易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

2014 年度报告摘要

2014年12月31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
送出日期:二〇一五年三月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	易方达恒生国企(QDII-ETF)
基金主代码	510900
交易代码	510900
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2012年8月9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
报告期末基金份额总额	101,021,934.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年10月22日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。同时,本基金可适当借出证券,以更好实现本基金的投资目标。本基金主要采取完全复制法进行投资,即参考恒生中国企业指数的成份股组成及权重构建股票投资组合,并根据恒生中国企业指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。当市场流动性不足、法规规定本基金不能投资关联方股票等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品进行替代。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率,本基金可投资恒生H股指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在3%以内。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金属股票指数基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的中国企业,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	汤嵩彦
	联系电话	020-38797888	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38799488	021-62701216

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	无	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		无	香港皇后大道中一号
办公地址		无	香港九龙深旺道1号汇丰中心1座6楼
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年8月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	1,763,357.79	22,820,047.06	14,434,784.00
本期利润	12,756,680.21	-7,846,747.31	44,333,973.76
加权平均基金份额本期利润	0.1192	-0.0434	0.0343
本期基金份额净值增长率	13.60%	-6.74%	6.09%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1240	-0.0106	0.0162
期末基金资产净值	113,550,603.53	122,707,620.08	394,679,031.10
期末基金份额净值	1.1240	0.9894	1.0609

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.期末可供分配利润,为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金合同于2012年8月9日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

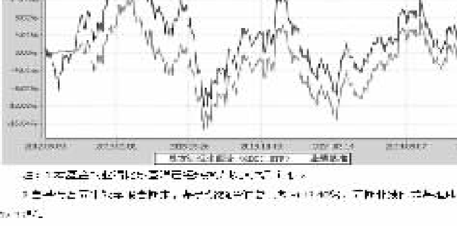
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	15.18%	1.52%	15.71%	1.55%	-0.53%	-0.03%
过去六个月	15.61%	1.29%	15.25%	1.31%	0.36%	-0.02%
过去一年	13.60%	1.17%	11.18%	1.20%	2.42%	-0.03%
过去三年	–	–	–	–	–	–
过去五年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	12.40%	1.20%	17.23%	1.29%	-4.83%	-0.09%

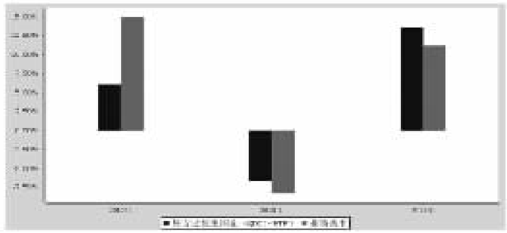
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
份额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2014年12月31日)



[illegible]

[illegible]



注:本基金合同生效日为2012年8月9日,基金合同生效当期的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日(2012年8月9日)至本报告期末未发生利润分配。

§4管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,本基金管理人于2001年4月17日成立,注册资本1.2亿元,旗下设有北京、广州、上海、南京、成都分公司和香港子公司、资产管理子公司。本基金管理人秉承“取信于市场,取信于社会”的宗旨,坚持“在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念,以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩,赢得市场认可。2004年10月,本基金管理人取得全国社会保障基金投资管理人资格;2005年8月,获得企业年金基金投资管理人资格;2007年12月,获得合格境内机构投资者(QDII)资格;2008年2月,获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日,本基金管理人旗下共管理59只开放式基金、1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务,资产管理总规模达4300亿元。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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50指数证券投资基金的基金经理、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、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2012-08-09	–	9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、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理。

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

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3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。

4.4管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》,内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合,围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等投资管理活动,贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括:集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括:通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会;投资人员应公平对待其管理的不同投资组合,控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差;建立集中交易制度,交易系统具备公平交易功能,对于满足公平交易执行条件的同向指令,系统将自动启用公平交易功能,按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行;根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制,通过系统与人工控制相结合的方式,力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待;建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制,对于发现的异常问题要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间(纯被动指数组合和量化投资组合除外)确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易,投资人员须提供充分的投资决策依据,并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制,并借助相关技术系统,使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况,持续督促公平交易制度的落实执行,并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

对于公司旗下基金在境外的投资交易行为,公司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,并结合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。

