

易方达资源行业混合型证券投资基金

[2016]第四季度报告

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2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达资源行业混合
基金主代码	110026
交易代码	110026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月1日
报告期末基金份额总额	1,407,717,152.12份
本基金主要投资于资源行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的绝对回报。	
投资目标	本基金将根据对资源行业各分子行业的综合分析，确定各分子行业的资产配置比例，精选个股进行投资，在充分考虑行业集中度的基础上，选择具有核心竞争力、估值合理的公司进行投资。
投资策略	本基金将根据对资源行业各分子行业的综合分析，确定各分子行业的资产配置比例，精选个股进行投资，在充分考虑行业集中度的基础上，选择具有核心竞争力、估值合理的公司进行投资。
业绩比较基准	中证细分行业主题指数收益率×80%+恒生指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上风险收益水平高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金，同类型基金相比，在享受资源行业收益的同时，也必须承担相应的资源行业投资风险。
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		70,386,177.37			
2.本期利润		-20,706,860.20			
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0195			
4.期末基金份额净值		1,407,108,026.04			
5.期末基金资产净值		1,428,709,277.50			

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将有所下降。

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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	4.24%	1.53%	1.96%	0.03%	2.28%	0.60%

3.2.2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

易方达资源行业混合型证券投资基金

累计净值增长与业绩比较基准收益的历史走势对比图(2011年8月16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-4.10%,同期业绩比较基准收益率为-39.21%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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
王超	本基金的基金经理、易方达港股成长证券投资基金的基金经理	2013-04-27	-	6年

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 管理人对报告期内基金运作的说明

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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 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法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

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 报告期内基金的估值政策和业绩表现说明

本报告期内基金未进行份额折算。

4.6 公平交易专项说明

4.6.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

4.6.2异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

4.7 报告期内基金的估值政策和业绩表现说明

本报告期内基金未进行份额折算。

4.8 备查文件目录

1.中国证监会准许本基金募集的文件;

2.《易方达资源行业混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《易方达资源行业混合型证券投资基金托管协议》;

5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

6.4.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.2异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.3公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.4异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.5公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.6异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.7公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.8异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.9公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.10异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.11公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.12异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.13公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.14异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.15公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.16异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.17公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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。

6.4.18异常交易行为的专项说明

本基金管理人未发现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,皆为指量化投资组合因投资策略需要而与其他组合发生的影响。

6.4.19公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立法律、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对待各投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资风险管理制度,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,以尽可能确保公平对待各投资