

# 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金 联接基金

## 2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十八日

## 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金简称            | 易方达创业板 ETF 联接      |                  |
| 基金主代码           | 110026             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日         | 2011 年 9 月 20 日    |                  |
| 基金管理人           | 易方达基金管理有限公司        |                  |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 1,521,624,573.30 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 易方达创业板 ETF 联接 A    | 易方达创业板 ETF 联接 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 110026             | 004744           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,410,022,847.74 份 | 111,601,725.56 份 |

注：自 2017 年 6 月 2 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 6 月 5 日。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159915               |
| 基金运作方式       | 交易型开放式（ETF）          |
| 基金合同生效日      | 2011 年 9 月 20 日      |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所              |
| 上市日期         | 2011 年 12 月 9 日      |
| 基金管理人名称      | 易方达基金管理有限公司          |
| 基金托管人名称      | 中国工商银行股份有限公司         |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                               |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资策略   | 本基金为创业板 ETF 的联接基金。创业板 ETF 是采用完全复制法实现对创业板指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于创业板 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行创业板 ETF 的买卖。本基金可以参与股指期货交易，但必须根据风险管理的原则，以套期保值为目的。 |
| 业绩比较基准 | 创业板指数收益率 X95%+活期存款利率(税后)X5%                                                                                                                                                                                                                   |

|        |                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为创业板 ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资创业板 ETF 追踪业绩比较基准，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。 |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------|

### 2.2.1 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                   |
| 投资策略   | 本基金采取完全复制法进行投资，即按照创业板指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。本基金可以参与股指期货交易，但必须根据风险管理的原则，以套期保值为目的。 |
| 业绩比较基准 | 创业板指数                                                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，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，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           | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张南                    | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 020-85102688          | 010-66105798        |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088          | 95588               |
| 传真          |      | 020-85104666          | 010-66105799        |

### 2.4 信息披露方式

|                      |                                                                 |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 登载基金半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> |
| 基金半年度报告备置地点          | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼                                  |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日） |                    |
|---------------|--------------------------------------|--------------------|
|               | 易方达创业板 ETF 联接<br>A                   | 易方达创业板 ETF 联接<br>C |
| 本期已实现收益       | -62,270,242.70                       | -4,876,989.70      |

|                      |                              |                 |
|----------------------|------------------------------|-----------------|
| 本期利润                 | -179,137,024.39              | -22,201,628.36  |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.1366                      | -0.3602         |
| 本期基金份额净值增长率          | -7.13%                       | -7.23%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b> |                 |
|                      | 易方达创业板 ETF 联接 A              | 易方达创业板 ETF 联接 C |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.6603                       | 0.6588          |
| 期末基金资产净值             | 2,341,086,020.83             | 185,127,907.61  |
| 期末基金份额净值             | 1.6603                       | 1.6588          |

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。

### 3.2 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

易方达创业板 ETF 联接 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | -7.14%   | 1.95%       | -7.46%     | 1.97%         | 0.32%   | -0.02% |
| 过去三个月      | -13.99%  | 1.54%       | -14.71%    | 1.55%         | 0.72%   | -0.01% |
| 过去六个月      | -7.13%   | 1.66%       | -7.84%     | 1.67%         | 0.71%   | -0.01% |
| 过去一年       | -11.85%  | 1.39%       | -10.95%    | 1.39%         | -0.90%  | 0.00%  |
| 过去三年       | -45.26%  | 2.11%       | -41.67%    | 1.99%         | -3.59%  | 0.12%  |
| 自基金合同生效起至今 | 66.03%   | 1.92%       | 85.41%     | 1.93%         | -19.38% | -0.01% |

易方达创业板 ETF 联接 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -7.17%   | 1.95%       | -7.46%     | 1.97%         | 0.29%  | -0.02% |
| 过去三个月      | -14.06%  | 1.54%       | -14.71%    | 1.55%         | 0.65%  | -0.01% |
| 过去六个月      | -7.23%   | 1.66%       | -7.84%     | 1.67%         | 0.61%  | -0.01% |
| 过去一年       | -11.93%  | 1.38%       | -10.95%    | 1.39%         | -0.98% | -0.01% |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 自基金合同生效起至今 | -8.32%   | 1.35%       | -7.45%     | 1.35%         | -0.87% | 0.00%  |

