Disclosure 信息披露

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

本报告期自2015年10月1日起至	
	§ 2 基金产品概况
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
报告期末基金份额总额	5,147,021,934.00(f)
投资目标	緊密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要求股份人员制部等机当的材件性事務实现共标的指数的紧密膨胀。则未基金适当由出来。以更好实现未完全的转度目录。在是一类深不定全数比走行投资,即参与中国企业指数的成份提出及及更新规能更积分组合,并限据电中国企业指数或成份组及更多效量,现在一个工程,但是一个工程,是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,是一个工程,但是一个工程,但是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,但是一个工程,可以是一个工程,可以是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,可以可以是一个工程,可以可以是一个工程,可以是一个工程,可以可以可以是一个工程,可以可以可以是一个工程,可以可以可以是一个工程,可以可以可以是一个工程,可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以可以
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 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放益转征。本基金主要均 香港证券市场上市的中国金业。据来赶江军风险以及境外市场的风险。
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
to CONTRACTOR	英文名称:无
境外投资顾问	中文名称:无
The All Information Annual Conference A	英文名称: The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
境外资产托管人	中文名称:香港上海汇丰银行有限公司
	§ 3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标	
	单位:人戶
主要财务指标	报告期 (2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-44,093,13
2.本期利润	164,366,76
3.加权平均基金份额本期利润	0.
4.期末基金资产净值	5,078,095,46

		性生中国企业交 增长率与业绩比 (2012年8月9日		历史走势对比图	
40076					
2559h				14	Λ
luin.				17	V .
p4.6490-					3
3000THs	M.			W. 10	
black.	1.1		41	16456	1.
4.100	W. M. M. M.	l B	19%	N. In. A.	M A
men i	CV V. Y.	MILL	1 10/19	29	1.7%
1000	A. M.	1 19771 17	MINN	60	W Y
1		10	44		11
distr.		1	Of the		
4007%					
(100,04)4	W. CHRON	I decident	GERMAN S	Herrie Har	Here There

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。

3.2.1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

排名	职务	任本基金的基	5金经理期限	证券从业年	说明
红色	4尺分	任职日期	高任日期	限	
张胜记	本基金的基金经理。另方达50%款证券投资基金的基金经理。另方达每中国企业交易更开放工场数证券投资基金按据金仓标。全经理,另方达上中位交易要开放工物效工物效工物效工物设置。企业是一级分型、经过、经过、企业企业。因为"达上中省企业公司"。另方达长符金企业和"成为"达上中省企业"的发展的企业。	2012-08-09	-	10年	硕士研究生,曾任易了 达基金管理有限公司 机构理财都研究员,总 构理财都投资经理助理、研 穷部行业研究员,易了 达沪深300交易型开步 式指数发起式证券投 经

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

本报告前外,本基金管理人所能遵守(证券投资基金法)等有关法律法规及基金合同、基金招募说用书等有关基金 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 4.4 公平交易专项说明

(人)"祖父并"(平于安)[生]"自宣正治是"[日]"(市)"。 易方法但中国企业交易型开放式精致基金(日晚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投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。

物力及恒生中国近亚文等为7万及7月8人需要《1年8人11/1917 人工产品。
前者数的成为使要企任进行中"胸壁操作、定制基金组合与指数权重基本一数。
4.5.据告期内基金的业绩表现
截至报告期末、本基金份额单值为0.9866元,本报告期份额净值增长率为4.40%。同期业绩比较基准收益率为4.84%。
年代限层法是0.39%。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商业原理
恒年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2016年第一季度,美联储继续加息的可能性很大,人民市疫值压力继续增强。"最整份有压力、另一方面,中国财政刺激政策将逐渐发挥效果,房地产"汽车等行业在政策设置下有望回题、中央经济政策加州股份制设市、传统行业有望走出低谷。同时,恒生中国企业指数的估值水平创于2000年来的新低、长期投资价值凸显。继续对由股格数的前景保持乐观。
长期来看,我国经济的处于制度政革红利的释放期,仍处于共业的工业化、城镇化以及区域经济一体化进程中,中长期经济增长的最长的不基金对恒生中国企业指数的长期表现保持乐观。作为完全被对投资基金、下阶段本基金将继续采取紧密限路比较基准的投资策略,审慎管理基金资产,追求跟踪偏离度及解踪误差的最小化、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。
§ 5 投资组合报告

