易方达深证100交易型开放式指数基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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4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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达深证100ETF
场内简称	深100ETF
基金主代码	159901
交易代码	159901
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年3月24日
报告期末基金份额总额	848,967,465.00份
投资目标	紧密跟踪目标指数,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。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例,以此构建本基金实际的投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证100价格指数
风险收益特征	本基金属股票基金,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,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、以及标的指数所代表的股票市场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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-5,543,378.43
2.本期利润	193,988,831.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.2209
4.期末基金资产净值	3,537,129,226.14
5.期末基金份额净值	4.1664

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2006年4月14日进行了基金份额折算,折算比例为0.94948342。

4. 本基金已于2010年11月19日进行了基金份额拆分,拆分比例为5:1,即每一份基金份额拆成5份。

5.本基金已于2014年8月29日进行了基金份额合并,合并比例为0.2:1,即每5份基金份额合并成1份。

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

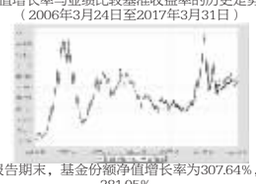
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.55%	0.79%	5.66%	0.79%	-0.11%	0.00%

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

易方达深证100交易型开放式指数基金

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

(2006年3月24日至2017年3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307.64%,同期业绩比较基准收益率为281.05%。

§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		
成曦	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、易方达生物科技指数分级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	2016-05-07	-	9年	硕士研究生,曾任华泰联合证券资产管理部研究员,易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。

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11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

2017年第一季度,经济景气度上升,通胀保持温和,工业企业利润增速大幅走高。1-2月份,全国规模以上工业企业实现利润同比增长31.5%,增幅较大;固定资产投资同比增长8.9%,增幅有所回落,但房地产开发同比增长8.9%,远高于去年同期3.0%的增幅;社会消费品零售总额同比增长9.5%,保持稳定。1月份全国居民消费价格指数(CPI)同比上涨2.55%,2月CPI同比增速明显放缓至0.8%,主要是由于春节后食品价格持续下跌,工业生产者出厂价格指数(PPI)则走出本轮新高,升至7.8%。货币政策方面,央行明确货币宽松的退出,并执行稳健中性的货币政策,继续推动金融市场去杠杆;广义货币供应量M2同比增长11.1%,增幅持续下降,银行间市场流动性3月下旬明显偏紧。尽管美元走强且中国录得贸易逆差,但2月外汇储备仍增加69.2亿美元至30,051亿美元,表明当月外汇有净流入。综合目前的市场数据来看,经济总体持续复苏迹象明显。报告期内,A股市场整体震荡上扬,但结构有所分化,上证指数上涨3.8%,创业板指数下跌2.8%。行业走势表现上,家用电器、食品饮料、国防军工、建筑装饰、钢铁、建筑材料、交通运输以及电子行业涨幅均在5%以上,而传媒、农林牧渔、纺织服装等行业跌幅在3%以上。

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4.1664元,本报告期份额净值增长率为5.55%,同期业绩比较基准收益率为5.66%,日跟踪偏离度的均值为0.01%,年化跟踪误差0.09%,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	3,509,525,914.43	99.14
	其中:股票	3,509,525,914.43	99.14
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	27,160,923.18	0.77
7	其他资产	3,448,310.27	0.10
8	合计	3,540,135,147.88	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	124,868,131.44	3.53
B	采矿业	19,163,597.25	0.54
C	制造业	2,006,794,191.74	56.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,692,317.30	1.18
F	批发和零售业	51,768,376.00	1.46
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	368,146,906.22	10.41
J	金融业	467,754,986.04	13.22
K	房地产业	202,632,594.59	5.73
L	租赁和商务服务业	32,755,461.50	0.93
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	83,800,173.24	2.37
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	88,002,793.14	2.49
S	综合	22,127,145.81	0.63
	合计	3,509,523,604.43	99.22