注：自 2017 年 6 月 2 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 6 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

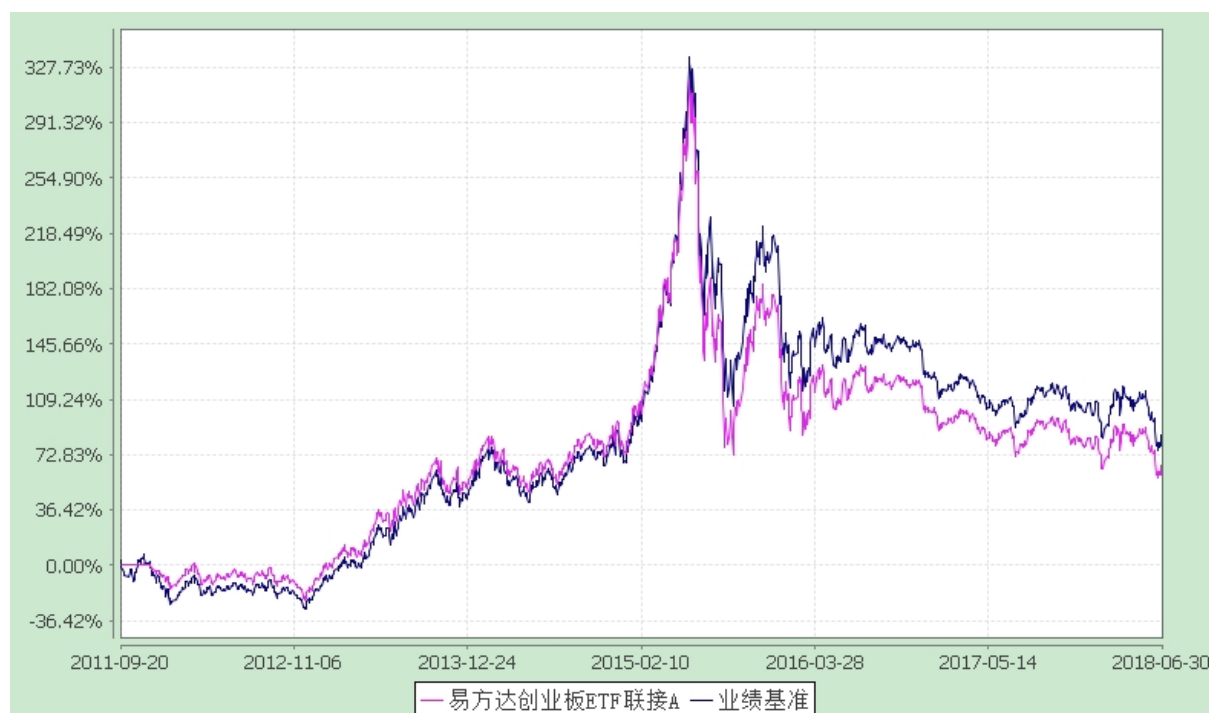
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