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

	7	Į.	页目				金額(人)	と市元)	1.1786320.00	资产的比例 (%)
1	权益投资							4,879,150,981.14		94.2
	其中:普通图 存托凭证	t .						4,879,150,981.14		94.2
	优先股 房地产信托							-		
2	基金投资							-		
3	固定收益投 其中:债券	跷						-		-
4	资产支持证							-		
4	金融衍生品: 其中:远期	192192						-		
	期货期权							-		
	权证	all adminis						-		
5	买人返售金l 其中:买断式	被说:" :回购的买人返售金	融资产					-		
6	货币市场工	具 结算备付金合计						296.569.892.27		5.7
8	其他资产	-C94-E17-22-F1						2,475,453.31		0.0
2.本	1.上表中的普 基金本报告期	月末通过沪港通 5个国家(地区	交易机制	投资的 多的股)港股市	直为18,668,94 凭证投资分	12.93元, 布	5,178,196,326.72 中可退替代款估值 占净值比例0.379 占基金资产净值	6.	96.0
	合计 -1 国家(地区)) 类别根据其所	在的证券	: ▽ 易月	確定。	4,879,072,964.				96.0
2.A	DR、GDR按照	存托凭证本身 行业分类的股票	挂牌的证	券交易	所确定。					
能源	行业类	影		公允任	介值(人民)	f元) 528,514,942.25		占基金资产净值。	七例(%)	10.4
材料						68,776,631.73				1.3
工业 非必需	消费品					209,334,588.98 157,376,105.90				4.1
必需消 保健	贵品					23,818,923.18				0.4
金融						70,004,461.15 3,582,503,912.81				70.5
信息技 电信服						95,327,970.19	-			1.8
公用事	·业 合计					143,415,427.94 4,879,072,964.13				2.8 96.0
	:以上分类采用	全球行业分类								96.0
5.4	报告期末按公 公司名称(英 文)	公司名称(中文)	资产净值 证券代码	比例大 所在 证 券市 场	所属国 家 (地区)	的前十名股男 数量 (股)	及存托	先证投资明细 公允价值(人民)		占基金资产 净值比例 (%)
1	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港新	香港	1	71,347,000	496,	,686,770.23	9.7
2	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港	香港	1:	26,522,000	496,	,068,773.43	9.7
3	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港 证券 所	香港	1	11,471,000	495,	891,205.96	9.7
4	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 交所	香港		11,743,500	423,	,054,185.49	8.3
5	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港 证易 所 香港	香港		16,762,000	351,	,773,852.42	6.9
6	China Petroleum & Chemical Corp	中国石油化工股份有限公司	386 HK	证券 交所 香港	香港	!	57,471,200	225,	,333,678.66	4.4
7	PetroChina Co Ltd	中国石油天然气 股份有限公司 中国太平洋保险	857 HK	证券易 所 香港	香港		47,528,000	202,	275,479.83	3.9
8	Insurance Group Co Ltd Agricultural Bank	(集团)股份有限公司 中国农业银行股	2601 HK	证券 交所 香港	香港		5,626,400		,366,564.01	2.9
9	of China Ltd	份有限公司 招商银行股份有	1288 HK 3968 HK	证券 所 香港 证券	香港	!	9,307,046		,113,313.46	2.9
	Bank Co Ltd :此外所用证券	代码的类别是		证券 交易 所	1376		9,307,040	142,	,087,803.00	2.0
本基 5.6d 本基 5.7d 本基 5.8 本基 5.9d 本基 5.10 造责、5.10	基金本报告按公司 据告期未按知识基基。 基础与期保持数据。 基础与期保持数据。 基础与期保持数据。 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 是证明, 是证明, 是证明, 是证明, 是证明, 是证明, 是证明, 是证明	允价值占基金。 依木持有债金基金。 允休持有占基金产。 允休持有占基金产。 依木持有占基金产。 长木持有占基础形。 长木持有占基础。 长木持有基金。 告附注: 的前十名服票。	资产净值比 资产净值比 持证券。 资产净值 行生品。 资产净值比	比例大 比例大 比例大 比例大	小排序的 小排序的 小排序的 小排序的	前十名资产的前五名金融的前十名基金。	支持证券 並衍生品: 投资明纸 立案调查	幹投资明细 投资明细	制日前一	年内受到
序4	5	名称					金額	(人民币元)		
2	应收证券清									2,441,233.8
3				\exists				-		34,219.4
5	应收申购款									
6 7	其他应收款 待摊费用			-						-
8	其他									2.475.400.0
5.10	0.4 报告期末持	寺有的处于转股 末未持有处于契								2,475,453.3
5.10	0.5 报告期末前	10个17年20日 10十名股票中存 12年11年2日 10年11年11年11年11年11年11年11年11年11年11年11年11年1	在流通受	限情/ 随受阿	记的说明 艮情况。	A fel deri-ha-1				
44						金份额变动				

