

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投
资基金
2018 年半年度报告
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：交通银行股份有限公司
送出日期：二〇一八年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通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。

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	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	35
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..	36
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	41
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	43
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 ..	43
7.8	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	43	
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明 细	43
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	43
7.11	投资组合报告附注	43
8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末上市基金前十名持有人	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..	46
9	开放式基金份额变动	46
10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	52
11	影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	53
12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达恒生国企 (QDII-ETF)
基金主代码	510900
交易代码	510900
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2012 年 8 月 9 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,307,021,934.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 10 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。同时，本基金可适当借出证券，以更好实现本基金的投资目标。本基金主要采取完全复制法进行投资，即参考恒生中国企业指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据恒生中国企业指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。当市场流动性不足、法规规定本基金不能投资关联方股票等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品进行替代。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率，本基金可投资恒生 H 股指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在 3% 以内。
业绩比较基准	恒生中国企业指数（使用估值汇率折算）
风险收益特征	本基金属股票指数基金，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。本基金主要投资香港证券市场上市的中国企业，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	陆志俊
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-85104666	021-62701216
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)	中国(上海)自由贸易试验区 银城中路188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	中国(上海)自由贸易试验区 银城中路188号
邮政编码		510620	200120
法定代表人		刘晓艳	彭纯

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	无	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		无	香港皇后大道中一号
办公地址		无	香港九龙深旺道 1 号汇丰中心 1 座 6 楼
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
--------	----------------	------------------

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	125,389,525.87
本期利润	-765,942,926.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0944
本期加权平均净值利润率	-7.47%
本期基金份额净值增长率	-3.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,229,551,364.32
期末可供分配基金份额利润	0.1480
期末基金资产净值	9,536,573,298.32
期末基金份额净值	1.1480
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.91%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.93%	1.24%	-4.67%	1.26%	0.74%	-0.02%
过去三个月	-1.68%	1.27%	-2.89%	1.29%	1.21%	-0.02%
过去六个月	-3.71%	1.42%	-4.62%	1.45%	0.91%	-0.03%
过去一年	5.70%	1.24%	3.77%	1.26%	1.93%	-0.02%
过去三年	-3.01%	1.37%	-8.81%	1.40%	5.80%	-0.03%
自基金合同生效起	19.91%	1.33%	15.76%	1.38%	4.15%	-0.05%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

易方达恒生中国企业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
(2012 年 8 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日)



- 注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。
2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 19.91%，同期业绩比较基准收益率为 15.76%。

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	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张胜记	本基金的基金经理、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、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达 50 指数证券投资基金的基金经理、指数及增强投资部副总经理	2012-08-09	-	13 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金经理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理。

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

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应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，通过投资交易系统中的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的恒生中国企业指数成分股均为在香港上市交易的内地公司，企业盈利增速的变化跟随国内经济周期的趋势。2018年上半年，国内经济保持平稳运行。防范化解重大风险、重点防控金融风险成为今年政府三大工作任务之一。《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》正式发布，去杠杆进入攻坚阶段，社会流动性环境不断收紧，中美贸易冲突形势日益严峻。上半年我国国内生产总值 GDP 同比增长 6.8%，规模以上工业增加值同比增长 6.7%，稳中略有回落。全国固定资产投资同比增长 6.0%，房地产开发投资同比增长 9.7%，房地产销售增速回落，全国住宅累计销售面积同比增长 3.3%。通胀稳定，6 月份居民消费价格指数（CPI）同比上涨 1.9%，我国货币政策继续稳中偏紧，央行连续两次降低存款准备金率共 1.5 个百分点，6 月末广义货币供应量 M2 同比增长 8.0%，略有回落。海外方面，美联储连续两次加息共 0.50%，美国联邦基金利率达到 1.75%~2.00% 的区间，美国股市高位震荡。报告期内，人民币兑港币先升后贬，港股通资金南下香港的趋势扭转，香港股市持续下跌，恒生中国企业指数下跌 5.43%（港币）。