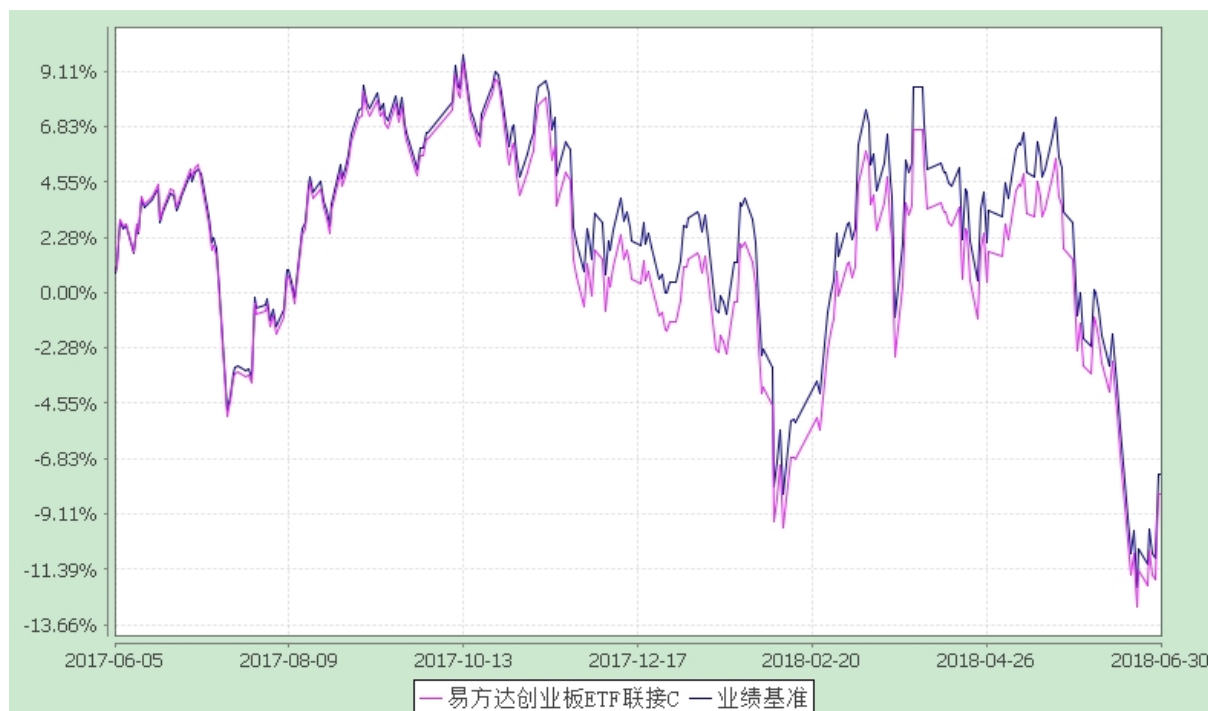
易方达创业板 ETF 联接 A

(2011 年 9 月 20 日至 2018 年 6 月 30 日)



易方达创业板 ETF 联接 C

(2017 年 6 月 5 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1.自 2017 年 6 月 2 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 6 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 66.03%，同期业绩比较基准收益率为 85.41%。C 类基金份额净值增长率为-8.32%，同期业绩比较基准收益率为-7.45%。

## 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、成都、大连等地设有分公司，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、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，投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、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 2018 年 6 月 30 日，易方达旗下管理的各类资产规模总计 1.3 万亿元，服务各类客户总数 7580 万户，公募基金累计分红超过 1000 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<br>基金经理<br>(助理) 期<br>限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                  |
|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|----------|----------------|---------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 任职<br>日期                     | 离任<br>日期 |                |                                                                     |
| 成曦  | 本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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 | 2016-05-07                   | -        | 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、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理                                       | 2017-07-18                   | -        | 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。   |

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 66 次，其中 64 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为创业板指，创业板指由深圳创业板块中规模大、流动性好、最具代表性的 100 只股票组成，综合反映创业板中最具影响力龙头企业的整体状况，集中体现了业绩高成长，产业新精尖的创业板特征。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2018 年上半年，国内宏观经济在多重压力下仍保持了较为稳健的增长，2 季度 GDP 同比增长 6.7%，较前值略回落 0.1 个百分点。证券市场上，A 股市场整体下跌。创业板指数今年前两个季度经历了先涨后跌，1 季度上涨 8.4%，在市场主流核心指数中排名靠前。虽然在 1 月底 2 月初伴随市场对中美贸易摩擦的担忧出现了急速下跌，但创业板指数自 2 月初至 5 月中展开了一波较强的反弹，涨幅领先各大主流宽基指数。5 月下旬，市场对创业板的股票质押爆仓风险担忧加剧，伴随着资管新规对股票市场的冲击、债务违约引发的信用债危机、中美之间贸易摩擦扩大的恐慌以及人民

币贬值等的不利影响下，创业板指呈现单边下跌态势，2 季度下跌 15.5%，上半年整体下跌 8.3%。上半年，对创业板指数走势拖累较大的是电子、传媒与公用事业，分别下跌 21.0%、21.2%、20.5%。

