易方达沪深300量化增强证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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。安永华明会计师事务所(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	易方达沪深300量化增强
基金主代码	110030
交易代码	110030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月5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
报告期末基金份额总额	341,991,846.35份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,主要通过运用量化策略进行投资组合管理,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要策略为复制标的指数,投资组合将以标的指数的构成为基础,主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果,结合基金管理人的长期研究与实践应用,利用多因子量化模型预测股票超额回报,在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合,获取超额收益,实现对投资组合的主动增强。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金中的指数增强型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

注:根据中国证监会2013年6月7日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2013]742号),易方达量化衍伸股票型证券投资基金自2013年6月7日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。修订后的《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》自2013年6月7日起正式生效。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-38797888	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-38799488	010-66275853

2.4 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7月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	25,928,645.39	7,092,045.93	1,117,829.24
本期利润	99,168,425.26	-3,459,963.59	8,462,197.25
加权平均基金份额本期利润	1.0783	-0.0528	0.0721
本期基金份额净值增长率	55.94%	-3.71%	11.30%
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	0.2861	0.0717	0.0155
期末基金资产净值	571,553,087.76	76,186,079.39	72,712,160.56
期末基金份额净值	1.6712	1.0717	1.1130

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.本基金合同于2012年7月5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

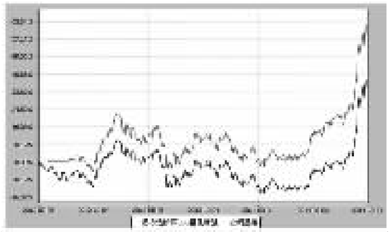
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	38.36%	1.52%	41.63%	1.56%	-3.27%	-0.04%
过去六个月	61.58%	1.22%	59.36%	1.26%	2.22%	-0.04%
过去一年	55.94%	1.12%	48.69%	1.15%	7.25%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	67.12%	1.13%	41.04%	1.16%	26.08%	-0.03%

注:根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2013年6月7日起,由"沪深300指数收益率×80%+活期存款利率(税后)×20%"变更为"沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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

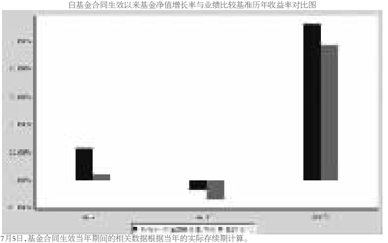
易方达沪深300量化增强证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年7月5日至2014年12月31日)



注:1.根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2013年6月7日起,由"沪深300指数收益率×80%+活期存款利率(税后)×20%"变更为"沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为67.12%,同期业绩比较基准收益率为41.04%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深300量化增强证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注:1.本基金合同生效日为2012年7月5日,基金合同生效当年期间的相关数据根据当年的实际存续期计算。
2.根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2013年6月7日起,由"沪深300指数收益率×80%+活期存款利率(税后)×20%"变更为"沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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7月5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		
罗山	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总经理	2013-01-08	-	17年	博士研究生,曾任巴克莱银行纽约分行衍生品交易部董事、新加坡分行信用产品交易部董事,苏格兰皇家银行香港分行权益及信用产品部总经理,加拿大皇家银行香港分行结构化产品部总经理,诚信资本合伙人,五矿证券公司副总裁,安信证券资产管理部副总经理,易方达基金管理有限公司指数及量化投资部资深投资经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1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机制。

4.3.2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。

公司投资风险管理部与监察部合作,利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对我司旗下所有投资组合2014年度的同向交易价差情况进行了分析,包括旗下各大类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四大类业务之间)的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差,以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3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。

本报告期内,本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%的交易共有13次,其中12次为旗下指数基金因投资策略需要而和其他组合发生反向交易,1次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易,该次交易基金经理已提供决策依据,并履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金管理人主要应用了量化投资策略,即利用定量方法,综合考虑宏观经济、上市公司基本面、市场情绪、投资者预期等多种因素,建立多因子模型对个股的超额收益进行预测,并在综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素,构建风险调整后的最优投资组合。管理人严格遵照量化指数增强的投资模式进行操作,以标的指数的构成为基础,主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。报告期内,本基金严格遵照上述策略进行操作,并且对量化模型进行优化,相对业绩基准获得了7.25%的超额收益,策略的表现符合预期。

