

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

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。  
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	易方达黄金ETF
场内简称	黄金ETF
基金代码	159924
交易代码	159924
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2013年11月29日
报告期末基金份额总额	416,362,464.03份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资于黄金期货合约的比例不低于基金资产净值的90%,为紧密跟踪标的指数表现,本基金力争将净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在0.2%以内。黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响,本基金投资于黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响,本基金投资于黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响,本基金投资于黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响。
业绩比较基准	上海黄金交易所Au99.99合约收盘价
风险收益特征	本基金属于黄金期货ETF,跟踪黄金期货合约的收盘价,具有与上海黄金交易所Au99.99合约收盘价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

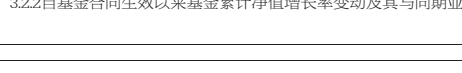
3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		1,481,229.64
2.本期公允价值变动收益		29,198,182.93
3.本期资产净值		6,042.02
4.本期基金份额净值		1.1467,3017
5.本期基金份额净值增长率		2.36%

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.本基金已于2013年12月11日进行了基金份额折算,折算比例为0.40739099。  
3.2 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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	1.64%	0.03%	1.60%	0.03%	-0.05%	0.00%

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



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

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。  
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	易方达岁丰添利债券(L2)
场内简称	岁丰添利
基金代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在封闭证券交易场所上市交易,到期开放赎回,本基金转为上市开放式基金(L2-FOF)
基金合同生效日	2010年11月19日
报告期末基金份额总额	401,139,209.71份
投资目标	本基金投资于主要债券品种,力争为持有人提供超越业绩比较基准的长期稳定回报,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于以下投资策略,进行基金资产非信用类固定收益类资产的投资:1.久期策略:根据对利率的预期,调整组合久期,把握债券投资的最佳时机;2.基于对宏观经济、行业景气度及公司基本面等因素的分析,选择具有较好投资价值的债券品种;3.基于可转换债券品种的内在价值,选择具有较高投资价值的可转换债券品种;4.基于对利率、信用风险、流动性、流动性风险等因素的分析,把握债券投资的最佳时机。
业绩比较基准	三年定期存款利率+债券收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,理论上长期资产配置和风险控制率高于混合型基金,属于中低风险基金,具有中等风险水平。
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

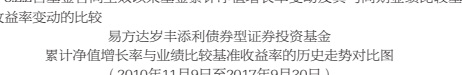
3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		1,531,796.17
2.本期公允价值变动收益		12,699,800.91
3.本期资产净值		6,056.06
4.本期基金份额净值		647.30,672.94
5.本期基金份额净值增长率		1.34%

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	1.21%	0.06%	1.00%	0.01%	0.21%	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



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

基金名称	易方达中板指数分级
基金代码	161118
交易代码	161118
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在封闭证券交易场所上市交易,到期开放赎回,本基金转为上市开放式基金(L2-FOF)
基金合同生效日	2012年9月17日
报告期末基金份额总额	207,706,463.09份
投资目标	本基金采用量化投资策略,以实现对标的指数的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用量化投资策略,紧密跟踪标的指数,力求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,为紧密跟踪标的指数表现,本基金力争将净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在0.2%以内。
业绩比较基准	中小板价格指数收益率×90%+业绩比较基准收益率×10%
风险收益特征	本基金属成长型股票基金,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险品种,投资者投资于本基金面临较高投资风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

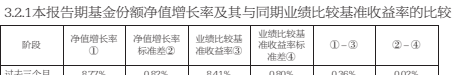
3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		-2,609,947.96
2.本期公允价值变动收益		23,707,147.93
3.本期资产净值		289,289,116.73
4.本期基金份额净值		1.1002

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	6.77%	0.62%	6.41%	0.07%	0.36%	0.62%

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



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

基金名称	易方达岁丰添利债券(L2)
场内简称	岁丰添利
基金代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在封闭证券交易场所上市交易,到期开放赎回,本基金转为上市开放式基金(L2-FOF)
基金合同生效日	2010年11月19日
报告期末基金份额总额	401,139,209.71份
投资目标	本基金投资于主要债券品种,力争为持有人提供超越业绩比较基准的长期稳定回报,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于以下投资策略,进行基金资产非信用类固定收益类资产的投资:1.久期策略:根据对利率的预期,调整组合久期,把握债券投资的最佳时机;2.基于对宏观经济、行业景气度及公司基本面等因素的分析,选择具有较好投资价值的债券品种;3.基于可转换债券品种的内在价值,选择具有较高投资价值的可转换债券品种;4.基于对利率、信用风险、流动性、流动性风险等因素的分析,把握债券投资的最佳时机。
业绩比较基准	三年定期存款利率+债券收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,理论上长期资产配置和风险控制率高于混合型基金,属于中低风险基金,具有中等风险水平。
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