本基金是易方达创业板 ETF 的联接基金。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、赎回以及成分股调整事项，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 A 类基金份额净值为 1.6603 元，本报告期份额净值增长率为-7.13%；C 类基金份额净值为 1.6588 元，本报告期份额净值增长率为-7.23%；同期业绩比较基准收益率为-7.84%。本报告期，本基金日跟踪偏离度的均值为 0.02%，年化跟踪误差 0.53%，在合同规定的控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内金融去杠杆、国外中美贸易摩擦的大环境很难有大的转变，宏观经济存在着一定的下行压力，稳增长依将是政策重点。国内经济在“稳健的货币政策要松紧适度，保持适度的社会融资规模和流动性合理充裕”以及“积极的财政政策要更加积极”的协同配合下，继续着力扩大内需、稳定经济增长与优化经济结构。

A 股市场的结构伴随着互联互通的发展发生了较大变化。一方面，市场对优质股的追捧成为投资的主流方式，另一方面国内外的蓝筹股定价思路开始趋向一致。在互联互通中，北上的资金在沪市集中投资以上证 50 为代表蓝筹股，在深市，更多选择估值盈利比更为合适的特色龙头股票。市场结构的变化叠加前期市场大幅回调加速部分行业的内部分化：龙头企业市占持续扩张，边缘企业生存难度加大。

在经历了上半年大幅调整后，市场风险已有所释放，同时政策基调也逐渐由去杠杆逐步向稳杠杆过渡，前期恐慌情绪得到明显缓解。目前，A 股的整体估值水平明显回落，多数核心指数的估值已经回到低估区域。与此同时，我们观察到市场的投资行为有了以下变化：主流的投资思路已经由短中期的轮动策略（例如：大小盘轮动，价值成长轮动）向买入并长期持有投资策略转移。整个权益市场的投资久期在拉长。当前的指数低估区域也为投资者提供了一个合适的长期窗口。

综合来看，现阶段是长期资金逐步建仓的良好时机，一类是基本面持续向好并且估值合理的白马蓝筹，另一类是前期调整充分并已重新进入快速发展通道的中小创类股票。报告期末，创业板指 PE 为 39 倍，处于 17%的历史分位水平，明显处于历史较低水平，而 wind 盈利预测显示其 2018 年整体盈利增速 34%，大幅高于沪深 300、中证 500 等主流宽基指数，估值与盈利匹配度较好，具备

较高的长期配置价值。

作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达创业板 ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达创业板 ETF 联接 C:本报告期内未实施利润分配。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，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管理人——易方达基金管理有限公司在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投资运作、基金资产净值

计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                |                                  |
| 银行存款            | 138,884,734.52                 | 100,146,104.16                   |
| 结算备付金           | 678,870.82                     | 429,376.80                       |
| 存出保证金           | 398,276.27                     | 185,159.20                       |
| 交易性金融资产         | 2,387,763,502.68               | 1,438,657,623.15                 |
| 其中：股票投资         | 92,735,025.55                  | 46,432,916.60                    |
| 基金投资            | 2,295,028,477.13               | 1,392,194,306.55                 |
| 债券投资            | -                              | 30,400.00                        |
| 资产支持证券投资        | -                              | -                                |
| 贵金属投资           | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         | -                              | -                                |
| 应收利息            | 27,054.75                      | 19,302.97                        |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 18,284,148.24                  | 9,733,640.20                     |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | 68,715.28                      | 366,565.22                       |
| 资产总计            | 2,546,105,302.56               | 1,549,537,771.70                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |                                |                                  |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 短期借款          | -                | -                |
| 交易性金融负债       | -                | -                |
| 衍生金融负债        | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款     | -                | -                |
| 应付证券清算款       | 11,655,565.77    | 13,275,522.06    |
| 应付赎回款         | 7,040,614.31     | 4,226,850.90     |
| 应付管理人报酬       | 92,684.81        | 59,705.45        |
| 应付托管费         | 18,536.91        | 11,941.08        |
| 应付销售服务费       | 38,749.95        | 5,289.70         |
| 应付交易费用        | 663,754.34       | 124,445.94       |
| 应交税费          | -                | -                |
| 应付利息          | -                | -                |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 381,468.03       | 354,487.79       |
| 负债合计          | 19,891,374.12    | 18,058,242.92    |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 1,521,624,573.30 | 856,623,311.30   |
| 未分配利润         | 1,004,589,355.14 | 674,856,217.48   |
| 所有者权益合计       | 2,526,213,928.44 | 1,531,479,528.78 |
| 负债和所有者权益总计    | 2,546,105,302.56 | 1,549,537,771.70 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日,A 类基金份额净值 1.6603 元,C 类基金份额净值 1.6588 元;基金份额总额 1,521,624,573.30 份,下属分级基金的份额总额分别为:A 类基金份额总额 1,410,022,847.74 份,C 类基金份额总额 111,601,725.56 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      | <b>-198,139,883.67</b>                   | <b>-91,478,993.59</b>                         |
| 1.利息收入           | 631,363.87                               | 489,749.64                                    |
| 其中：存款利息收入        | 631,359.51                               | 277,508.54                                    |
| 债券利息收入           | 4.36                                     | 212,241.10                                    |
| 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） | -66,887,666.96                           | -65,874,902.10                                |
| 其中：股票投资收益        | -3,856,750.91                            | -7,606,115.18                                 |
| 基金投资收益           | -63,267,035.92                           | -58,605,518.97                                |