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1.6712元,本报告期份额净值增长率为55.94%,同期业绩比较基准收益率为48.69%,年化跟踪误差2.58%,各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年中国经济从高速发展进入中高速发展的新常态,全年GDP增速降至7.4%,为24年来最低值。在经济增速趋势性下行的形势下,央行不断通过各种货币工具对流动性进行微调,并于11月下调存贷款利率,大盘蓝筹股由此产生了一轮强势上涨行情,市场热情持续高涨。

管理人预计2015年以沪深300为代表的大盘蓝筹股大概率下将继续上行。首先,一带一路和国企改革等重大举措将为蓝筹股的发展拓展巨大空间,蓝筹股将成为市场关注的重点;其次,结构转型给经济带来的下行压力将由相对宽松的财政和货币政策对冲,市场流动性将比较充沛,资金成本将延续下行趋势,提高股市的估值水平;第三,虽然需求很难有快速提升,但原油和其它大宗商品价格的大幅下跌将降低大部分蓝筹企业的成本,使企业利润得到明显改善;最后,四季度蓝筹股的大行情一改市场的长期低迷状态,极大地提升了市场人气,为股市的上行提供了相当的基础。市场的不确定性主要来源于宏观政策与深化改革措施是否能达到市场预期;以美国为主的发达经济体宽松货币政策的退出也将影响海外资金对中国市场的配置水平。

下一阶段管理人将根据资产配置策略管理基金的权益类资产比例。在组合构建的过程中,管理人将会坚持既定量化策略,利用定量的方法,根据多因子模型的预测,通过优化的方法构建收益类型的投资组合。与此同时,管理人将结合量化投研团队的研究成果,根据市场变化对量化投资策略进行优化和补充,勤勉尽职,力争为投资者提供持续稳健的超额收益。

4.6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,具备相关行业研究、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。

4.7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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(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:易方达沪深300量化增强证券投资基金
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	44,198,556.03	4,154,939.82
结算备付金	5,875,796.38	253,229.87
存出保证金	25,110.56	18,022.29
交易性金融资产	539,793,146.09	72,341,880.75
其中:股票投资	539,793,146.09	72,341,880.75
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
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	8,444.26	1,090.00
应收股利	-	-
应收申购款	14,819,190.94	61,806.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	604,720,244.26	76,830,968.82
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	18,748,583.49	-
应付赎回款	13,582,859.05	268,716.06
应付管理人报酬	280,480.12	52,586.59
应付托管费	52,590.03	9,860.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	191,453.25	32,714.03
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	311,190.56	281,012.74
负债合计	33,167,156.50	644,889.43
所有者权益:		
实收基金	341,991,846.35	71,087,201.63
未分配利润	229,561,241.41	5,098,877.76
所有者权益合计	571,553,087.76	76,186,079.39
负债和所有者权益总计	604,720,244.26	76,830,968.82

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.6712元,基金份额总额341,991,846.35份。

7.2 利润表

会计主体:易方达沪深300量化增强证券投资基金
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	101,649,786.95	-1,515,741.07
1.利息收入	66,841.08	44,631.74
其中:存款利息收入	66,736.16	41,748.88
债券利息收入	104.92	2,882.86
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)	28,145,490.31	8,912,280.94
其中:股票投资收益	26,566,789.59	7,826,443.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	45,150.78	30,302.98
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	29,220.00	-
股利收益	1,504,329.94	1,055,534.51
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	73,239,779.87	-10,552,009.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	197,675.69	79,355.77
减:二、费用	2,481,361.69	1,944,222.52
1. 管理人报酬	881,908.48	802,798.37
2. 托管费	165,357.79	140,719.11
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,000,565.02	617,685.00
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	433,530.40	383,020.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	99,168,425.26	-3,459,963.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	99,168,425.26	-3,459,963.59