\$7 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运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。 § 8 备查文件目录 ョニスコロネ 国证监会核准易方法恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件:

《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》;
 《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

基金管理人业务资格批件和营业执照。

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。

投资者可在营业时间免费查阅,也可按丁本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

\$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、 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、误导性陈还取重大遗漏,开对其内容的具头性、 推确性和宗整体者但今别发走带责任。 基金托管人中国建设银行設份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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、误导性除述或者重大遗漏。 基金管理人诉诺以诚实信用、勤秘灵劳的原则管理和应用基金资产。但不保证基金一定盈利。 基金管过人诉诺以该求信用、勤秘灵劳的原则管理和应用基金资产。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。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况 资策略

3.1 主要财务指标	
	单位:人民币元
主要财务指标	报告期 (2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	78,675,296.33
2.本期利润	346,686,916.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.4103
4.期末基金资产净值	1,465,726,423.13
5.期末基金份额净值	1.8804
注,1 所述其全业结指标不句括持有人认顺	武· 京 京 京 京 京 京 京 京 京 京 京 京 京

CI:1月122每至329月19中个程后对有人AA99以《为基金时各项政用、计入费用后采购収益水平要低于折列数学。 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)和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。

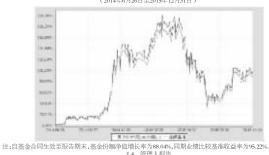
3.2 基金学值表現

3.2.1本报告期基金份額等值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前後

| 浄血粉集率| | 浄血粉集率| | 中血粉集率| | 中血粉集率| | 中血粉集率| | 中血粉集率| | 中血粉集率| | 中血粉集率| | 日本第一年中極差差 | 中本を建立 | 日本27.18 | 日本3.1658 | 日本3.16

易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金 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 (2014年6月26日至2015年12月31日)



4.1 基金	·经理(或基金经理小组)简介	官埋入报古			
姓名	职务	任本基金的基	L 金经理期限	证券从业年	iğill
KEA	机分	任职日期	高任日期	限	15095
会海燕	本基金的基金经理,易方法证券公司指数分级证券投票基金的基金经理,易方法上证如排数分级证券投票基金的基金经理,易方法上证的排数分级证券投票基金的基金经理,另方法军工程的处证是特别工程式指数证券投票基金经基金经基金经基金经基金经基金经基金经基金经基金经基金的基金经理。 展为法国金汉本指数分级证券投票基金的基金经理。 展为法国金汉本指数分级证券投票基金的基金经理。	2014-06-26	-	10年	硕士研究生,曾任汇丰银行 Consumer Credit 银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师,华宝兴业基金管理有限公司分析师。基金经理,易方达基金管理有限公司投资发展都产品经理。
林飞	本基金的基金经理。另方法产得3000截至卫生又易型开 放文指数加索投资基金的基金企理。另方法的"管理 有限公司RQHI/QHI产品投资金成员。指数与量化 投资配益处理	2014-06-26	-	12年	博士研究生、管任题通 基金管理有限人可研 究员、基金管理助理。 另方达基金管理助理。 从可基金管理助理。 数与量化均等相应经 理助理。指数与量化均 济强固位经理有限 基金基金经理。另方达 济强加位级。 基金基金经理,另方达 介值。如《多思型开放式 升散、基金经理,另方达 或是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个

4.2 官建人对旅告期內央查查之下壁地寸目前60的以时 本报告期內,本基金管理人严格遵守(证券投资基金法)等有关注律法规及基金合同、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、勤勉尽劳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。在本报告期內,基金运作合法合规,无报害基金份额持有人利益

任巴学獎出班總幹承又非,工证宗信工部15.95%。在24倍方面1人入外為力化對源上工证少情數上數12.66年20所。即即數百第五十分 3.32%。行业方面,电子房地产 计算机,通信等较快速缩较大,钢铁、交通空输。国防军工等较快表现相对落后。报告期 內限票市场整体反弹、随着成交金额、两脑、股指等市场环境企稳的背景下。沪深30m半银行金融指数上涨31.66%。 报告期内本基金为正常近年期 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 和基金申联变动时,应用指数复制和数量化技术降低中击成本和减少限端误差。