|                            |                        |                       |
|----------------------------|------------------------|-----------------------|
| 债券投资收益                     | -614.03                | -                     |
| 资产支持证券投资收益                 | -                      | -                     |
| 贵金属投资收益                    | -                      | -                     |
| 衍生工具收益                     | -                      | -                     |
| 股利收益                       | 236,733.90             | 336,732.05            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -134,191,420.35        | -27,121,780.77        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                      | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 2,307,839.77           | 1,027,939.64          |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>3,198,769.08</b>    | <b>1,281,336.94</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 510,620.32             | 367,297.43            |
| 2. 托管费                     | 102,123.96             | 73,459.52             |
| 3. 销售服务费                   | 135,940.19             | 206.30                |
| 4. 交易费用                    | 2,268,917.46           | 664,793.62            |
| 5. 利息支出                    | -                      | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                      | -                     |
| 6. 税金及附加                   | 0.03                   | -                     |
| 7. 其他费用                    | 181,167.12             | 175,580.07            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-201,338,652.75</b> | <b>-92,760,330.53</b> |
| 减：所得税费用                    | -                      | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-201,338,652.75</b> | <b>-92,760,330.53</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                  |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------------|------------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                  | 未分配利润            | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 856,623,311.30                        | 674,856,217.48   | 1,531,479,528.78  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -201,338,652.75  | -201,338,652.75   |
| 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）      | 665,001,262.00                        | 531,071,790.41   | 1,196,073,052.41  |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,764,630,259.14                      | 1,417,914,194.34 | 3,182,544,453.48  |
| 2.基金赎回款                                | -1,099,628,997.14                     | -886,842,403.93  | -1,986,471,401.07 |
| 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                            | 1,521,624,573.30                      | 1,004,589,355.14 | 2,526,213,928.44  |

|                                        |                                            |                 |                  |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|------------------|
| 金净值)                                   |                                            |                 |                  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 537,211,496.80                             | 539,742,811.95  | 1,076,954,308.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -92,760,330.53  | -92,760,330.53   |
| 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）      | 177,193,679.12                             | 184,222,106.43  | 361,415,785.55   |
| 其中：1.基金申购款                             | 638,098,835.24                             | 595,602,716.98  | 1,233,701,552.22 |
| 2.基金赎回款                                | -460,905,156.12                            | -411,380,610.55 | -872,285,766.67  |
| 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）                        | 714,405,175.92                             | 631,204,587.85  | 1,345,609,763.77 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2011]第 740 号《关于核准易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 377,470,567.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 39,577.08 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2017 年 6 月 2 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 6 月 5 日。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准

则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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》、《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 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。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。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 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。金融商品转让, 按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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。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。存款利息收入不征收增值税。

（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。

（5）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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                      | 与本基金的关系             |
|----------------------------|---------------------|
| 易方达基金管理有限公司                | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金       | 本基金是该基金的联接基金        |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 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。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.3 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。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 510,620.32                     | 367,297.43                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,563,740.82                   | 857,614.99                          |

注：1.本基金的管理费按调整后的前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的创业板 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2.客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的客户维护费

