易方达财富快线货币市场基金

【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	易方达财富快线货币		
基金主代码	000647		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年6月17日		
报告期末基金份额总额	9,692,543,500.49份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达财富快线货币A	易方达财富快线货币B	易方达财富快线货币Y
下属分级基金的交易代码	000647	000648	000920
报告期末下属分级基金的份额总额	4,147,916,719.10份	778,685,386.44份	4,765,941,394.96份

注:自2014年12月3日起,本基金增设Y类份额类别,份额首次确认日为2014年12月5日。

§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)		
	易方达财富快线货币A	易方达财富快线货币B	易方达财富快线货币Y
1.本期已实现收益	38,249,676.34	6,090,143.71	33,670,630.00
2.本期利润	38,249,676.34	6,090,143.71	33,670,630.00
3.期末基金资产净值	4,147,916,719.10	778,685,386.44	4,765,941,394.96

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达财富快线货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9464%	0.0017%	0.3381%	0.0000%	0.6083%	0.0017%

易方达财富快线货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0065%	0.0017%	0.3381%	0.0000%	0.6684%	0.0017%

易方达财富快线货币Y

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9470%	0.0017%	0.3381%	0.0000%	0.6089%	0.0017%

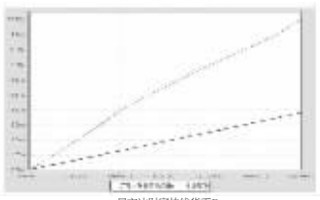
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达财富快线货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

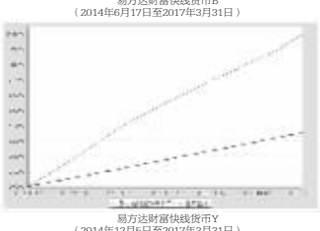
易方达财富快线货币A

(2014年6月17日至2017年3月31日)



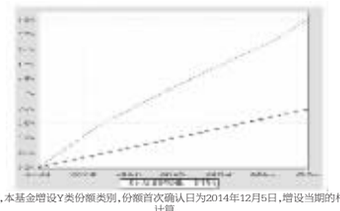
易方达财富快线货币B

(2014年6月17日至2017年3月31日)



易方达财富快线货币Y

(2014年12月5日至2017年3月31日)



注:1.自2014年12月3日起,本基金增设Y类份额类别,份额首次确认日为2014年12月5日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为10.2896%,B类基金份额净值收益率为11.0288%,同期业绩比较基准收益率为3.8951%。Y类基金份额净值收益率为8.2024%,同期业绩比较基准收益率为3.2310%。

§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		
石大铎	本基金的基金经理,易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理,易方达易理财货币市场基金的基金经理,易方达增利货币市场基金的基金经理,易方达天天利理财货币市场基金的基金经理,易方达天天理财货币市场基金的基金经理,易方达天天发货币市场基金的基金经理,易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理,易方达龙宝货币市场基金的基金经理,易方达货币市场基金的基金经理,易方达保证金收益货币市场基金的基金经理,易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2014-06-17	-	8年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁莹	本基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天利理财货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达理财货币市场基金的基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理	2015-03-17	-	7年	硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员,易方达基金管理有限公司固定收益研究员、交易员,固定收益基金经理助理。
刘明阳	本基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、现金管理部总经理	2016-01-30	-	10年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司固定收益研究员、交易员,高级策略分析师、基金经理。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,石大铎的"任职日期"为基金合同生效之日,梁莹、刘明阳的"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 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,同日反向交易或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2.5%,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0.9390元,本报告期份额净值增长率为1.16%,同期业绩比较基准收益率为0.44%,日跟踪偏离度的均值为0.04%,年化跟踪误差1.17%,各项指标均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	1,829,403,702.63	93.87
	其中:股票	1,829,403,702.63	93.87
2	固定收益投资	39,952,000.00	2.05
	其中:债券	39,952,000.00	2.05
	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	66,412,946.27	3.41
7	其他资产	13,111,798.04	0.67
8	合计	1,948,880,446.94	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

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	12,892,630.00	0.67
B	采矿业	24,251,231.40	1.26
C	制造业	885,489,528.11	45.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,748,581.58	3.04
E	建筑业	41,322,626.22	2.14
F	批发和零售业	199,922,357.70	10.35
G	交通运输、仓储和邮政业	33,749,836.45	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	260,779,672.12	13.50
J	金融业	12,650,923.20	0.65
K	房地产业	169,535,355.73	8.78
L	租赁和商务服务业	44,229,633.32	2.29
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	22,741,078.19	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,436,705.44	2.25
R	文化、体育和娱乐业	9,614,509.35	0.50
S	综合	10,022,103.66	0.52
	合计	1,829,403,702.63	94.72

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	600690	青岛海尔	7,746,513	94,352,528.34	4.89
2	002024	苏宁云商	8,591,366	92,786,752.80	4.80
3	300104	乐视网	2,513,317	85,251,712.64	4.41
4	600649	城投控股	2,795,544	51,186,410.64	2.65
5	600584	长电科技	2,666,041	50,334,854.08	2.61
6	002044	美年健康	3,115,976	43,436,705.44	2.25
7	000547	航天发展	2,575,515	38,246,397.75	1.98
8	000415	渤海金控	4,774,964	34,045,493.32	1.76
9	600654	中安消	1,830,705	31,909,188.15	1.65
10	000878	云南铜业	2,187,155	30,642,041.55	1.59

