

## 易方达国企改革指数分级证券投资基金

## [2016]第四季度报告

2016年第4季度报告

2016年12月31日

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：二〇一七年一月二十日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中银国际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。

本报告中财务数据未经审计。

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		易方达国企改革指数分级证券投资基金	
基金主代码		660237	
交易代码		660237	
基金运作方式		契约型开放式,分级基金,收益基金	
基金合同生效日		2016年4月1日	
报告期末基金资产净值		420,000,000.00	
报告日期		本基金的报告期指基期,即本基金的净值增长率为与同期业绩比较基准收益率的最小化。	
投资策略		本基金主要投资于易方达国企改革指数成份股,并辅以少量的现金类资产,以期在控制风险的前提下,通过投资于易方达国企改革指数成份股,分享中国经济改革进程中,国有企业改革和发展的成果,并力争超越业绩比较基准。	
业绩比较基准		96%×中国国企改革指数收益率+4%×同期银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征		本基金是一只股票型基金,主要投资于完全复制鹏华国企改革指数的股票,风险相对较高。本基金将通过投资于易方达国企改革指数成份股,分享中国经济改革进程中,国有企业改革和发展的成果,并力争超越业绩比较基准。	
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	
报告期天数		92	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末总资产		420,000,000.00	
报告期末负债		0.0000	
报告期末所有者权益		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,000,000.00	
报告期末可供分配基金份额总额		0.0000	
报告期末基金份额净值		1.0000	
报告期末基金份额总额		420,00	