4.4.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

4.4.3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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的恒生中国企业指数成分股均为在香港上市交易的内地公司,企业盈利增速的变化跟随国内经济周期的趋势。2014年,国内经济增速处于底部徘徊阶段,全年GDP增长7.4%,四季度开始逐渐显露一些复苏的迹象,房地产销售出现回暖。全年规模以上工业增加值同比增速8.3%,前高后低;发电量仅增长3.2%,反映出经济整体处于低位运行阶段。整体通胀稳定在低位,全年居民消费价格比上年上涨2.0%,工业生产者出厂价格同比下降1.9%。在经济下行、通胀较低的背景下,政府不断加大经济刺激力度。各地陆续放开房地产限购政策,央行不断加大货币投放力度,定向降准与货币投放、大幅降低存贷款基准利率,一年期贷款基准利率下调达40bp。海外市场,美国经济强劲复苏,进入新一轮上行周期,连续两个季度GDP年化增长率达5%左右,就业增长情况良好;美联储年内退出量化宽松,开始酝酿加息;在强劲经济数据的支撑下,美国股市迭创新高。欧洲经济仍在泥潭中挣扎,失业率居高不下,GDP仍处于衰退的边缘,欧洲央行不断加大货币宽松力度,推出负利率政策之后,又推出1万亿欧元的量化宽松政策,欧洲股市小幅上涨。在国内外经济基本面的综合影响下,恒生中国企业指数全年上涨10.80%(港币)。

易方达恒生中国企业交易型开放式指数基金(H股ETF)属于完全跟踪指数的证券投资基金。报告期内,本基金跟随指数的成分股变化进行日常调整操作,控制基金组合与指数权重基本一致。

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1.1240元,本报告期份额净值增长率为13.60%,同期业绩比较基准收益率为11.18%,年化跟踪误差1.26%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

恒生中国企业指数的成分股均为内地公司,上市公司的基本面变化取决于国内经济的增长前景,但市场交易主体主要由欧美等海外资金构成,流动性受欧美等发达经济体的直接影响很大。展望2015年,限购放松、按揭利率降低等因素将继续带动国内房地产销售的回升,房地产行业有望进入复苏周期。同时,地方融资平台债务清理进入尾声,政府财政支出有望重新进入上行周期。在房地产复苏、财政支出上行的带动下,国内经济走出底部的概率很大。另一方面,央行仍有可能进一步降息或降存款准备金率,欧洲央行量化宽松政策力度超出预期,国内外流动性将进一步宽松,香港股市有望继续向好。恒生国企指数(H股指数)的市盈率在全球股市属于低位,成份股相对A股大幅折价,有望重新吸引海内外资金的关注。

长期来看,我国经济仍处于制度改革红利的释放期,仍处于快速的工业化、城镇化以及区域经济一体化进程中,中长期经济增长前景良好,本基金对恒生中国企业指数的长期表现保持乐观。作为完全被动投资基金,下阶段本基金将继续采取紧密跟踪比较基准的投资策略,审慎管理基金资产,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,期望为投资者分享中国经济的未来成长提供良好的投资机会。

4.7管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司营运总监担任估值委员会主席,研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§5托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014年度,基金托管人在易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014年度,易方达基金管理有限公司在易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014年度,由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	10,089,780.15	3,533,716.92
结算备付金	–	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	110,317,359.12	119,646,389.20
其中:股票投资	110,317,359.12	119,646,389.20
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	1,440.23	598.54
应收股利	19,777.71	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	120,428,357.21	123,180,704.66
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	5,993,335.17	–
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	50,118.38	65,344.84
应付托管费	16,706.12	21,781.59
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	–	–
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	817,594.01	385,958.15
负债合计	6,877,753.68	473,084.58
所有者权益:		
实收基金	101,021,934.00	124,021,934.00
未分配利润	12,528,669.53	-1,314,313.92
所有者权益合计	113,550,603.53	122,707,620.08
负债和所有者权益总计	120,428,357.21	123,180,704.66

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.1240元,基金份额总额101,021,934.00份。

7.2 利润表

会计主体:易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	14,066,393.20	-5,351,103.03
1.利息收入	18,540.98	28,517.16
其中:存款利息收入	18,540.98	28,517.16
债券利息收入	–	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,979,931.06	26,583,688.70
其中:股票投资收益	-1,040,979.85	20,727,443.73
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	60,041.13	180,875.88
股利收益	3,960,869.78	5,675,369.09
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	10,993,322.42	-30,666,794.37
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-133,023.17	-3,072,292.34
5.其他收入(损失以“-”号填列)	207,621.91	1,775,777.82
减:二、费用	1,309,712.99	2,495,644.28
1.管理人报酬	621,910.55	1,084,678.63
2.托管费	207,303.50	361,559.47
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	127,192.04	543,639.83
5.利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	353,306.90	505,766.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	12,756,680.21	-7,846,747.31
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	12,756,680.21	-7,846,747.31

