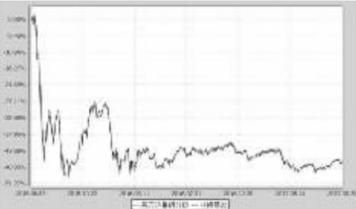


易方达并购重组指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

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6月3日至2017年9月30日)



注:本基金合同生效至本报告期末,基金份额净值增长率为-47.29%,同期业绩比较基准收益率为-47.10%。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 性别, 任职日期, 离任日期, 国籍, 学历, 证券从业年限, 基金从业年限, 说明. Lists the fund manager's details and their qualifications.

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 基金经理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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,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,并重视交易执行环节的公平交易措施,“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统内的公平交易模块,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,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.3.3 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,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 本基金跟踪的标的指数为中证并购重组指数,中证并购重组指数由处于并购或资产重组进程的个股组成,是衡量涉及并购或资产重组整体走势的代表性指数。报告期内,本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2017年3季度,中证并购重组指数上涨2.3%,并购重组一直是监管层关注的重点,9月22日证监会对上市公司并购重组信息披露规则作出进一步修订完善,目的为提高并购重组效率,打击“限高”“限风”“限债”“限增”等违规行为,规范重组上市,监管层对并购重组进一步的规范及对市上利用并购重组概念进行过度炒作打击,但与此同时更加规范的并购重组,将有利于其服务实体经济的功能得以充分发挥,在国家对金融服务实体经济等政策配合下,并购重组将会有更健康、有序的发展。

截至报告期末,本基金份额净值为0.8555元,本报告期份额净值增长率为1.18%,同期业绩比较基准收益率为2.20%,跟踪偏离度的均值为0.033%,年化跟踪误差为2.09%,各项指标均在合同约定的目标控制范围之内。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing fund asset composition: 序号, 类别, 名称, 金额(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists various asset categories and their values.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing stock investment by industry: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists industry codes and their respective values.

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

Table showing top 10 stock investments: 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(%). Lists the top 10 stocks held by the fund.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond investment by type: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond types and their values.

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

Table showing top 5 bond investments: 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(%). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

Table showing asset-backed investment details: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed investment details.

5.13 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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

5.14 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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

5.15 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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.17 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

5.18 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

Table showing asset-backed investment details: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed investment details.

5.19 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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

5.20 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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

5.21 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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.22 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有股指期货。

5.23 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.24 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

5.25 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

Table showing asset-backed investment details: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed investment details.

5.26 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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

5.27 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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

5.28 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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.29 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有股指期货。

5.30 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.31 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

易方达安心回报债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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6月3日至2017年9月30日)



注:本基金合同生效至本报告期末,基金份额净值增长率为172.88%,同期业绩比较基准收益率为167.32%。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 性别, 任职日期, 离任日期, 国籍, 学历, 证券从业年限, 基金从业年限, 说明. Lists the fund manager's details and their qualifications.

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 基金经理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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,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,并重视交易执行环节的公平交易措施,“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统内的公平交易模块,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,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.3.3 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,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 本基金跟踪的标的指数为中证并购重组指数,中证并购重组指数由处于并购或资产重组进程的个股组成,是衡量涉及并购或资产重组整体走势的代表性指数。报告期内,本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2017年3季度,中证并购重组指数上涨2.3%,并购重组一直是监管层关注的重点,9月22日证监会对上市公司并购重组信息披露规则作出进一步修订完善,目的为提高并购重组效率,打击“限高”“限风”“限债”“限增”等违规行为,规范重组上市,监管层对并购重组进一步的规范及对市上利用并购重组概念进行过度炒作打击,但与此同时更加规范的并购重组,将有利于其服务实体经济的功能得以充分发挥,在国家对金融服务实体经济等政策配合下,并购重组将会有更健康、有序的发展。

截至报告期末,本基金份额净值为1.661元,本报告期份额净值增长率为3.23%,同期业绩比较基准收益率为0.94%,跟踪偏离度的均值为0.033%,年化跟踪误差为2.09%,各项指标均在合同约定的目标控制范围之内。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing fund asset composition: 序号, 类别, 名称, 金额(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists various asset categories and their values.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing stock investment by industry: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists industry codes and their respective values.

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

Table showing top 10 stock investments: 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(%). Lists the top 10 stocks held by the fund.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond investment by type: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond types and their values.

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

Table showing top 5 bond investments: 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(%). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

Table showing asset-backed investment details: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed investment details.

5.13 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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

5.14 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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

5.15 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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.16 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有股指期货。

5.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.18 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

5.19 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

Table showing asset-backed investment details: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed investment details.

5.20 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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

5.21 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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

易方达安心回报债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2011年6月21日至2017年9月30日)



注:本基金合同生效至本报告期末,A类基金份额净值增长率为172.88%,B类基金份额净值增长率为167.32%,同期业绩比较基准收益率为31.11%。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 性别, 任职日期, 离任日期, 国籍, 学历, 证券从业年限, 基金从业年限, 说明. Lists the fund manager's details and their qualifications.

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 基金经理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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,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,并重视交易执行环节的公平交易措施,“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统内的公平交易模块,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,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.3.3 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,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 本基金跟踪的标的指数为中证并购重组指数,中证并购重组指数由处于并购或资产重组进程的个股组成,是衡量涉及并购或资产重组整体走势的代表性指数。报告期内,本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2017年3季度,中证并购重组指数上涨2.3%,并购重组一直是监管层关注的重点,9月22日证监会对上市公司并购重组信息披露规则作出进一步修订完善,目的为提高并购重组效率,打击“限高”“限风”“限债”“限增”等违规行为,规范重组上市,监管层对并购重组进一步的规范及对市上利用并购重组概念进行过度炒作打击,但与此同时更加规范的并购重组,将有利于其服务实体经济的功能得以充分发挥,在国家对金融服务实体经济等政策配合下,并购重组将会有更健康、有序的发展。

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.661元,本报告期份额净值增长率为3.23%,B类基金份额净值为1.642元,本报告期份额净值增长率为3.21%,同期业绩比较基准收益率为0.94%,跟踪偏离度的均值为0.033%,年化跟踪误差为2.09%,各项指标均在合同约定的目标控制范围之内。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing fund asset composition: 序号, 类别, 名称, 金额(元), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists various asset categories and their values.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing stock investment by industry: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists industry codes and their respective values.

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

Table showing top 10 stock investments: 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(%). Lists the top 10 stocks held by the fund.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond investment by type: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond types and their values.

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

Table showing top 5 bond investments: 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(%). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

Table showing top 10 asset-backed investments: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 10 asset-backed investments.

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

Table showing top 5 precious metal investments: 序号, 贵金属名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 precious metal investments.

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

Table showing top 5 warrant investments: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists the top 5 warrant investments.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未持有国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本报告期内,本基金未持有期权。

易方达恒生前中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2017年第三季度报告

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2012年8月21日至2017年9月30日)



注:1.此处的“任职日期”为基金合同生效日,“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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 性别, 任职日期, 离任日期, 国籍, 学历, 证券从业年限, 基金从业年限, 说明. Lists the fund manager's details and their qualifications.

注:1.此处的“任职日期”为基金合同生效日,“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 基金经理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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,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