

基金管理人: 易方达基金管理有限公司
基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

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 年度报告摘要

2015年12月31日

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
基金代码: 110020
基金简称: 易方达沪深300ETF联接

资产
单位: 人民币元
2015年12月31日
2014年12月31日
资产总计: 4,386,722,902.87
1,717,621,521.50

注: 1. 本基金管理费前一日基金资产净值减去前一日报告期末HETF公允价值后的余额(若为负数,则取0)的0.25%费率计提;
2. 本基金托管费前一日基金资产净值减去前一日报告期末HETF公允价值后的余额(若为负数,则取0)的0.05%费率计提;

当期发生的基金应支付的税费
单位: 人民币元
本期: 383,400.20
上期: 273,655.24

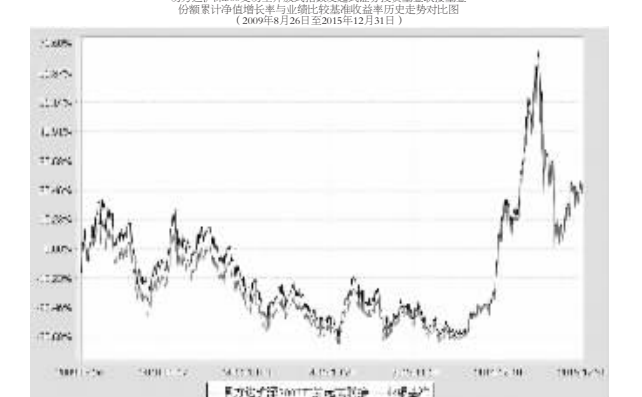
投资策略
本基金主要采取复制法,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并跟踪标的指数的变动及其权重变动进行相应调整,以保持投资组合与标的指数的收益特征基本一致。

负债和所有者权益
单位: 人民币元
本期: 1,717,621,521.50
上期: 1,717,621,521.50

所有者权益
单位: 人民币元
本期: 1,717,621,521.50
上期: 1,717,621,521.50

主要会计科目及余额表
1.1 资产类科目
1.2 负债类科目
1.3 所有者权益类科目

主要财务指标
基金净值增长率: 1.95%
基金份额净值增长率: 1.95%



主要会计科目及余额表 (续)
1.4 损益类科目
1.5 所有者权益类科目

3.1 基金管理人及基金托管人
3.2 基金经理
3.3 基金经理助理

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

4.1 基金管理人及基金托管人
4.2 基金经理
4.3 基金经理助理

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

5.1 报告期内基金投资策略和运作分析
5.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

5.3 报告期内基金投资组合报告
5.4 报告期内基金投资组合报告

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

5.5 报告期内基金投资组合报告
5.6 报告期内基金投资组合报告

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

注: 1. 根据本基金合同的约定, 本基金销售服务费费率由0.50%调整为0.40%, 其他费率由基金管理人根据基金托管人审核并公告后执行。

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

关联方名称
本期: 2015年1月1日至2015年12月31日
上期: 2014年1月1日至2014年12月31日

17 601109 北京银行 33,330,799.15 0.46
18 601390 中国中铁 31,308,652.02 0.43

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 601318 中国平安 161,416,881.72 2.21

序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期末基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 119,547,870.06 1.64