易方达恒生中国企业交易型开放式指数基金（H 股 ETF）属于完全跟踪指数的证券投资基金。

报告期内，本基金跟随指数的成分股变化进行日常调整操作，控制基金组合与指数权重基本一致。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1480 元，本报告期份额净值增长率为 -3.71%，同期业绩比较基准收益率为 -4.62%，年化跟踪误差 0.76%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

恒生中国企业指数的成分股均为内地公司，上市公司的基本面变化取决于国内经济的增长前景，但市场交易主体包括欧美等海外资金，流动性受欧美等发达经济体的直接影响很大。展望 2018 下半年，中国经济稳中向好的大趋势不变，规模以上工业企业的盈利增长仍将较好，港股长期向上的基本面基础稳固。另一方面，美联储持续加息的风险加大，外汇市场波动加剧，需要密切关注流动性变化前景，预计 H 股指数的短期仍将处于震荡筑底阶段。

长期来看，我国经济仍处于制度改革红利的释放期，仍处于快速的工业化、城镇化以及区域经济一体化进程中，中长期经济增长前景良好，本基金对恒生中国企业指数的长期表现保持乐观。作为完全被动投资基金，下阶段本基金将继续采取紧密跟踪比较基准的投资策略，审慎管理基金资产，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，期望为投资者分享中国经济的未来成长提供良好的投资工具。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提

供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 415,351,096.70 元。

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，基金托管人在易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，易方达基金管理有限公司在易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 415,351,096.70 元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	559,053,593.85	75,854,375.40
结算备付金		8,431,000.00	84,322,226.68
存出保证金		-	11,227,247.65
交易性金融资产	6.4.7.2	9,311,778,922.55	6,494,329,583.10
其中: 股票投资		9,311,778,922.55	6,494,329,583.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		8,246,819.90	34,234,846.49
应收利息	6.4.7.5	36,007.07	17,698.07
应收股利		82,858,822.68	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,970,405,166.05	6,699,985,977.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	74,395.89
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,097,725.14	3,398,404.19
应付托管费		1,699,241.70	1,132,801.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	564,890.65	517,267.13
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		415,351,096.70	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	11,118,913.54	118,321,995.16
负债合计		433,831,867.73	123,444,863.76
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	8,307,021,934.00	5,281,021,934.00
未分配利润	6.4.7.10	1,229,551,364.32	1,295,519,179.63

所有者权益合计		9,536,573,298.32	6,576,541,113.63
负债和所有者权益总计		9,970,405,166.05	6,699,985,977.39

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1480 元，基金份额总额 8,307,021,934.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达恒生中国企业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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-704,964,656.74	795,836,145.72
1.利息收入		1,572,355.28	661,946.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,572,355.28	661,946.22
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		224,922,169.23	655,431,184.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	85,102,075.22	550,182,669.20
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	139,820,094.01	105,248,515.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-891,332,452.00	136,037,024.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		7,376,712.80	-5,044,931.68
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-47,503,442.05	8,750,922.40
减：二、费用		60,978,269.39	45,066,232.47
1. 管理人报酬		30,776,558.42	25,409,522.67
2. 托管费		10,258,852.78	8,469,840.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,225,810.74	9,255,662.84
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	6.4.7.20	2,717,047.45	1,931,206.07