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达沪深300量化增强证券投资基金
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)	71,087,201.63	5,098,877.76	76,186,079.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	99,168,425.26	99,168,425.26
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)	270,904,644.72	125,293,938.39	396,198,583.11
其中:1.基金申购款	399,046,023.08	167,171,694.98	566,217,718.06
2.基金赎回款	-128,141,378.36	-41,877,756.59	-170,019,134.95
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)	341,991,846.35	229,561,241.41	571,553,087.76
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)	65,323,355.42	7,388,805.14	72,712,160.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,459,963.59	-3,459,963.59
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)	5,763,846.21	1,170,036.21	6,933,882.42
其中:1.基金申购款	62,742,631.73	7,764,748.25	70,507,379.98
2.基金赎回款	-56,978,785.52	-6,594,712.04	-63,573,497.56
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)	71,087,201.63	5,098,877.76	76,186,079.39

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

易方达沪深300量化增强证券投资基金(原名易方达量化衍伸股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经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]627号《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的批复》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《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》于2012年7月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为248,871,987.37份基金份额,其中认购资金利息折合6,407.02份基金份额。本基金为契约型开放式,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,注册登记机构为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会2013年6月7日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2013]742号),易方达量化衍伸股票型证券投资基金自2013年6月7日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。

7.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》和《企业会计准则第30号——财务报表列报》等7项会计准则;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

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。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会
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

金额单位: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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,416,370,073.41	100.00%	743,421,485.73	100.00%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	298,000.64	100.00%	191,453.25	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	155,244.17	100.00%	32,714.03	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	881,908.48	802,798.37
其中:支付销售机构的客户维护费	66,503.14	34,121.59

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.8%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。

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	165,357.79	140,719.11

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷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

基金托管费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。

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

份额单位:份

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
报告期初持有的基金份额	22,970,097.03	22,970,097.03
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	22,970,097.03	22,970,097.03
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.72%	32.31%

注:基金管理人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。

7.4.8.4.2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
广东省易方达教育基金会	13,999,560.00	4.09%	27,999,560.00	39.39%

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
中国建设银行	44,198,556.03	59,135.68	4,154,939.82	35,801.07

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,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

金额单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	600089	特变电工	配股发行	4,631	31,953.90
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000413	东旭光电	2014-11-25	重大事项	7.67	2015-01-28	8.44	34,088	281,318.41	261,454.96	-
600428	中远航运	2014-12-22	重大事项	8.00	2015-01-08	8.30	253,390	1,354,740.86	2,027,120.00	-
600649	城投控股	2014-11-03	重大事项	7.23	-	-	14,000	101,886.71	101,220.00	-
600844	丹化科技	2014-12-15	重大事项	7.60	2015-01-07	8.25	135,933	994,583.81	1,033,090.80	-
601519	大智慧	2014-07-21	重大事项	5.98	2015-01-23	6.58	29,000	181,537.00	173,420.00	-

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536,196,840.33元,属于第二层次的余额为3,596,305.76元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次71,278,835.52元,第二层次1,063,045.23元,无属于第三层次的余额)。

(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	539,793,146.09	89.26
	其中:股票	539,793,146.09	89.26
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	50,074,352.41	8.28
7	其他各项资产	14,852,745.76	2.46
8	合计	604,720,244.26	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1指数投资报告期末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	14,445,594.83	2.53
C	制造业	140,988,506.89	24.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,419,452.88	4.62
E	建筑业	19,117,206.04	3.34
F	批发和零售业	10,647,850.74	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	13,482,403.00	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,430,369.50	2.17
J	金融业	216,816,681.06	37.93
K	房地产业	20,542,133.78	3.59
L	租赁和商务服务业	2,716,036.40	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,502,272.00	0.44
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	6,272,026.80	1.10
S	综合	1,773,883.32	0.31
	合计	488,154,417.24	85.41

8.2.2积极投资报告期末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	1,299,155.00	0.23
B	采矿业	1,638,742.16	0.29
C	制造业	32,208,307.78	5.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,346,492.00	0.24
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,221,515.21	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	452,284.00	0.08
J	金融业	5,549,610.96	0.97
K	房地产业	3,698,284.65	0.65
L	租赁和商务服务业	16,346.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,144,772.09	0.20
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	63,219.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	51,638,728.85	9.03