截至报告期末,本基金份额净值为1.8804元,本报告期份额净值增长率为31.05%,同期业绩比较基准收益率为

截至报告期末,本基金份额净值为1.8804元,本报告期份额净值增长率为31.08%,同期业龄比较基准收益率为1.66%。目聚峰储度的药物 50.0%。目露逃患差为0.04%。日本企品,在全局规定的目标控制范围之内。4.43管理人对太观经济、证券市场及行业生势的简要展望 展建下一价设,中国经济增速仍面临下行风险。但是偏依的货币改策以及积极的财政政策为市场提供了一个经济的 下跌期灾。从风险偏好的感应因素来看。北杆短期率以按复,但从中长期看改革与创新仍然值得职待,在设址与环联压力之下,财政政策有望加码,而改革进程。包括国金、财税,开放、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推准。通过使务例如实 基局全要者生产率,将是中国经济长时税,开放、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推模。通过实场则或求 提高全要者生产率,将是中国经济长时的关键手段。我们中国经济告知市区流传模、通过水平均域汇率的稳定以及失行能及或证明明,实践能加速速度低于到明,积极的财政政策来对中发光增长的下行压力,并消除逾增组比较、继续推进改革和创新,重射体型信心。A股市场仍是实现经济转型的国家总够的核心高地。因此它起路上当前对于A股市场不公未要观遇过农市场施品存量、促进也市的加。把社会资金、资源更有效率地配置、促进产业并购,重组,改善上市公司业绩,A股市场和产业发展的正反馈仍将重现。

保险行业在未来将极大受益于健康险和养老险政策,行业高成长属性明显,估值弹性有望受到业绩增长得到进一步支 译。 作为被动型投资基金,本基金将坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目 标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化、为投资者提供质地优良的指数投资工具,既为短期投资者提供"高弹性、高 波动"的投资工具,又为长期看好非银行金融行业投资前景的投资者提供方便,高效的投资工具。 多5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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	-	-
В	采矿业	-	
С	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	-	-
Н	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	1,454,289,901.90	99.22
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	-	
0	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	1,454,289,901.90	99.22
5.3 报	告期末按公允价值占基金资产净值比例大小相	非序的前十名股票投资明细	
			Ett Aztreda Milli Mi

0.0 1区日	- 明本技公儿川旧	.口兹並页厂 伊阻比	例入/1967/1911 石収示	行义 页明加	
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	9,711,031	349,597,116.00	23.85
2	600030	中信证券	7,056,394	136,541,223.90	9.32
3	600837	海通证券	7,254,385	114,764,370.70	7.83
4	601601	中国太保	2,818,436	81,340,062.96	5.55
5	601688	华泰证券	2,928,068	57,741,500.96	3.94
6	600999	招商证券	2,603,220	56,489,874.00	3.85
7	000776	广发证券	2,653,626	51,613,025.70	3.52
8	000166	申万宏源	3,995,465	42,791,430.15	2.92
9	601628	中国人寿	1,493,769	42,288,600.39	2.89
10	601377	兴业证券	3,762,565	41,388,215.00	2.82
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 报告期未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未未持有债券。

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。

除中信证券、海通证券、华泰证券、广发证券外,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	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	601377	兴业证券	41,388,215.00	2.82	配股停牌
		§ 6	开放式基金份额变动		
					单位:
设告期期初基金份	额总额				644,872,856.00
	5.11.5报告期 序号 1	5.11.5报告期末前十名股票中 序号 股票代码	5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况 序号 股票代码 股票公称 1 661377 兴业证券 § 6	5.11.5报告期末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 1 661377 兴业证券 41,388.215.00 § 6 开放式基金份额变动	序号 股票代码 股票名称 液通受限部分的公允价值 (元) 占基金资产等值比例(%) 1 601377 兴业证券 41,388,215.00 2.82 § 6 开放式基金份额变动

7.1 基金管理人持有本基金份额。 7.1 基金管理人持有本基金份额。 7.2 基金管理人法用固有资金投资本基金情况本据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

0.1 面呈入TP14% 1.中国证监全核准易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金募集的文件; 2.《易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同); 3.《易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金托管协议》; 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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。

