易方达军工指数分级证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	易方达军工分级
基金主代码	502003
交易代码	502003
基金运作方式	契约型开放式,分级基金
基金合同生效日	2015年7月8日
报告期末基金份额总额	499,698,616.92份
投资目标	紧密追踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资,即完全按照标的指数的成份股组成及权重构建基金投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。
业绩比较基准	95%×中证军工指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现,其风险收益特征与标的指数相似。长期而言,其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金;A类份额具有预期风险、收益较低的特征;B类份额具有预期风险、收益较高的特征。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达军工分级 易方达军工分级A 易方达军工分级B
下属分级基金场内简称	军工分级 军工A 军工B
下属分级基金的交易代码	502003 502004 502005
报告期末下属分级基金的份额总额	233,498,610.92份 133,100,003.00份 133,100,003.00份
下属分级基金的风险收益特征	基础份额为股票型基金,其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 与基础份额相比,A类份额的预期收益和预期风险低于基础份额。 与基础份额相比,B类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。

§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	-15,398,128.31
2.本期利润	24,247,516.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0450
4.期末基金资产净值	491,822,500.13
5.期末基金份额净值	0.9842

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

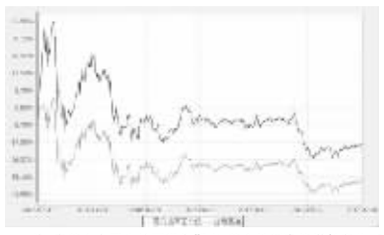
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.76%	1.28%	4.23%	1.20%	0.53%	0.08%

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

易方达军工指数分级证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年7月8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-36.70%,同期业绩比较基准收益率为-17.99%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
金南燕	本基金的基金经理,易方达中证金指证券公司父母型开放式指数证券收益基金的基金经理,易方达中证军工父母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,易方达中证500父母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,易方达证金证券指数分级证券投资基金的基金经理	2015-07-08	-	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。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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。报告期内中证军工指数上涨4.43%。

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0.9842元,本报告期份额净值增长率为4.76%,同期业绩比较基准收益率为4.23%,日跟踪偏离度的均值为0.06%,年化跟踪误差为1.360%,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	464,995,508.09	92.48
	其中:股票	464,995,508.09	92.48
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	30,985,112.63	6.16
7	其他资产	6,846,007.04	1.36
8	合计	502,826,627.76	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	0.01
C	制造业	436,833,776.27	88.82
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,514,485.95	0.92
G	交通运输,仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	19,640,236.83	3.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,751,249.60	0.76
N	水利,环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务,修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化,体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	464,995,508.09	94.55

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	601989	中国重工	7,965,393	53,129,171.31	10.80
2	600893	航发动力	811,758	25,383,672.66	5.16
3	000768	中航飞机	1,153,211	22,176,247.53	4.51
4	002465	海格通信	1,345,563	15,595,075.17	3.17
5	600150	中国船舶	588,540	14,519,281.80	2.95
6	600118	中国卫星	492,571	13,870,799.36	2.82
7	002179	中航光电	329,533	12,258,627.60	2.49
8	600879	航天电子	1,359,188	11,960,854.40	2.43
9	002049	紫光国芯	303,356	11,278,776.08	2.29
10	600435	北方导航	744,459	10,861,656.81	2.21

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 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	111,906.19
2	应收证券清算款	5,285,828.90
3	应收股利	-
4	应收利息	5,641.05
5	应收申购款	1,442,630.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,846,007.04

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

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	601989	中国重工	53,129,171.31	10.80	重大事项停牌
2	600150	中国船舶	14,519,281.80	2.95	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达军工分级	易方达军工分级A	易方达军工分级B
报告期期初基金份额总额	240,614,717.34	154,178,253.00	154,178,253.00
报告期基金总申购份额	221,468,628.37	-	-
减:报告期基金总赎回份额	283,521,433.74	-	-
报告期基金拆分变动份额	54,936,698.95	-21,078,250.00	-21,078,250.00
报告期末基金份额总额	233,498,610.92	133,100,003.00	133,100,003.00

注:拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额及折算调整份额。

§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.中国证监会准予易方达军工指数分级证券投资基金募集注册的文件;

2.《易方达军工指数分级证券投资基金基金合同》;

3.《易方达军工指数分级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。

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

易方达丰和债券型证券投资基金

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	易方达丰和债券
基金主代码	002969
交易代码	002969
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月23日
报告期末基金份额总额	3,396,886,979.94份
投资目标	本基金主要投资于债券资产,严格管理权益类品种的投资比例,在控制基金资产净值波动的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势,深入分析货币和财政政策,国家产业政策以及资本市场资金环境,证券市场走势等,综合考量各类资产的市场容量,市场流动性和风险收益特征等因素,在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例。本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。本基金将适度参与股票资产投资,本基金股票投资部分主要采取"自下而上"的投资策略,精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况,行业成长空间,行业集中度,公司竞争优势等因素的判断,对公司的盈利能力,营运能力,资证能力,成长性,估值水平,公司战略,治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析,追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,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	55,149,184.12
2.本期利润	60,551,334.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0178
4.期末基金资产净值	3,662,378,124.01
5.期末基金份额净值	1.0782

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	1.71%	0.16%	1.34%	0.09%	0.37%	0.07%

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

易方达丰和债券型证券投资基金

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

(2016年11月23日至2017年9月30日)

