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

2015 第四季度 报告

2015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
报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

§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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达沪深300ETF发起式联接
基金主代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
报告期末基金份额总额	3,666,184,583.67份
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。
投资策略	本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,本基金决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖,本基金可适度参与目标ETF基金份额交易和回购,赎回之间的套利,以增强基金收益。在正常市场情况下,力争将年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为沪深300ETF的联接基金,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金;本基金主要通过投资沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。
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

基金名称	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金主代码	510310
基金运作方式	交易型开放式(ETF),发起式
基金合同生效日	2013年3月6日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月25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组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全按资于标的指数成份股时,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,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

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	94,426,367.58
2.本期利润	716,609,801.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.1804
4.期末基金资产净值	4,382,241,861.92
5.期末基金份额净值	1.1953

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。

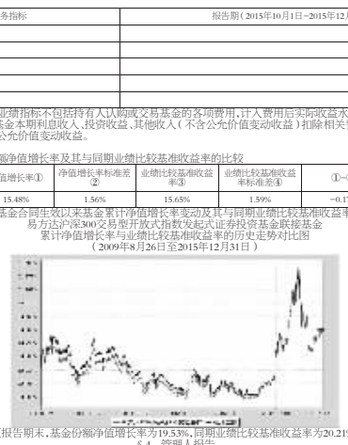
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	15.48%	1.56%	15.65%	1.59%	-0.17%	-0.03%

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



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为19.53%,同期业绩比较基准收益率为20.21%。

§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		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达中证500交易型开放式指数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	2013-11-14	-	7年	博士研究生,曾任中国金融期货交易所股份有限公司研究部研究员、易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。

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。本基金管理人规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。

4.3.2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%的交易共有6次,其中5次为指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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 投资组合报告附注

4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现说明

2015年第四季度,中国宏观经济出现边际改善,工业增加值和社会消费品零售增速企稳,CPI与PPI增速止跌。美联储12月底加息靴子落地,人民币兑美元即期汇率贬值预期加强,长端利率跟幅有所收窄。资本市场方面,经过三季度的快速下跌,A股市场在四季度出现整体反弹,上证指数上涨15.93%,深证综指上涨34.49%。大小盘风格分化明显,上证50指数和沪深300指数分别上涨12.80%和16.49%,中证500指数和创业板指数分别上涨24.40%和30.32%。

作为被动型指数基金,报告期内,本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深300指数,取得与标的指数基本一致的业绩表现。

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1.1953元,本报告期份额净值增长率为15.48%,同期业绩比较基准收益率为15.65%,年化跟踪误差0.803%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换,短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免,这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复杂进程有所反复,宏观经济政策也将在稳增长、保就业的“下限”和防通胀的“上限”之间动态平衡,当经济运行处于预期的合理区间内,则以调结构为主要着力点。就今年中国经济运行实际情况来看,政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险,并加大“区间调控、定向调控和预调微调”的力度。从长期来看,通过供给侧改革、提高全要素生产率,将是中国经济长期可持续增长的关键手段,我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

目前以沪深300指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于较为合理的位置,具有中长期投资价值。作为被动投资的基金,本基金将继续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,追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	13,667,546.00	0.31
	其中:股票	13,667,546.00	0.31
2	基金投资	4,030,022,347.49	91.87
3	固定收益投资	140,205,000.00	3.20
	其中:债券	140,205,000.00	3.20
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	184,199,663.70	4.20
8	其他资产	18,628,345.68	0.42
9	合计	4,386,722,902.87	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF),发起式	易方达基金管理有限公司	4,030,022,347.49	91.96

5.3报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1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	7,999,931.00	0.18
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	330,975.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,336,640.00	0.12
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	-	-
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	13,667,546.00	0.31

5.4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	601018	宁波港	654,000	5,336,640.00	0.12
2	600271	航天信息	65,000	4,644,900.00	0.11
3	600690	青岛海尔	325,000	3,224,000.00	0.07
4	600153	建发股份	22,500	330,975.00	0.01
5	000876	新 希 望	6,900	131,031.00	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,205,000.00	3.20
	其中:政策性金融债	140,205,000.00	3.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	140,205,000.00	3.20

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150311	15进出11	900,000	90,090,000.00	2.06
2	150416	15农发16	500,000	50,115,000.00	1.14

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。

5.9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。

5.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1601	IF1601	60	66,110,400.00	-297,480.00	在本报告期内,基金利用股指期货进行多头套保,以应对由于基金的大额申赎给带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
公允价值变动总额合计(元)				-297,480.00	
股指期货投资期末期权益(元)				12,538,320.00	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				1,332,360.00	

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内,本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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国债期货。

5.12投资组合报告附注

5.12.1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。

除中信证券和海通证券之外,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2015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,中国证监会决定对公司进行立案调查。

根据海通证券股份有限公司2015年9月11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审查、了解客户真实身份违法违规案,被中国证监会予以警告及行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2015年11月27日发布的《收到中国证券监督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》相关规定,被中国证监会予以立案调查。

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上述上市公司的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述五家上市公司的投资判断未发生改变。

除中信证券外,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。

5.12.2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。

5.12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,060,877.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,085,869.98
5	应收申购款	1,481,598.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,628,345.68

5.12.4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。

5.12.5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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601018	宁波港	5,336,640.00	0.12	重大事项停牌
2	600271	航天信息	4,644,900.00	0.11	重大事项停牌
3	600690	青岛海尔	3,224,000.00	0.07	重大事项停牌
4	600153	建发股份	330,975.00	0.01	重大事项停牌
5	000876	新 希 望	131,031.00	0.00	重大事项停牌