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-765,942,926.13	750,769,913.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-765,942,926.13	750,769,913.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达恒生中国企业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6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	5,281,021,934.00	1,295,519,179.63	6,576,541,113.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-765,942,926.13	-765,942,926.13
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）	3,026,000,000.00	1,115,326,207.52	4,141,326,207.52
其中：1.基金申购款	4,026,000,000.00	1,369,730,501.17	5,395,730,501.17
2.基金赎回款	-1,000,000,000.00	-254,404,293.65	-1,254,404,293.65
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）	-	-415,351,096.70	-415,351,096.70
五、期末所有者权益（基金净值）	8,307,021,934.00	1,229,551,364.32	9,536,573,298.32
项目	上年度可比期间 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）	9,055,021,934.00	446,795,227.90	9,501,817,161.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	750,769,913.25	750,769,913.25
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）	-3,931,000,000.00	-508,646,793.92	-4,439,646,793.92
其中：1.基金申购款	324,000,000.00	42,832,208.51	366,832,208.51
2.基金赎回款	-4,255,000,000.00	-551,479,002.43	-4,806,479,002.43
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）	5,124,021,934.00	688,918,347.23	5,812,940,281.23
-----------------	------------------	----------------	------------------

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

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（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[2012]823 号《关于核准易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金及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《易方达恒生中国企业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，本基金基金合同于 2012 年 8 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,616,541,259.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 42,259.00 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司，基金托管人为交通银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

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》、《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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内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[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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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。

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。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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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。

(5) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定

缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	559,053,593.85
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	559,053,593.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,350,119,965.52	9,311,778,922.55	-38,341,042.97
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	9,350,119,965.52	9,311,778,922.55	-38,341,042.97

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	36,007.07
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	-
应收债券利息	-
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	-
合计	36,007.07

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	564,890.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	564,890.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	433,068.27
应付替代款	8,218,723.54
其他应付款	2,467,121.73
合计	11,118,913.54

6.4.7.9 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6月30日	账面金额
基金份额(份)		

上年度末	5,281,021,934.00	5,281,021,934.00
本期申购	4,026,000,000.00	4,026,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,000,000,000.00	-1,000,000,000.00
本期末	8,307,021,934.00	8,307,021,934.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,108,896,645.20	186,622,534.43	1,295,519,179.63
本期利润	125,389,525.87	-891,332,452.00	-765,942,926.13
本期基金份额交易产生的变动数	625,573,172.92	489,753,034.60	1,115,326,207.52
其中：基金申购款	830,402,110.43	539,328,390.74	1,369,730,501.17
基金赎回款	-204,828,937.51	-49,575,356.14	-254,404,293.65
本期已分配利润	-415,351,096.70	-	-415,351,096.70
本期末	1,444,508,247.29	-214,956,882.97	1,229,551,364.32

6.4.7.11 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6月30日	
活期存款利息收入		591,263.31
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		981,091.97
其他		-
合计		1,572,355.28

6.4.7.12 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6月30日	
卖出股票成交总额		3,202,197,665.48
减：卖出股票成本总额		3,117,095,590.26
买卖股票差价收入		85,102,075.22

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	139,820,094.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	139,820,094.01

6.4.7.17 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6月30日
1.交易性金融资产	-891,334,159.93
——股票投资	-891,334,159.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
——期权投资	-
3.其他	1,707.93
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-891,332,452.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-47,503,442.05
合计	-47,503,442.05

注：替代损益收入是指投资者采用退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，被替代股票的申购结算成本（赎回结算金额）与申购（赎回）申请确认金额的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	17,225,810.74

银行间市场交易费用	-
合计	17,225,810.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	6,757.46
上市费	29,752.78
指数使用费	2,051,770.63
分红手续费	415,351.10
其他	10,099.99
合计	2,717,047.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司(以下简称“汇丰银行”)	境外资产托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基 金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	30,776,558.42	25,409,522.67
其中：支付销售机构的客户维护费	457,435.35	1,086,303.39

注：本基金管理费按前一日的基金资产净值 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,258,852.78	8,469,840.89

注：本基金托管费（包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内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。

6.4.10.4.2 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6月30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
易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,297,234,126.00	15.62%	996,464,822.00	18.87%
广发证券	111,043,106.00	1.34%	59,045,023.00	1.12%

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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
	525,784,168.51	590,208.59	63,795,783.56	404,100.96
交通银行-活期存款	33,269,425.34	1,054.72	35,900,177.57	2,819.79

