易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)

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	易方达中债新综指发起式(LOF)	
场内简称	易基综债	
基金主代码	161119	
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)、发起式	
基金合同生效日	2012年11月8日	
报告期末基金份额总额	97,169,597.28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。	
投资策略	本基金为被动管理的指数基金,主要采用分层抽样复制和动态最优化的方法,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	中债-新综合指数	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达中债新综指发起式(LOF)A	易方达中债新综指发起式(LOF)C
下属分级基金的交易代码	161119	161120
报告期末下属分级基金的份额总额	79,532,284.92份	17,637,312.36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)	
	易方达中债新综指发起式(LOF)A	易方达中债新综指发起式(LOF)C
1.本期已实现收益	418,954.03	74,258.33
2.本期利润	1,752,400.11	336,467.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.0177
4.期末基金资产净值	103,459,393.82	22,585,482.00
5.期末基金份额净值	1.3008	1.2806

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

易方达中债新综指发起式(LOF)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	1.50%	0.08%	1.48%	0.06%	0.02%	0.02%

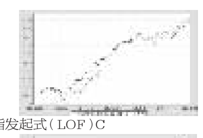
易方达中债新综指发起式(LOF)C

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	1.43%	0.08%	1.48%	0.06%	-0.05%	0.02%

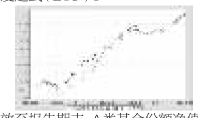
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)
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
(2012年11月8日至2018年9月30日)

易方达中债新综指发起式(LOF)A



易方达中债新综指发起式(LOF)C



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30.08%,C类基金份额净值增长率为28.06%,同期业绩比较基准收益率为28.70%。

§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		
王晓晨	本基金的基金经理、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、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	2014-07-05	-	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“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年三季度我国宏观经济仍然面临一定的不确定性。7-8月工业增加值同比增速位于6-6.1%左右的偏低水平,季度环比数据则相对更弱。三季度以来固定资产投资增速进一步下行,其中基建投资的不断下滑是主要推动原因,值得特别关注。房地产投资及制造业投资则相对稳定,但2017年四季度制造业投资增速明显上行,将对今年未来几个月的同比数据构成压力。外贸方面,此前较为稳定的出口增速在8月份也有所回落。此前市场担忧较多的社融数据近期同比增速开始企稳,但结构上仍然难言乐观,其中信托及委托贷款维持下滑态势,票据冲量的现象依旧较为明显。通胀数据在三季度以来小幅升温,结构上食品及非食品部分均高于预期。

三季度央行仍然维持了相对宽松的货币环境,债券市场流动性较为充裕。7月份市场收益率整体下行,随后8-9月份有所回升,反映出市场投资者对于宏观经济走势仍抱有信心。在三季度收益率波动的过程中,中短端品种整体表现较好,收益率曲线由此前极为平坦的形态趋向于正常。由于信用事件的发生频率仍然偏高,信用利差并未收窄,评级间利差依然保持在相对偏高的水平上。

操作上,基金总体上按照指数的结构和久期进行配置。但是由于基金规模仍然较小,分类债券资产的权重与指数中该资产的权重仍存在一定偏差,基金在一定程度上采取了较为灵活的配置策略。

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1.3008元,本报告期份额净值增长率为1.50%;C类基金份额净值为1.2806元,本报告期份额净值增长率为1.43%;同期业绩比较基准收益率为1.48%。

§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	148,279,703.70	95.94
	其中:债券	148,279,703.70	95.94
	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	2,719,191.26	1.76
7	其他资产	3,555,740.46	2.30
8	合计	154,554,635.42	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	79,947,000.00	63.43
	其中:政策性金融债	79,947,000.00	63.43
4	企业债券	58,196,703.70	46.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,136,000.00	8.04
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	148,279,703.70	117.64

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	180204	18国开04	200,000	20,582,000.00	16.33
2	180210	18国开10	200,000	19,746,000.00	15.67
3	180205	18国开05	100,000	10,459,000.00	8.30
4	1280362	12曲公路债	100,000	10,353,000.00	8.21
5	101573010	15安庆城投MTN001	100,000	10,136,000.00	8.04

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	285.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,470,022.48
5	应收申购款	85,432.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,555,740.46

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

项目	易方达中债新综指发起式(LOF)A	易方达中债新综指发起式(LOF)C
报告期期初基金份额总额	93,362,380.64	18,698,095.81
报告期基金总申购份额	9,909,018.23	1,411,192.98
减:报告期基金总赎回份额	23,739,113.95	2,471,976.43
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	79,532,284.92	17,637,312.36