E 为前一日代销机构保有该基金份额的基金资产净值

R 为代销机构的客户维护费率

对于非工作日，则按照前一工作日的保有资产市值计算当日客户维护费。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 102,123.96                     | 73,459.52                           |

注：本基金的托管费按调整后的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

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 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的创业板 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日      |                 |           |
|----------------|---------------------------------|-----------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                 |           |
|                | 易方达创业板 ETF 联接 A                 | 易方达创业板 ETF 联接 C | 合计        |
| 易方达基金管理有限公司    | -                               | 91,624.88       | 91,624.88 |
| 中国工商银行         | -                               | -               | -         |
| 广发证券           | -                               | -               | -         |
| 合计             | -                               | 91,624.88       | 91,624.88 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                 |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                 |           |
|                | 易方达创业板ETF联接A                    | 易方达创业板ETF联接C    | 合计        |
| 易方达基金管理有限公司    | -                               | 206.30          | 206.30    |
| 中国工商银行         | -                               | -               | -         |
| 广发证券           | -                               | -               | -         |
| 合计             | -                               | 206.30          | 206.30    |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，按 C 类份额前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

##### 易方达创业板 ETF 联接 A

无。

##### 易方达创业板 ETF 联接 C

无。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称       | 本期                   |            | 上年度可比期间              |            |
|-------------|----------------------|------------|----------------------|------------|
|             | 2018年1月1日至2018年6月30日 |            | 2017年1月1日至2017年6月30日 |            |
|             | 期末余额                 | 当期利息收入     | 期末余额                 | 当期利息收入     |
| 中国工商银行-活期存款 | 138,884,734.52       | 576,203.53 | 70,493,706.51        | 251,571.91 |

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

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 1,506,023,018 份和 841,764,500 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 17.66%和 27.39%。

#### 6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 300072 | 三聚环保 | 2018-06-19 | 重大事项停牌 | 23.28  | 2018-07-10 | 24.00  | 166,612 | 4,375,323.16 | 3,878,727.36 | -  |
| 300118 | 东方日升 | 2018-05-07 | 重大事项停牌 | 10.80  | 2018-08-07 | 9.63   | 66,100  | 719,431.46   | 713,880.00   | -  |
| 300146 | 汤臣倍健 | 2018-01-31 | 重大事项停牌 | 16.60  | 2018-07-31 | 16.50  | 75,900  | 1,259,940.00 | 1,259,940.00 | -  |
| 300197 | 铁汉生态 | 2018-05-28 | 重大事项停牌 | 5.37   | -          | -      | 155,400 | 848,761.74   | 834,498.00   | -  |
| 300266 | 兴源环境 | 2018-02-05 | 重大事项停牌 | 19.99  | 2018-07-02 | 17.99  | 51,900  | 1,037,481.00 | 1,037,481.00 | -  |
| 300317 | 珈伟股份 | 2018-02-05 | 重大事项停牌 | 11.90  | 2018-07-03 | 10.71  | 26,400  | 314,160.00   | 314,160.00   | -  |
| 300324 | 旋极信息 | 2018-05-30 | 重大事项停牌 | 8.38   | -          | -      | 117,343 | 1,130,000.70 | 983,334.34   | -  |

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****(1)公允价值****(a)金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**(b)持续的以公允价值计量的金融工具****(i)各层次金融工具公允价值**

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,378,741,481.98 元，属于第二层次的余额为 9,022,020.70 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 45,357,381.03 元，第二层次 1,393,300,242.12 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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(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 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资  | 92,735,025.55    | 3.64          |
|    | 其中：股票 | 92,735,025.55    | 3.64          |
| 2  | 基金投资  | 2,295,028,477.13 | 90.14         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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      | 139,563,605.34   | 5.48   |
| 8 | 其他各项资产            | 18,778,194.54    | 0.74   |
| 9 | 合计                | 2,546,105,302.56 | 100.00 |

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                 | 基金类型 | 运作方式         | 管理人         | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------|--------------|-------------|------------------|---------------|
| 1  | 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型  | 交易型开放式 (ETF) | 易方达基金管理有限公司 | 2,295,028,477.13 | 90.85         |

