易方达银行指数分级证券投资基金之银行业A与银行业B上市交易公告书

易方达基金管理有限公司

二〇一五年六月八日

一、重要声明与提示

易方达银行指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之银行业A与银行业B上市交易公告书（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金基金管理人易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请详细阅读刊登在中国证监会指定信息披露媒体以及本公司网站（www.efunds.com.cn）上的《易方达银行指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）。

二、基金概览

（一）基金名称：易方达银行指数分级证券投资基金

基础份额简称：易方达银行分级；场内简称：银行业；场内代码161121

A类份额简称：易方达银行分级A；场内简称：银行业A；场内代码150255

B类份额简称：易方达银行分级B；场内简称：银行业B；场内代码150256

（二）基金类型

股票基金

（三）基金存续期限

不定期

（四）基金份额的申购和赎回

投资者可通过场外或场内两种方式申购与赎回易方达银行分级。易方达银行分级A、易方达银行分级B只上市交易，不单独接受申购和赎回；易方达银行分级（“基础份额”）只可申购和赎回，不上市交易。

（五）基金份额的配对转换

份额配对转换是指易方达银行分级(基础份额)与易方达银行分级A、易方达银行分级B之间的配对转换，包括分拆和合并两方面。

分拆指基金份额持有人将其持有的每2份易方达银行分级的场内份额申请转换成1份易方达银行分级A与1份易方达银行分级B的行为。

合并指基金份额持有人将其持有的每1份易方达银行分级A与1份易方达银行分级B申请转换成2份易方达银行分级场内份额的行为。

（六）基金份额折算

1. 定期份额折算

本基金每一运作周年折算一次，若距离上一次基金份额折算不满3个月则可不进行折算。定期份额折算期间，本基金基金份额折算对象为定期份额折算基准日登记在册的易方达银行分级A、易方达银行分级。在基金份额折算前与折算后，A类份额和B类份额的份额配比保持1：1的比例。

在折算时，A类份额的累计约定应得收益，即A类份额每个运作周年的最后一个工作日的基金份额参考净值超出本金1.0000元部分，将折算为场内基础份额分配给A类份额持有人。

基础份额持有人持有的每2份基础份额将按1份A类份额获得新增基础份额的分配。其中，持有场外基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外基础份额的分配；持有场内基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内基础份额的分配。经过上述份额折算，A类份额的基金份额参考净值和基础份额的基金份额净值将相应调整。

有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

2. 不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：（1）基础份额的基金份额净值大于1.5000元；或（2）B类份额的基金份额参考净值小于0.2500元。不定期份额折算期间，本基金基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的易方达银行分级A、易方达银行分级B与易方达银行分级。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

（七）基金份额总额

截至2015年6月4日，本基金的基金份额总额为377,856,974.14份，其中，易方达银行分级为208,149,970.14份，易方达银行分级A为84,853,502.00份，易方达银行分级B为84,853,502.00份。

（九）基金份额参考净值

截至2015年6月4日，易方达银行分级的基金份额净值为1.0037元，易方达银行分级A的基金份额参考净值为1.0001元，易方达银行分级B的基金份额参考净值为1.0073元。

（十）本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：银行业A（基金代码：150255）；银行业B（基金代码：150256）。

（十一）本次上市交易份额

截至2015年6月4日，易方达银行分级A 84,853,502.00份；易方达银行分级B 84,853,502.00份。

（十二）上市交易的证券交易所

深圳证券交易所

（十三）上市交易日期

2015年6月11日

（十四）基金管理人

易方达基金管理有限公司

（十五）基金托管人

中国建设银行股份有限公司

（十六）上市推荐人

无

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1. 本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可[2015]673号文。
2. 基金的运作方式：契约型开放式。
3. 基金合同期限：不定期。
4. 发售日期：2015年5月18日至2015年5月29日。
5. 发售价格：1.00元人民币。
6. 发售方式：场内、场外认购。
7. 发售机构：

（1）场内销售机构

场内销售机构是指具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单详见深圳证券交易所网站）：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东莞证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、华信证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、长城国瑞证券、长城证券、长江证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中天证券、中投证券、中信建投、中信山东、中信浙江、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

如果会员单位有所增加或减少，请以深交所的具体规定为准。具体名单可在深交所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

