易方达裕鑫债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期：二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达裕鑫债券	
基金主代码	003133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月5日	
报告期末基金份额总额	55,566,176.76份	
投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债新综合指数收益率（全价）×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达裕鑫债券A	易方达裕鑫债券C
下属分级基金的交易代码	003133	003134
报告期末下属分级基金的份额总额	55,256,117.18份	310,059.58份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日-2018年9月30日）	
	易方达裕鑫债券A	易方达裕鑫债券C
1.本期已实现收益	569,186.93	3,322.85
2.本期利润	1,233,083.07	6,546.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0206	0.0192
4.期末基金资产净值	54,468,063.69	303,785.49
5.期末基金份额净值	0.9857	0.9798

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本报告期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

易方达裕鑫债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	0.10%	0.23%	0.20%	1.83%	-0.10%

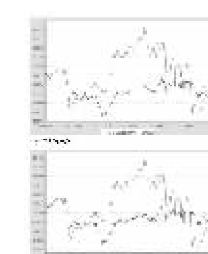
易方达裕鑫债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.98%	0.10%	0.23%	0.20%	1.75%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达裕鑫债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年9月5日至2018年9月30日)

易方达裕鑫债券A



注：自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为-1.43%，C类基金份额净值增长率为-2.02%，同期业绩比较基准收益率为-1.52%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张清华	本基金的基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理	2016-09-05	-	11年	硕士研究生，曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张磊	本基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理助理	2016-12-03	-	12年	硕士研究生，曾任泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心固定收益部研究员、投资经理，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益部投资经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理

注：1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期，张清华的"任职日期"为基金合同生效之日，张磊的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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。本基金管理人制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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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24次，其中23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，1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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度资本市场均经历了较大程度的波动。随着前期融资环境收紧的影响逐步体现，三季度经济下行压力逐步集聚，同时中美贸易摩擦升温也进一步加剧市场对于未来经济下行的担忧。货币政策持续宽松，流动性充裕，这推动无风险利率出现非常明显的下行。在内外环境日趋严峻下，前期偏紧的财政政策也出现调整，同时也开始强调宽货币到宽信用的转化，表内信贷投放明显增多，社会融资总量增速也有所企稳。在稳增长政策预期下，市场对于政策效果的期待明显上升。同时由于美国经济表现强劲，带动美债利率创出新高，人民币汇率贬值压力大幅上升，在此情形下，前期宽裕的资金面也出现了一些修正。三季度受到供给方的影响，大宗商品表现仍然较为强势，此外叠加猪肉和蔬菜价格上涨，市场对于通胀的回升也有所担心。多重因素一起推动无风险利率出现明显上行。尽管表内信贷投放加速，但是在风险偏好快速下降背景下，实体企业面临的流动性仍然偏紧，三季度违约事件频发，信用风险仍在继续发酵。

权益市场波动同样剧烈，对企业盈利的担心逐步增加，叠加金融去杠杆环境下流动性持续收紧，部分大盘蓝筹股票也出现了快速下跌，指数一度到达新低，但是在稳增长预期下有所修复。同时全球新兴市场动荡也对国内权益市场有所影响。

本基金在三季度的债券投资继续维持相对合理的久期和组合杠杆，减持部分资质相对较差的品种，以获取持有期收益为主要目标，维持组合流动性，时刻关注信用风险，积极根据市场情况进行利率债波段操作。权益方面，保持了较低的权益类资产配置比例，并在板块配置上维持了更为均衡的风格，力争取得更为稳定的回报。

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0.9857元，本报告期份额净值增长率为2.06%；C类基金份额净值为0.9798元，本报告期份额净值增长率为1.98%；同期业绩比较基准收益率为0.23%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,011,960.00	1.84
	其中：股票	1,011,960.00	1.84
2	固定收益投资	50,971,665.00	92.47
	其中：债券	50,971,665.00	92.47
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	2,183,913.63	3.96
7	其他资产	956,989.03	1.74
8	合计	55,124,527.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,011,960.00	1.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,011,960.00	1.85

