易方达中小盘混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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:二〇一七年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中小盘混合
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月19日
报告期末基金份额总额	1,304,678,063.60份
投资目标	通过投资具有竞争优势和较高或长性的中小盘股票,力求在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	采取"自下而上"的策略,投资具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高或长性的中小盘股票,以谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	45%×天相中盘指数收益率+35%×天相小盘指数收益率+20%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是混合基金,理论上其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。
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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	98,739,220.40
2.本期利润	42,332,568.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0299
4.期末基金资产净值	4,414,294,010.24
5.期末基金份额净值	3.3834

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

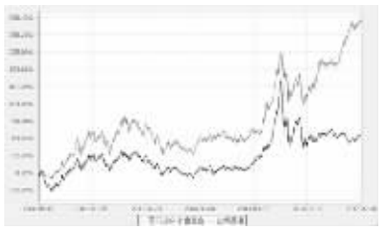
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.41%	0.65%	4.07%	0.63%	-2.66%	0.02%

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

易方达中小盘混合型证券投资基金

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

(2008年6月19日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为286.35%,同期业绩比较基准收益率为70.26%。

§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		
张坤	本基金的基金经理、易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、研究部总经理助理	2012-09-28	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。

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。本基金管理人制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7次,均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年三季度,A股市场稳步上涨,沪深300指数上涨4.63%,上证指数上涨4.90%。

三季度,宏观经济方面,前期商品房市场的热销拉动房地产投资恢复,带动经济企稳。流动性方面,随着人民币汇率的升值,流动性压力相比二季度有所缓解。受地产投资拉动的影响,工业品价格普遍出现了上涨。股票市场方面,市场在三季度稳步上涨,同时呈现较明显的结构分化,以有色、钢铁、采掘为代表的周期行业和以计算机、通信、电子为代表的新兴行业表现较为突出,而家电、公用事业等行业表现相对落后。

本基金在三季度股票仓位有所提升,并对结构进行了调整,降低了交运等行业的配置,增加了医药、食品饮料等行业的配置。个股方面,降低了部分高估值的小盘股配置,增加了业务模式有特色、长期逻辑清晰、估值水平合理的个股的投资比例。

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3.3834元,本报告期份额净值增长率为1.41%,同期业绩比较基准收益率为4.07%。

§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	4,030,836,753.18	90.82
	其中:股票	4,030,836,753.18	90.82
2	固定收益投资	199,504,999.98	4.49
	其中:债券	199,504,999.98	4.49
	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	97,000,265.50	2.19
	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	99,040,539.46	2.23
7	其他资产	12,071,370.90	0.27
8	合计	4,438,453,929.02	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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	2,913,600,215.85	66.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	688,413,989.45	15.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	243,475,800.00	5.52
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	115,100.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	185,024,806.59	4.19
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,030,836,753.18	91.31

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	000858	五粮液	7,800,081	446,788,639.68	10.12
2	600519	贵州茅台	841,074	435,373,545.36	9.86
3	000568	泸州老窖	7,816,666	431,474,967.72	9.77
4	600009	上海机场	10,950,024	415,881,911.52	9.42
5	600007	中国国贸	12,900,000	243,165,000.00	5.51
6	002572	索菲亚	6,080,040	229,825,512.00	5.21
7	600690	青岛海尔	14,800,010	223,332,150.90	5.06
8	002032	苏泊尔	5,870,066	222,240,698.76	5.03
9	000423	东阿阿胶	3,200,000	207,776,000.00	4.71
10	000089	深圳机场	23,000,000	199,640,000.00	4.52

注:本报告期末本基金投资五粮液(000858)比例占基金资产净值超过10%,属于被动超标。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,504,000.00	4.52
	其中:政策性金融债	199,504,000.00	4.52
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)	999.98	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	199,504,999.98	4.52

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	170204	17国开04	1,200,000	119,760,000.00	2.71
2	170207	17国开07	400,000	39,876,000.00	0.90
3	170410	17农发10	400,000	39,868,000.00	0.90
4	128016	雨虹转债	10	999.98	0.00

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	1,379,321.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,764,625.08
5	应收申购款	7,927,423.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,071,370.90

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

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	000568	泸州老窖	44,384,967.72	1.01	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,593,095,293.30
报告期基金总申购份额	237,421,147.45
减:报告期基金总赎回份额	525,838,377.15
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,304,678,063.60

§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.中国证监会批准易方达中小盘股票型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达中小盘混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达中小盘混合型证券投资基金托管协议》;

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

二〇一七年十月二十六日

易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

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:二〇一七年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中证500ETF
基金主代码	510580
交易代码	510580
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2015年8月27日
报告期末基金份额总额	8,167,752.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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。但在因特殊情形导致基金无法完全按资于标的指数成份股时,基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证500指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	4,702,789.12
2.本期利润	9,228,087.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.6041
4.期末基金资产净值	55,765,405.44
5.期末基金份额净值	6.8275

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2015年9月9日进行了基金份额拆算,拆算比例为0.15409267。

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

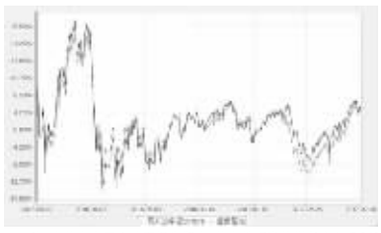
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.50%	0.91%	7.58%	0.94%	2.92%	-0.03%