（2）场外销售机构

①直销销售机构：易方达基金管理有限公司

直销销售机构网点信息：

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼易方达基金管理有限公司广州直销中心；

北京市西城区金融街20号B座8层易方达基金管理有限公司北京直销中心；

上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室易方达基金管理有限公司上海直销中心。易方达基金管理有限公司网上交易系统：网址www.efunds.com.cn。

②非直销销售机构

中国邮政储蓄银行、东莞农村商业银行、东莞银行、杭州银行、民生银行、平安银行、浦发银行、泉州银行、上海农村商业银行、上海银行、广发证券、安信证券、渤海证券、长城证券、长江证券、大通证券、第一创业证券、东北证券、东海证券、东吴证券、光大证券、国都证券、国金证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华安证券、华宝证券、华福证券、华龙证券、华融证券、华西证券、华信证券、江海证券、金元证券、平安证券、齐鲁证券、山西证券、上海证券、申万宏源西部证券、申万宏源证券、西部证券、西南证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、银河证券、中金公司、中山证券、中天证券、中投证券、中信建投证券、中原证券、创金启富、泛华普益、海银基金销售、好买基金、和讯信息、恒天明泽、久富财富、上海长量、数米基金、天天基金、同花顺、万银财富、一路财富、宜投基金销售、展恒基金、中信建投期货、众禄基金。

如变更场外销售机构，本公司将另行公告。

8. 验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。
9. 募集资金总额及入账情况

本次募集的有效净认购金额为377,815,233.34元人民币，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计41,740.80元人民币，有效认购户数为4,520户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本息合计募集基金份额总额为377,856,974.14份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。上述有效净认购金额已于2015年6月3日内划入本基金在基金托管人中国建设银行开立的基金托管专户。在基金募集期内，本公司基金从业人员未认购易方达银行指数分级证券投资基金

10. 基金备案情况

本基金于2015年6月3日验资完毕，2015年6月3日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2015年6月3日获得书面确认。

11. 基金合同生效日：2015年6月3日。
12. 基金合同生效日的基金份额总额：377,856,974.14份。

（二）本基金上市交易的主要内容

1. 基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]247号。
2. 上市交易日期：2015年6月11日。
3. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
4. 本次上市交易的基金份额场内简称及代码：银行业A：150255、银行业B：150256。
5. 本次上市交易份额：易方达银行分级A 84,853,502.00份、易方达银行分级B 84,853,502.00份（截至2015年6月4日）。
6. 基金净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深圳证券交易所，深圳证券交易所于下个工作日通过行情系统揭示易方达银行分级的基金份额净值，以及易方达银行分级A与易方达银行分级B的基金份额参考净值。
7. 未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的易方达银行分级，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为易方达银行分级A和易方达银行分级B即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，可以通过跨系统转托管转至深圳证券交易所场内后分拆为易方达银行分级A和易方达银行分级B即可上市交易。本基金跨系统转托管和份额配对转换业务将于2015年6月11日开通，具体详见相关公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2015年6月4日，本基金份额持有人户数为4,516户，平均每户持有的基金份额为83,670.72份。易方达银行分级A持有人户数为733户，平均每户持有的易方达银行分级A基金份额为115,761.94份。易方达银行分级B持有人户数为733户，平均每户持有的易方达银行分级B基金份额为115,761.94份。

（二）持有人结构

截至2015年6月4日，机构投资者持有的本次上市交易的易方达银行分级A基金份额为18,175,885.00份，占本次易方达银行分级A上市交易基金份额比例为21.42%；个人投资者持有的本次上市交易的易方达银行分级A基金份额为66,677,617.00份，占本次易方达银行分级A上市交易基金份额比例为78.58%。

截至2015年6月4日，机构投资者持有的本次上市交易的易方达银行分级B基金份额为18,175,883.00份，占本次易方达银行分级B上市交易基金份额比例为21.42%；个人投资者持有的本次上市交易的易方达银行分级B基金份额为66,677,619.00份，占本次易方达银行分级B上市交易基金份额比例为78.58%。

（三）前十名场内基金份额持有人的情况：

截至2015年6月4日，易方达银行分级A前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称	持有易方达银行分级A基金份额（份）	占易方达银行分级A比例（%）
1	中国对外经济贸易信托有限公司-伏牛1期汇富130号 精构化证券集合信托	7,500,365	8.84
2	中国对外经济贸易信托有限公司-外贸信托 伏牛2期汇富147号 精构化证券投资集合资金信托计划	7,500,365	8.84
3	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,575,088	1.86
4	吴美兰	1,500,102	1.77
5	李光英	1,500,087	1.77
6	苗娣	1,500,087	1.77
7	高玉春	1,500,087	1.77
8	贺财霖	1,250,085	1.47
9	苗坤	1,150,067	1.36
10	邸尚华	1,000,058	1.18
合计		25,976,391	30.61