8.3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

8.3.1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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	334,811	25,013,729.81	4.38
2	600030	中信证券	545,672	18,498,280.80	3.24
3	600000	浦发银行	1,082,209	16,979,859.21	2.97
4	600036	招商银行	1,001,894	16,621,421.46	2.91
5	600015	华夏银行	1,142,395	15,376,636.70	2.69
6	600674	川投能源	721,602	14,958,809.46	2.62
7	601166	兴业银行	868,677	14,333,170.50	2.51
8	600837	海通证券	563,221	13,551,097.26	2.37
9	601668	中国建筑	1,805,476	13,143,865.28	2.30
10	600016	民生银行	1,114,923	12,130,362.24	2.12

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

8.3.2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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600141	兴发集团	392,846	5,986,973.04	1.05
2	601099	太平洋	390,268	5,549,610.96	0.97
3	600216	浙江医药	472,099	5,126,995.14	0.90
4	600851	海欣股份	335,674	2,917,007.06	0.51
5	600376	首开股份	246,864	2,488,389.12	0.44

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

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	28,223,927.91	37.05
2	600016	民生银行	27,774,200.60	36.46
3	600036	招商银行	26,879,497.85	35.28
4	601668	中国建筑	18,351,967.39	24.09
5	600674	川投能源	17,733,604.50	23.28
6	600030	中信证券	17,730,047.47	23.27
7	600000	浦发银行	17,434,280.86	22.88
8	600015	华夏银行	17,072,761.52	22.41
9	600837	海通证券	16,436,343.36	21.57
10	601288	农业银行	15,684,336.00	20.59
11	601166	兴业银行	14,747,262.86	19.36
12	000651	格力电器	12,762,353.62	16.75
13	601006	大秦铁路	11,771,734.83	15.45
14	601600	中国铝业	11,383,318.45	14.94
15	600048	保利地产	10,879,147.92	14.28
16	000338	潍柴动力	10,512,269.23	13.80
17	601988	中国银行	9,301,582.00	12.21
18	600887	伊利股份	8,695,540.28	11.41
19	600600	青岛啤酒	8,349,001.47	10.96
20	601398	工商银行	8,278,728.82	10.87
21	600518	康美药业	8,181,199.17	10.74
22	601169	北京银行	8,155,501.24	10.70
23	000878	云南铜业	8,140,568.93	10.69
24	601098	中南传媒	8,101,849.15	10.63
25	601555	东吴证券	7,519,010.79	9.87
26	000002	万 科A	7,465,535.35	9.80
27	600188	兖州煤业	6,905,653.68	9.06
28	600216	浙江医药	6,828,692.94	8.96
29	000581	威孚高科	6,804,220.10	8.93
30	601688	华泰证券	6,789,999.06	8.91
31	600999	招商证券	6,751,750.95	8.86
32	601111	中国国航	6,675,025.52	8.76
33	600141	兴发集团	6,611,028.38	8.68
34	601099	太平洋	6,499,140.48	8.53
35	002202	金风科技	6,434,487.76	8.45
36	600050	中国联通	6,362,631.00	8.35
37	601808	中海油服	6,282,111.85	8.25
38	000709	河北钢铁	6,221,620.67	8.17
39	000625	长安汽车	6,110,474.53	8.02
40	600583	海油工程	5,849,972.09	7.68
41	600886	国投电力	5,848,163.00	7.68
42	002415	海康威视	5,650,956.42	7.42
43	601336	新华保险	5,546,361.38	7.28
44	600089	特变电工	5,433,925.70	7.13
45	000728	国元证券	5,289,192.25	6.94
46	600150	中国船舶	4,977,768.54	6.53
47	601179	中国西电	4,966,552.16	6.52
48	601901	方正证券	4,965,630.00	6.52
49	601390	中国中铁	4,965,455.95	6.52
50	002024	苏宁云商	4,664,891.75	6.12
51	601601	中国太保	4,614,157.58	6.06
52	600900	长江电力	4,587,903.08	6.02
53	000758	中色股份	4,530,643.25	5.95
54	601818	光大银行	4,511,398.00	5.92
55	000783	长江证券	4,409,678.13	5.79
56	601989	中国重工	4,388,206.00	5.76
57	601991	大唐发电	4,330,628.63	5.68