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司和香港上海汇丰银行有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金

托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票交通银行。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2018-06-28	2018-06-29	-	0.500	415,351,096.70	-	415,351,096.70	-
合计	-	-	-	0.500	415,351,096.70	-	415,351,096.70	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险

监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理事后风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票指数基金，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。本基金主要采用完全复制法跟踪恒生中国企业指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的中国企业，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任（本基金为进行避险和组合的有效管理可以投资衍生品），或者基金所投资证券之发行人出现违约（包括国家信用风险）、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投资备选库制度和交易对手备选库制度及分散化投资方式防范信用风险。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (2017 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30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。

6.4.13.2.2 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6月30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

6.4.13.2.3 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6月30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

6.4.13.2.4 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6月30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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 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6月30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

6.4.13.2.6 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6月30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

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 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。

6.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。此外，基金主要投资的香港证券市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此香港证券市场证券的每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	559,053,593.85	-	-	-	559,053,593.85
结算备付金	8,431,000.00	-	-	-	8,431,000.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	9,311,778,922.55	9,311,778,922.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	8,246,819.90	8,246,819.90
应收利息	-	-	-	36,007.07	36,007.07
应收股利	-	-	-	82,858,822.68	82,858,822.68
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	567,484,593.85	-	-	9,402,920,572.20	9,970,405,166.05
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,097,725.14	5,097,725.14
应付托管费	-	-	-	1,699,241.70	1,699,241.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	564,890.65	564,890.65
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	415,351,096.70	415,351,096.70
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	11,118,913.54	11,118,913.54
负债总计	-	-	-	433,831,867.73	433,831,867.73
利率敏感度缺口	567,484,593.85	-	-	8,969,088,704.47	9,536,573,298.32
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	75,854,375.40	-	-	-	75,854,375.40
结算备付金	84,322,226.68	-	-	-	84,322,226.68
存出保证金	11,227,247.65	-	-	-	11,227,247.65
交易性金融资产	-	-	-	6,494,329,583.10	6,494,329,583.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	34,234,846.49	34,234,846.49
应收利息	-	-	-	17,698.07	17,698.07
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	171,403,849.73	-	-	6,528,582,127.66	6,699,985,977.

					39
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	-	-	-	74,395.89	74,395.89
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,398,404.19	3,398,404.19
应付托管费	-	-	-	1,132,801.39	1,132,801.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	517,267.13	517,267.13
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	118,321,995.16	118,321,995.16
负债总计	-	-	-	123,444,863.76	123,444,863.76
利率敏感度缺口	171,403,849.73	-	-	6,405,137,263.90	6,576,541,113.63

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	2.市场利率上升 25 个基点	-	-
	1.市场利率下降 25 个基点	-	-

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币

贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2018年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	33,270,450.46	-	33,270,450.46
结算备付金	-	8,431,000.00	-	8,431,000.00
交易性金融资产	-	9,311,778,922.55	-	9,311,778,922.55
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	968,421.50	-	968,421.50
应收利息	-	319.21	-	319.21
应收股利	-	17,362,396.10	-	17,362,396.10
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	9,371,811,509.82	-	9,371,811,509.82
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,371,811,509.82	-	9,371,811,509.82
项目	上年度末			
	2017年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	-	8,443,292.84	-	8,443,292.84
结算备付金	-	8,359,100.00	-	8,359,100.00
交易性金融资产	-	6,494,329,583.10	-	6,494,329,583.10
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	1,240,246.63	-	1,240,246.63
应收利息	-	83.56	-	83.56
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	6,512,372,306.13	-	6,512,372,306.13
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	6,512,372,306.13	-	6,512,372,306.13

