易方达双月利理财债券型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6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:二〇一七年七月二十一日

§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7月18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4月1日起至6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	110052	
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	421,712,127.36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、国外经济走势进行分析和纯阐基础上,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	110052	110053
报告期末下属分级基金的份额总额	236,974,659.60份	184,737,467.76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4月1日-2017年6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	2,227,034.94	517,981.82
2.本期利润	2,227,034.94	517,981.82
3.期末基金资产净值	236,974,659.60	184,737,467.76

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	0.9115%	0.0009%	0.3413%	0.0000%	0.5702%	0.0009%

易方达双月利理财债券B

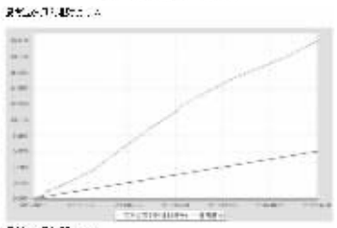
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9843%	0.0009%	0.3413%	0.0000%	0.6430%	0.0009%

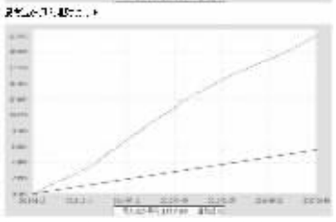
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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6月30日)





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20.4146%,B类基金份额净值收益率为21.9417%,同期业绩比较基准收益率为6.1050%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石大烨	本基金的基金经理,易方达掌柜季资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,易方达天天理财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,易方达宝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,易方达财富快线货币市场基金的基金经理,易方达理财通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。
梁莹	本基金的基金经理,易方达增金宝货币市场基金的基金经理,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,易方达宝宝货币市场基金的基金经理,易方达财富快线货币市场基金的基金经理,易方达理财通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助理,易方达易理财货币市场基金的基金经理助理,易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理,易方达天天理财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,石大烨的"任职日期"为基金合同生效之日,梁莹的"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。本基金管理人规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,同日反向交易或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3次,其中3次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,2次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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年二季度国内经济出现复苏走强的迹象,三、四月份的经济数据超出了市场机构的预期,其中的基建和地产投资数据均出现比较显著的回升,显示企业补库存需求旺盛。市场机构开始逐渐认同国内经济已经企稳复苏。同时,二季度金融监管力度仍然较强,市场担忧金融去杠杆会不断推进,这导致债券市场中信用债品种的流动性不断丧失。在二季度,货币政策也一直保持中性态度,资金面维持紧平衡,货币市场利率维持高位。银行在负债端的压力逐步显现,体现银行融资成本的同业存单利率在二季度攀升至历史高位。上述因素导致国内债券市场在二季度出现了较为显著的调整,利率债、信用债收益率都出现大幅上行。六月份,人民银行公开市场操作向市场投放了较多的流动性,这使得前期市场机构对于季末资金面紧张和监管政策加强的担忧得到缓解,银行间业存单的发行利率从高位开始快速回落。五月的经济数据有所回落,市场对于经济复苏的前景出现分歧。在多重因素叠加作用下,债券市场收益率在六月有所回落,信用利差有所缩窄。但是整体来看,二季度末的利率水平比一季度末仍然出现了比较显著的上行。货币市场的收益水平,在二季度一直维持高位,这为理财债券型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、中短期存款为主要配置资产。在二季度末拉长了组合的剩余期限。总体来看,组合在二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0.9115%;B类基金份额净值收益率为0.9843%;同期业绩比较基准收益率为0.3413%。

§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	335,650,297.66	57.10
	其中:债券	335,650,297.66	57.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	99,959,389.94	17.01
	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	151,147,458.85	25.71
4	其他资产	1,036,889.43	0.18
5	合计	587,794,035.88	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	8.44	
	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	164,369,384.01	38.98
	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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

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	0.27	38.98
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	23.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	84.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	18.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	139.14	38.98