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:二〇一六年一月二十二日

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

基金简称	易方达沪深300非银联接
基金主代码	000950
交易代码	000950
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月22日
报告期末基金份额总额	1,190,790,600.46(/)
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投資策略	本基金为中省化如申银行金融工作资保证基金。中级如时银行金融工作是项目完全机制定工程的 定如时银行金融和联发用的影响。他也特殊是企。本是企业理由进步计中深级时间转行金融和 主规划金融计处据的效果则是,为中等任何限定从规矩体中以为,基本每年在经济市场企业 对战、依据、本有规律等最近。,决定提供制度,就应约为大规划产,或由标业人能的方式会 为一个企业。 之间的资料,以用根据金收益。未是金可以参与政格制度交易,但必须根据风险管理的规则,以新 保险分目的。
业绩比较基准	沪深300非银行金融指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是ETF联接基金。理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基 主要通过投资于易方法产源30申银行金融ETF实现对业绩比较基准的紧密限据,具有与业绩比较 基作相似的风险或特征。
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
2.1.1目标基金基本情况	<u> </u>
基金名称	易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512070
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2014年6月26日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014年7月18日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
2.1.2目标基金产品说明	
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法。即完全按照标的指数的成份股租成及其权置构建基金股票投资组合 根据标价指数或价限及其权量的变动进行相应调整。但在现时转情形导或基金元法完全投资于标 报数或份股时,基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合。以达到紧密跟踪标览数约目的。
业绩比较基准	沪深300非银行金融指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,預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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法预器标的指数的表现。具有与标的指数所代表的市场组合相的风险业益特征。

1.本期已实现收益	-69,656,391.70
2.本期利润	242,401,050.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.174
4.期末基金资产净值	1,003,720,916.50
5.期末基金份额争值	0.842

易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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 (2015年1月22日至2015年12月31日)

注:1.本基金合同于2015年1月22日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.按基金合同和招募说用书的约定,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(第二部分上,投资范围、二、投资策略和四、投资限制,的有关约定。
3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为一15.71%。同期业绩比较基准收益率为—14.73%。
\$4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基	6金经理期限	证券从业年	说明
圧石	联分	任职日期	离任日期	限	
余海燕	本基金的基金经理。易方法国企改定指数分级证券投资基金的基金经理。易方法的等300%的一个工业交易型开 第2个基础。是一个工业,是一个工业,是一个工业。 第2个工业,是一个工业,是一个工业。 第2个工业,是一个工业,是一个工业。 第2个工业,是一个工业,是一个工业。 第2个工业,是一个工业,是一个工业。 第2个工业,是一个工业,是一个工业。 第2个工业,是一个工工业。 第2个工业工业,是一个工工业。 第2个工业工业,是一个工工业工业。	2015-01-22	-	10年	硕士研究生,曾任汇丰 银行 Conamer Credit Risk 信用风险分析师, 华宝兴业基金管理 限公司分析师,基金经 理助理、基金经理。易 方达基金管理有限公 司投资发展都产品经 理。

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。 - 地方%或以7.2 (2847年)2.4 地方4.5 (2847年)2.4 (28年2人) (2847年)2.4 (2847年)

4.3 公平交易专项说明 4-312个平文的前处的外门间心 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。以及强化单后监控分析来确保公平 对待不同投资组合。切实的范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资资选率管理制度和集中交 易制度等,并重视交易技行东行的公平交易精能。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。

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。
4.2 异常交易行为的专项说明
4.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内、公司能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最超过该证
券当日成交量的5%的交易共有公、其中5次为指数及量化组合因投资策略需要取取他组合发生的反向交易;1次为不同
基金经理管理的基金股投资额略不同而发生的反向交易,专基金经理管理处理行了审批程序。
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 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4 报告期内基金投资额和运输表现说明
4.4 报告期内基金投资额和运输表现说明
4.4 报告期内基金投资额和运输表现说明
安定度国内宏观经济仍采现明显改善迹象。通缩风险继续升温。12 全国制造业PMI微反弹至49.7,连续6个月低于
安长线。他8年以来同期新低、制金业量气等改象。通知风险继续升温。12 全国制造业PMI微反弹至49.7,连续6个月低于
安长线。他8年以是同期新低、制金业量气等改象。通知风险继续升温。15 中国

在四季度出现整体反弹,上证综指上涨15.93%。在风格方面,大小盘分化明显,上证50指数上涨12.80%。创业板指数上涨30.25%。行业方面,电子,房地产、计算机,通信等板块涨幅较大,钢铁,交通运输,围防军工等板块表现相对落后。本基金是产深300非银行金施ETT的联接基金,报告期内限票市场整体反弹,随着成交金额,两融,股指等市场环境金跑的背景下,沙梁0041银行金施指数上涨31.66%。
报告期内本基金为正常运作期,在操作中,我们"格遵于基金合同,坚持限定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎支动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和成少据深误差。
44.48告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为0.8429元,本报告期份额净值增长率为27.63%。同期业绩比较基准收益率为30.0%。日期继续20.07%。18.0%。18.0%。19.0%。1