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变			
	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）		
分析		本期末	上年度末	
		2018年6月30日	2017年12月31日	
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-468,590,575.49	-325,618,615.29	
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	468,590,575.49	325,618,615.29	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,311,778,922. 55	97.64	6,494,329,583 .10	98.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-3,661,806.87	-0.06
合计	9,311,778,922. 55	97.64	6,490,667,776 .23	98.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	465,588,944.22	324,716,477.87
	2.业绩比较基准下降 5%	-465,588,944.22	-324,716,477.87

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 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 9,311,778,922.55 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 6,494,329,583.10 元，无属于第二层次的余额，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 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	9,311,778,922.55	93.39
	其中：普通股	9,311,778,922.55	93.39
	存托凭证	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	567,484,593.85	5.69
8	其他各项资产	91,141,649.65	0.91
9	合计	9,970,405,166.05	100.00

注：1.上表中的普通股投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 和 7.3 的合计项不含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 6,908,652,928.83 元，占净值比例 72.44%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	9,311,778,922.55	97.64
合计	9,311,778,922.55	97.64

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	1,154,202,004.71	12.10
材料	146,048,105.25	1.53
工业	310,955,683.02	3.26

非必需消费品	323,800,869.66	3.40
必需消费品	41,979,845.98	0.44
保健	184,612,881.93	1.94
金融	5,967,425,487.97	62.57
信息技术	394,829,597.97	4.14
电信服务	455,134,559.70	4.77
公用事业	181,512,179.35	1.90
房地产	151,277,707.01	1.59
合计	9,311,778,922.55	97.64

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量(股)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
1	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安 保险(集团) 股份有限 公司	2318 HK	香港证 券交易 所	香港	15,376,500	935,995,540.23	9.81
2	China Constructi on Bank Corporati on	中国建设 银行股份 有限公司	939 HK	香港证 券交易 所	香港	149,051,00 0	911,070,511.23	9.55
3	Industrial and Commerci al Bank of China Limited	中国工商 银行股份 有限公司	1398 HK	香港证 券交易 所	香港	181,869,00 0	900,069,135.40	9.44
4	Bank of China Limited	中国银行 股份有限 公司	3988 HK	香港证 券交易 所	香港	248,023,00 0	813,430,864.16	8.53
5	China Petroleum & Chemical Corporati on	中国石油 化工股份 有限公司	386 HK	香港证 券交易 所	香港	79,679,200	470,914,509.98	4.94

6	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港证券交易所	香港	23,235,000	396,685,927.13	4.16
7	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	1,189,200	394,829,597.97	4.14
8	Petrochina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港证券交易所	香港	65,876,000	331,574,131.93	3.48
9	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	香港	5,578,500	327,815,364.50	3.44
10	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港证券交易所	香港	12,183,046	297,360,680.10	3.12
11	Agricultural Bank of China Limited	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港证券交易所	香港	86,364,000	267,225,502.43	2.80
12	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港证券交易所	香港	8,229,000	210,564,351.47	2.21
13	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	香港	16,222,000	185,183,441.43	1.94
14	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港证券交易所	香港	10,608,000	166,529,921.37	1.75
15	PICC Property and Casualty Company Limited	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	香港证券交易所	香港	21,524,614	153,708,495.48	1.61
16	Anhui Conch Cement	安徽海螺水泥股份有限公司	914 HK	香港证券交易所	香港	3,849,500	146,048,105.25	1.53

	Company Limited							
17	Bank of Communications Co.,Ltd.	交通银行股份有限公司	3328 HK	香港证券交易所	香港	27,323,200	138,447,501.42	1.45
18	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	728 HK	香港证券交易所	香港	41,148,000	127,319,195.20	1.34
19	China CITIC Bank Corporation Limited	中信银行股份有限公司	998 HK	香港证券交易所	香港	30,189,000	124,971,018.37	1.31
20	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	中国邮政储蓄银行股份有限公司	1658 HK	香港证券交易所	香港	27,916,000	120,268,855.75	1.26
21	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	香港	22,237,500	105,178,727.36	1.10
22	Sinopharm Group Co., Ltd.	国药控股股份有限公司	1099 HK	香港证券交易所	香港	3,726,800	99,132,153.27	1.04
23	China Vanke Co.,Ltd.	万科企业股份有限公司	2202 HK	香港证券交易所	香港	4,106,500	95,037,119.62	1.00
24	China Communications Construction Company Limited	中国交通建设股份有限公司	1800 HK	香港证券交易所	香港	13,814,000	88,281,102.17	0.93
25	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	香港证券交易所	香港	4,278,000	85,480,728.66	0.90

