易方达双月利理财债券型证券投资基金

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

§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	易方达双月利理财债券
基金主代码	110062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月15日
报告期末基金份额总额	681,395,369.81份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过分析影响债券市场和货币市场的各类要素,对固定收益产品的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置。具体来看,本基金将对资金面进行综合分析的基础上,判断是否存在利差套利空间,以确定是否进行杠杆操作。在充分考虑组合流动性管理需要的前提下,配置协议存款。对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上,运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测,深入分析利率品种的收益和风险,并据此调整债券组合的平均久期。
业绩比较基准	基金托管人公布的七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达双月利理财债券A / 易方达双月利理财债券B
下属分级基金的交易代码	110062 / 110063
报告期末下属分级基金的份额总额	272,496,022.24份 / 408,899,347.57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)	
	易方达双月利理财债券A	易方达双月利理财债券B
1.本期已实现收益	3,359,202.94	2,740,414.40
2.本期利润	3,359,202.94	2,740,414.40
3.期末基金资产净值	272,496,022.24	408,899,347.57

注:1.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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按运作期结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达双月利理财债券A

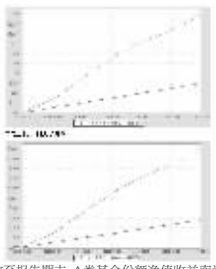
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0961%	0.0026%	0.3450%	0.0000%	0.7511%	0.0026%

易方达双月利理财债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1696%	0.0026%	0.3450%	0.0000%	0.8245%	0.0026%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达双月利理财债券型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年1月15日至2017年9月30日)



易方达双月利理财债券A

注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为21.7334%,B类基金份额净值收益率为23.3666%,同期业绩比较基准收益率为6.4500%。

§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
石大铎	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达天天发货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达财富快钱货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2013-01-15	-	8年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁堂	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达易富快钱货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达货币市场基金的基金经理助理	2014-09-24	-	7年	硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员,易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理。

注:1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期,石大铎的“任职日期”为基金合同生效之日,梁堂的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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年三季度债券市场收益率处于震荡格局中,并没有出现明显的趋势。基本面上七月公布的六月经济数据显示经济韧性仍然较强,市场对于经济的悲观预期有所修正。但是七月数据再次意外大幅下滑,固定资产投资和工业增加值均出现非常明显的下行。八月数据有所反弹,但是反弹力度不及预期;背后有部分政策限产的原因,但是市场对于经济下滑的担心又开始加剧。另一方面融资数据仍然保持强势,表内贷款持续超预期,尤其是居民部门的贷款量一直处于高位,整体的社会融资总量也相对较好。经济数据和融资数据的背离使得市场短期分歧有所加大,但是市场对于中长期利率下行的看法却比较一致,这使得收益率的上行空间有限。另一方面,央行货币政策维持中性态度,非银行金融机构资金面相对偏紧,此外部分新规约束也造成了流动性的结构性紧张,短端收益率持续处于高位,居高不下的短端收益率也约束了长端收益率的下行空间。整体来看,三季度末的货币市场利率水平比二季度末略有下行,但总体货币市场收益率在三季度维持在较高位,这为短期理财基金的投资提供了较好的机会。

操作方面,报告期内基金以同业存单、中期存款为主要配置资产。在三季度末拉长了组合的剩余期限。总体来看,组合在三季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额净值收益率为1.0961%;B类基金份额净值收益率为1.1695%;同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

§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	固定收益投资	470,562,051.07	56.81
	其中:债券	470,562,051.07	56.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	370,536,627.32	43.91
4	其他资产	1,978,780.64	0.23
5	合计	843,077,459.03	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	19.78
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	158,569,362.14	23.27
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定“本基金在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”,本报告期内本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	122
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	149
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	81

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天”,本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	0.23	23.27
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	29.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	56.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	34.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		123.44	23.27

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金属于理财债券型基金,不适用本项目。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	39,900,584.07	5.96
	其中:政策性金融债	39,900,584.07	5.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	430,661,467.00	63.20
8	其他	-	-
9	合计	470,562,051.07	69.06
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111717218	17光大银行CD218	1,200,000	118,965,081.79	17.46
2	111710463	17兴业银行CD463	500,000	49,569,261.91	7.27
3	111706038	17交通银行CD038	500,000	49,557,394.94	7.27
4	111712153	17北京银行CD153	500,000	48,300,296.34	7.09
5	111781410	17南京银行CD141	500,000	48,263,581.19	7.08
6	111783160	17广州农村商业银行CD150	400,000	38,411,680.67	5.64
7	170204	17国开04	300,000	29,879,616.32	4.39
8	111713075	17浙商银行CD075	300,000	28,964,913.85	4.25
9	111718209	17华夏银行CD209	300,000	28,917,879.18	4.24
10	111718234	17华夏银行CD234	200,000	19,741,387.13	2.90

