份	4,300	30,831.00	0.13
228	002157	正邦科技	5,800	30,798.00	0.13
229	000559	万向钱潮	5,989	30,663.68	0.13
230	002266	浙富控股	7,500	30,525.00	0.13
231	000930	中粮生化	4,100	30,422.00	0.13
232	000878	云南铜业	3,836	30,419.48	0.13
233	300170	汉得信息	3,100	30,318.00	0.13
234	002250	联化科技	3,200	30,176.00	0.12
235	000970	中科三环	4,100	30,053.00	0.12
236	002023	海特高新	2,900	30,015.00	0.12
237	300285	国瓷材料	1,800	30,006.00	0.12
238	002004	华邦健康	6,500	29,965.00	0.12
239	002595	豪迈科技	1,871	29,936.00	0.12
240	300068	南都电源	2,100	29,862.00	0.12
241	002701	奥瑞金	5,900	29,854.00	0.12
242	002407	多氟多	2,700	29,592.00	0.12
243	002372	伟星新材	1,900	29,469.00	0.12
244	002120	韵达股份	968	29,330.40	0.12
245	000415	渤海租赁	8,100	29,160.00	0.12
246	000528	柳工	4,790	29,075.30	0.12
247	000591	太阳能	9,800	29,008.00	0.12
248	300558	贝达药业	900	28,773.00	0.12
249	300133	华策影视	3,200	28,672.00	0.12
250	300316	晶盛机电	2,860	28,657.20	0.12
251	002152	广电运通	5,100	28,611.00	0.12
252	002597	金禾实业	1,800	28,602.00	0.12
253	000935	四川双马	1,900	28,576.00	0.12
254	002491	通鼎互联	3,600	28,368.00	0.12
255	000027	深圳能源	5,400	28,350.00	0.12
256	002155	湖南黄金	3,600	28,260.00	0.12
257	002035	华帝股份	3,150	27,877.50	0.12
258	000902	新洋丰	3,100	27,776.00	0.11
259	002030	达安基因	2,730	27,736.80	0.11
260	300747	锐科激光	200	27,520.00	0.11
261	002440	闰土股份	3,000	27,000.00	0.11
262	300113	顺网科技	2,100	26,691.00	0.11
263	000400	许继电气	3,000	26,670.00	0.11
264	300098	高新兴	3,911	26,438.36	0.11
265	002368	太极股份	1,139	26,424.80	0.11
266	002610	爱康科技	16,800	26,376.00	0.11

267	002444	巨星科技	2,742	25,994.16	0.11
268	000717	韶钢松山	5,700	25,935.00	0.11
269	300207	欣旺达	3,000	25,770.00	0.11
270	300182	捷成股份	6,000	25,740.00	0.11
271	002025	航天电器	1,200	25,716.00	0.11
272	000807	云铝股份	6,600	25,608.00	0.11
273	002555	三七互娱	2,700	25,488.00	0.11
274	002408	齐翔腾达	3,700	25,308.00	0.10
275	002497	雅化集团	3,800	25,232.00	0.10
276	000800	一汽轿车	3,800	25,156.00	0.10
277	002280	联络互动	6,500	25,155.00	0.10
278	000831	五矿稀土	3,000	25,110.00	0.10
279	002244	滨江集团	6,300	25,074.00	0.10
280	002051	中工国际	2,260	25,040.80	0.10
281	002285	世联行	4,926	25,024.08	0.10
282	002151	北斗星通	1,185	25,003.50	0.10
283	000059	华锦股份	4,200	24,948.00	0.10
284	002603	以岭药业	2,371	24,800.66	0.10
285	002643	万润股份	2,450	24,794.00	0.10
286	300188	美亚柏科	1,900	24,738.00	0.10
287	300026	红日药业	8,100	24,705.00	0.10
288	300294	博雅生物	915	24,695.85	0.10
289	300078	思创医惠	2,483	24,681.02	0.10
290	002047	宝鹰股份	3,600	24,660.00	0.10
291	002010	传化智联	3,772	24,518.00	0.10
292	300038	数知科技	2,600	24,258.00	0.10
293	002449	国星光电	2,330	24,185.40	0.10
294	000869	张裕 A	930	24,180.00	0.10
295	002233	塔牌集团	2,400	24,144.00	0.10
296	000793	华闻传媒	8,100	24,057.00	0.10
297	000031	中粮地产	4,900	23,912.00	0.10
298	002841	视源股份	420	23,898.00	0.10
299	000758	中色股份	6,500	23,725.00	0.10
300	000683	远兴能源	10,000	23,700.00	0.10
301	002383	合众思壮	2,000	23,660.00	0.10
302	300180	华峰超纤	2,100	23,415.00	0.10
303	002212	南洋股份	2,100	23,352.00	0.10
304	300244	迪安诊断	1,538	23,331.46	0.10
305	000848	承德露露	2,900	23,316.00	0.10
306	000006	深振业 A	4,500	23,310.00	0.10
307	002411	延安必康	1,104	23,272.32	0.10
308	300212	易华录	1,120	23,206.40	0.10
309	002299	圣农发展	1,400	23,156.00	0.10
310	300377	赢时胜	2,090	23,073.60	0.10