26	CITIC Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	6030 HK	香港证券交易所	香港	6,043,900	79,899,197.58	0.84
27	BYD Company Limited	比亚迪股份有限公司	1211 HK	香港证券交易所	香港	1,993,000	79,898,184.17	0.84
28	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	广州汽车集团股份有限公司	2238 HK	香港证券交易所	香港	12,353,600	79,885,505.63	0.84
29	The People's Insurance Company (Group) of China Limited	中国人民保险集团股份有限公司	1339 HK	香港证券交易所	香港	23,158,000	72,045,441.16	0.76
30	New China Life Insurance Company Ltd.	新华人寿保险股份有限公司	1336 HK	香港证券交易所	香港	2,583,900	71,127,570.84	0.75
31	CRRC Corporation Limited	中国中车股份有限公司	1766 HK	香港证券交易所	香港	13,658,000	70,126,714.18	0.74
32	Haitong Securities Co., Ltd.	海通证券股份有限公司	6837 HK	香港证券交易所	香港	10,107,200	67,574,545.94	0.71
33	China Railway Group Limited	中国中铁股份有限公司	390 HK	香港证券交易所	香港	12,492,000	62,349,470.79	0.65
34	China Huarong Asset Management Co.,Ltd	中国华融资产管理股份有限公司	2799 HK	香港证券交易所	香港	31,541,000	60,364,332.82	0.63
35	Dongfeng Motor Group Co.	东风汽车集团股份有限公司	489 HK	香港证券交易所	香港	8,464,000	59,228,786.72	0.62

	Ltd.							
36	China Cinda Asset Management Co.,Ltd.	中国信达资产管理股份有限公司	1359 HK	香港证券交易所	香港	27,539,500	58,510,752.17	0.61
37	CGN Power Co.,Ltd.	中国广核电力股份有限公司	1816 HK	香港证券交易所	香港	33,121,000	56,686,359.66	0.59
38	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	香港证券交易所	香港	2,522,000	56,240,587.39	0.59
39	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港证券交易所	香港	684,000	55,851,496.74	0.59
40	Huaneng Power International,Inc.	华能国际电力股份有限公司	902 HK	香港证券交易所	香港	12,480,000	54,713,817.60	0.57
41	Huatai Securities Co.,Ltd.	华泰证券股份有限公司	6886 HK	香港证券交易所	香港	5,097,400	53,634,271.90	0.56
42	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	267 HK	香港证券交易所	香港	5,269,000	49,131,770.53	0.52
43	Great Wall Motor Company Limited	长城汽车股份有限公司	2333 HK	香港证券交易所	香港	9,674,000	48,936,896.40	0.51
44	GF Securities Co., Ltd.	广发证券股份有限公司	1776 HK	香港证券交易所	香港	4,783,400	46,136,199.14	0.48
45	ZhongAn Online P&C Insurance Co.,Ltd.	众安在线财产保险股份有限公司	6060 HK	香港证券交易所	香港	1,100,200	45,961,520.62	0.48
46	Hengan International Group	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香港证券交易所	香港	659,500	41,979,845.98	0.44