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1694%
报告期内偏离度的最低值	-0.0363%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0684%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.9.2117华夏银行CD209(代码:111718209)、17华夏银行CD234(代码:111718234)为易方达双月利理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年3月29日,银监会机关针对票据违规操作、掩盖不良、规避监管、乱收费用、滥用通道、违背国家宏观调控政策等市场乱象,作出了25件行政处罚决定,罚款金额合计4290万元,其中包括华夏银行。

17南京银行CD141(代码:111781410)为易方达双月利理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年6月22日,江苏银监局针对南京银行独立董事任职时间超过监管规定,处以人民币25万元的行政处罚。

17北京银行CD153(代码:111712153)为易方达双月利理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年8月8日,北京银监局针对北京银行未经核准提前授权部分人员实际履行高管人员职责,责令北京银行改正,并对其给予100万元罚款的行政处罚。

17交通银行CD038(代码:111706038)为易方达双月利理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年3月29日,中国银监会针对交通银行批量转让个人贷款,处以人民币20万元的行政处罚。

本基金投资17华夏银行CD209、17华夏银行CD234、17南京银行CD141、17北京银行CD153、17交通银行CD038的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除17华夏银行CD209、17华夏银行CD234、17南京银行CD141、17北京银行CD153、17交通银行CD038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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,404,675.71
4	应收申购款	574,104.93
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,978,780.64

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达双月利理财债券A	易方达双月利理财债券B
报告期期初基金份额总额	236,974,659.60	184,737,467.76
本报告期基金总申购份额	158,812,392.64	229,161,879.81
本报告期基金总赎回份额	123,291,030.00	5,000,000.00
报告期期末基金份额总额	272,496,022.24	408,899,347.57

§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 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
	1	2017年09月13日-2017年09月30日	-	200,000.000.00	-	200,000.000.00	29.35%

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;极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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达双月利理财债券型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达双月利理财债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达双月利理财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。

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

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

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	易方达标普消费品指数增强(QDII)
基金主代码	118002
交易代码	118002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月4日
报告期末基金份额总额	32,319,858.31份
投资目标	在严格控制跟踪误差的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以指数化投资为主,并辅以有限度的增强操作。本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股构成及权重为基础,并基于量化模型和基本面研究进行投资组合的构建。在投资组合建立后,基金管理人将适时对投资组合进行调整,力争将投资组合对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在8%以内,从而分享高端消费品行业品牌优势、高盈利所具有的长期投资价值,并力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	标普全球高端消费品指数(净收益指数,使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金为股票基金,其预期风险与收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金在控制跟踪误差的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看,本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金主要投资于全球高端消费品企业,需承担汇率风险、国家风险和高端消费品企业特有的风险。
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
境外投资顾问	英文名称:无 中文名称:无
境外资产托管人	英文名称:Bank of China(Hong Kong)Limited 中文名称:中国银行(香港)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	1,547,149.06
2.本期利润	2,153,258.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0621
4.期末基金资产净值	54,797,607.77
5.期末基金份额净值	1.695

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。

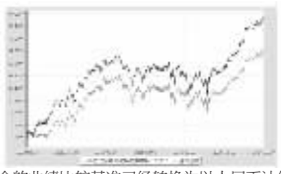
3.2 基金净值表现

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	3.92%	0.57%	4.06%	0.51%	-0.14%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金
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
(2012年6月4日至2017年9月30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69.50%,同期业绩比较基准收益率为95.73%。

§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
张胜记	本基金的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普500指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达50指数证券投资基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、指数与量化投资部副总经理	2014-09-13	-	12年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、易方达证券投资部交易员、指数与量化投资部总经理助理。
FAN BINGI(范冰)	本基金的基金经理、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、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金经理、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普500指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普500指数证券投资基金(LOF)的基金经理	2017-03-25	-	12年	硕士研究生,曾任皇家加拿大银行托管部核算专员、美国道富集团Middle Office中台交易支持专员、巴克莱资产管理公司悉尼全融数据部高级金融数据分析员、主管,新加坡金融数据部副主管,贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。