數全报告期末、本基金份额净值为0.429元、本报告期份额净值增长率为27.63%。同期业绩比较基准收益率为3001%。日期偿储度的效应0.4%。日期端误差类为15%。年化跟踪误差为2.385%。与业绩比较基准产生偏离主要是由报告期内目标正TF偏离。基金申购赎回冲击等因素所致。
4.4°富理人对玄观经济、证券市场及行业定势的简要展望展望下一份股、自显能的投资政策分市场提供了一个经济的"下跌期权"从风险偏好的驱动因素来看,11年短期难以恢复。但从中长期看改革与创新仍然值得期待。在晚业与环账压力之下,财政政策有望加码,而改革进程、包括国企、财税、开放、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推走通过比场侧成革、提高全要来生产率,将是中国经济长期可持续进年级、我们对中国经济告别相放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。未来市场风险偏好的提升需要关注新的积极变化、确定人压而汇单的稳定以及央行降起效强和销,美政结和自然更度低于预期,很极的财政政策来对中经济增长的下行压力,详简险编码程度以及央行降本政策的销,美政结和自然更重度低于预期,很极的财政政策来对中经济增长的下行压力,详简险编码程度以及央行降本和创新、重构转型信心。本来市场风险偏好的提升需要关注新的积极变化、确定人压而汇单的稳定以及央行降本和创新,重构转型信心。本报市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地、因此在战略上当前对于A股市场不必太悲观。通过资本市场或店存量、促进创新创业、托社会资金、资源更有效率地配置,促进产业中纳,重组、改善上市公司业绩,A股市场不必太忠观,在设计、 A股市场和产业发展的正反馈仍将重现。 在宏观经济转型大背景下,金融市场从间接融资走向直接融资的大变革中,券商将是制度红利释放的最大受益者。

保险行业在未来将极大受益于健康险和养老险政策,行业高成长属性明显,估值弹性有望受到业绩增长得到进一步支

作为被动型投资基金,本基金将坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目 标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,为投资者提供质地优良的指数投资工具,既为短期投资者提供"高弹性、高波动"的投资工具,又为长期看好非银行金融行业投资前景的投资者提供方便、高效的投资工具。

§ 5 投资组合报告 5.1报告期末基金资产组合情况

5.3报告期末按行业分类的股票 5.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。 1.50%(平1)以17)17(不)7)有取杀。 5.根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 本基金本报告期末未持有股票。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 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五名债券投资明细 本基金本报告期末未持有债券。
5.7报告期末先持有债券。
5.7报告期末处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。
5.8报告期末按允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。
5.9报告期末被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投资。
5.9报告期末未持有投资股份值,有量的企业,在1.11报告期末本基金投资的组情期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。
5.11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股值债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股值债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股值债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资租债期货。
5.12投资组合报告局时,年季证券,广发证券外、本基金的目标ETF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。
根据中信证券股份有限公司3015年11月26日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定、中国证监会产对公司进行文案调查。
根据海通证券股份有限公司3015年1月27日发布的使到中国证券管理委员会调查通知书的公告》,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》和关规定、被中国证监会于投资中国证金存政处罚事先告知书的公告》,因公司涉嫌法及《证券公司监督管理条例》和关规定、被中国证监会于以常国专用工程分析的关于收到中国证金合行政处罚事先告知书的公告》,因公司涉嫌未按规定对案。了解客户百分数处罚。

中国证益全方以警告及行政处罚。 根据序案证券股份有限公司2015年9月12日发布的(关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告),因公司涉 嫌未按规定收案户的身份信息进行审查和了解。被中国证监会予以警告及行政处罚。 报届广发证券股份有限公司2015年9月12日发布的(关于收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》的 公告)因公司涉嫌未按规定申查。了解客户真实身份进赴进规案。被中国证监会予以警告及行政处罚。 在上述公告公布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中信证券,海通 证券,华零证章,广发证券的投资价值协成实现性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。 5.122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。

序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	331,832.75
2	应收证券清算款	17,426,865.81
3	应收股利	
4	应收利息	12,683.12
5	应收申购款	3,380,649.64
6	其他应收款	470,091.50
7	待摊费用	
8	其他	-
9	合计	21,622,122.82

5.12.5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

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生产++++++

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

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。

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