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000401	冀东水泥	93,700	1,011,960.00	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	26,688,728.20	48.73
	其中：政策性金融债	26,688,728.20	48.73
4	企业债券	13,956,456.00	25.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,326,480.80	18.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,971,665.00	93.06

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	180208	18国开08	200,000	20,206,000.00	36.89
2	136374	16建业01	50,000	4,982,000.00	9.10
3	120001	16以岭EB	48,870	4,835,197.80	8.83
4	132004	15国盛EB	45,730	4,344,350.00	7.93
5	018006	国开1702	32,820	3,298,738.20	6.02

5.6 报告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。

5.7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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,598.90
2	应收证券清算款	1,490.78
3	应收股利	-
4	应收利息	887,898.05
5	应收申购款	1.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	956,989.03

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120001	16以岭EB	4,835,197.80	8.83
2	132004	15国盛EB	4,344,350.00	7.93
3	132008	17山高EB	1,146,933.00	2.09

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达裕鑫债券A	易方达裕鑫债券C
报告期期初基金份额总额	74,381,318.48	409,028.24
报告期基金总申购份额	11,836.91	45,691.64
减：报告期基金总赎回份额	19,137,038.21	144,660.30
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	55,256,117.18	310,059.58

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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
	1	2018年07月01日~2018年09月30日	39,999,000.00	-	-	39,999,000.00	71.98%
	2	2018年07月01日~2018年09月30日	29,333,100.80	-	17,500,000.00	11,833,100.80	21.30%
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。							

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会准予易方达裕鑫债券型证券投资基金注册的文件；
2.《易方达裕鑫债券型证券投资基金基金合同》；
3.《易方达裕鑫债券型证券投资基金托管协议》；
4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2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。

9.3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
二〇一八年十月二十四日

易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中债7-10年期国开行债券指数
基金主代码	003358
交易代码	003358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月27日
报告期末基金份额总额	988,108,811.12份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	标的指数"中债-7-10年期国开行债券指数"收益率
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	7,668,081.03
2.本期利润	6,701,161.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0073
4.期末基金资产净值	973,447,399.70
5.期末基金份额净值	0.9852

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。

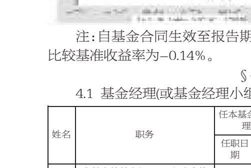
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.94%	0.15%	1.11%	0.15%	-0.17%	0.00%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2016年9月27日至2018年9月30日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-1.48%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张雅君	本基金的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、固定收益基金投资部总经理助理	2016-09-27	-	9年	硕士研究生，曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理。
王晓晨	本基金的基金经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部副总经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、易方达资产管理（香港）有限公司固定收益投资决策委员会委员	2017-02-15	-	15年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理。

注：1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期，张雅君的"任职日期"为基金合同生效之日，王晓晨的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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。本基金管理人制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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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24次，其中23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，1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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度债券市场经历了较大幅度的波动。随着前期融资环境收紧的影响逐步体现，三季度经济下行压力逐步显现，同时中美贸易摩擦升温也进一步加剧市场对于未来经济下行的担忧。同时货币政策持续宽松，流动性充裕，7月份债券收益率大幅下行。但7月下旬国务院常务会议召开，前期偏紧的财政政策出现调整，同时也开始强调宽货币到宽信用的转化，表内信贷投放明显增多，社会融资总量增速也有所企稳。在稳增长政策预期下，市场对于政策效果的期待明显上升。同时由于美国经济表现强劲，带动美债利率创出新高，人民币汇率贬值压力大幅上升，前期过度宽裕的资金面也出现了一些修正。此外叠加大宗商品表现强势，猪肉和蔬菜价格上涨，市场对于通胀的回升也有所担心。多重因素共同推动债券市场在8月份开始出现明显的回调。尽管表内信贷投放加速，但是在风险偏好快速下降背景下，实体企业面临的流动性仍然偏紧，三季度违约事件频发，信用风险仍在继续发酵。