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

易方达中证500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

(2015年8月27日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为5.21%,同期业绩比较基准收益率为5.85%。

§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		
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证50指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数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交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2016-04-16	-	12年	硕士研究生,曾任汇丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师,华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理,易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。
杨俊	本基金的基金经理、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交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-06-23	-	8年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。

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。本基金管理人制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7次,均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年三季度国内宏观经济增长延续了前期的复苏态势,国内外需求旺盛、供需格局持续改善,最新公布的宏观数据显示9月份全国制造业PMI为52.4,创2012年5月以来的新高,在经历了7月和8月的低迷态势后中国经济增长表现出了很强的韧性。在流动性方面,季度末央行宣布对普惠金融领域实施定向降准,投资者对于前期偏紧的流动性预期有所改善。三季度人民币对美元即期汇率大幅升值,在岸和离岸美元对人民币即期汇率均一度回落至6.5以下。资本市场方面,A股市场表现良好,最终三季度上证综指以上涨4.90%收官。在风格方面,大小盘齐涨,小盘股一改前期的颓势,本季度上证50指数、沪深300指数、创业板综指、中证500指数分别上涨4.80%、4.63%、4.04%、7.58%;行业方面,有色金属、钢铁、食品饮料、采掘、通信、电子、保险等板块涨幅居前,公用事业、传媒、纺织服装、家用电器、医药生物等板块下跌。

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6.8275元,本报告期份额净值增长率为10.50%,同期业绩比较基准收益率为7.58%,日跟踪偏离度的均值为0.06%,年化跟踪误差为1.032%,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	53,150,692.48	94.69
	其中:股票	53,150,692.48	94.69
2	固定收益投资	13,100.00	0.02
	其中:债券	13,100.00	0.02
	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	2,875,577.90	5.12
7	其他资产	89,012.90	0.16
8	合计	56,128,383.28	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	800,813.77	1.44
B	采矿业	1,557,527.02	2.79
C	制造业	33,593,747.43	60.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,640,678.73	2.94
E	建筑业	1,201,675.52	2.15
F	批发和零售业	2,713,297.62	4.87
G	交通运输、仓储和邮政业	1,501,924.05	2.69
H	住宿和餐饮业	59,503.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,615,914.81	6.48
J	金融业	785,299.26	1.41
K	房地产业	3,108,916.04	5.57
L	租赁和商务服务业	979,845.62	1.76
M	科学研究和技术服务业	178,926.45	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	453,901.38	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	47,286.85	0.08
Q	卫生和社会工作	187,110.03	0.34
R	文化、体育和娱乐业	489,636.63	0.88
S	综合	234,688.27	0.42
	合计	53,150,692.48	95.31

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	002460	赣锋锂业	6,285	548,680.50	0.98
2	300156	神雾环保	18,326	442,756.16	0.79
3	601012	隆基股份	14,173	417,678.31	0.75
4	300136	信维通信	9,341	392,322.00	0.70
5	600487	亨通光电	11,309	389,029.60	0.70
6	600516	方大炭素	12,181	372,129.55	0.67
7	603799	华友钴业	3,537	323,529.39	0.58
8	600525	长园集团	15,651	311,454.90	0.56
9	601717	郑煤机	35,347	274,999.66	0.49
10	002405	四维图新	10,665	273,237.30	0.49

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	-	-
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)	13,100.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,100.00	0.02

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	128016	雨虹转债	131	13,100.00	0.02

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	88,457.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	555.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,012.90

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

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	300156	神雾环保	442,756.16	0.79	重大事项停牌
2	601717	郑煤机	274,999.66	0.49	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	21,126,753.00
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	12,959,001.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	8,167,752.00

注:期初基金总份额包含场外份额20,030,238份;期末基金总份额包含场外份额7,071,237份;总赎回份额包含场外总赎回份额12,959,001份。

§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
机构	1	2017年07月01日-2017年08月21日	12,159,001.00	-	12,159,001.00	-	-
	2	2017年07月01日-2017年09月30日	7,111,300.00	-	800,000.00	6,311,300.00	77.27%
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;拨端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;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;持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。						

注:申购份额包括申购或者买入基金份额,赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会注册易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2.《易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3.《易方达中证500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。

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

二〇一七年十月二十六日

易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中债新综合指数发起式(LOF)	
场内简称	易基综债	
基金主代码	161119	
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)、发起式	
基金合同生效日	2012年11月8日	
报告期末基金份额总额	182,910,622.40份	
投资目标	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金为被动管理的指数基金,主要采用分层抽样复制和动态最优化的方法,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。	
业绩比较基准	中债-新综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型指数基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达中债新综指发起式(LOF)A	易方达中债新综指发起式(LOF)C
下属分级基金的交易代码	161119	161120
报告期末下属分级基金的份额总额	151,638,264.54份	31,272,357.86份

§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7月1日-2017年9月30日)	
	易方达中债新综指发起式(LOF)A	易方达中债新综指发起式(LOF)C
1.本期已实现收益	1,481,903.84	199,336.18
2.本期利润	1,875,954.60	250,604.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0117	0.0107
4.期末基金资产净值	188,659,936.61	38,428,249.48
5.期末基金份额净值	1.2441	1.2288

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

易方达中债新综指发起式(LOF)A

| 阶段 | 净值增长率