易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

【2016】第四季度报告

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:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月18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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达上证中盘ETF
基金主代码	510130
交易代码	510130
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年3月29日
报告期末基金份额总额	73,085,089.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资,即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生,基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-6,839,922.78
2.本期利润	7,675,416.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.1016
4.期末基金资产净值	255,633,664.96
5.期末基金份额净值	3.4978

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2010年5月28日进行了基金份额折算,折算比例为0.34394741。

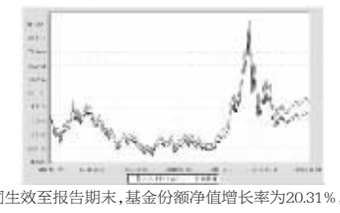
3.2 基金净值表现

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	2.77%	0.66%	1.95%	0.69%	0.82%	-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

易方达上证中盘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
(2010年3月29日至2016年12月31日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为20.31%,同期业绩比较基准收益率为5.21%。

§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、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、指数与量化投资部副总经理	2010-03-29	-	11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。

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。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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12次,皆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。

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

2016年第四季度,国内经济复苏态势良好,通胀有所抬头。1-11月份全国固定资产投资同比增长8.3%,房地产开发同比增长6.5%,维持高位;11月份规模以上工业增加值同比实际增长6.2%, 社会消费品零售总额同比增长10.8%, 保持稳定。居民消费价格指数(CPI)同比上涨2.3%,工业生产者出厂价格指数(PPI)同比增长3.3%,通胀上升迹象比较明显。央行货币政策继续偏紧,国债等无风险利率上行,广义货币供应量M2同比增长11.4%,居民中长期贷款占比居高不下,反映出地产销售维持高位。政策上,去杠杆力度加大,热点城市房地产调控政策逼近历史最严。报告期内,A股先涨后跌,结构分化加大,上证指数上涨3.29%,创业板、中小板继续下跌,上证中盘指数上涨1.95%。从行业表现来看,建筑、钢铁、化工、食品饮料等板块涨幅居前;传媒、计算机、房地产、电子等行业跌幅较大。

上证中盘ETF基金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。

4.4.2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3.4978元,本报告期份额净值增长率为2.77%,同期业绩比较基准收益率为1.95%,年化跟踪误差0.53%,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	248,403,969.70	96.94
	其中:股票	248,403,969.70	96.94
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	7,849,923.45	3.06
7	其他资产	4,245.72	0.00
8	合计	256,258,138.87	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	847,032.00	0.33
B	采矿业	10,501,966.73	4.11
C	制造业	90,069,863.13	35.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,640,077.00	8.07
E	建筑业	12,278,726.18	4.80
F	批发和零售业	13,372,321.62	5.23
G	交通运输、仓储和邮政业	15,818,548.16	6.19
H	住宿和餐饮业	489,036.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,880,393.63	5.82
J	金融业	31,100,535.61	12.17
K	房地产业	31,364,812.45	12.27
L	租赁和商务服务业	2,428,055.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	841,520.00	0.33
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	824,585.79	0.32
S	综合	2,946,496.40	1.15
	合计	248,403,969.70	97.17

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	600900	长江电力	680,577	8,616,104.82	3.37
2	600276	恒瑞医药	145,247	6,608,738.50	2.59
3	600015	华夏银行	551,000	5,978,350.00	2.34
4	601009	南京银行	374,935	4,064,296.40	1.59
5	600795	国电电力	1,215,800	3,854,086.00	1.51
6	601899	紫金矿业	1,140,800	3,810,272.00	1.49
7	601939	建设银行	692,519	3,767,303.36	1.47
8	601099	太平洋	702,891	3,619,888.65	1.42
9	600585	海螺水泥	206,300	3,498,848.00	1.37
10	600019	宝钢股份	508,954	3,231,857.90	1.26

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

5.11.1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	2,524.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,720.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,245.72

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

报告期期初基金份额总额	77,885,089.00
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	4,800,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	73,085,089.00

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3.《易方达上证中盘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。

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
二〇一七年一月二十日

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

【2016】第四季度报告

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:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月18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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达上证中盘ETF联接
基金主代码	110021
交易代码	110021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月31日
报告期末基金份额总额	174,017,837.53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。力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为上证中盘ETF的联接基金。上证中盘ETF是采用完全复制法实现对上证中盘指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于上证中盘ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用实物申购的方式或证券二级市场交易的方式进行上证中盘ETF 的买卖。待指数衍生金融产品推出以后,基金管理人在履行适当程序后,本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为上证中盘ETF 的联接基金,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于上证中盘ETF 追踪业绩比较基准,具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。
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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510130
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年3月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年6月23日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

基金名称	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资,即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生,基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

§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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	1,771,510.42
2.本期利润	5,651,579.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0319
4.期末基金资产净值	209,276,092.68
5.期末基金份额净值	1.2026

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。

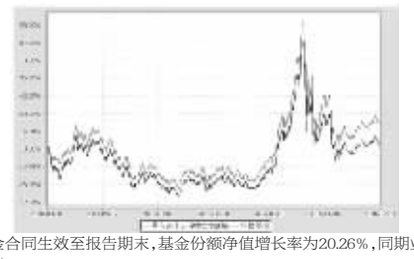
3.2 基金净值表现

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	2.59%	0.62%	1.86%	0.65%	0.73%	-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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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
(2010年3月31日至2016年12月31日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为20.26%,同期业绩比较基准收益率为4.18%。