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	124,021,934.00	-1,314,313.92	122,707,620.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	12,756,680.21	12,756,680.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,000,000.00	1,086,303.24	-21,913,696.76
其中:1.基金申购款	30,000,000.00	744,710.59	30,744,710.59
2.基金赎回款	-53,000,000.00	341,592.65	-52,658,407.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	101,021,934.00	12,528,669.53	113,550,603.53
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	372,021,934.00	22,657,097.10	394,679,031.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-7,846,747.31	-7,846,747.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-248,000,000.00	-16,124,663.71	-264,124,663.71
其中:1.基金申购款	2,000,000.00	-169,300.56	1,830,699.44
2.基金赎回款	-250,000,000.00	-15,955,363.15	-265,955,363.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	124,021,934.00	-1,314,313.92	122,707,620.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:叶俊英,主管会计工作负责人:张优造,会计机构负责人:陈荣

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金(简称"本基金")根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]823号《关于核准易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2012年8月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,616,541,259.00份基金份额,其中认购资金利息折合42,259.00份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司,基金托管人为交通银行股份有限公司,境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司(以下简称"汇丰银行")	境外资产托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申赎代办券商
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
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	该基金是本基金的联接基金
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	621,910.55	1,084,678.63
其中:支付销售机构的客户维护费	–	–

注:本基金管理费按前一日的基金资产净值0.6%年费率计提。计算方法如下:

H =E×0.6%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	207,303.50	361,559.47

注:本基金托管费(包括境外托管费)按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H =E×0.2%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末2014年12月31日		上年度末2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
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	61,712,681.00	61.09%	108,870,981.00	87.78%
广发证券	–	–	1,366,664.00	1.10%

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,099,400.32	16,481.27	2,995,201.32	28,419.56
汇丰银行	6,990,379.83	–	538,515.60	–

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行和汇丰银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为110,317,359.12元,无属于第二层次和第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次119,646,389.20元,无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	110,317,359.12	91.60
	其中:普通股	110,317,359.12	91.60
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托凭证	–	–
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	10,089,780.15	8.38
8	其他各项资产	21,217.94	0.02
9	合计	120,428,357.21	100.00

注:上表中的普通股投资项含可退替代款估值增值,而8.3的合计项不含可退替代款估值增值。8.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
香港	110,317,359.12	97.15
合计	110,317,359.12	97.15

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。

8.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	17,946,828.00	15.81
材料	2,788,079.57	2.46
工业	3,729,319.82	3.28
非必需消费品	4,278,704.66	3.77
必需消费品	912,880.36	0.80
保健	1,511,064.71	1.33
金融	74,321,453.74	65.45
信息技术	–	–
电信服务	2,471,214.16	2.18
公用事业	2,357,814.10	2.08
合计	110,317,359.12	97.15

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.4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益投资明细

金额单位:人民币元

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	占基金资产净值比例(%)
1	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港证券交易所	香港	2,221,000	11,160,751.32	9.83
2	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港证券交易所	香港	2,493,000	11,131,255.47	9.80
3	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港证券交易所	香港	3,204,000	11,045,347.53	9.73
4	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港证券交易所	香港	370,000	8,887,803.86	7.83
5	PetroChina Co Ltd	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港证券交易所	香港	1,052,000	7,137,064.66	6.29
6	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	香港	101,500	6,333,561.13	5.58
7	China Petroleum & Chemical Corp	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	香港	1,275,200	6,287,293.90	5.54
8	Agricultural Bank of China Ltd	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港证券交易所	香港	1,228,000	3,797,430.85	3.34
9	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港证券交易所	香港	229,046	3,516,179.10	3.10
10	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港证券交易所	香港	111,000	3,450,044.06	3.04

注:1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2. 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细,应阅读登载于www.efunds.com.cn网站的年度报告正文。

8.5报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	2,942,132.65	2.40
2	China Construction Bank Corp	939 HK	2,782,402.73	2.27
3	Bank of China Ltd	3988 HK	2,376,844.52	1.94
4	Byd Co Ltd	1211 HK	1,699,472.80	1.38
5	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	1,471,921.90	1.20
6	China Cinda Asset Management C	1359 HK	1,433,921.46	1.17
7	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,368,754.53	1.12
8	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	1,227,898.62	1.00
9	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	1,094,922.94	0.89
10	China Vanke Co Ltd	2202 HK	884,159.33	0.72
11	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	791,350.58	0.64
12	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	732,859.05	0.60
13	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	603,738.72	0.49
14	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	578,410.42	0.47
15	China Pacific Insurance Group Co Ltd	2601 HK	576,885.15	0.47
16	PICC Property & Casualty Co Ltd	2328 HK	509,795.11	0.42
17	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	493,072.23	0.40
18	China Telecom Corp Ltd	728 HK	451,751.41	0.37
19	Bank of Communications Co Ltd	3328 HK	436,094.33	0.36
20	China Oilfield Services Ltd	2883 HK	418,193.82	0.34