58	600383	金地集团	4,272,097.11	5.61
59	600362	江西铜业	4,266,250.64	5.60
60	600585	海螺水泥	4,134,570.75	5.43
61	600535	天士力	4,084,969.89	5.36
62	600851	海欣股份	4,069,180.46	5.34
63	002311	海大集团	3,959,794.48	5.20
64	601328	交通银行	3,930,668.00	5.16
65	600703	三安光电	3,917,662.62	5.14
66	002241	歌尔声学	3,877,342.13	5.09
67	600276	恒瑞医药	3,858,966.79	5.07
68	002500	山西证券	3,842,959.67	5.04
69	000895	双汇发展	3,746,097.54	4.92
70	601607	上海医药	3,723,151.91	4.89
71	601377	兴业证券	3,713,438.57	4.87
72	600519	贵州茅台	3,690,903.20	4.84
73	002304	洋河股份	3,674,073.68	4.82
74	000963	华东医药	3,667,230.87	4.81
75	000750	国海证券	3,658,823.48	4.80
76	600109	国金证券	3,657,882.68	4.80
77	002673	西部证券	3,622,876.62	4.76
78	601009	南京银行	3,599,931.81	4.73
79	600508	上海能源	3,585,029.26	4.71
80	600816	安信信托	3,535,905.51	4.64
81	000063	中兴通讯	3,428,711.00	4.50
82	600196	复星医药	3,399,275.31	4.46
83	601018	宁波港	3,208,200.00	4.21
84	600239	云南城投	3,090,164.00	4.06
85	002353	杰瑞股份	3,042,005.48	3.99
86	600018	上港集团	3,038,595.00	3.99
87	600352	浙江龙盛	3,022,271.93	3.97
88	600739	辽宁成大	2,987,456.05	3.92
89	600201	金宇集团	2,963,419.34	3.89
90	600690	青岛海尔	2,913,441.13	3.82
91	000826	桑德环境	2,810,666.31	3.69
92	600256	广汇能源	2,800,187.94	3.68
93	000400	许继电气	2,760,604.65	3.62
94	600376	首开股份	2,693,394.21	3.54
95	002008	大族激光	2,686,882.00	3.53
96	600893	航空动力	2,673,588.80	3.51
97	600832	东方明珠	2,666,870.13	3.50
98	000027	深圳能源	2,640,966.39	3.47
99	600428	中远航运	2,622,179.29	3.44
100	601628	中国人寿	2,612,868.86	3.43
101	600177	雅戈尔	2,611,396.87	3.43
102	601928	凤凰传媒	2,604,833.01	3.42
103	601880	大连港	2,518,647.80	3.31
104	002475	立讯精密	2,518,302.29	3.31
105	000039	中集集团	2,511,154.84	3.30
106	002410	广联达	2,499,811.03	3.28
107	600010	包钢股份	2,491,041.66	3.27
108	601168	西部矿业	2,410,798.00	3.16
109	600027	华电国际	2,409,677.09	3.16
110	600066	宇通客车	2,395,856.93	3.14
111	002292	奥飞动漫	2,383,784.29	3.13
112	600038	哈飞股份	2,324,361.10	3.05
113	002595	豪迈科技	2,289,122.87	3.00
114	002048	宁波华翔	2,285,162.39	3.00
115	002400	省广股份	2,227,860.91	2.92
116	603993	洛阳钼业	2,146,820.52	2.82
117	600369	西南证券	2,122,060.67	2.79
118	002230	科大讯飞	2,098,290.73	2.75
119	002317	众生药业	2,096,404.02	2.75
120	600398	海澜之家	2,083,118.06	2.73
121	000538	云南白药	2,055,116.52	2.70
122	600880	博瑞传播	2,047,104.28	2.69
123	000858	五 粮 液	2,019,020.90	2.65
124	600104	上汽集团	1,988,024.23	2.61
125	000425	徐工机械	1,962,269.78	2.58
126	600645	中源协和	1,905,844.84	2.50
127	600642	申能股份	1,876,382.00	2.46
128	600815	厦工股份	1,845,820.64	2.42
129	002594	比亚迪	1,845,671.91	2.42
130	600340	华夏幸福	1,813,085.35	2.38
131	002236	大华股份	1,771,993.23	2.33
132	600844	丹化科技	1,764,060.50	2.32
133	600637	百视通	1,758,249.29	2.31
134	601929	吉视传媒	1,756,783.47	2.31
135	000869	张 裕A	1,748,031.93	2.29
136	000423	东阿阿胶	1,737,858.05	2.28
137	600875	东方电气	1,736,529.85	2.28
138	000926	福星股份	1,699,276.47	2.23
139	600597	光明乳业	1,692,437.81	2.22
140	300017	网宿科技	1,663,102.61	2.18
141	000402	金 融 街	1,602,897.96	2.10
142	000729	燕京啤酒	1,585,625.00	2.08
143	000686	东北证券	1,567,218.00	2.06
144	600068	葛洲坝	1,553,875.00	2.04
145	600221	海南航空	1,539,323.00	2.02