§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

单位:份

项目	易方达中债新综指发起式(LOF)A	易方达中债新综指发起式(LOF)C
报告期期初管理人持有的本基金份额	29,709,723.72	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	29,709,723.72	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	37.36	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	29,709,723.72	30.5751%	10,000,450.04	10.2917%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	29,709,723.72	30.5751%	10,000,450.04	10.2917%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	29,709,723.72	-	-	29,709,723.72	30.58%
	2	2018年07月01日~2018年08月27日	37,664,135.72	-	22,000,000.00	15,664,135.72	16.12%
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。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)募集的文件;

2.《易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照。

10.2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。

10.3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

易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	易方达标普生物科技指数(QDII-LOF)	
场内简称	标普生物	
基金主代码	161127	
交易代码	161127	
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)	
基金合同生效日	2016年12月13日	
报告期末基金份额总额	119,869,921.57份	
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	作为追踪标普生物指数的被动式海外指数基金,本基金采用完全复制法,力求追踪误差最小化。	
业绩比较基准	标普生物科技精选行业指数收益率(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。本基金主要投资美国证券市场,需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
境外投资顾问	英文名称:无	
	中文名称:无	
境外资产托管人	英文名称:State Street Bank and Trust Company	
	中文名称:道富银行	

§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	1,697,404.25
2.本期利润	3,940,031.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0405
4.期末基金资产净值	172,094,231.51
5.期末基金份额净值	1.4357

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。

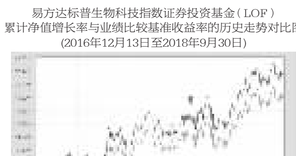
3.2 基金净值表现

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	4.38%	1.07%	4.50%	1.09%	-0.12%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)
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12月13日至2018年9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43.57%,同期业绩比较基准收益率为53.99%。

§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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自2017年06月23日至2018年08月10日)、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自2016年11月28日至2018年08月10日)、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自2016年12月13日至2018年08月10日)、易方达标普500指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自2016年12月02日至2018年08月10日)、量化策略部副总经理	2016-12-13	2018-08-11	10年	博士研究生,曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员,易方达基金管理有限公司指数与量化投资部指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员、量化基金组合部副总经理、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基金经理、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理。
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(自2010年03月31日至2018年08月10日)、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(自2010年03月29日至2018年08月10日)、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、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自2016年12月03日至2018年08月10日)、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理(自2016年12月15日至2018年08月10日)、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(自2016年12月06日至2018年08月10日)、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	2016-12-15	2018-08-11	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。
FAN BING(范冰)	本基金的基金经理、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、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达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MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2017-03-25	-	13年	硕士研究生,曾任皇家加拿大银行托管部核算专员,美国道富集团Middle Office中台交易支持专员,巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管,贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。
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、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式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、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普500指数证券投资基金(LOF)的基金经理	2018-08-11	-	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“离任日期”为公告确定的解聘日期,林伟斌的“任职日期”为基金合同生效之日,FAN BING(范冰)、张胜记、刘树荣的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金没有请境外投资顾问。

4.3报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年三季度,美国经济数据强劲,PMI数据超预期,就业和工资数据也显示经济保持增长,GDP增速也达到近年来的最好水平。美国与各国的贸易摩擦不断升级,出台对外国企业限制投资法案,与中国互相加征关税,但同时也在和加拿大、墨西哥、日本和欧盟等传统盟国谈判新的贸易协定。二季报数据显示美股企业盈利继续好于预期,对股价提供了支撑。2018年9月份美联储如期加息25基点,并维持年内加息四次的指引。在Jackson Hole年会上,美联储主席鲍威尔重申渐进式加息的合理性。

作为追踪标普生物指数的被动式海外指数基金,本基金采用完全复制法,力求追踪误差最小化。

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1.4357元,本报告期份额净值增长率为4.38%,同期业绩比较基准收益率为4.50%,年化跟踪误差0.688%,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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	161,215,171.93	91.95
	其中:普通股	161,215,171.93	91.95
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	2,638,035.62	1.50
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	11,256,543.41	6.42
8	其他资产	211,681.47	0.12
9	合计	175,321,432.43	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	161,215,171.93	93.68
合计	161,215,171.93	93.68

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。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	161,215,171.93	93.68
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	161,215,171.93	93.68

