

易方达国企改革指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Data for 过去三个月: 3.06%, 0.05%, 1.22%, 0.00%, 1.20%, 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

易方达国企改革指数分级证券投资基金

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15日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-36.09%,同期业绩比较基准收益率为-30.00%。

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, 任本基金基金经理时间, 证券从业年限, 说明. Lists 余海勇 and 杨松.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年7月1日至2017年9月30日). Rows include 1.本期利润总额, 2.本期净利润, etc.

注: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。

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Data for 过去三个月: 3.06%, 0.05%, 1.22%, 0.00%, 1.20%, 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

易方达国企改革指数分级证券投资基金

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15日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-36.09%,同期业绩比较基准收益率为-30.00%。

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, 任本基金基金经理时间, 证券从业年限, 说明. Lists 余海勇 and 杨松.

注:上述的“离任日期”为基金合同生效之日,“聘任日期”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。

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Data for 过去三个月: 3.06%, 0.05%, 1.22%, 0.00%, 1.20%, 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

易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

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9日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为19.00%,同期业绩比较基准收益率为26.62%。

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, 任本基金基金经理时间, 证券从业年限, 说明. Lists 余海勇 and 杨松.

注:上述的“离任日期”为基金合同生效之日,“聘任日期”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。

3.2 基金净值表现

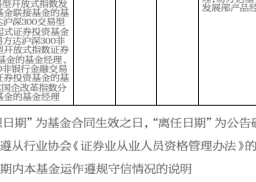
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Data for 过去三个月: 4.30%, 0.07%, 3.04%, 0.05%, 1.26%, -0.02%.

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

易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

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9日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为19.00%,同期业绩比较基准收益率为26.62%。

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, 任本基金基金经理时间, 证券从业年限, 说明. Lists 余海勇 and 杨松.

注:上述的“离任日期”为基金合同生效之日,“聘任日期”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。

3.2 基金净值表现

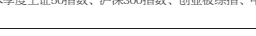
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Data for 过去三个月: -2.09%, 0.05%, -2.11%, 0.00%, 0.02%, -0.01%.

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

易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2013年8月29日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为19.00%,同期业绩比较基准收益率为26.62%。

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,以及强化的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。

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市场公开竞价交易中,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。

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年三季度国内宏观经济增长延续了前期的复苏态势,国内外需求旺盛,供需格局持续改善,最新公布的宏观数据显示9月份全国制造业PMI为52.4,创2012年5月以来的新高,在经历了7月和8月的低迷态势后中国经济增长表现出了很强的韧性。

4.4.2报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截至报告期末,本基金份额净值为1.0510元,本报告期份额净值增长率为3.05%,同期业绩比较基准收益率为1.22%,日跟踪偏离度均值为0.07%,年化跟踪误差为1.680%,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 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, etc.

5.2 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 6 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(%). Lists 1. 000026 振华重工, 2. 000019 青岛啤酒, etc.

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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

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五名债券投资明细

本报告期内未持有债券。

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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.2 报告期内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。

5.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.9.2 报告期内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。

5.9.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.9.9.2 报告期内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。

5.9.9.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.9.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.9.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.9.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.9.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.9.9.9.2 报告期内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。

5.9.9.9.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.9.9.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.9.9.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.9.9.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.9.9.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.9.9.9.9.2 报告期内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。

5.9.9.9.9.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.9.9.9.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.9.9.9.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.9.9.9.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.9.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.9.9.9.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.9.9.9.9.9.2 报告期内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。

5.9.9.9.9.9.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.9.9.9.9.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.9.9.9.9.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.9.9.9.9.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

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,以及强化的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。

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市场公开竞价交易中,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。

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年三季度国内宏观经济增长延续了前期的复苏态势,国内外需求旺盛,供需格局持续改善,最新公布的宏观数据显示9月份全国制造业PMI为52.4,创2012年5月以来的新高,在经历了7月和8月的低迷态势后中国经济增长表现出了很强的韧性。

4.4.2报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截至报告期末,本基金份额净值为1.0510元,本报告期份额净值增长率为3.05%,同期业绩比较基准收益率为1.22%,日跟踪偏离度均值为0.07%,年化跟踪误差为1.680%,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 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, etc.

5.2 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 6 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(%). Lists 1. 000026 振华重工, 2. 000019 青岛啤酒, etc.

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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

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五名债券投资明细

本报告期内未持有债券。

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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.2 报告期内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。

5.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本报告期内未持有资产支持证券。

5.9.5 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贵金属投资明细

本报告期内未持有贵金属。

5.9.6 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权证投资明细

本报告期内未持有权证。

5.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内未进行国债期货交易。