## 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.3.1 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         | 7,060,977.24  | 0.28          |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 46,640,410.20 | 1.85          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | 1,456,405.74  | 0.06          |
| F  | 批发和零售业           | 724,654.00    | 0.03          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |

|   |                 |               |      |
|---|-----------------|---------------|------|
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 22,975,030.37 | 0.91 |
| J | 金融业             | -             | -    |
| K | 房地产业            | -             | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | 618,450.00    | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业      | 367,878.00    | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 3,562,740.91  | 0.14 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -             | -    |
| P | 教育              | -             | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | 4,491,420.30  | 0.18 |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 4,837,058.79  | 0.19 |
| S | 综合              | -             | -    |
|   | 合计              | 92,735,025.55 | 3.67 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300498 | 温氏股份 | 320,662 | 7,060,977.24 | 0.28         |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 328,998 | 4,336,193.64 | 0.17         |
| 3  | 300072 | 三聚环保 | 166,612 | 3,878,727.36 | 0.15         |
| 4  | 300003 | 乐普医疗 | 76,971  | 2,823,296.28 | 0.11         |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 82,990  | 2,723,731.80 | 0.11         |
| 6  | 300015 | 爱尔眼科 | 69,870  | 2,256,102.30 | 0.09         |
| 7  | 300408 | 三环集团 | 91,246  | 2,144,281.00 | 0.08         |
| 8  | 300136 | 信维通信 | 66,792  | 2,052,518.16 | 0.08         |
| 9  | 300142 | 沃森生物 | 98,580  | 1,969,628.40 | 0.08         |
| 10 | 300070 | 碧水源  | 139,087 | 1,937,481.91 | 0.08         |

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

#### 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.5.1 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  | 300498 | 温氏股份 | 123,555,215.31 | 8.07           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2  | 300059 | 东方财富 | 62,749,136.96 | 4.10 |
| 3  | 300124 | 汇川技术 | 42,720,049.41 | 2.79 |
| 4  | 300072 | 三聚环保 | 36,926,259.29 | 2.41 |
| 5  | 300136 | 信维通信 | 36,704,399.89 | 2.40 |
| 6  | 300003 | 乐普医疗 | 36,366,946.83 | 2.37 |
| 7  | 300070 | 碧水源  | 33,650,599.49 | 2.20 |
| 8  | 300024 | 机器人  | 32,003,589.54 | 2.09 |
| 9  | 300408 | 三环集团 | 31,857,078.71 | 2.08 |
| 10 | 300142 | 沃森生物 | 31,790,797.83 | 2.08 |
| 11 | 300015 | 爱尔眼科 | 28,288,251.43 | 1.85 |
| 12 | 300296 | 利亚德  | 26,676,598.14 | 1.74 |
| 13 | 300017 | 网宿科技 | 26,663,711.21 | 1.74 |
| 14 | 300315 | 掌趣科技 | 20,687,331.99 | 1.35 |
| 15 | 300027 | 华谊兄弟 | 20,598,202.03 | 1.34 |
| 16 | 300274 | 阳光电源 | 20,338,804.16 | 1.33 |
| 17 | 300122 | 智飞生物 | 19,679,548.78 | 1.29 |
| 18 | 300144 | 宋城演艺 | 19,149,432.89 | 1.25 |
| 19 | 300088 | 长信科技 | 19,037,009.27 | 1.24 |
| 20 | 300182 | 捷成股份 | 17,145,179.88 | 1.12 |