注:1.本基金合同于2016年11月23日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为7.82%,同期业绩比较基准收益率为0.96%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张清华	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,易方达恒指沪港通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,易方达深证成指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,易方达瑞逸灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达瑞誉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达瑞安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理,固定收益基金投资部总经理	2016-11-23	-	10年	硕士研究生,曾任晨星资讯(深圳)有限公司数量分析师,中信证券股份有限公司研究员,易方达基金管理有限公司投资经理。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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年三季度债券市场整体处于震荡格局。基本面方面,七月经济数据下行幅度超出市场预期,固定资产投资和工业增加值增速均出现明显下行。八月经济数据有所反弹,但力度不及预期,导致市场对于经济下滑的担忧加剧。另一方面融资数据仍然保持强势,表内贷款特别是居民部门贷款增量持续超预期,社会融资总量也持续处于较高水平。经济数据和融资数据的背离使得市场对债券市场短期走势的分歧有所加剧,但对于中长期利率下行的看法却相对一致,这使得收益率的上行空间相对有限。货币政策方面,央行货币政策维持稳健中性,非银行金融机构融资压力较大,短端收益率持续处于高位,并制约长端收益率的下行空间。

权益市场三季度震荡上行,总体趋势仍然不强。三季度由于供给限制导致大宗商品价格上涨,包括有色金属、钢铁、煤炭在内的周期行业上涨幅度较多。此外创业板在三季度也有所反弹,反映市场的风险偏好有所恢复。

报告期内,组合债券部分维持中性偏短久期,保持适度的杠杆比例和组合流动性,继续优化信用债的资质结构。权益部分以波段操作为主,并根据市场进行灵活调整。

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1.0782元,本报告期份额净值增长率为1.71%,同期业绩比较基准收益率为1.34%。

§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	642,130,727.42	16.29
	其中:股票	642,130,727.42	16.29
2	固定收益投资	3,196,215,229.80	81.09
	其中:债券	3,196,215,229.80	81.09
	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	46,256,008.86	1.17
7	其他资产	56,826,237.04	1.44
8	合计	3,941,428,203.12	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	-	-
C	制造业	480,448,468.12	13.12
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输,仓储和邮政业	49,980,578.58	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	73,712,680.72	2.01
K	房地产业	37,989,000.00	1.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利,环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	642,130,727.42	17.53

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	002008	大族激光	2,594,929	113,138,904.40	3.09
2	002179	中航光电	2,275,044	84,631,636.80	2.31
3	601318	中国平安	1,361,017	73,712,680.72	2.01
4	000651	格力电器	1,917,401	72,669,497.90	1.98
5	002415	海康威视	2,083,950	66,686,400.00	1.82
6	600009	上海机场	1,315,971	49,980,578.58	1.36
7	000002	万科A	1,447,200	37,989,000.00	1.04
8	000568	泸州老窖	750,000	36,315,000.00	0.99
9	600056	中国医药	1,284,212	30,922,625.52	0.84
10	603589	口子窖	440,100	21,512,088.00	0.59

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	248,284,000.00	6.78
	其中:政策性金融债	248,284,000.00	6.78
4	企业债券	1,631,429,865.30	44.55
5	企业短期融资券	502,336,000.00	13.72
6	中期票据	697,231,000.00	19.04
7	可转债(可交换债)	116,934,364.50	3.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,196,215,229.80	87.27

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	011767007	17首钢SCP006	2,500,000	251,275,000.00	6.86
2	127540	G17龙源2	2,000,000	198,620,000.00	5.42
3	041669030	16王府井CP002	1,600,000	160,752,000.00	4.39
4	122846	11渝富债	1,500,000	150,990,000.00	4.12
5	143215	17宏资01	1,500,000	149,550,000.00	4.08

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则,主要选择流动性好的国债期货合约进行交易,以对冲投资组合的利率风险、有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
0T1712	10年期国债1712	270	257,067,000.00	-100,950.00	本交易期内组合利用国债期货进行了套保交易,调整组合的整体久期。
公允价值变动总额合计(元)					-100,950.00
国债期货投资本期收益(元)					-1,000,150.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-100,950.00

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货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、交易活跃的期货合约。本基金力争利用国债期货的杠杆作用,降低债券持仓调整的交易成本,以达到有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本的目的。本报告期内,本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.116 中信G1(代码:136830)为易方达丰和债券型证券投资基金的前十大持仓证券。根据中信证券股份有限公司董事会2017年5月24日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》,因公司涉嫌未按规定向客户提供融资融券服务,被中国证监会予以行政处罚。

本基金投资16中信G1的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除16中信G1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	5,563,938.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	48,430,187.37
5	应收申购款	2,832,111.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,826,237.04

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	13,368,171.60	0.37

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	36,315,000.00	0.99	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	3,395,327,702.50
报告期基金总申购份额	736,206,090.66
减:报告期基金总赎回份额	734,646,813.22
报告期基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	3,396,886,979.94

§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.中国证监会准予易方达丰和债券型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达丰和债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达丰和债券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、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

易方达创业板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	易方达创业板ETF
场内简称	创业板
基金主代码	159915
交易代码	159915
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	3,243,454,936.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资,即按照创业板指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更,成份股发生变更,成份股权重由于自由流通量调整而发生变化,或份额累发现金股息,配股及增发,股票长期停牌,市场流动性不足等情况发生时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。本基金可以参与股指期货交易,但必须根据风险管理的原则,以套期保值为目的。
业绩比较基准	创业板指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,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,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

|