易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：二〇一六年三月二十五日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月22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。普华永道中天会计师事务所(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2015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	易方达深证100ETF联接
基金主代码	110019
交易代码	110019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月1日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,613,559,069.57份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达深证100交易型开放式指数基金
基金主代码	159901
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2006年3月24日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月24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	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

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	本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争最终将年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	深证100价格指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为深证100ETF的联接基金，主要通过投资于深证100ETF追踪业绩比较基准表现，业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。因此，本基金具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。理论上，本基金预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪目标指数，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。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例，以此构建本基金实际的投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证100价格指数
风险收益特征	本基金属股票基金，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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	1,293,815,703.34	-550,106,724.60	-636,276,349.43
本期利润	1,464,175,784.66	1,461,878,588.10	-166,502,995.44
加权平均基金份额本期利润	0.4376	0.1946	-0.0170
本期基金份额净值增长率	21.79%	33.01%	-3.19%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1362	-0.1866	-0.2986
期末基金资产净值	2,969,601,920.50	5,535,499,972.83	5,848,697,509.62
期末基金份额净值	1.1362	0.9329	0.7014

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。

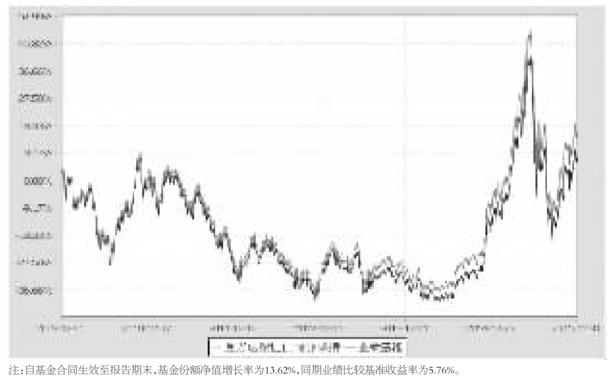
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	25.63%	1.92%	24.48%	1.89%	1.15%	0.03%
过去六个月	-11.65%	2.95%	-12.13%	2.76%	0.48%	0.19%
过去一年	21.79%	2.57%	21.11%	2.46%	0.68%	0.11%
过去三年	56.83%	1.80%	50.98%	1.75%	5.85%	0.05%
过去五年	14.08%	1.63%	8.42%	1.61%	5.66%	0.02%
自基金合同生效起至今	13.62%	1.61%	5.76%	1.61%	7.86%	0.00%

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

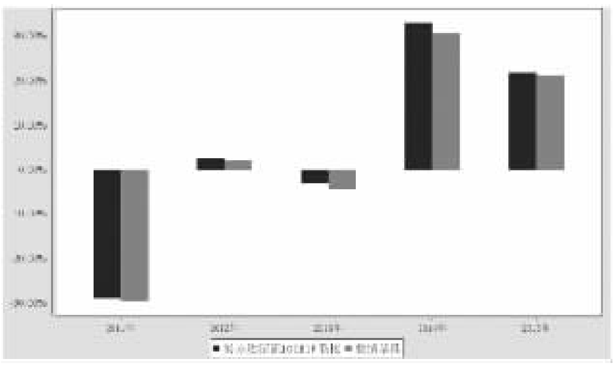
易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009年12月1日至2015年12月31日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为13.62%，同期业绩比较基准收益率为5.76%。

3.2.3 过去五年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

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§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，易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日，注册资本1.2亿元，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承"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，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008年2月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2015年12月31日，易方达旗下共管理88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8269.58亿元。

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		
林飞	本基金的基金经理、易方达50指数证券投资基金的基金经理（自2007年02月10日至2015年06月05日）、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的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理（自2006年07月04日至2015年06月05日）、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（自2013年03月06日至2015年06月05日）、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理	2009-12-01	2015-06-06	12年	博士研究生，曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数与量化投资部总经理助理、易方达沪深300指数证券投资基金基金经理。
王建军	本基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2010-09-27	-	8年	博士研究生，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。
成曦	本基金的基金经理助理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理助理	2015-09-02	-	7年	硕士研究生，曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员。