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	000651	格力电器	5,941,367	188,341,333.90	5.32
2	000333	美的集团	5,560,397	185,161,220.10	5.23
3	300498	温氏股份	3,800,004	124,868,131.44	3.53
4	000725	京东方A	31,721,020	109,120,308.80	3.08
5	000002	万科A	5,134,878	105,675,789.24	2.99
6	000858	五粮液	2,305,956	99,156,108.00	2.80
7	000001	平安银行	10,526,812	96,530,866.04	2.73
8	002415	海康威视	2,464,530	78,618,507.00	2.22
9	000776	广发证券	3,772,779	64,476,793.11	1.82
10	002304	洋河股份	689,239	60,225,703.82	1.70

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根据广发证券股份有限公司董事会2016年11月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会<行政处罚决定书>的公告》,因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为,被中国证监会予以警告及行政处罚。

2017年3月29日,银监会机关针对票据违规操作、掩盖不良、规避监管、乱收费用、滥用通道、违背国家宏观调控政策等市场乱象,作出了25件行政处罚决定,罚款金额合计4290万元,其中包括平安银行。

本基金为指数型基金,上述股票系标的指数成份券,上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除广发证券、平安银行外,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	58,017.55
2	应收证券清算款	3,384,598.78
3	应收股利	-
4	应收利息	5,693.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,448,310.27

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	892,367,465.00
报告期基金总申购份额	85,400,000.00
减:报告期基金总赎回份额	128,800,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	848,967,465.00

§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 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
中国银行股份有限公司-易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2017年1月1日至2017年3月31日	389,993,215.00	4,704,000.00	21,871,650.00	372,825,565.00	43.92%
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及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准易方达深证100交易型开放式指数基金募集的文件;

2.《易方达深证100交易型开放式指数基金基金合同》;

3.《易方达深证100交易型开放式指数基金托管协议》;

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
二〇一七年四月二十一日

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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4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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达深证100ETF联接
基金主代码	110019
交易代码	110019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月1日
报告期末基金份额总额	1,669,178,482.95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	本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争最终将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,决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。待指数衍生金融产品推出以后,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	深证100价格指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为深证100ETF的联接基金,主要通过投资于深证100ETF追踪业绩比较基准表现,业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。因此,本基金具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。理论上,本基金预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
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	易方达深证100交易型开放式指数基金
基金主代码	159901
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年3月24日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月24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	中国银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪目标指数,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。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例,以此构建本基金实际的投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证100价格指数
风险收益特征	本基金属股票基金,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,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、以及标的指数所代表的股票市场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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	9,493,754.01
2.本期利润	90,616,349.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0531
4.期末基金资产净值	1,725,114,047.74
5.期末基金份额净值	1.0335

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

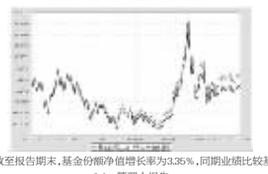
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.43%	0.74%	5.39%	0.75%	0.04%	-0.01%

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

易方达深证100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

(2009年12月1日至2017年3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3.35%,同期业绩比较基准收益率为-5.97%。

§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		
成曦	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、易方达生物科技指数分级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	2016-05-07	-	9年	硕士研究生,曾任华泰联合证券资产管理部研究员,易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。

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11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