311	000563	陕国投 A	8,590	23,021.20	0.10
312	002376	新北洋	1,500	23,010.00	0.10
313	300222	科大智能	1,473	22,831.50	0.09
314	300115	长盈精密	2,755	22,563.45	0.09
315	002262	恩华药业	2,500	22,550.00	0.09
316	300010	立思辰	3,100	22,506.00	0.09
317	001965	招商公路	2,800	22,484.00	0.09
318	002839	张家港行	4,200	22,470.00	0.09
319	002366	台海核电	2,392	22,436.96	0.09
320	002563	森马服饰	2,500	22,300.00	0.09
321	300324	旋极信息	3,974	22,294.14	0.09
322	300055	万邦达	2,900	22,243.00	0.09
323	300357	我武生物	600	22,194.00	0.09
324	000156	华数传媒	2,789	22,116.77	0.09
325	300496	中科创达	1,000	22,100.00	0.09
326	000926	福星股份	3,600	22,032.00	0.09
327	002389	航天彩虹	1,800	21,978.00	0.09
328	000718	苏宁环球	6,900	21,942.00	0.09
329	300433	蓝思科技	3,370	21,938.70	0.09
330	002131	利欧股份	14,835	21,807.45	0.09
331	002573	清新环境	3,000	21,660.00	0.09
332	002061	浙江交科	2,100	21,567.00	0.09
333	002468	申通快递	1,300	21,385.00	0.09
334	002709	天赐材料	986	21,356.76	0.09
335	300367	东方网力	2,400	21,288.00	0.09
336	002091	江苏国泰	3,800	21,280.00	0.09
337	002670	国盛金控	2,101	21,178.08	0.09
338	002421	达实智能	5,400	21,168.00	0.09
339	300451	创业软件	1,100	21,065.00	0.09
340	000933	神火股份	5,400	21,060.00	0.09
340	300476	胜宏科技	1,800	21,060.00	0.09
342	000078	海王生物	7,000	20,860.00	0.09
343	002419	天虹股份	1,900	20,843.00	0.09
344	002128	露天煤业	2,900	20,764.00	0.09
345	002028	思源电气	2,100	20,727.00	0.09
346	000021	深科技	3,600	20,700.00	0.09
347	002608	江苏国信	2,700	20,655.00	0.09
348	000877	天山股份	2,900	20,619.00	0.09
349	000712	锦龙股份	2,269	20,602.52	0.09
350	000685	中山公用	2,940	20,580.00	0.09
351	002056	横店东磁	3,700	20,461.00	0.08
352	002511	中顺洁柔	2,400	20,448.00	0.08
353	300355	蒙草生态	5,240	20,383.60	0.08
354	002745	木林森	1,800	20,322.00	0.08

