易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

2019 半年度 报告摘要

2019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：招商银行股份有限公司
送出日期：二〇一九年八月二十四日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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2019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	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）	
场内简称	香港小盘	
基金主代码	161124	
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2016年11月2日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,605,909.83份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016年11月10日	
下属分级基金的基金简称	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
下属分级基金的场内简称	香港小盘	-
下属分级基金的交易代码	161124	006263
报告期末下属分级基金的份额总额	28,005,190.89份	600,718.94份

注：自2018年8月13日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2018年8月14日。

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	易方达恒生综合小型股指数基金（香港小盘LOF）属于被动跟踪指数的证券投资基金。本基金主要采取完全复制指数的投资方案，期除基金管理人认定不合适投资的成份股后，完全复制剩余成份股的指数权重进行投资。报告期内，跟踪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。
业绩比较基准	恒生综合小型股指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%
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，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，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	张燕
	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-85104666	0755-83195201

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

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

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（2019年1月1日至2019年6月30日）	
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	2,121,608.54	26,838.27
本期利润	3,577,721.15	30,627.69
加权平均基金份额本期利润	0.1094	0.0732
本期基金份额净值增长率	9.32%	9.16%
3.1.2期末数据和指标	报告期末（2019年6月30日）	
	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A	易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C
期末可供分配基金份额利润	0.1005	0.0979
期末基金资产净值	30,820,269.92	659,537.24
期末基金份额净值	1.1005	1.0979

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

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）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	2.90%	0.90%	2.22%	0.93%	0.68%	-0.03%
过去三个月	-3.30%	1.10%	-4.99%	1.08%	1.69%	0.02%
过去六个月	9.32%	1.05%	3.83%	1.04%	5.49%	0.01%
过去一年	-5.51%	1.28%	-11.33%	1.24%	5.82%	0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.05%	1.10%	-0.24%	1.08%	10.29%	0.02%

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）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	2.89%	0.90%	2.22%	0.93%	0.67%	-0.03%
过去三个月	-3.37%	1.10%	-4.99%	1.08%	1.62%	0.02%
过去六个月	9.16%	1.05%	3.83%	1.04%	5.33%	0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.95%	1.25%	-9.02%	1.21%	5.07%	0.04%

注：自2018年8月13日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2018年8月14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

易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）

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

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）A

（2016年11月2日至2019年6月30日）

易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）C

（2018年8月14日至2019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2018年8月13日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2018年8月14日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为10.05%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。C类基金份额净值增长率为-3.95%，同期业绩比较基准收益率为-9.02%。

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[200114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、广州、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。易方达始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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，易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，易方达标普全球购物消费品指数增强型证券投资基金的基金经理，易方达300指数证券投资基金的基金经理，指数投资部总经理	2016-11-02	-	14年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、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、指数及增强投资部副总经理，易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深300指数证券投资基金）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基金经理，易方达标普500指数证券投资基金（LOF）基金经理，易方达沪深100交易型开放式指数基金联接基金基金经理，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金（LOF）基金经理，易方达标普500指数证券投资基金（LOF）基金经理，易方达沪深100交易型开放式指数证券投资基金（LOF）基金经理，易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理，易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理
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，易方达深证成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，易方达深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，易方达证券公司分类指数证券投资基金的基金经理，易方达证券公司分类指数证券投资基金的基金经理，易方达证券公司分类