截至2015年6月4日，易方达银行分级B前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称	持有易方达银行分级B基金份额（份）	占易方达银行分级B比例（%）
1	中国对外经济贸易信托有限公司-伏牛1期汇富130号 精构化证券集合信托	7,500,364	8.84
2	中国对外经济贸易信托有限公司-外贸信托 伏牛2期汇富147号 精构化证券投资集合资金信托计划	7,500,364	8.84
3	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,575,089	1.86
4	吴美兰	1,500,102	1.77
5	李光英	1,500,087	1.77
6	苗娣	1,500,087	1.77
7	高玉春	1,500,087	1.77
8	贺财霖	1,250,085	1.47
9	苗坤	1,150,067	1.36
10	邸尚华	1,000,058	1.18
合计		25,976,390	30.61

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1. 名称：易方达基金管理有限公司
2. 法定代表人：刘晓艳
3. 总裁：刘晓艳
4. 注册资本：壹亿贰仟万元人民币
5. 注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
6. 设立批准文号：证监基金字[2001]4号
7. 工商登记注册的法人营业执照文号：440000000002868
8. 经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务。
9. 股权结构：广东粤财信托有限公司，持有股份25%；广发证券股份有限公司，持有股份25%；盈峰投资控股集团有限公司，持有股份25%；广东省广晟资产经营有限公司，持有股份16.67%；广州市广永国有资产经营有限公司，持有股份8.33%。
10. 内部组织结构及职能：

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益。

公司下设二十八个部门：权益投资总部、固定收益总部、现金管理部、指数与量化投资部、研究部、投资银行部、集中交易室、投资发展部、投资风险管理部、养老金部、客户服务与销售支持部、渠道营销部、互联网金融部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、南京分公司、机构客户部、系统研发部、技术运营部、核算部、注册登记部、宣传策划部、综合管理部、人力资源部、监察部、北京办事处。

1).权益投资总部下设公募基金投资部、养老金与专户权益投资部、投资一部，公募基金投资部负责公募基金资产的日常管理和运作，养老金与专户权益投资部负责权益类社保基金及其他受托资产的投资管理工作，投资一部以团队形式负责所辖资产的研究和投资管理工作。

2).固定收益总部下设固定收益机构投资部、固定收益基金投资部、固定收益研究部和固定收益交易室，四个部门分别负责固定收益类公募、专户、年金的投资、研究及交易工作。

3).现金管理部主要负责货币类以及短期理财类基金的投资管理工作。

4).指数与量化投资部主要负责指数基金以及量化策略基金的投资管理及相关工作。

5).研究部的主要工作职责是对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种进行研究。

6).投资银行部主要负责公司投行类业务，包括一级市场和一级半市场中的股权投资、国企混合所有制改革、上市公司并购重组等投融资业务。

7).集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作，保存交易记录，备份交易数据。

8).投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发；为市场营销工作提供专业支持。

9).投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估，投资与市场的相关数据支持服务工作。

10).养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。

11).渠道营销部主要负责各类基金代销机构的合作开发及总部层面的维护工作，营销策划方案的制订、推动，营销效果及客群的数据挖掘、分析。

12).客户服务与销售支持部主要负责公司销售支持工作，为渠道、机构客户、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持。

13).互联网金融部负责研发基于互联网的交易模式和服务模式，建设相应系统并持续改进用户体验，开展互联网金融业务的营销策划、方案制作、方案实施及对外的合作洽谈，为互联网上的客户提供服务。

14).北京分公司负责组织实施以北京为中心的华北和西北地区的渠道销售工作。

15).上海分公司负责组织实施以上海为中心的华东地区及东北部分地区的渠道销售工作。

16).广州分公司负责组织实施以广州为中心的华南地区的渠道销售工作。

17).成都分公司负责组织实施以四川省为中心的渠道销售工作。

18).南京分公司负责组织以江苏省为中心的渠道销售工作。

19).机构客户部负责公司机构客户的销售和服务工作，下设银行客户部、非银行客户部两个二级部门，分别负责所属客户群体的销售和服务工作。

20).系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试、以及上线运营后的应用支持工作。

21).技术运营部负责公司IT基础设施的规划与建设，公司日常运营的技术支持与服务，保障公司信息系统安全可靠高效运行。

22).核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作，负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作，以及各银行账户的管理工作。