355	300199	翰宇药业	2,166	20,230.44	0.08
356	002237	恒邦股份	2,400	20,112.00	0.08
357	002544	杰赛科技	1,853	20,049.46	0.08
358	300459	金科文化	2,700	19,845.00	0.08
359	002048	宁波华翔	1,900	19,817.00	0.08
360	300101	振芯科技	2,000	19,800.00	0.08
361	002505	大康农业	12,200	19,764.00	0.08
362	300287	飞利信	5,200	19,656.00	0.08
363	000789	万年青	1,800	19,602.00	0.08
364	300458	全志科技	966	19,320.00	0.08
365	002773	康弘药业	567	19,317.69	0.08
366	002618	丹邦科技	1,400	19,278.00	0.08
367	300618	寒锐钴业	260	19,260.80	0.08
368	300037	新宙邦	800	19,240.00	0.08
369	000937	冀中能源	5,100	19,227.00	0.08
370	000799	酒鬼酒	1,200	19,176.00	0.08
371	002690	美亚光电	900	19,152.00	0.08
372	000507	珠海港	2,900	19,140.00	0.08
373	000301	东方盛虹	3,500	19,110.00	0.08
373	300054	鼎龙股份	3,000	19,110.00	0.08
375	002108	沧州明珠	4,538	19,104.98	0.08
376	002716	金贵银业	3,100	19,003.00	0.08
377	000539	粤电力 A	4,100	18,983.00	0.08
378	300463	迈克生物	1,300	18,980.00	0.08
379	300159	新研股份	4,100	18,901.00	0.08
380	000034	神州数码	1,400	18,830.00	0.08
381	300053	欧比特	2,276	18,572.16	0.08
382	002402	和而泰	3,000	18,540.00	0.08
383	300002	神州泰岳	5,600	18,480.00	0.08
384	002807	江阴银行	3,600	18,288.00	0.08
385	002665	首航节能	6,500	18,265.00	0.08
386	300616	尚品宅配	300	18,231.00	0.08
387	000650	仁和药业	3,300	18,084.00	0.07
388	300257	开山股份	1,800	17,982.00	0.07
389	000727	华东科技	12,200	17,934.00	0.07
390	300454	深信服	200	17,920.00	0.07
391	000901	航天科技	2,000	17,680.00	0.07
392	000989	九芝堂	1,800	17,658.00	0.07
393	002242	九阳股份	1,100	17,611.00	0.07
394	002926	华西证券	2,100	17,577.00	0.07
395	002614	奥佳华	1,100	17,545.00	0.07
396	000818	航锦科技	1,900	17,537.00	0.07
397	002424	贵州百灵	2,000	17,500.00	0.07
398	000016	深康佳 A	5,400	17,496.00	0.07

399	002648	卫星石化	1,800	17,406.00	0.07
400	002042	华孚时尚	3,200	17,376.00	0.07
401	002249	大洋电机	5,255	17,341.50	0.07
402	300197	铁汉生态	4,550	17,244.50	0.07
403	002359	北讯集团	2,100	17,241.00	0.07
404	002431	棕榈股份	4,800	17,136.00	0.07
405	000158	常山北明	3,230	16,860.60	0.07
406	000525	红太阳	1,200	16,836.00	0.07
407	000555	神州信息	1,800	16,812.00	0.07
408	002302	西部建设	1,900	16,796.00	0.07
409	300529	健帆生物	400	16,600.00	0.07
410	300145	中金环境	5,100	16,575.00	0.07
411	000426	兴业矿业	3,300	16,434.00	0.07
412	002156	通富微电	2,300	16,399.00	0.07
413	002517	恺英网络	4,400	16,324.00	0.07
414	002343	慈文传媒	1,807	16,299.14	0.07
415	002912	中新赛克	200	16,212.00	0.07
416	002596	海南瑞泽	2,700	16,173.00	0.07
417	002727	一心堂	900	16,002.00	0.07
418	000088	盐田港	3,200	16,000.00	0.07
419	002488	金固股份	2,400	15,912.00	0.07
420	000537	广宇发展	2,100	15,729.00	0.07
421	300353	东土科技	1,800	15,714.00	0.07
422	002920	德赛西威	900	15,615.00	0.06
423	002292	奥飞娱乐	2,700	15,282.00	0.06
424	002600	领益智造	6,100	15,250.00	0.06
425	300482	万孚生物	600	15,246.00	0.06
426	300567	精测电子	300	15,144.00	0.06
427	300266	兴源环境	4,250	15,002.50	0.06
428	000062	深圳华强	900	14,994.00	0.06
429	002390	信邦制药	3,643	14,899.87	0.06
430	300085	银之杰	1,861	14,813.56	0.06
431	000723	美锦能源	4,600	14,766.00	0.06
432	000980	众泰汽车	3,400	14,722.00	0.06
433	002434	万里扬	2,200	14,498.00	0.06
434	002509	天广中茂	6,100	14,457.00	0.06
435	300373	扬杰科技	1,000	14,440.00	0.06
436	000910	大亚圣象	1,400	14,434.00	0.06
437	000990	诚志股份	1,200	14,412.00	0.06
438	002429	兆驰股份	7,492	14,234.80	0.06
439	000921	海信家电	2,000	14,140.00	0.06
440	002251	步步高	1,900	14,098.00	0.06
441	300118	东方日升	2,471	14,059.99	0.06
442	300339	润和软件	1,500	13,680.00	0.06