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	49,687,730.16	11.78
	其中:政策性金融债	49,687,730.16	11.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	285,962,567.50	67.81
8	其他	-	-
9	合计	335,650,297.66	79.59
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	111708195	17中信银行CD195	700,000	69,249,259.16	16.42
2	111707139	17招商银行CD139	600,000	59,396,843.35	14.08
3	170204	17国开04	500,000	49,687,730.16	11.78
4	111711240	17平安银行CD240	500,000	49,494,367.27	11.74
5	111717126	17光大银行CD126	500,000	49,452,464.17	11.73
6	111711236	17平安银行CD236	300,000	29,699,305.17	7.04
7	111718209	17华夏银行CD209	300,000	28,670,328.38	6.80

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	0.1187%
报告期内偏离度的最低值	-0.0112%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0217%

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,每日计提应益;

(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。

5.9.2报告期末投资组合前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019546	16国债18	1,700,000	169,813,000.00	1.76
2	170204	17国开04	1,000,000	99,570,000.00	1.03

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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1在17年5月29日,中国银监会针对招商银行批量转让个人贷款,处以人民币50万元的行政处罚。

2017年3月29日,中国银监会针对平安银行内控管理严重违反审慎经营规则;非真实转让信贷资产;销售对公非保本理财产品出具回购承诺、承诺保本;为同业投资业务提供第三方信用担保;未严格审查贸易背景真实性办理票据承兑、贴现业务,处以人民币1670万元的行政处罚。

本基金为指数型基金,招商银行、平安银行是标的指数成份券,该类股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行、平安银行外,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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	418,956.20
2	应收证券清算款	51,104,973.18
3	应收股利	-
4	应收利息	4,316,828.52
5	应收申购款	6,378,788.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,219,546.72

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

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601088	中国神华	305,925,303.60	3.18	重大事项停牌

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

项目	易方达上证50指数A	易方达上证50指数C
报告期期初基金份额总额	8,100,369,957.16	-
报告期基金总申购份额	340,091,379.92	3,017,476.94
减:报告期基金总赎回份额	543,037,951.41	2,170,593.66
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	7,897,423,385.67	846,883.28

注:自2017年06月06日起,本基金增设C类份额类别,本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§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份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

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 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50指数证券投资基金设立的文件;

2.《易方达50指数证券投资基金基金合同》;

3.《易方达50指数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
二〇一七年七月二十一日

易方达50指数证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年七月二十一日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月18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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达上证50指数	
基金主代码	110003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年3月22日	
报告期末基金份额总额	7,898,270,268.95份	
投资目标	在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越指数的投资收益,追求长期资本增值。	
投资策略	本基金为指数增强型基金,股票投资部分以上证50指数作为标的指数,资产配置上追求充分投资,不根据对市场走势的判断主动调整股票仓位,通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,控制与目标指数的偏离风险,追求超越基准的收益水平。	
业绩比较基准	上证50指数	
风险收益特征	本基金为股票基金,其预期风险、收益水平高于混合基金、债券基金及货币市场基金。本基金在控制与目标指数偏离风险的同时,力争获得超越基准的收益。长期来看,本基金具有与目标指数相匹配的风险水平。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达上证50指数A	易方达上证50指数C
下属分级基金的交易代码	110003	004746
报告期末下属分级基金的份额总额	7,897,423,385.67份	846,883.28份

注:自2017年6月6日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月7日。

§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4月1日-2017年6月30日)	
	易方达上证50指数A	易方达上证50指数C
1.本期已实现收益	234,921,881.45	9,943.57
2.本期利润	1,392,514,676.09	68,474.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.1739	0.0550
4.期末基金资产净值	9,621,540,199.40	1,031,746.60
5.期末基金份额净值	1.2183	1.2183

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.自2017年6月6日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月7日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达上证50指数A

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	11.44%	0.69%	8.06%	0.70%	3.38%	-0.01%

易方达上证50指数C

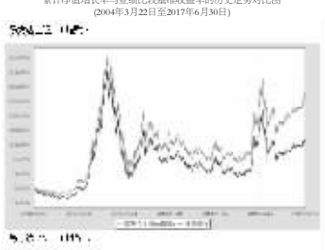
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.56%	0.79%	3.40%	0.71%	2.16%	0.08%