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		1,531,796.17
2.本期公允价值变动收益		12,699,800.91
3.本期资产净值		6,056.06
4.本期基金份额净值		647.30,672.94
5.本期基金份额净值增长率		1.34%

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	1.21%	0.06%	1.00%	0.01%	0.21%	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



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

基金名称	易方达黄金ETF
场内简称	黄金ETF
基金代码	159924
交易代码	159924
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2013年11月29日
报告期末基金份额总额	416,362,464.03份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资于黄金期货合约的比例不低于基金资产净值的90%,为紧密跟踪标的指数表现,本基金力争将净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在0.2%以内。黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响,本基金投资于黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响,本基金投资于黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响,本基金投资于黄金期货合约的净值增长率不受黄金现货价格波动的影响。
业绩比较基准	上海黄金交易所Au99.99合约收盘价
风险收益特征	本基金属于黄金期货ETF,跟踪黄金期货合约的收盘价,具有与上海黄金交易所Au99.99合约收盘价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

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		1,481,229.64
2.本期公允价值变动收益		29,198,182.93
3.本期资产净值		6,042.02
4.本期基金份额净值		1.1467,3017
5.本期基金份额净值增长率		2.36%

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	1.64%	0.03%	1.60%	0.03%	-0.05%	0.00%

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



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

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。  
本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	易方达岁丰添利债券(L2)
场内简称	岁丰添利
基金代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在封闭证券交易场所上市交易,到期开放赎回,本基金转为上市开放式基金(L2-FOF)
基金合同生效日	2010年11月19日
报告期末基金份额总额	401,139,209.71份
投资目标	本基金投资于主要债券品种,力争为持有人提供超越业绩比较基准的长期稳定回报,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于以下投资策略,进行基金资产非信用类固定收益类资产的投资:1.久期策略:根据对利率的预期,调整组合久期,把握债券投资的最佳时机;2.基于对宏观经济、行业景气度及公司基本面等因素的分析,选择具有较好投资价值的债券品种;3.基于可转换债券品种的内在价值,选择具有较高投资价值的可转换债券品种;4.基于对利率、信用风险、流动性、流动性风险等因素的分析,把握债券投资的最佳时机。
业绩比较基准	三年定期存款利率+债券收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,理论上长期资产配置和风险控制率高于混合型基金,属于中低风险基金,具有中等风险水平。
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

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		1,531,796.17
2.本期公允价值变动收益		12,699,800.91
3.本期资产净值		6,056.06
4.本期基金份额净值		647.30,672.94
5.本期基金份额净值增长率		1.34%

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	1.21%	0.06%	1.00%	0.01%	0.21%	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



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

基金名称	易方达岁丰添利债券(L2)
场内简称	岁丰添利
基金代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在封闭证券交易场所上市交易,到期开放赎回,本基金转为上市开放式基金(L2-FOF)
基金合同生效日	2010年11月19日
报告期末基金份额总额	401,139,209.71份
投资目标	本基金投资于主要债券品种,力争为持有人提供超越业绩比较基准的长期稳定回报,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于以下投资策略,进行基金资产非信用类固定收益类资产的投资:1.久期策略:根据对利率的预期,调整组合久期,把握债券投资的最佳时机;2.基于对宏观经济、行业景气度及公司基本面等因素的分析,选择具有较好投资价值的债券品种;3.基于可转换债券品种的内在价值,选择具有较高投资价值的可转换债券品种;4.基于对利率、信用风险、流动性、流动性风险等因素的分析,把握债券投资的最佳时机。
业绩比较基准	三年定期存款利率+债券收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,理论上长期资产配置和风险控制率高于混合型基金,属于中低风险基金,具有中等风险水平。
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

主要财务指标		报告期
单位:人民币元		
1.本期投资收益		1,531,796.17
2.本期公允价值变动收益		12,699,800.91
3.本期资产净值		6,056.06
4.本期基金份额净值		647.30,672.94
5.本期基金份额净值增长率		1.34%

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	1.21%	0.06%	1.00%	0.01%	0.21%	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