443	000564	供销大集	5,400	13,662.00	0.06
444	300474	景嘉微	373	13,487.68	0.06
445	002635	安洁科技	1,188	13,460.04	0.06
446	002382	蓝帆医疗	900	13,374.00	0.06
447	000155	川能动力	3,700	13,320.00	0.06
448	002737	葵花药业	900	13,302.00	0.06
449	002501	利源精制	4,700	13,301.00	0.06
450	002002	鸿达兴业	4,600	13,248.00	0.05
451	002925	盈趣科技	300	13,164.00	0.05
452	002815	崇达技术	900	13,149.00	0.05
453	002258	利尔化学	1,000	13,140.00	0.05
454	000822	山东海化	2,700	13,095.00	0.05
455	300323	华灿光电	1,800	13,014.00	0.05
456	002607	亚夏汽车	1,800	12,960.00	0.05
457	000981	银亿股份	4,100	12,792.00	0.05
458	000710	贝瑞基因	400	12,760.00	0.05
459	002503	搜于特	5,400	12,690.00	0.05
460	000959	首钢股份	3,400	12,682.00	0.05
461	002625	光启技术	1,250	12,375.00	0.05
462	002430	杭氧股份	1,300	12,155.00	0.05
463	002080	中材科技	1,500	12,135.00	0.05
464	002320	海峡股份	900	12,105.00	0.05
465	002611	东方精工	3,200	12,000.00	0.05
466	000553	沙隆达 A	1,300	11,869.00	0.05
467	300348	长亮科技	700	11,501.00	0.05
468	300568	星源材质	500	11,095.00	0.05
469	002664	长鹰信质	900	11,052.00	0.05
470	002668	奥马电器	2,261	11,011.07	0.05
471	002681	奋达科技	2,937	10,749.42	0.04
472	000987	越秀金控	1,344	10,711.68	0.04
473	002512	达华智能	2,000	10,620.00	0.04
474	300409	道氏技术	800	10,488.00	0.04
475	300107	建新股份	1,100	10,373.00	0.04
476	002437	誉衡药业	3,700	10,360.00	0.04
477	000766	通化金马	1,500	10,290.00	0.04
478	002308	威创股份	2,300	10,235.00	0.04
479	002699	美盛文化	1,840	10,083.20	0.04
480	000617	中油资本	900	9,675.00	0.04
481	000587	金洲慈航	4,000	9,400.00	0.04
482	300741	华宝股份	300	9,321.00	0.04
483	002016	世荣兆业	900	8,118.00	0.03
484	002118	紫鑫药业	1,800	7,848.00	0.03
485	002930	宏川智慧	300	7,755.00	0.03
486	300504	天邑股份	300	7,728.00	0.03

487	300317	珈伟新能	1,300	6,110.00	0.03
488	002911	佛燃股份	300	5,058.00	0.02
489	300634	彩讯股份	200	4,774.00	0.02
490	002907	华森制药	200	3,768.00	0.02
491	002143	印纪传媒	1,300	3,718.00	0.02

#### 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	000333	美的集团	518,426.00	2.56
2	000651	格力电器	276,090.00	1.36
3	000858	五粮液	173,842.64	0.86
4	002027	分众传媒	170,989.00	0.84
5	002415	海康威视	149,091.00	0.73
6	000002	万科 A	145,652.00	0.72
7	300498	温氏股份	132,414.00	0.65
8	000001	平安银行	123,912.00	0.61
9	000725	京东方 A	120,174.00	0.59
10	002304	洋河股份	109,630.00	0.54
11	000538	云南白药	101,703.00	0.50
12	300059	东方财富	96,074.00	0.47
13	000661	长春高新	94,335.00	0.46
14	000776	广发证券	89,149.00	0.44
15	000568	泸州老窖	88,693.00	0.44
16	300750	宁德时代	81,113.00	0.40
17	002142	宁波银行	78,387.00	0.39
18	300601	康泰生物	70,693.00	0.35
19	002916	深南电路	66,114.00	0.33
20	002821	凯莱英	62,063.00	0.31