注：1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期，林飞的"任职日期"为基金合同生效之日，王建军、成曦的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

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 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进行提示，并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制度。

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2015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11次，其中8次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易，3次为不同基金经理管理的组合间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。

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

2015年GDP同比增速为6.9%，其中一二季度基本持平，但三四季度则出现连续微弱下滑。从工业增加值角度来看，上半年工业增加值同比增速呈现出明显的企稳回升势头，但下半年则出现了持续的小幅下滑趋势。CPI全年整体仍维持在较低的水平，同时PPI仍处于长期的负增长状态，特别是下半年呈现加速下滑的趋势，实体经济出现明显的通缩风险。全年来看，货币供应量整体呈现宽松状态，同时2015年连续出现了五次降息，上半年市场增量资金入市明显，上证指数一度冲破5100点。随后在清理场外配资业务的影响下，市场出现了快速的大幅回撤，呈现出明显的去杠杆特征。2015年上证指数涨幅为9.41%，深证100价格指数涨幅为21.80%，作为被动型指数基金，深证100ETF联接基金的单位净值跟随业绩比较基准出现了一定幅度的上涨。

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1.1362元，本报告期份额净值增长率为21.79%，同期业绩比较基准收益率为21.11%，年化跟踪误差为3.5533%，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

展望下一阶段市场，宏观经济整体复苏仍具有相当的不确定性。经济结构的转型和经济增长方式的转变以及潜在经济增速的下行等，是未来一段时间内宏观经济发展的核心问题，解决这一核心问题的有效手段则是进行供给侧改革。同时保持整体经济一定的增速以防范系统性风险，为结构转型创造稳定的环境也是政府经济工作的重点之一。

从中长期的角度来看，随着各项全面深入的市场化改革措施的逐步推进和实施，国内整体经济结构转型将逐见成效。从短期角度来看，随着供给侧改革的推进，宏观经济整体上可能会有一定的阵痛期。同时，国家层面的"一带一路"战略将促进国内企业的"走出去"发展战略和化解国内相对过剩的传统工业产能，有利于经济结构的加速转型。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性和潜在的内生增长力，本基金对中国经济中长期的前景持相对乐观的判断。深证100指数行业分布均衡合理，指数成分股成长性较高，深证100指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金，深证100ETF联接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业绩基准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。期望深证100ETF联接基金为投资者分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了2015年12月31日的资产负债表、2015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：易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	94,275,655.78	108,612,488.02
结算备付金	-	-
存出保证金	750,443.88	664,267.77
交易性金融资产	2,865,515,032.00	5,459,961,765.64
其中：股票投资	2,995,384.00	9,561,424.93
基金投资	2,802,381,648.00	5,220,105,340.71
债券投资	60,138,000.00	230,295,000.00
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	14,005,147.23	36,801.59
应收利息	794,876.55	7,643,005.28
应收股利	-	-
应收申购款	1,475,587.91	1,972,250.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,976,816,743.35	5,578,890,579.01
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	-	-
应付赎回款	5,477,106.22	42,088,877.10
应付管理人报酬	70,463.16	136,881.87
应付托管费	14,092.65	27,376.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	770,358.88	75,791.31
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	882,801.94	1,061,679.53
负债合计	7,214,822.85	43,390,606.18
所有者权益：		
实收基金	2,613,559,069.57	5,933,596,383.88
未分配利润	356,042,850.93	-398,096,411.05
所有者权益合计	2,969,601,920.50	5,535,499,972.83
负债和所有者权益总计	2,976,816,743.35	5,578,890,579.01

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.1362元，基金份额总额2,613,559,069.57份。

