

易方达信息产业混合型证券投资基金

2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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	易方达信息产业混合
基金主代码	001513
交易代码	001513
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	156,101,173.32 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资方面，本基金综合考虑行业景气度及可持续性、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势、国家政策等因素，进行股票资产

	在各细分子行业之间的配置。在个股选择方面，本基金对信息产业上市公司的投资价值进行综合评价，精选具备较强竞争优势的上市公司。在债券投资方面，本基金将通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率 $\times 70\%$ + 一年期人民币定期存款利率（税后） $\times 30\%$
风险收益特征	本基金为混合基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。
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

§ 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	15,058,391.28
2.本期利润	13,919,146.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0777
4.期末基金资产净值	183,674,929.09
5.期末基金份额净值	1.177

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	8.98%	1.02%	3.40%	0.80%	5.58%	0.22%

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

易方达信息产业混合型证券投资基金
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
(2016 年 9 月 27 日至 2017 年 9 月 30 日)



注：1.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为 17.70%,同期业绩比较基准收益率为-2.53%。

§ 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		
郑希	本基金的基金经理、易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达价值精选混合型证券投资基金的基金经理、投资一部副总经理	2016-09-27	-	11 年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理、科瑞证券投资基金基金经理。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”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。

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 三季度 A 股市场呈现整体上涨，结构上趋于一致，大盘蓝筹股以及白马成长股普遍上涨，同时创业板有明显反弹。2017 年三季度沪深 300 指数上涨 4.63%，上证指数上涨 4.90%，中小板指数上涨 8.86%，中证 TMT 指数上涨 4.58%，创业板指数上涨 2.69%，创业板综指上涨 4.04%。

分析原因，从宏观经济层面看，美国、欧洲、日本经济数据进一步好转，国内供给侧改革效果显现，同时在金融去杠杆效应有所缓解的背景下，全球资产价格出现普遍上涨；从流动性层面看，整体上三季度资金面情况有所好转，市场整体估值水平有所提升，随着内地与海外资金互相流动效应进一步显现，海外市场与 A 股市场估值体系逐步趋同；从企业层面看，行业竞争格局稳定、管理效率优秀的行业龙头企业盈利优势普遍开始显现，尤其是与供给侧改革相关的企业盈利水平进一步提升；信息产业内部各个子行业盈利水平均有所提升，同时市场整体风险偏好有所提升，三季度信息行业中具有明显超额收益的是半导体、5G 和人工智能三个子行业。

本基金在 2017 年三季度保持仓位稳定，并以消费电子投资品种为核心仓位，同时增加了通信、软件以及半导体等较高风险资产的配置比例。

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 1.177 元，本报告期份额净值增长率为 8.98%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%。

§ 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	165,813,616.29	88.91
	其中：股票	165,813,616.29	88.91
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	18,718,385.54	10.04
7	其他资产	1,965,592.75	1.05
8	合计	186,497,594.58	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

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	127,650,226.16	69.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,135,842.87	16.41
J	金融业	1,698,272.00	0.92
K	房地产业	1,167.00	0.00

L	租赁和商务服务业	2,650,185.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	313,823.77	0.17
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	3,333,006.05	1.81
S	综合	-	-
	合计	165,813,616.29	90.28

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	600703	三安光电	532,804	12,329,084.56	6.71
2	002384	东山精密	350,241	10,058,921.52	5.48
3	300365	恒华科技	263,243	9,863,715.21	5.37
4	000063	中兴通讯	348,486	9,862,153.80	5.37
5	002415	海康威视	245,200	7,846,400.00	4.27
6	600563	法拉电子	125,471	7,252,223.80	3.95
7	600183	生益科技	445,300	6,826,449.00	3.72
8	002456	欧菲光	259,650	5,501,983.50	3.00
9	300033	同花顺	87,800	5,487,500.00	2.99
10	300545	联得装备	74,500	4,917,745.00	2.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

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 同花顺（代码：300033）为易方达信息产业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。浙江核新同花顺网络信息股份有限公司 2016 年 11 月 26 日收到了中国证监会下发的《行政处罚决定书》，公司违反证券期货法律法规，被中国证监会予以行政处罚。

中兴通讯（代码：000063）为易方达信息产业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。根据中兴通讯股份有限公司董事会 2017 年 3 月 7 日《关于重大事项进展公告》，公司违反了美国进出口法律管制，并在调查过程中因提供信息及其他行为违反了相关美国法律法规，被美国相关机构处以罚款。

本基金投资同花顺、中兴通讯的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除同花顺、中兴通讯外，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	108,532.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,438.11
5	应收申购款	1,853,622.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,965,592.75
---	----	--------------

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

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	236,994,371.18
报告期基金总申购份额	52,716,125.35
减：报告期基金总赎回份额	133,609,323.21
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	156,101,173.32

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	99,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	99,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	64.06

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 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
机构	1	2017年07月01日~2017年07月24日	48,827,149.74	-	48,827,149.74	-	-
	2	2017年07月01日~2017年09月30日	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	64.06%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达信息产业混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达信息产业混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达信息产业混合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