	Company Limited							
47	China Gas Holdings Ltd.	中国燃气控股有限公司	384 HK	香港证券交易所	香港	1,577,400	41,958,532.41	0.44
48	Air China Limited	中国国际航空股份有限公司	753 HK	香港证券交易所	香港	6,426,000	41,066,625.35	0.43
49	China Galaxy Securities Co.,Ltd.	中国银河证券股份有限公司	6881 HK	香港证券交易所	香港	10,947,000	37,194,545.27	0.39
50	Guangdong Investment Ltd.	粤海投资有限公司	270 HK	香港证券交易所	香港	2,680,000	28,153,469.68	0.30

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益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 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	China Construction Bank Corporation	939 HK	578,160,958.28	8.79
2	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	574,525,916.78	8.74
3	Bank of China Limited	3988 HK	547,625,080.85	8.33
4	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	540,251,578.78	8.21
5	Tencent Holdings Ltd	700 HK	448,337,110.17	6.82
6	China Mobile Limited	941 HK	361,152,927.95	5.49
7	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	286,809,533.08	4.36
8	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	257,518,158.18	3.92
9	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	216,303,437.14	3.29
10	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	194,521,217.95	2.96
11	Petrochina Company	857 HK	190,851,646.03	2.90

	Limited			
12	CNOOC Limited	883 HK	179,929,799.50	2.74
13	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	150,344,939.73	2.29
14	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	122,482,566.31	1.86
15	PICC Property and Casualty Company Limited	2328 HK	112,895,672.96	1.72
16	China CITIC Bank Corporation Limited	998 HK	91,702,144.22	1.39
17	Bank of Communications Co.,Ltd.	3328 HK	88,111,527.43	1.34
18	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	82,227,908.02	1.25
19	ZhongAn Online P&C Insurance Co.,Ltd.	6060 HK	81,512,626.69	1.24
20	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	80,606,838.38	1.23

注：1.买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Bank of China Limited	3988 HK	356,334,463.70	5.42
2	China Construction Bank Corporation	939 HK	300,287,666.66	4.57
3	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	205,902,668.28	3.13
4	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	198,374,118.49	3.02
5	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	179,794,260.20	2.73
6	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	151,394,941.03	2.30
7	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	136,650,798.28	2.08
8	Petrochina Company Limited	857 HK	136,622,904.52	2.08
9	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	125,104,132.53	1.90
10	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	77,418,949.52	1.18
11	Zhuzhou CRRC Times Electric Co., Ltd.	3898 HK	73,821,291.59	1.12
12	PICC Property and Casualty Company Limited	2328 HK	72,244,020.07	1.10
13	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	71,580,032.47	1.09
14	Anhui Conch Cement Company Limited	914 HK	61,598,141.46	0.94
15	Bank of Communications Co.,Ltd.	3328 HK	59,375,041.07	0.90
16	China CITIC Bank Corporation Limited	998 HK	57,154,434.81	0.87
17	China Railway Construction Corporation Limited	1186 HK	56,630,391.22	0.86

18	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	53,615,305.28	0.82
19	China Telecom Corporation Limited	728 HK	51,756,315.96	0.79
20	Sinopharm Group Co., Ltd.	1099 HK	44,782,650.50	0.68

注：1.卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	6,825,879,089.64
卖出收入（成交）总额	3,202,197,665.48

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 2018 年 2 月 12 日，中国银监会针对招商银行的如下事由罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转

让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本基金为指类型基金，招商银行是标的指数成份券，该类股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 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	应收证券清算款	8,246,819.90
3	应收股利	82,858,822.68
4	应收利息	36,007.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,141,649.65