7.2 利润表

会计主体：易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	1,468,994,659.20	1,466,163,957.53
1.利息收入	5,419,442.81	10,906,505.63
其中：存款利息收入	1,093,246.14	545,866.22
债券利息收入	4,326,196.67	10,360,639.41
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）	1,291,178,810.02	-558,306,797.81
其中：股票投资收益	-910,597.63	-5,361,132.80
基金投资收益	1,290,792,743.77	-554,076,894.40
债券投资收益	1,258,947.67	1,117,512.29
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	37,716.21	13,717.10
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	170,360,081.32	2,011,985,312.70
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	2,036,325.05	1,578,937.01
减：二、费用	4,818,874.54	4,285,369.43
1.管理人报酬	1,100,997.00	1,432,462.69
2.托管费	220,199.43	286,492.51
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,903,977.57	1,766,893.60
5.利息支出	-	68,083.35
其中：卖出回购金融资产支出	-	68,083.35
6.其他费用	593,700.54	731,437.28
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	1,464,175,784.66	1,461,878,588.10
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	1,464,175,784.66	1,461,878,588.10

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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）	5,933,596,383.88	-398,096,411.05	5,535,499,972.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,464,175,784.66	1,464,175,784.66
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）	-3,320,037,314.31	-710,036,522.68	-4,030,073,836.99
其中：1.基金申购款	2,385,264,060.46	75,115,139.71	2,460,379,200.17
2.基金赎回款	-5,705,301,374.77	-785,151,662.39	-6,490,453,037.16
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）	2,613,559,069.57	356,042,850.93	2,969,601,920.50
项目	上年度可比期间 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）	8,338,655,241.34	-2,489,957,731.72	5,848,697,509.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,461,878,588.10	1,461,878,588.10
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）	-2,405,058,857.46	629,982,732.57	-1,775,076,124.89
其中：1.基金申购款	1,906,613,427.25	-555,885,065.77	1,350,728,361.48
2.基金赎回款	-4,311,672,284.71	1,185,867,798.34	-3,125,804,486.37
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）	5,933,596,383.88	-398,096,411.05	5,535,499,972.83

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：刘晓艳，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

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2009]第947号《关于核准易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的批复》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《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2009年12月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为18,924,975,988.28份基金份额，其中认购资金利息折合4,124,004.79份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

除下述事项外，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。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.2差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）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。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

（5）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	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
易方达深证100交易型开放式指数基金	本基金是该基金的联接基金
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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	409,327,914.82	24.51%	-	-

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基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	564,414.60	0.01%	-	-

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	381,207.83	24.60%	381,207.83	49.50%
关联方名称	上年度可比期间 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
-	-	-	-	-

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,100,997.00	1,432,462.69
其中：支付销售机构的客户维护费	3,914,273.26	6,155,769.63

注：1.基金管理费按调整后的前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.5\%/$当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值＝前一日基金资产净值－本基金持有的深证100ETF前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计提，按月支付；由基金托管人于次月前10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2.客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$H= E \times R/$当年天数

H为每日应计提的客户维护费

E为前一日代销机构保有该基金份额的基金资产净值

R为代销机构的客户维护费率

对于非工作日，则按照前一工作日的保有资产市值计算当日客户维护费。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	220,199.43	286,492.51

注：基金托管费按调整后的前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.1\%/$当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值＝前一日基金资产净值－本基金持有的深证100ETF前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计提，按月支付；由基金托管人于次月前10个工作日内从基金资产中一次性支取。

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
报告期初持有的基金份额	97,330,384.05	97,330,384.05
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	97,330,384.05	-
报告期末持有的基金份额	-	97,330,384.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.64%

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

无。

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国银行	94,275,655.78	761,352.51	108,612,488.02	335,009.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有604,521,787份和1,375,848,117份目标ETF基金份额，占其总份额的比例分别为47.58%和54.27%。

7.4.9 期末（2015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
000876	新希望	2015-08-17	重大事项停牌	18.99	2016-03-02	17.09	80,100	1,521,099.00	1,521,099.00	-