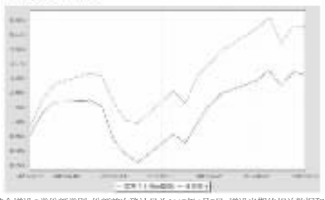
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达50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的历史走势对比图

(2004年3月22日至2017年6月30日)





注:1.自2017年6月6日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月7日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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267.52%,同期业绩比较基准收益率为137.93%;C类基金份额净值增长率为5.56%,同期业绩比较基准收益率为3.40%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张胜记	本基金的基金经理,易方达瑞ippo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,易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理,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	2012-09-28	-	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、机构理财投资经理助理,基金经理助理,研究部行业研究员。易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理,指数与量化投资部总经理助理。

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。本基金管理人规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,同日反向交易或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5次,其中3次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,2次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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年二季度,价格方面:CPI保持平稳,同比增速回落至2%以下;产业方面:4、5、6月中采PMI分别为51.2、51.2、51.7,企业景气度连续11个月保持在荣枯线上;资金方面:4、5月份新增人民币贷款为11000亿元、11100亿元,相较一季度有一定下降;政策方面:6月份以来,虽然央行货币投放有所增加,但是整体去杠杆的监管态度仍未改变,因此中期来看,货币政策仍将持续偏紧状态。年初以来,IPO常态化、地产抑制法、金融去杠杆等政策安排虽然给市场带来一定短期压力,但预期在各个市场出清后,经济将有机会进入新一轮上行周期。

报告期内本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2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1.0262元,本报告期份额净值增长率为0.22%,同期业绩比较基准收益率为-0.27%。日跟踪偏离度的均值为0.05%,年化跟踪误差1.53%,各项指标均在合同规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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,095,476,270.34	94.07
	其中:股票	9,095,476,270.34	94.07
2	固定收益投资	269,383,000.00	2.79
	其中:债券	269,383,000.00	2.79
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	141,330,649.17	2.50
7	其他资产	62,219,546.72	0.64
8	合计	9,668,409,466.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,221,738,460.89	12.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	59,572,636.22	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,494,350.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	276,657,335.25	2.88
K	房地产业	864,225.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,260,000.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	2,473,317.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	1,570,067,963.98	16.32

5.2.1.2指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	517,318,607.58	5.38
C	制造业	1,938,496,387.25	20.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,030,147.57	0.82
E	建筑业	377,705,124.44	3.93
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	177,615,297.50	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	126,236,279.90	1.31
J	金融业	3,919,567,193.56	40.73
K	房地产业	389,439,268.56	4.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,525,408,306.36	78.21

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股票投资明细

5.3.1期末指数投资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

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(%)
1	601318	中国平安	19,044,196	944,782,563.56	9.82
2	600519	贵州茅台	1,987,786	937,936,824.10	9.75
3	600887	伊利股份	24,810,916	535,667,676.44	5.57
4	601601	中国太保	13,459,381	455,869,234.47	4.74
5	600036	招商银行	18,438,223	440,857,911.93	4.58
6	601166	兴业银行	23,460,678	395,547,031.08	4.11
7	601668	中国建筑	37,495,608	362,957,485.44	3.77
8	601088	中国神华	13,023,640	305,925,303.60	3.18
9	600048	保利地产	24,551,566	244,779,113.02	2.54
10	601766	中国中车	19,153,497	193,833,389.64	2.01

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(%)
1	000858	五粮液	6,999,563	389,595,676.58	4.05
2	000001	平安银行	29,462,975	276,657,335.25	2.88
3	000661	长春高新	2,016,894	260,401,184.34	2.71
4	600276	恒瑞医药	3,151,500	159,434,385.00	1.66
5	002241	歌尔股份	6,520,832	125,721,640.96	1.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	169,813,000.00	1.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,570,000.00	1.03
	其中:政策性金融债	99,570,000.00	1.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	269,383,000.00	2.80

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019546	16国债18	1,700,000	169,813,000.00	1.76
2	170204	17国开04	1,000,000	99,570,000.00	1.03

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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值