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境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金没有请境外投资顾问。

4.3报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4公平交易专项说明

4.4.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程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相应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,通过投资交易系统中的公平交易模块,同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式,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。

4.4.2异常交易行为的专项说明

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。

4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年三季度,美国经济整体继续保持复苏的态势,劳动力市场就业充分,失业率维持低位,工资水平也稳中有升。七月份美联储主席耶伦就FOMC利率决议的证词偏鸽派,表示未来需要渐进式的加息步调,并预计今年开始缩表,美股应声大涨。八月份特朗普内政推行不畅以及在地缘政治上与朝鲜的摩擦引发了避险情绪,造成股市较大的回调。Jackson Hole年会召开,耶伦和德拉吉讲话均未透露更多货币政策信息。九月份伴随着美元指数的反弹和经济数据向好的提振,美股反弹走高,美国债务上限再度冻结3个月并达成2018财年临时支出法案避免政府关门。美联储9月FOMC会议如期宣布从10月份开始缩表,并维持利率“散点图”不变,暗示12月份仍有加息的可能。欧洲方面,经济步入复苏轨道,德国现任总理默克尔领导的基民盟在大选中获胜;西班牙加泰罗尼亚举行独立公投,带来一定不确定性。新兴市场方面,人口和政策红利的释放以及经济复苏等因素,继续推高股市,吸引资金流入。本基金是跟踪标普全球高端消费品指数的增强型指数基金,股票仓位根据合同要求保持在90%以上。在行业配置上,基本与指数权重分布一致,科技行业有所超配。在国别配置上,与指数权重分布基本一致,低配韩国市场,同时超配香港市场。

4.5.2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1.695元,本报告期份额净值增长率为3.92%,同期业绩比较基准收益率为4.06%,年化跟踪误差3.936%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	52,362,215.79	93.13
	其中:普通股	50,413,053.46	89.67
	存托凭证	1,395,986.96	2.48
	优先股	553,175.37	0.98
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,527,243.00	6.27
8	其他资产	333,100.68	0.59
9	合计	56,222,559.47	100.00

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投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	20,384,538.15	37.20
法国	8,292,709.22	15.12
德国	6,801,190.31	12.41
英国	5,391,693.36	9.84
香港	4,750,766.11	8.67
瑞士	3,495,807.21	6.38
意大利	1,449,317.73	2.64
日本	1,294,898.58	2.34
澳大利亚	349,585.92	0.64
新加坡	171,709.20	0.31
合计	52,362,215.79	95.56

注:1.国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	40,259,613.37	73.47
必需消费品	9,242,409.27	16.87
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	2,860,193.15	5.22
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	52,362,215.79	95.56

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Diageo PLC	-	DGE LN	伦敦证券交易所	英国	20,066	4,393,054.40	8.02
2	Daimler AG	-	DAI GR	德国证券交易所Xetra交易平台	德国	7,949	4,196,784.67	7.66
3	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	-	MC FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	2,196	4,010,663.25	7.32
4	NIKE Inc	-	NKE US	纽约证券交易所	美国	10,143	3,490,442.28	6.37
5	Cie Financiere Richemont SA	-	CFR VX	瑞士证券交易所	瑞士	4,160	2,520,423.36	4.60
6	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,020	2,309,123.52	4.21
7	Bayerische Motoren Werke AG	-	BMW GR	德国证券交易所Xetra交易平台	德国	2,564	1,714,944.18	3.13
8	Tencent Holdings Ltd	-	700 HK	香港证券交易所	香港	6,000	1,713,934.15	3.13
9	Pernod Ricard SA	-	RI FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	1,760	1,611,662.39	2.94
10	Kering	-	KER FP	巴黎纽约泛欧证券交易所	法国	603	1,590,016.49	2.90

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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明细

本基金本报告期末未持有基金。

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

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	108,989.88
4	应收利息	197.21
5	应收申购款	223,913.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	333,100.68

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

单位:份

报告期期初基金份额总额	41,238,201.06
报告期基金总申购份额	8,570,630.00
减:报告期基金总赎回份额	17,488,872.75
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	32,319,858.31

注:本基金份额变动含易方达标普全球高端消费品指数(QDII)人民币、美元现汇份额。

§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