§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、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、指数与量化投资部副总经理	2010-03-31	-	11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。

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。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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12次,皆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。

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

2016年第四季度,国内经济复苏态势良好,通胀有所抬头。1-11月份全国固定资产投资同比增长8.3%,房地产开发同比增长6.5%,维持高位;11月份规模以上工业增加值同比实际增长6.2%, 社会消费品零售总额同比增长10.8%, 保持稳定。居民消费价格指数(CPI)同比上涨2.3%,工业生产者出厂价格指数(PPI)同比增长3.3%,通胀上升迹象比较明显。央行货币政策继续偏紧,国债等无风险利率上行,广义货币供应量M2同比增长11.4%,居民中长期贷款占比居高不下,反映出地产销售维持高位。政策上,去杠杆力度加大,热点城市房地产调控政策逼近历史最严。报告期内,A股先涨后跌,结构分化加大,上证指数上涨3.29%,创业板、中小板继续下跌,上证中盘指数上涨1.95%。从行业表现来看,建筑、钢铁、化工、食品饮料等板块涨幅居前;传媒、计算机、房地产、电子等行业跌幅较大。

本基金是易方达上证中盘ETF的联接基金,主要投资于上证中盘ETF。报告期内,本基金依据申购赎回的情况进行日常操作,控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低水平上。

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1.2026元,本报告期份额净值增长率为2.59%,同期业绩比较基准收益率为1.86%,年化跟踪误差0.53%,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	21,885.00	0.01
	其中:股票	21,885.00	0.01
2	基金投资	196,961,240.42	93.34
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,010,179.21	6.64
8	其他资产	23,353.00	0.01
9	合计	211,016,657.63	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	196,961,240.42	94.12

5.3报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	21,885.00	0.01
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	21,885.00	0.01

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投资明细

代码	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	600649	城投控股	900	18,306.00	0.01
2	600773	西藏城投	300	3,579.00	0.00

5.5 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。

5.6 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10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。

5.11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。

5.12投资组合报告附注

5.12.1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。

5.12.2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。

5.12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,348.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,698.71
5	应收申购款	16,305.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,353.00

5.12.4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。

5.12.5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	600649	城投控股	18,306.00	0.01	重大事项停牌

§6开放式基金份额变动

单位:份

序号	
	181,037,075.85
报告期基金总申购份额	6,327,200.25
减:报告期基金总赎回份额	13,346,438.57
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	174,017,837.53

§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备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会核准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募集的文件;

2.《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合同》;

3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《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托管协议》;

5.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
二〇一七年一月二十日

银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20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2017年1月19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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河转型混合
场内简称	-
交易代码	519651
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月12日
报告期末基金份额总额	2,668,692,591.91份
投资目标	本基金将充分把握我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济战略布局过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司的研究投资优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的红利,在严格控制投资风险的条件下,力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金为权益类资产主要投资于转型增长主题领域的相关行业及其子行业的混合型基金,在投资中将对基金的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础,进而结合"自上而下"的资产配置策略和"自下而上"的个股精选策略,注重股票资产在转型增长主题相关行业内及其子行业的配置,并考虑相关市场的估值风险和大类资产的系统风险,通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。 本基金为权益类资产主要投资于转型增长主题的混合型基金,投资策略主要包括但不限于资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略以及资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为权益类资产主要投资于转型增长主题的混合基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种,其风险收益水平高于货币基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-168,098,205.82
2.本期利润	-116,490,015.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0425
4.期末基金资产净值	1,475,628,448.21
5.期末基金份额净值	0.553

注:1.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。

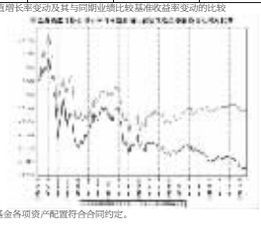
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.21%	0.79%	-0.66%	0.58%	-6.55%	0.21%

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



注:截止2015年11月12日建仓期满,本基金各项资产配置符合合同约定。

3.3 其他指标

注:无。

§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		
王海华	银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河行业优选混合型证券投资基金的基金经理、银河康乐股票型证券投资基金的基金经理	2016年12月29日	-	11	硕士研究生学历,曾就职于中石化集团第三建设公司、宁波华能国际贸易与经济合作有限公司。2004年6月加入银河基金管理有限公司,历任交易员、研究员、高级研究员、基金经理助理等职,2013年12月起担任银河行业优选混合型证券投资基金的基金经理,2014年11月起担任银河康乐股票型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2016年7月担任银河蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月起担任银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
卢轶乔	银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河消费驱动混合型证券投资基金的基金经理	2015年5月13日	2016年12月29日	7	博士研究生学历,曾就职于建设银行。2008年7月加入银河基金管理有限公司,历任研究员、银河消费驱动股票型证券投资基金的基金经理助理等职;2012年12月起担任银河消费驱动混合型证券投资基金的基金经理。

注:1.上表中卢轶乔的任职日期为基金合同生效之日,卢轶乔的离任日期为公司做出决定之日;王海华的任职日期为公司做出决定之日;

2.证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着"诚实信用、勤奋律己、创新图强"的原则管理和运用基金资产,在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值,努力实现基金份额持