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

#### 7.5.2 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  | 300498 | 温氏股份 | 30,409,897.09 | 1.99            |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 16,678,775.64 | 1.09            |
| 3  | 300124 | 汇川技术 | 12,480,124.00 | 0.81            |
| 4  | 300003 | 乐普医疗 | 12,262,155.38 | 0.80            |
| 5  | 300136 | 信维通信 | 9,936,277.00  | 0.65            |
| 6  | 300142 | 沃森生物 | 9,829,548.93  | 0.64            |
| 7  | 300408 | 三环集团 | 9,317,765.00  | 0.61            |
| 8  | 300015 | 爱尔眼科 | 8,902,934.29  | 0.58            |
| 9  | 300070 | 碧水源  | 8,806,229.79  | 0.58            |
| 10 | 300024 | 机器人  | 8,292,503.54  | 0.54            |
| 11 | 300122 | 智飞生物 | 7,401,637.16  | 0.48            |
| 12 | 300296 | 利亚德  | 6,968,582.80  | 0.46            |
| 13 | 300017 | 网宿科技 | 6,360,108.09  | 0.42            |
| 14 | 300168 | 万达信息 | 5,747,731.85  | 0.38            |
| 15 | 300144 | 宋城演艺 | 5,482,780.29  | 0.36            |
| 16 | 300347 | 泰格医药 | 5,307,412.34  | 0.35            |
| 17 | 300274 | 阳光电源 | 5,186,659.39  | 0.34            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 300253 | 卫宁健康 | 5,008,228.89 | 0.33 |
| 19 | 300027 | 华谊兄弟 | 4,915,180.22 | 0.32 |
| 20 | 300088 | 长信科技 | 4,659,455.00 | 0.30 |

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

### 7.5.3 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 | 1,423,421,452.03 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 377,709,245.46   |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.13.3 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 | 398,276.27 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -             |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 27,054.75     |
| 5 | 应收申购款   | 18,284,148.24 |
| 6 | 其他应收款   | 68,715.28     |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 18,778,194.54 |

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 300072 | 三聚环保 | 3,878,727.36    | 0.15             | 重大事项停<br>牌   |

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别               | 持有人户<br>数(户) | 户均持有的基金份<br>额 | 持有人结构         |            |                  |            |
|--------------------|--------------|---------------|---------------|------------|------------------|------------|
|                    |              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者            |            |
|                    |              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 易方达创业板<br>ETF 联接 A | 130,178      | 10,831.50     | 92,300,535.56 | 6.55%      | 1,317,722,312.18 | 93.45%     |
| 易方达创业板<br>ETF 联接 C | 8,048        | 13,867.01     | 18,991,007.71 | 17.02%     | 92,610,717.85    | 82.98%     |

|    |         |           |                |       |                  |        |
|----|---------|-----------|----------------|-------|------------------|--------|
| 合计 | 138,226 | 11,008.24 | 111,291,543.27 | 7.31% | 1,410,333,030.03 | 92.69% |
|----|---------|-----------|----------------|-------|------------------|--------|

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别            | 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 | 易方达创业板 ETF 联接 A | 118,879.63 | 0.0084%  |
|                  | 易方达创业板 ETF 联接 C | 16,204.66  | 0.0145%  |
|                  | 合计              | 135,084.29 | 0.0089%  |

## 8.3 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                             | 份额级别            | 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 | 易方达创业板 ETF 联接 A | 0                 |
|                                | 易方达创业板 ETF 联接 C | 0                 |
|                                | 合计              | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 易方达创业板 ETF 联接 A | 0                 |
|                                | 易方达创业板 ETF 联接 C | 0                 |
|                                | 合计              | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 易方达创业板 ETF 联接 A  | 易方达创业板 ETF 联接 C |
|--------------------------------|------------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2011 年 9 月 20 日）基金份额总额 | 377,470,567.39   | -               |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 839,973,130.11   | 16,650,181.19   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,522,387,105.58 | 242,243,153.56  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 952,337,387.95   | 147,291,609.19  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                | -               |
| 本报告期末基金份额总额                    | 1,410,022,847.74 | 111,601,725.56  |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本基金管理人于 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)。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 渤海证券 | 1      | 1,098,164,494.66 | 60.98%       | 1,022,726.06 | 60.98%     | -  |
| 长城国瑞 | 1      | 702,620,728.05   | 39.02%       | 654,352.51   | 39.02%     | -  |
| 长江证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 华泰证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 申万宏源 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 银河证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |

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、个股分析的报告及丰富全面

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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易      |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易           |              |
|------|-----------|--------------|--------|----------------|------|--------------|----------------|--------------|
|      | 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 | 成交金额           | 占当期基金成交总额的比例 |
| 渤海证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | 515,836,897.34 | 95.67%       |
| 长城国瑞 | 29,795.36 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            | 23,360,783.06  | 4.33%        |
| 长江证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -              | -            |
| 国信证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -              | -            |
| 华泰证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -              | -            |
| 申万宏源 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -              | -            |
| 银河证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -              | -            |

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日