5.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金管理人旗下子公司易方达资产管理有限公司于本报告期未持有易方达沪深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份额为1,476,505.04份。

§6开放式基金份额变动

	单位:份
报告期期初基金份额总额	4,716,780,194.50
报告期基金总申购份额	307,080,031.39
减:报告期基金总赎回份额	1,357,675,642.22
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,666,184,583.67

§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

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

8.1备查文件目录

1.中国证监会核准易方达沪深300指数证券投资基金募集的文件;

2.中国证监会《关于易方达沪深300指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》;

3.《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合同》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《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托管协议》;

6.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。

易方达基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日

易方达沪深300量化增强证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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
报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

§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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	257,092,332.76份
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。
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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-7,489,865.93
2.本期利润	89,577,047.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.3124
4.期末基金资产净值	484,115,272.78
5.期末基金份额净值	1.8830

注:1.上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。

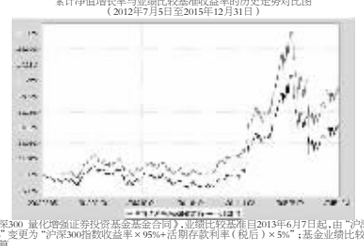
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	18.46%	1.65%	15.65%	1.59%	2.81%	0.06%

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



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88.30%,同期业绩比较基准收益率为49.08%。

§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		
罗山	本基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、指数与量化投资部副总经理	2013-01-08	-	19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基金经理。

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。本基金管理人规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。

4.3.2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%的交易共有6次,其中5次为指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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 投资组合报告附注

4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现说明

2015年第四季度,中国宏观经济运行出现边际改善,工业增加值和社会消费品零售增速企稳,CPI与PPI增速止跌。美联储12月底加息靴子落地,人民币兑美元即期汇率贬值预期加强,长端利率跟幅有所收窄。资本市场方面,经过三季度的快速下跌,A股市场在四季度出现整体反弹,上证指数上涨15.93%,深证综指上涨34.49%。大小盘风格分化明显,上证50指数和沪深300指数分别上涨12.80%和16.49%,中证500指数和创业板指数分别上涨24.40%和30.32%。

作为被动型指数基金,报告期内,本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深300指数,取得与标的指数基本一致的业绩表现。

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1.5214元,本报告期份额净值增长率为16.56%,同期业绩比较基准收益率为16.49%,日跟踪偏离度的均值为0.02%,日跟踪误差为0.026%,年化跟踪误差0.396%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换,短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免,这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复杂进程有所反复,宏观经济政策也将在稳增长、保就业的“下限”和防通胀的“上限”之间动态平衡,当经济运行处于预期的合理区间内,则以调结构为主要着力点。就今年中国经济运行实际情况来看,政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险,并加大“区间调控、定向调控和预调微调”的力度。从长期来看,通过供给侧改革、提高全要素生产率,将是中国经济长期可持续增长的关键手段,我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

目前以沪深300指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于较为合理的位置,具有中长期投资价值。作为被动投资的基金,本基金将继续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,追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,265,170,274.42	98.45
	其中:股票	4,265,170,274.42	98.45
2	固定收益投资	505,883.37	0.01
	其中:债券	505,883.37	0.01
	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	64,608,057.44	1.49
7	其他资产	1,974,919.54	0.05
8	合计	4,332,259,134.77	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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	10,413,737.55	2.15
C	制造业	120,815,941.88	24.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,345,313.95	4.62
E	建筑业	18,166,853.64	3.75
F	批发和零售业	14,317,754.37	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	15,994,975.26	3.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,442,815.08	5.67
J	金融业	157,695,798.70	32.57
K	房地产业	18,011,502.53	3.72
L	租赁和商务服务业	3,183,198.36	0.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,524,348.60	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	641,074.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	4,851,854.84	1.00
S	综合	2,232,428.00	0.46
	合计	420,637,596.96	86.89

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股票投资明细

5.3.1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

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	568,006	20,448,216.00	4.22
2	601988	中国银行	3,291,800	13,200,118.00	2.73
3	600016	民生银行	1,262,311	12,168,678.04	2.51
4	601398	工商银行	2,486,409	11,387,753.22	2.35
5	600030	中信证券	552,077	10,682,689.95	2.21
6	601288	农业银行	3,271,729	10,567,684.67	2.18
7	601166	兴业银行	571,078	9,748,301.46	2.01
8	000001	平安银行	697,223	8,359,703.77	1.73
9	601668	中国建筑	1,243,735	7,885,279.90	1.63
10	000983	西山煤电	1,260,191	7,661,961.28	1.58

5.3.2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

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	600835	上海机电	144,600	4,382,826.00	0.91
2	600894	广日股份	168,654	3,371,393.46	0.70
3	000758	中色股份	188,800	2,809,344.00	0.58
4	000979	中弘股份	421,400	1,685,600.00	0.35
5	600008	首盛集团	182,700	1,341,018.00	0.28

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	123,348.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,348.00	0.03

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	950	123,348.00	0.03

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根据中信证券股份有限公司2015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,中国证监会决定对公司进行立案调查。

根据海通证券股份有限公司2015年9月11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审查、了解客户真实身份违法违规案,被中国证监会予以警告及行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2015年11月27日发布的《收到中国证券监督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》相关规定,被中国证监会予以立案调查。

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上述上市公司的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述五家上市公司的投资判断未发生改变。

除中信证券外,本基金投资