2017年第一季度,经济景气度上升,通胀保持温和,工业企业利润增速大幅走高。1-2月份,全国规模以上工业企业实现利润同比增长31.5%,增幅较大;固定资产投资同比增长8.9%,增幅有所回落,但房地产开发同比增长8.9%,远高于去年同期3.0%的增幅;社会消费品零售总额同比增长9.5%,保持稳定。1月份全国居民消费价格指数(CPI)同比上涨2.55%,2月CPI同比增速明显放缓至0.8%,主要是由于春节后食品价格持续下跌,工业生产者出厂价格指数(PPI)则走出本轮新高,升至7.8%。货币政策方面,央行明确货币宽松的退出,并执行稳健中性的货币政策,继续推动金融市场去杠杆;广义货币供应量M2同比增长11.1%,增幅持续下降,银行间市场流动性3月下旬明显偏紧。尽管美元走强且中国录得贸易逆差,但2月外汇储备仍增加69.2亿美元至30,051亿美元,表明当月外汇有净流入。综合目前的市场数据来看,经济总体持续复苏迹象明显。报告期内,A股市场整体震荡上扬,但结构有所分化,上证指数上涨3.8%,创业板指数下跌2.8%。行业走势表现上,家用电器、食品饮料、国防军工、建筑装饰、钢铁、建筑材料、交通运输以及电子行业涨幅均在5%以上,而传媒、农林牧渔、纺织服装等行业跌幅在3%以上。

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1.0335元,本报告期份额净值增长率为5.43%,同期业绩比较基准收益率为5.39%,日跟踪偏离度的均值为0.01%,年化跟踪误差0.18%,在合同规定的控制范围之内。

§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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	70,747,970.30	4.08
	其中:股票	70,747,970.30	4.08
2	基金投资	1,558,340,114.02	89.97
3	固定收益投资	9,988,000.00	0.58
	其中:债券	9,988,000.00	0.58
	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	91,797,545.70	5.30
8	其他资产	1,196,645.62	0.07
9	合计	1,732,070,275.64	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	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	1,558,340,114.02	90.33

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	103,969.04	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,621,672.94	2.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	569,118.46	0.03
F	批发和零售业	1,362,594.40	0.08
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	8,367,448.88	0.49
J	金融业	10,941,355.85	0.63
K	房地产业	6,232,379.43	0.36
L	租赁和商务服务业	562,509.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,017,513.24	0.12
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	1,419,683.56	0.08
S	综合	532,795.34	0.03
	合计	70,747,970.30	4.10

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	000002	万科A	186,563	3,839,466.54	0.22
2	000333	美的集团	112,503	3,746,349.90	0.22
3	000725	京东方A	777,572	2,674,847.68	0.16
4	000858	五粮液	57,161	2,457,923.00	0.14
5	000166	申万宏源	389,572	2,415,346.40	0.14
6	000001	平安银行	257,283	2,359,285.11	0.14
7	002415	海康威视	60,233	1,921,432.70	0.11
8	002450	康得新	79,357	1,517,305.84	0.09
9	002304	洋河股份	16,916	1,478,120.08	0.09
10	002024	苏宁云商	120,898	1,305,698.40	0.08

5.5 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	9,988,000.00	0.58
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,988,000.00	0.58

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

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	019546	16国债18	100,000	9,988,000.00	0.58

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根据广发证券股份有限公司董事会2016年11月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会<行政处罚决定书>的公告》,因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为,被中国证监会予以警告及行政处罚。

2017年3月29日,银监会机关针对票据违规操作、掩盖不良、规避监管、乱收费用、滥用通道、违背国家宏观调控政策等市场乱象,作出了25件行政处罚决定,罚款金额合计4290万元,其中包括平安银行。

本基金为ETF联接基金,上述股票系目标ETF的成分券,上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除广发证券、平安银行之外,本基金目标ETF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。除平安银行之外,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。5.12.2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	182,293.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	157,458.82
5	应收申购款	818,819.71
6	其他应收款	38,073.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,196,645.62

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

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	1,741,285,769.09
报告期基金总申购份额	61,756,545.53
减:报告期基金总赎回份额	133,863,831.67
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,669,178,482.95

§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基金文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会核准易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;

2.《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》;

3.《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;

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。

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
二〇一七年四月二十一日

易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达新利混合
基金主代码	001249
交易代码	001249
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月30日
报告期末基金份额总额	585,190,506.77份
投资目标	本基金在控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值。通过定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。严格遵守低估值的股票投资逻辑,以绝对收益为目标,力争获得稳健、持续的投资收益。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率(税后)+2%