注: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。

8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	21,774,326.34	28.58
2	600036	招商银行	17,133,787.08	22.49
3	601668	中国建筑	13,469,505.42	17.68
4	601318	中国平安	11,948,748.85	15.68
5	600837	海通证券	10,122,151.02	13.29
6	600048	保利地产	8,433,411.94	11.07
7	000338	潍柴动力	8,395,158.32	11.02
8	601988	中国银行	7,657,251.27	10.05
9	600600	青岛啤酒	7,651,292.93	10.04
10	601288	农业银行	6,973,817.42	9.15
11	601098	中南传媒	6,713,731.79	8.81
12	601166	兴业银行	6,686,182.79	8.78
13	600000	浦发银行	6,501,422.99	8.53
14	600674	川投能源	6,438,131.02	8.45
15	601006	大秦铁路	6,268,309.41	8.23
16	600030	中信证券	6,175,138.77	8.11
17	601111	中国国航	6,135,103.51	8.05
18	601601	中国太保	6,131,664.56	8.05
19	000878	云南铜业	6,012,270.87	7.89
20	601179	中国西电	5,551,400.06	7.29
21	000651	格力电器	5,537,123.32	7.27
22	600188	兖州煤业	5,319,286.16	6.98
23	600362	江西铜业	5,054,241.57	6.63
24	600015	华夏银行	4,826,599.27	6.34
25	002415	海康威视	4,763,535.20	6.25
26	601818	光大银行	4,599,566.00	6.04
27	601991	大唐发电	4,588,730.03	6.02
28	600816	安信信托	4,199,627.51	5.51
29	600050	中国联通	3,932,626.05	5.16
30	601009	南京银行	3,892,685.45	5.11
31	000758	中色股份	3,634,237.56	4.77
32	601018	宁波港	3,603,441.28	4.73
33	600999	招商证券	3,572,359.21	4.69
34	600508	上海能源	3,551,034.20	4.66
35	000728	国元证券	3,543,840.69	4.65
36	002673	西部证券	3,519,881.49	4.62
37	000538	云南白药	3,466,257.88	4.55
38	601168	西部矿业	3,420,327.36	4.49
39	600276	恒瑞医药	3,250,183.40	4.27
40	600239	云南城投	3,248,118.16	4.26
41	000826	桑德环境	3,235,716.90	4.25
42	600089	特变电工	3,200,479.24	4.20
43	601688	华泰证券	3,115,414.93	4.09
44	000027	深圳能源	3,039,920.00	3.99
45	601336	新华保险	3,036,974.02	3.99
46	002500	山西证券	3,001,969.49	3.94
47	002311	海大集团	2,959,422.20	3.88
48	600519	贵州茅台	2,943,009.50	3.86
49	601600	中国铝业	2,927,562.01	3.84
50	002353	杰瑞股份	2,908,969.85	3.82
51	600177	雅戈尔	2,889,552.81	3.79
52	600027	华电国际	2,771,412.67	3.64
53	000581	威孚高科	2,706,090.92	3.55
54	601555	东吴证券	2,664,468.65	3.50
55	601928	凤凰传媒	2,540,098.03	3.33
56	601998	中信银行	2,502,983.10	3.29
57	600583	海油工程	2,436,602.57	3.20
58	000002	万 科A	2,418,314.31	3.17
59	600642	申能股份	2,391,482.72	3.14
60	600886	国投电力	2,371,866.42	3.11
61	600739	辽宁成大	2,340,960.10	3.07
62	000709	河北钢铁	2,325,347.30	3.05
63	002202	金风科技	2,289,067.06	3.00
64	601390	中国中铁	2,254,411.00	2.96
65	601328	交通银行	2,250,844.10	2.95
66	601398	工商银行	2,229,112.71	2.93
67	600815	厦工股份	2,217,831.11	2.91
68	601666	平煤股份	2,143,069.21	2.81
69	600875	东方电气	2,120,189.21	2.78
70	000425	徐工机械	2,108,802.03	2.77
71	601099	太平洋	2,054,709.74	2.70
72	000423	东阿阿胶	2,042,739.52	2.68
73	600066	宇通客车	2,035,207.27	2.67
74	603993	洛阳钼业	1,938,706.00	2.54
75	600315	上海家化	1,847,798.59	2.43
76	000402	金 融 街	1,821,981.67	2.39
77	600887	伊利股份	1,761,452.68	2.31
78	601607	上海医药	1,755,800.63	2.30
79	600518	康美药业	1,710,172.82	2.24
80	000750	国海证券	1,705,960.38	2.24
81	000729	燕京啤酒	1,704,120.26	2.24
82	600216	浙江医药	1,687,089.01	2.21
83	002146	荣盛发展	1,637,369.25	2.15
84	600068	葛洲坝	1,635,131.58	2.15
85	601808	中海油服	1,619,326.65	2.13
86	600028	中国石化	1,617,269.61	2.12
87	600197	伊力特	1,612,600.21	2.12
88	600221	海南航空	1,608,835.00	2.11
89	601186	中国铁建	1,601,276.05	2.10
90	002233	塔牌集团	1,584,751.02	2.08
91	600256	广汇能源	1,540,667.92	2.02