三季度本基金对持仓债券进行了一定的结构调整，使其更精确的复制指数。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.9852元，本报告期份额净值增长率为0.94%，同期业绩比较基准收益率为1.11%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	954,886,000.00	98.00
	其中：债券	954,886,000.00	98.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	7,390,622.73	0.76
7	其他资产	12,059,060.85	1.24
8	合计	974,335,683.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	954,886,000.00	98.09
	其中：政策性金融债	954,886,000.00	98.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	954,886,000.00	98.09

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	170215	17国开15	2,200,000	218,086,000.00	22.40
2	180210	18国开10	2,200,000	217,206,000.00	22.31
3	170210	17国开10	2,200,000	215,028,000.00	22.09
4	160210	16国开10	1,500,000	138,855,000.00	14.26
5	150218	15国开18	600,000	57,876,000.00	5.95

5.6 报告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。

5.7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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2本基金本报告期没有投资股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	36.41
2	应收证券清算款	500,613.01
3	应收股利	-
4	应收利息	11,543,142.14
5	应收申购款	15,269.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,059,060.85

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	789,529,706.01
报告期基金总申购份额	806,465,325.44
减：报告期基金总赎回份额	607,886,220.33
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	988,108,811.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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09月11日~2018年09月30日	-	203,810,251.71	-	203,810,251.71	20.63%
	2	2018年07月01日~2018年08月06日，2018年08月17日~2018年09月06日，2018年09月11日~2018年09月30日	200,003,000.00	-	-	200,003,000.00	20.24%
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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金注册的文件；
2.《易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金合同》；
3.《易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金托管协议》；
4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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
二〇一八年十月二十四日

易方达上证50指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期：二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达上证50分级		
基金主代码	502048		
交易代码	502048		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年4月15日		
报告期末基金份额总额	556,722,570.91份		
投资目标	紧密追踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。		
业绩比较基准	上证50指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	从投资者持有的基金份额来看，基础份额为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金；A类份额具有预期风险、收益较低的特征；B类份额具有预期风险、收益较高的特征。		
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		
下属分级基金的基金简称	易方达上证50分级	易方达上证50分级A	易方达上证50分级B
下属分级基金场内简称	50分级	上证50A	上证50B
下属分级基金的交易代码	502048	502049	502050
报告期末下属分级基金的份额总额	292,813,512.91份	131,954,529.00份	131,954,529.00份
下属分级基金的风险收益特征	基础份额为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	A类份额具有预期风险、收益较低的特征。	B类份额具有预期风险、收益较高的特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	4,838,344.30
2.本期利润	28,824,705.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0532
4.期末基金资产净值	489,404,467.74
5.期末基金份额净值	0.8791

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。

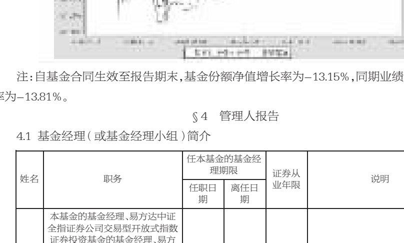
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.26%	1.33%	4.86%	1.36%	1.40%	-0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

易方达上证50指数分级证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2015年4月15日至2018年9月30日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-13.15%，同期业绩比较基准收益率为-13.81%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2015-04-15	-	13年	硕士研究生，曾任汇丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

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，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 公平交易专项说明