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ACADIA Pharmaceuticals Inc	-	ACAD US	纳斯达克证券交易所	美国	21,175	3,024,048.17	1.76
2	Viking Therapeutics Inc	-	VKTX US	纳斯达克证券交易所	美国	22,851	2,738,364.76	1.59
3	Alexion Pharmaceuticals Inc	-	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,487	2,378,262.37	1.38
4	Sangamo Therapeutics Inc	-	SGMO US	纳斯达克证券交易所	美国	19,792	2,307,795.49	1.34
5	Ionis Pharmaceuticals Inc	-	IONS US	纳斯达克证券交易所	美国	6,390	2,267,358.18	1.32
6	TESARO Inc	-	TSRO US	纳斯达克证券交易所	美国	8,416	2,258,497.49	1.31
7	AnaptysBio Inc	-	ANAB US	纳斯达克证券交易所	美国	3,242	2,225,107.10	1.29
8	Array BioPharma Inc	-	ARRY US	纳斯达克证券交易所	美国	21,221	2,218,949.25	1.29
9	Ligand Pharmaceuticals Inc	-	LGND US	纳斯达克证券交易所	美国	1,154	2,179,065.44	1.27
10	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,642	2,177,122.89	1.27

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR S&P Biotech ETF	ETF	开放式	SSgA Funds Management Inc	2,638,035.62	1.53

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,109.04
5	应收申购款	209,572.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	211,681.47

5.10.4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。

5.10.5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

报告期期初基金份额总额	72,513,422.85
报告期基金总申购份额	62,740,845.62
减:报告期基金总赎回份额	15,384,346.90
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	119,869,921.57

注:本基金份额变动含易方达标普生物科技指数(QDII-LOF)人民币份额及美元现汇份额。

§7 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)注册的文件;

2.《易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2 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。

8.3 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

易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金

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:中国工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。

基金托管人中国工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	易方达中证500ETF
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2015年8月27日
报告期末基金份额总额	1,719,978.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时,基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下,本基金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%。
业绩比较基准	中证500指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§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	-269,000.38
2.本期利润	-892,875.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5191
4.期末基金资产净值	8,107,846.41
5.期末基金份额净值	4.7139

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.本基金已于2015年9月9日进行了基金份额折算,折算比例为0.15409267。

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	-9.92%	1.26%	-7.99%	1.30%	-1.93%	-0.04%

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

易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金
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
(2015年8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-27.36%,同期业绩比较基准收益率为-23.05%。

§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、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证50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	2016-04-16	-	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。
杨俊	本基金的基金经理、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、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-06-23	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

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。报告期内中证500指数下跌7.99%。

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4.7139元,本报告期份额净值增长率为-9.92%,同期业绩比较基准收益率为-7.99%,日跟踪偏离度的均值为0.05%,年化跟踪误差为0.982%,各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期,本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

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

§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	7,979,448.30	94.50
	其中:股票	7,979,448.30	94.50
2	固定收益投资	999.99	0.01
	其中:债券	999.99	0.01
	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	459,904.66	5.45
7	其他资产	3,676.00	0.04
8	合计	8,444,028.95	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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	69,864.27	0.86
B	采矿业	190,869.90	2.35
C	制造业	4,766,428.66	58.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	245,350.60	3.03
E	建筑业	114,328.78	1.41
F	批发和零售业	433,677.09	5.35
G	交通运输、仓储和邮政业	291,188.34	3.59
H	住宿和餐饮业	35,652.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	702,196.56	8.66
J	金融业	201,794.64	2.49
K	房地产业	453,937.42	5.60
L	租赁和商务服务业	130,791.48	1.61
M	科学研究和技术服务业	15,310.20	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	52,062.34	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,616.82	0.07
Q	卫生和社会工作	12,502.80	0.15
R	文化、体育和娱乐业	146,147.00	1.80
S	综合	111,729.40	1.38
	合计	7,979,448.30	98.42

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	000661	长春高新	330	78,210.00	0.96
2	002147	新光圆成	4,902	72,353.52	0.89
3	600086	东方金钰	6,046	60,701.84	0.75
4	603019	中科曙光	1,120	52,505.60	0.65
5	600201	生物股份	2,852	48,541.04	0.60
6	600256	广汇能源	9,410	48,085.10	0.59
7	000703	恒逸石化	2,787	47,239.65	0.58
8	000860	顺鑫农业	1,020	46,512.00	0.57
9	600426	华鲁恒升	2,700	46,467.00	0.57
10	000977	浪潮信息	1,910	45,992.80	0.57

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	999.99	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	999.99	0.01

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	113518	顾家转债	10	999.99	0.01

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,596.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	79.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,676.00

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002147	新光圆成	72,353.52	0.89	重大事项停牌
2	600086	东方金钰	60,701.84	0.75	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,719,978.00
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,719,978.00

注:期初基金总份额包含场外份额623,463份;期末基金总份额包含场外份额623,463份。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	623,463.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	623,463.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.25

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07月01日~2018年09月30日	623,463.00	-	-	623,463.00	36.25%
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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会注册易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2.《易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3.《易方达中证500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。

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