23).注册登记部主要工作是进行开放式基金、特定多个客户资产管理计划及养老金产品的注册登记业务。

24).宣传策划部负责制作宣传材料，传播公司信息，管理媒体关系，管理广告投放及维护公司网站等。

25).综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作，负责公司财务会计、行政保卫和文书档案等工作。

26).人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施，具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。

27).监察部负责独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督，协助并督促各部门履行内控职责，确保公司各项经营活动稳健合规，实现公司经营目标。

28).北京办事处负责与在京监管部门的日常联系工作。

11. 人员情况

截止到2015年3月31日，本公司有员工467人，其中262人具有硕士学历，20人具有博士学历。91%的公司员工具有基金从业资格。

12. 信息披露负责人：张南

电话：020-85102688

13. 基金管理业务介绍

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。

14. 本基金基金经理

王建军先生，经济学博士。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师、易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理。现任易方达基金管理有限公司易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理（自2010年9月27日起任职）、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2010年9月27日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2011年9月20日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2011年9月20日起任职）、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理（自2012年9月20日起任职）。

（二）基金托管人

1. 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

2. 主要人员情况

赵冠甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3. 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末，中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

（三）基金验资机构

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话：(010) 58153000

传真：(010) 85188298

经办注册会计师：昌华、熊姝英

联系人：许建辉

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

易方达银行指数分级证券投资基金2015年6月4日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资 产	本期末（2015年6月4日）
资 产：	
银行存款	377,815,233.34
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	112,108,026.00
其中：股票投资	112,108,026.00
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	7,556.30
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	42,256.98
资产合计	489,973,072.62
负债和所有者权益：	
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	110,612,477.52
应付赎回款	-
应付管理人报酬	10,352.22
应付托管费	2,277.49
应付销售服务费	-
应付交易费用	100,689.57
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	2,607.04
负债合计	110,728,403.84
所有者权益：	
实收基金	377,856,974.14
未分配利润	1,387,694.64
所有者权益合计	379,244,668.78
负债与持有人权益总计	489,973,072.62

八、基金投资组合

截至2015年6月4日，易方达银行指数分级证券投资基金的投资组合如下：

(一) 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	112,108,026.00	22.88
	其中：股票	112,108,026.00	22.88
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	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	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	377,815,233.34	77.11
7	其他资产	49,813.28	0.01
8	合计	489,973,072.62	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.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	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	-	-
J	金融业	112,108,026.00	29.56
K	房地产业	-	-
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	112,108,026.00	29.56

2.积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金于2015年6月4日未持有积极投资股票。

(三) 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明细

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	600036	招商银行	913,900	18,680,116.00	4.93
2	600016	民生银行	1,380,700	14,635,420.00	3.86
3	601166	兴业银行	673,700	13,150,624.00	3.47
4	600000	浦发银行	659,600	12,288,348.00	3.24
5	601328	交通银行	925,200	7,512,624.00	1.98
6	601818	光大银行	1,173,000	7,155,300.00	1.89
7	000001	平安银行	404,000	6,613,480.00	1.74
8	601988	中国银行	1,366,200	6,434,802.00	1.70
9	601288	农业银行	1,559,600	6,004,460.00	1.58
10	601398	工商银行	1,092,000	5,831,280.00	1.54

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

本基金于2015年6月4日未持有积极投资股票。

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于2015年6月4日未持有债券。

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金于2015年6月4日未持有债券。

(六) 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

本基金于2015年6月4日未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金于2015年6月4日未持有权证。

(八) 投资组合报告附注

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。

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。

3.其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,556.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	42,256.98
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,813.28

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2015年6月4日未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末股票投资中存在流通受限情况的说明

（1）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2015年6月4日指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（2）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2015年6月4日未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

（一）中国证监会准予易方达银行指数分级证券投资基金募集注册的文件；

（二）《易方达银行指数分级证券投资基金基金合同》；

（三）《易方达银行指数分级证券投资基金招募说明书》；

（四）《易方达银行指数分级证券投资基金托管协议》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件和营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

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。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

易方达基金管理有限公司

二〇一五年六月八日

附件：基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让其持有基础份额、A类份额和B类份额，依法申请赎回或转让其持有的基础份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专