

易方达沪深300量化增强证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

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。

基金的投资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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况, 基金主要指标. Includes fund name, type, and key performance indicators.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

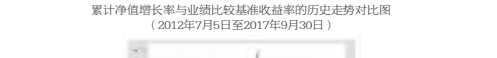
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期. Lists financial metrics for the reporting period.

注:1.上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。

注: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。

3.2.1 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

易方达沪深300量化增强证券投资基金
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



注:自基金合同生效至本报告期末,基金份额净值增长率为127.62%,同期业绩比较基准收益率为50.33%。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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

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。

基金的投资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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

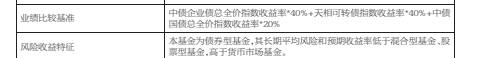
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期. Lists financial metrics for the reporting period.

注:1.上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。

注: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。

3.2.1 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

易方达双债增强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



注:自基金合同生效至本报告期末,A类基金份额净值增长率为46.29%,C类基金份额净值增长率为42.88%,同期业绩比较基准收益率为1.19%。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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

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。

基金的投资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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

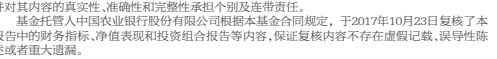
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期. Lists financial metrics for the reporting period.

注:1.上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。

注: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。

3.2.1 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

易方达月月利理财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



注:自2017年8月29日起,本基金增设C类份额,份额首次确认为2017年8月30日,增設当日的相关数据和指标按实际存续期间计算。

注:自2017年8月29日起,本基金增设C类份额,份额首次确认为2017年8月30日,增設当日的相关数据和指标按实际存续期间计算。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期. Lists financial metrics for the reporting period.

注:1.上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。

注: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。

3.2.1 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

易方达月月利理财债券型C
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



注:自2017年8月29日起,本基金增设C类份额,份额首次确认为2017年8月30日,增設当日的相关数据和指标按实际存续期间计算。

注:自2017年8月29日起,本基金增设C类份额,份额首次确认为2017年8月30日,增設当日的相关数据和指标按实际存续期间计算。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期. Lists financial metrics for the reporting period.

注:1.上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。

注: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。

3.2.1 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

易方达月月利理财债券型A
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



Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业资格, 说明. Lists fund management personnel.

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。

4.2.3 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发现异常交易行为。

4.3 公平交易专项说明
本基金报告期内严格执行了公平交易制度,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
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约定,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。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
4.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

4.5.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业类别. Lists industry categories for the portfolio.

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.1 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 with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.2 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 with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.3 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 with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.4 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投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.6 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股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.7 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股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.9 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股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.10 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 with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.11 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 with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.12 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 with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.13 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股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

注:1.本报告期末本基金持仓集中度符合基金合同约定。

5.1.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资