注: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。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	892,089,139.39
卖出股票收入(成交)总额	524,444,443.51

注:"买入股票成本"或"卖出股票收入"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。

8.5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。

8.6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。

8.7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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					29,220.00
股指期货投资本期公允价值变动					-

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,按照相关法律法规的有关规定,进行股指期货投资。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时,通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求。如出现大量净申购,本基金可买入数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求,并在净申购资金到账后逐步平仓;反之,如预期出现大量净赎回,本基金可在逐步卖出股票的同时买入数量匹配的股指期货合约以维持目标市场暴露度,并在投资人赎回的同时平仓。

8.11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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3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	25,110.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,444.26
5	应收申购款	14,819,190.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,852,745.76

8.12.4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。

8.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2期末积极投资前五名股票中存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。

§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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,610	60,961.11	189,637,483.40	55.45%	152,354,362.95	44.55%

9.2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	391,591.50	0.1145%

9.3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7月5日)基金份额总额	248,871,987.37
本报告期期初基金份额总额	71,087,201.63
本报告期基金总申购份额	399,046,023.08
减:本报告期基金总赎回份额	128,141,378.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	341,991,846.35

§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未发生重大人事变动。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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

根据易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议,本基金的投资策略从资产配置策略、权益类投资策略、固定收益投资策略、金融衍生品投资策略、新股发行策略等多种投资策略的综合运用变更为运用量化手段进行指数增强的投资策略。投资组合将以标的指数的构成为基础,主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果,结合基金管理人的长期研究与实践应用,利用多因子量化模型预测股票超额回报,在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合,实现对投资组合的主动增强。

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年聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为30,000.00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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	1,416,370,073.41	100.00%	298,000.64	100.00%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下:

1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展、投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	
	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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	103,714.60	100.00%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一五年三月二十七日