注:1.买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Bank of China Ltd	3988 HK	5,515,705.99	4.49
2	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	4,455,890.25	3.63
3	China Construction Bank Corp	939 HK	4,298,381.04	3.50
4	PetroChina Co Ltd	857 HK	3,604,339.84	2.94
5	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	3,238,102.63	2.64
6	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	2,796,421.30	2.28
7	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	2,165,210.13	1.76
8	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	1,323,295.23	1.08
9	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	1,296,998.82	1.06
10	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	1,160,166.89	0.95
11	China Pacific Insurance Group Co Ltd	2601 HK	1,075,373.89	0.88
12	China Telecom Corp Ltd	728 HK	994,835.32	0.81
13	Bank of Communications Co Ltd	3328 HK	822,912.46	0.67
14	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	768,442.70	0.63
15	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	736,916.47	0.60
16	PICC Property & Casualty Co Ltd	2328 HK	731,493.83	0.60
17	China CITIC Bank Corp Ltd	998 HK	673,672.10	0.55
18	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	1171 HK	642,577.60	0.52
19	China Oilfield Services Ltd	2883 HK	623,601.03	0.51
20	China Cinda Asset Management C	1359 HK	612,073.05	0.50

注:1.卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	26,898,123.78
卖出收入(成交)总额	46,179,496.43

注:“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.6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。

8.7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。

8.8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。

8.9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。

8.10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。

8.11投资组合报告附注

8.11.1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。

8.11.2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。

8.11.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	19,777.71
4	应收利息	1,440.23
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	21,217.94

8.11.4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。

8.11.5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。

§9基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		交通银行股份有限公司-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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
572	176,611.77	80,573,229.00	79.76%	20,448,705.00	20.24%	61,712,681.00	61.09%

注:机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“交通银行股份有限公司—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	潮域投资咨询(上海)有限公司	7,097,700.00	7.03%
2	国君资管-工行-国泰君安君享套利5号限额特定集合资产管理计划	3,139,685.00	3.11%
3	国君资管-建行-国泰君安君享套利2号限额特定集合资产管理计划	2,027,545.00	2.01%
4	吕建国	1,501,100.00	1.49%
5	国君资管-招行-国泰君安君享对冲一号限额特定集合资产管理计划	1,347,200.00	1.33%
6	国君资管-招行-国泰君安君享对冲二号限额特定集合资产管理计划	1,347,200.00	1.33%
7	纵馨荷	1,110,000.00	1.10%
8	李林晖	900,000.00	0.89%
9	李霄玫	807,000.00	0.80%
10	李恩祥	719,500.00	0.71%
11	交通银行股份有限公司-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	61,712,681.00	61.09%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

9.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年8月9日)基金份额总额	1,616,541,259.00
本报告期期初基金份额总额	124,021,934.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	53,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	101,021,934.00

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续3年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度审计费为40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
State Street Global Markets	1	19,856,426.97	27.22%	9,928.37	20.73%	–
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	14,988,868.32	20.55%	7,494.57	15.65%	–
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	8,648,857.23	11.86%	6,919.10	14.44%	–
Everbright Securities (International) Limited	1	6,884,441.40	9.44%	5,507.47	11.50%	–
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	5,815,820.04	7.97%	4,652.67	9.71%	–
JP Morgan Securities Limited	1	5,794,502.23	7.94%	4,635.72	9.68%	–
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	5,634,755.97	7.72%	4,507.76	9.41%	–
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	1	4,234,498.68	5.81%	3,387.56	7.07%	–
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	1,085,251.71	1.49%	868.18	1.81%	–
Haitong International Securities Company Limited	1	–	–	–	–	–
China Everbright Forex & Futures (HK) Limited	1	–	–	–	–	–
Citigroup Global Markets Limited	1	–	–	–	–	–
Macquarie Group	1	–	–	–	–	–

注:a)本报告期内本基金无减少交易账户,于如下证券经营机构Macquarie Group新增一个交易账户。

b)本基金管理人负责选择证券经营机构,并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下:

1)交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行,以及能否取得较高质量的成交结果;

2)研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等;

3)提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面;

4)法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训;

5)价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献;

6)其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c)基金交易账户的选择程序如下:

1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2)基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
State Street Global Markets	–	–	–	–	–	–	–	–
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	–	–	–	–	–	–	–	–
Everbright Securities (International) Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
JP Morgan Securities Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	–	–	–	–	–	–	–	–
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	–	–	–	–	–	–	–	–
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
Haitong International Securities Company Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
China Everbright Forex & Futures (HK) Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–	–	–	–	–	–	–
Macquarie Group	–	–	–	–	–	–	–	–

易方达基金管理有限公司
二〇一五年三月二十七日