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有	持有人结构

(户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		交通银行股份有限公司 —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	
		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
31,189	266,344.6 1	6,847,366,283 .00	82.43%	1,459,655,6 51.00	17.57%	1,297,234,1 26.00	15.62%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“交通银行股份有限公司—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	1,883,139,776.00	22.67%
2	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统普通保险产品—013C-CT001 沪	519,765,700.00	6.26%
3	麦格理银行有限公司—自有资金	498,593,843.00	6.00%
4	国际金融—汇丰—JPMORGAN CHASE BANK, NATIONAL ASSOCIATION	246,811,586.00	2.97%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统普通保险产品	242,739,000.00	2.92%
6	UBS AG	242,586,855.00	2.92%
7	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	241,175,187.00	2.90%
8	中国人寿保险（集团）公司	164,999,950.00	1.99%
9	工银瑞信基金管理公司—农行—中国农业银行股份有限公司企业年金理事会	97,454,600.00	1.17%
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	95,744,100.00	1.15%
11	交通银行股份有限公司—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	1,297,234,126.00	15.62%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年8月9日)基金份额总额	1,616,541,259.00
本报告期期初基金份额总额	5,281,021,934.00
本报告期基金总申购份额	4,026,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	8,307,021,934.00

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	
State Street Global Markets	1	199,372,639.60	1.99%	99,686.36	1.75%	-
Goldman Sachs	1	449,514,956.06	4.48%	245,172.51	4.30%	-
JP Morgan Securities Limited	1	22,909,206.15	0.23%	18,327.37	0.32%	-
Credit Suisse (HongKong) Limited	1	381,647,847.96	3.81%	305,318.27	5.35%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	360,218,336.67	3.59%	288,174.67	5.05%	-
安信证券	1	1,485,804,564.91	14.82%	742,902.26	13.02%	-

长城证券	1	104,100,891.50	1.04%	52,050.41	0.91%	-
Everbright Securities (International) Limited	1	414,276,592.96	4.13%	331,421.37	5.81%	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	316,175,568.52	3.15%	158,087.81	2.77%	-
海通证券	1	1,238,773.30	0.01%	991.02	0.02%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	513,473,024.75	5.12%	410,778.42	7.20%	-
民生证券	1	2,308,740,843.72	23.02%	1,154,370.38	20.24%	-
瑞银证券	1	1,017,472,211.32	10.15%	508,736.16	8.92%	-
Shen Yin Wang Guo Securities HK Ltd	1	190,219,146.39	1.90%	152,175.34	2.67%	-
中信建投	1	1,915,340,499.66	19.10%	957,670.28	16.79%	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	347,571,651.65	3.47%	278,057.31	4.87%	-
China Everbright Forex & Futures (HK) Limited	1	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	1	-	-	-	-	-
Macquarie Group	1	-	-	-	-	-

注： a) 本报告期内本基金无减少交易账户，新增长城证券股份有限公司一个交易单元。
 b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

- 1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；
- 2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、

个股分析报告和专题研究报告等;

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面;

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训;

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献;

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下:

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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
State Street Glob al Mark ets	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morg an Secur ties Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Credi t Suiss	-	-	-	-	-	-	-	-

e (Hon gKon g) Limit ed								
Chin a Mer c han ts Secu rities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Ever brigh t Secu rities (In te rnatio nal) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Secu rities (Hon g Kong) Brok erage Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Inter	-	-	-	-	-	-	-	-

natio nal Secur ities Com pany Limit ed								
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen yin Wang uo Secur ties HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI C Secur ties Brok erage (HK) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Ever brigh t Forex & Futur es (HK) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigr oup	-	-	-	-	-	-	-	-

Glob al Mark ets Limit ed							
Macq uarie Grou p	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达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新增瑞银证券为易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-01-30
3	易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业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	易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 3 月 30 日、4 月 2 日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-27
6	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
7	易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 5 月 22 日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-05-17
8	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
9	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-25

10	易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 6 月 28 日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-25
11	易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年 7 月 2 日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 02 月 09 日 ~2018 年 06 月 30 日	405,939, 600.00	1,607,82 9,976.00	130,629, 800.00	1,883,13 9,776.00	22.67 %
交通银行股份有限公司—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	1	2018 年 01 月 17 日 ~2018 年 01 月 22 日	996,464, 822.00	873,000, 000.00	572,230, 696.00	1,297,23 4,126.00	15.62 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3.《易方达恒生中国企业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。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日