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	39,952,000.00	2.07
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	39,952,000.00	2.07

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	019546	16国债18	400,000	39,952,000.00	2.07

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持有股指期货。

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根据中安消股份有限公司董事会2017年3月24日发布的《立案调查进展暨风险提示公告》,因公司涉嫌违反证券法律法规,被中国证监会立案调查。

本基金为指数型基金,中安消系标的指数成份券,该股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除中安消外,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	247,293.00
2	应收证券清算款	12,227,570.88
3	应收股利	-
4	应收利息	577,461.04
5	应收申购款	59,473.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,111,798.04

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	93,134,202.65
报告期基金总申购份额	11,337,424.63
减:报告期基金总赎回份额	63,210,489.71
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	41,261,137.57

注:本基金份额变动含易方达标普医疗保健指数(ODII-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 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	2017年2月15日至2017年2月22日	10,003,150.31	-	10,003,150.31	-	-
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.中国证监会准予易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)注册的文件;

2.《易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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

易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	易方达标普医疗保健指数(QDII-LOF)		
场内简称	标普医药		
基金主代码	161126		
交易代码	161126		
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)		
基金合同生效日	2016年11月28日		
报告期末基金份额总额	41,261,137.57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	作为追踪标普医疗等权重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500医疗保健等权重指数收益率(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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	390,240.27
2.本期利润	2,847,537.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0559
4.期末基金资产净值	43,904,324.87
5.期末基金份额净值	1.0641

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

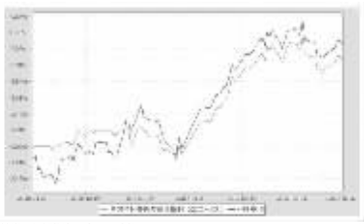
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.53%	0.63%	8.47%	0.74%	-2.94%	-0.11%

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

易方达标普医疗保健指数证券投资基金(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11月28日至2017年3月31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.本基合同于2016年11月28日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

3.按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(第十三部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

4.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为6.41%,同期业绩比较基准收益率为7.61%。

§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、易方达中证500交易型开放式指数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500指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、量化基金组合部副总经理	2016-11-28	-	9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量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。
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	2016-12-03	-	12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。
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、易方达标普500指数证券投资基金(LOF)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	2017-03-25	-	12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(State Street)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、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、亚太投资部指数基金部基金经理。

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,范冰、张胜记的"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

本基金未聘请境外投资顾问。

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,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2017年一季度,对美国市场乃至全球市场影响最大的两个因素是特朗普上任后的政策进展和美联储的货币政策。整体来看,2016年12月美联储鹰派加息之后,对特朗普新政的预期和对经济基本面向好的信心推动美股上涨。在经历了1月20日特朗普上任后密集的政策兑现期后,"特朗普行情"动能开始出现放缓甚至局部逆转的迹象。3月16日美联储再度加息,符合市场预期,美联储主席耶伦的言论较为温和,在对未来加息路径的前瞻指引上也偏鸽派。特朗普政策方面,1万亿美元基建计划由于政策推行的潜在阻力较大,政策落地时间或许会在2017 年下半年;医改提案未对奥巴马医改法案做大大修改,在共和党内部产生巨大分歧,未能成功通过众议院批准,特朗普近阶段不会再在医改上做过多努力,而可能在2017年晚些时候提出新的方案;在医改提案失败后,特朗普政府将主要推动税收改革的实施,而税改最大的问题在于如何解决庞大的财政赤字。标普医疗指数(美元)一季度上涨9.51%,美国货币和特朗普政策的不确定性是波动的主要来源。人民币对美元汇率从年初的高点回落,逐步企稳。

作为追踪标普医疗等权重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1.0641元,本报告期份额净值增长率为5.53%,同期业绩比较基准收益率为8.47%,跟踪误差3.894%。因本报告期包含了基金合同规定的建仓期,故跟踪误差等指标仍在调整之中。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2017年3月15日至本报告期末,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。

§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	40,781,445.68	89.62
	其中:普通股	40,781,445.68	89.62
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	4,643,322.84	10.20
8	其他资产	78,010.08	0.17
9	合计	45,502,778.60	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	40,781,445.68	92.89
合计	40,781,445.68	92.89

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	40,781,445.68	92.89
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	40,781,445.68	92.89

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	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,060	799,704.76	1.82
2	Cerner Corp	-	CERN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,801	731,248.87	1.67
3	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达克证券交易所	美国	136	719,182.48	1.64
4	PerkinElmer Inc	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	1,790	717,026.31	1.63
5	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	1,455	715,342.19	1.63
6	Varian Medical Systems Inc	-	VAR US	纽约证券交易所	美国	1,133	712,354.73	1.62
7	HCA Holdings Inc	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	1,158	710,975.76	1.62
8	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克证券交易所	美国	663	707,222.61	1.61
9	Cooper Cos Inc	-	COO US	纽约证券交易所	美国	512	706,099.75	1.61
10	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	596	701,668.74	1.60

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

本基金本报告期末未持有基金。

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	21,064.03
4	应收利息	768.69
5	应收申购款	56,177.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,010.08

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	1,988,624,006.71
报告期基金总申购份额	7,145,867.44
减:报告期基金总赎回份额	99,914,983.64
报告期基金拆分变动份额	12,264,162.00
报告期期末基金份额总额	1,908,119,052.51

注:拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额。

§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