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	002450	康得新	85,410.00	0.42

2	300072	三聚环保	51,982.40	0.26
3	000792	盐湖股份	48,044.00	0.24
4	000651	格力电器	41,234.00	0.20
5	000568	泸州老窖	41,152.00	0.20
6	000917	电广传媒	37,862.00	0.19
7	000423	东阿阿胶	33,911.00	0.17
8	000049	德赛电池	32,978.00	0.16
9	300750	宁德时代	32,505.00	0.16
10	000333	美的集团	30,535.00	0.15
11	002460	赣锋锂业	29,770.00	0.15
12	000858	五粮液	29,714.00	0.15
13	002027	分众传媒	28,919.00	0.14
14	300203	聚光科技	28,327.00	0.14
15	300058	蓝色光标	27,857.00	0.14
16	000566	海南海药	27,430.00	0.14
17	000979	中弘退(退市)	25,761.80	0.13
18	000667	美好置业	24,534.00	0.12
19	000513	丽珠集团	24,420.00	0.12
20	002657	中科金财	23,998.00	0.12

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	11,820,666.34
卖出股票收入（成交）总额	3,179,293.62

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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 2018 年 2 月 7 日，大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实，对平安银行处以人民币四十万元行政罚款。

2018 年 3 月 14 日，中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，给予警告，没收违法所得 3,036,061.39 元，并处罚款 10,308,084.15 元，合计处罚金额 13,344,145.54 元。

2018 年 6 月 28 日，天津银监局针对平安银行贷款前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用的违法违规事实，罚款人民币 50 万元。

2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的违法行为，罚款人民币 140 万元。

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	2,232.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	382.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,614.68

#### 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	
		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
267	121,393.0 2	26,711,956. 00	82.41%	5,699,980.0 0	17.59%	26,410,556 .00	81.48%

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—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	陈建锋	1,421,900.00	6.77%
2	钱中明	651,800.00	3.10%
3	望华卓越（青岛）投资管理有限公司 —望华卓越高分红价值成长私募证券	250,900.00	1.19%



	投资基金		
4	田啟敏	200,000.00	0.95%
5	包承寬	179,711.00	0.86%
6	趙勇	150,013.00	0.71%
7	蘇明煜	141,800.00	0.68%
8	楊鳳玲	132,612.00	0.63%
9	何榮芬	109,001.00	0.52%
10	汪南英	100,019.00	0.48%
11	中國銀行股份有限公司—易方達深證 成指交易型開放式指數證券投資基金 联接基金	15,000,000.00	71.42%

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
本报告期期初基金份额总额	18,001,380.00
本报告期基金总申购份额	21,267,911.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,857,355.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,411,936.00

注：期末基金总份额包含场外份额 11,410,556 份；总申购份额包含场外总申购份额 12,267,911 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 857,355 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 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。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连续 2 年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	
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	1,555,175.00	10.39%	1,448.30	10.44%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	12,902,599.96	86.23%	12,016.64	86.65%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	504,546.00	3.37%	403.52	2.91%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少申万宏源证券有限公司一个交易单元,新增北京高华证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司各一个交易单元，新增国金证券股份有限公司两个交易单元。

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
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	4,638.80	62.68%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	2,762.40	37.32%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

### 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	2018-01-23
2	易方达基金管理有限公司关于调整易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金场外份额在直销中心申购、赎回业务数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-16
3	易方达基金管理有限公司关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-22
4	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-23
5	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-29
6	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、证券日报及基金管理人网站	2018-06-08
7	关于易方达基金管理有限公司北京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、证券日报及基金管理人网站	2018-09-10
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 基金增加国盛证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-12-20

## § 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	1	2018年01月01日~2018年12月31日	13,645,790.00	13,610,329.00	845,563.00	26,410,556.00	81.48%

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		日					
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

### § 13 备查文件目录

#### 13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.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

二〇一九年三月二十八日