

易方达黄金主题证券投资基金 (LOF)

2017年第三季度报告

截至报告期末,本基金份额净值为0.718元,本报告期内份额净值增长率为-0.28%,同期业绩比较基准收益率为1.30%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 投资组合, 金额(人民币), 占基金总资产比例(%)

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资产分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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

本基金本报告期末未持有基金。

Table with 10 columns: 序号, 基金名称, 基金简称, 基金代码, 管理人, 公允价值(人民币), 占基金总资产比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(人民币)

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

Table with 2 columns: 项目, 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 单位:份

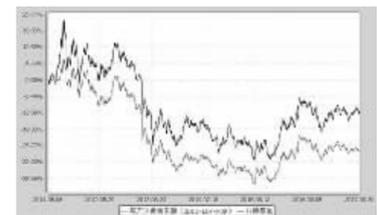
§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 备查文件目录

- 8.1 备查文件目录
1. 中国证监会核准易方达黄金主题证券投资基金(LOF)募集的文件;
2. 易方达黄金主题证券投资基金(LOF)基金合同;
3. 易方达黄金主题证券投资基金(LOF)托管协议;
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。
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



注:1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-28.20%,同期业绩比较基准收益率为-13.23%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 从业年限, 说明

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。

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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金信息

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 单位:人民币元

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。

易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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。

4.3 公平交易专项说明

本报告期内,本基金管理人严格执行《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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1. 三季度宏观经济呈现偏弱态势,虽然6月工业增加值同比增长7.6%,大幅高于市场预期,但此后持续下行。其中7月回落至6.4%,尤其是月度环比大幅下降,8月份6.0%的同比增速水平依然明显低于市场预期。

2. 三季度组合进入新的封闭期,整体规模保持平稳,组合杠杆目前位于中性水平。总体来看,我们在维持久期匹配的整体框架下,将根据市场情况灵活运用组合的配置策略。

4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.076元,本报告期内份额净值增长率为1.22%,C类基金份额净值为1.062元,本报告期内份额净值增长率为1.14%,同期业绩比较基准收益率为0.64%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 投资组合, 金额(人民币), 占基金总资产比例(%)

5.11 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 本基金本报告期没有投资股票。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 项目, 金额(人民币)

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未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 单位: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基金份额变动情况

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。

8.1 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

Table with 5 columns: 投资者名称, 持有份额, 持有份额占基金总份额比例, 持有时间

§ 8 备查文件目录

- 1. 中国证监会核准易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2. 易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金合同;
3. 易方达纯债1年定期开放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

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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金信息

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 单位:人民币元

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.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为26.46%,C类基金份额净值增长率为24.56%,同期业绩比较基准收益率为13.35%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 从业年限, 说明

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。

4.3 公平交易专项说明

本报告期内,本基金管理人严格执行《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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1. 三季度宏观经济呈现偏弱态势,虽然6月工业增加值同比增长7.6%,大幅高于市场预期,但此后持续下行。其中7月回落至6.4%,尤其是月度环比大幅下降,8月份6.0%的同比增速水平依然明显低于市场预期。

2. 三季度组合进入新的封闭期,整体规模保持平稳,组合杠杆目前位于中性水平。总体来看,我们在维持久期匹配的整体框架下,将根据市场情况灵活运用组合的配置策略。

4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.2160元,本报告期内份额净值增长率为9.34%,同期业绩比较基准收益率为3.34%,跟踪偏离度的均值为0.03%,年化跟踪误差为0.757%,各项指标均在合同约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

Table with 5 columns: 序号, 投资组合, 金额(人民币), 占基金总资产比例(%)

易方达证券公司指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

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。

4.3 公平交易专项说明

本报告期内,本基金管理人严格执行《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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1. 三季度宏观经济呈现偏弱态势,虽然6月工业增加值同比增长7.6%,大幅高于市场预期,但此后持续下行。其中7月回落至6.4%,尤其是月度环比大幅下降,8月份6.0%的同比增速水平依然明显低于市场预期。

2. 三季度组合进入新的封闭期,整体规模保持平稳,组合杠杆目前位于中性水平。总体来看,我们在维持久期匹配的整体框架下,将根据市场情况灵活运用组合的配置策略。

4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.1620元,本报告期内份额净值增长率为9.34%,同期业绩比较基准收益率为3.34%,跟踪偏离度的均值为0.03%,年化跟踪误差为0.757%,各项指标均在合同约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

Table with 5 columns: 序号, 投资组合, 金额(人民币), 占基金总资产比例(%)

5.11 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 本基金本报告期没有投资股票。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 项目, 金额(人民币)

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

Table with 2 columns: 项目, 单位:份

Table with 2 columns: 项目, 单位: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基金份额变动情况

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。

8.1 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

Table with 5 columns: 投资者名称, 持有份额, 持有份额占基金总份额比例, 持有时间

§ 8 备查文件目录

- 1. 中国证监会核准易方达证券公司指数分级证券投资基金募集的文件;
2. 易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同;
3. 易方达证券公司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