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。本基金管理人制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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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24次，其中23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，1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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度国内经济增速回落，前期货币、财政政策收紧的效果逐步传导至实体经济。中美贸易摩擦的影响逐步显现，导致外需承压。宏观数据显示9月份PMI指数大幅回落至50.8%，比上月回落0.5个百分点，创2018年年内次低，经济下行压力显现。新订单指数和出口订单指数双双下滑，显示内外需均相对疲弱。8月工业企业利润增速从上月的16.2%大幅放缓至9.2%。在货币政策方面，央行三季度货币政策例会称，未来稳健的货币政策保持中性，要松紧适度，管好货币供给总闸门，保持流动性合理充裕。季度末美元指数连续回升，人民币对美元即期汇率延续前期贬值预期，季末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均贬至6.88。资本市场方面，受国内去杠杆政策压制以及中美贸易摩擦升级影响，市场风险偏好回落，最终三季度上证综指以下跌0.92%收官。风格方面，大小盘结构分化显著，低估值大盘股表现较好，中小市值股票在退市制度改革等因素影响下普遍承压，上证50指数上涨5.11%，创业板指大幅下跌12.16%；行业方面，保险、银行、采掘、钢铁、国防军工等板块涨幅居前，家用电器、纺织服装、医药生物、电子、传媒等板块跌幅较大。

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

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.8791元，本报告期份额净值增长率为6.26%，同期业绩比较基准收益率为4.86%，日跟踪偏离度的均值为0.04%，年化跟踪误差为0.997%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	462,973,732.04	93.66
	其中：股票	462,973,732.04	93.66
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	27,976,475.10	5.66
7	其他资产	3,380,200.12	0.68
8	合计	494,330,407.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	19,709,424.96	4.03
C	制造业	122,048,152.31	24.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	22,325,263.78	4.56
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,067,833.20	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,086,628.07	1.24
J	金融业	272,130,188.23	55.60
K	房地产业	13,606,241.49	2.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	462,973,732.04	94.60

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,053,467	72,162,489.50	14.74
2	600519	贵州茅台	48,932	35,720,360.00	7.30
3	600036	招商银行	1,003,075	30,784,371.75	6.29
4	601166	兴业银行	1,212,214	19,334,813.30	3.95
5	600016	民生银行	2,758,926	17,491,590.84	3.57
6	601328	交通银行	2,671,943	15,604,147.12	3.19
7	600887	伊利股份	591,211	15,182,298.48	3.10
8	601288	农业银行	3,725,485	14,492,136.65	2.96
9	600276	恒瑞医药	214,901	13,646,213.50	2.79
10	600030	中信证券	765,509	12,776,345.21	2.61

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告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。

5.7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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.12018年3月26日，中国人民银行福州中心支行针对兴业银行股份有限公司违反国库管理规定的违法行为，给予警告并处罚款5万元人民币。

2018年4月19日，中国银保监会针对兴业银行的如下事由罚款5870万元：(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；(二)非真实转让信贷资产；(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务；(四)内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；(六)债券卖出回购业务违规出表；(七)个人理财资金违规投资；(八)提供日期倒签的材料；(九)部分非现场监管统计数据与事实不符；(十)个别董事未经任职资格核准即履职；(十一)变相批量转让个人贷款；(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

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。

2018年7月5日，深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款30万元。

2018年7月26日，中国人民银行针对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户，罚款人民币130万元。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除兴业银行、招商银行、交通银行外，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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	43,402.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,697.24
5	应收申购款	3,330,100.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,380,200.12

5.11.4报告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。

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达上证50分级	易方达上证50分级A	易方达上证50分级B
报告期期初基金份额总额	284,705,330.44	133,173,579.00	133,173,579.00
报告期基金总申购份额	51,494,993.95	-	-
减：报告期基金总赎回份额	45,824,911.48	-	-
报告期基金拆分变动份额	2,438,100.00	-1,219,050.00	-1,219,050.00
报告期期末基金份额总额	292,813,512.91	131,954,529.00	131,954,529.00

注：拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《资管新规》）要求，公募产品不得进行份额分级，本基金将在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范，请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达上证50指数分级证券投资基金募集注册的文件；
2. 《易方达上证50指数分级证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达上证50指数分级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。

9.2 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。

9.3 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
二〇一八年十月二十四日