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2015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2015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2015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2,803,855,933.00元，属于第二层次的余额为61,659,099.00元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次9,496,674.93元，第二层次5,450,465,090.71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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标ETF，若本基金因上述事项在目标ETF当日份额净值的基础上，对目标ETF的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标ETF的公允价值从第一层次转出。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金于2015年3月19日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015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(2014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	2,995,384.00	0.10
	其中：股票	2,995,384.00	0.10
2	基金投资	2,802,381,648.00	94.14
3	固定收益投资	60,138,000.00	2.02
	其中：债券	60,138,000.00	2.02
	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	94,275,655.78	3.17
8	其他各项资产	17,026,055.57	0.57
9	合计	2,976,816,743.35	100.00

8.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式（ETF）	易方达基金管理有限公司	2,802,381,648.00	94.37

8.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.3.1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	1,521,099.00	0.05
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	1,474,285.00	0.05
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	2,995,384.00	0.10

8.4 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

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	000876	新希望	80,100	1,521,099.00	0.05
2	300168	万达信息	44,500	1,474,285.00	0.05

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 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	000002	万科A	57,808,877.98	1.04
2	000651	格力电器	41,280,481.50	0.75
3	000001	平安银行	35,740,274.63	0.65
4	000725	京东方A	30,957,101.75	0.56
5	000333	美的集团	28,649,207.32	0.52
6	002024	苏宁云商	24,660,862.47	0.45
7	300059	东方财富	20,430,146.46	0.37
8	000063	中兴通讯	17,710,007.99	0.32
9	000783	长江证券	17,649,657.41	0.32
10	300104	乐视网	17,449,007.37	0.32
11	000100	TCL 集团	17,442,906.00	0.32
12	002450	康得新	16,670,475.13	0.30
13	000166	申万宏源	16,187,552.88	0.29
14	300024	机器人	14,968,174.18	0.27
15	000625	长安汽车	14,327,011.83	0.26
16	002594	比亚迪	14,010,845.03	0.25
17	000768	中航飞机	13,916,730.92	0.25
18	002415	海康威视	12,746,982.04	0.23
19	000538	云南白药	12,557,433.52	0.23
20	000157	中联重科	12,124,486.16	0.22

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。

8.5.2 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	000002	万科A	41,461,047.70	0.75
2	000651	格力电器	30,636,636.99	0.55
3	000001	平安银行	26,337,010.84	0.48
4	000725	京东方A	20,933,598.00	0.38
5	000333	美的集团	20,719,063.32	0.37
6	002024	苏宁云商	16,655,210.70	0.30
7	000776	广发证券	16,410,612.70	0.30
8	300059	东方财富	15,825,218.17	0.29
9	002415	海康威视	15,633,355.42	0.28
10	300104	乐视网	15,063,328.70	0.27
11	300024	机器人	14,031,357.44	0.25
12	000783	长江证券	13,109,214.25	0.24
13	000166	申万宏源	12,992,552.49	0.23
14	000100	TCL 集团	12,377,138.85	0.22
15	002450	康得新	12,163,895.76	0.22
16	000063	中兴通讯	11,783,951.98	0.21
17	000625	长安汽车	11,775,019.04	0.21
18	002594	比亚迪	11,529,300.01	0.21
19	000768	中航飞机	10,166,952.85	0.18
20	000538	云南白药	9,255,949.12	0.17

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。

8.5.3 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	934,384,360.08
卖出股票收入（成交）总额	735,440,942.06

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。

8.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,138,000.00	2.03
	其中：政策性金融债	60,138,000.00	2.03
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	60,138,000.00	2.03

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150416	15农发16	600,000	60,138,000.00	2.03

8.8 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。

8.9 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.10 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。

8.11 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。

8.12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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1根据广发证券股份有限公司2015年8月26日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，被中国证监会予以立案调查。

根据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。

在上述公告公布后，本基金管理人对广发证券进行了进一步了解和分析，认为上述处罚不会对广发证券的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对广发证券的投资判断未发生改变。

本基金是深证100ETF的联接基金，本基金股票投资部分本报告期末并未持有广发证券，本基金的目标ETF对广发证券维持了标准配置。

除广发证券外，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。

8.13.2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。

8.13.3 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	750,443.88
2	应收证券清算款	14,005,147.23
3	应收股利	-
4	应收利息	794,876.55
5	应收申购款	1,475,587.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,026,055.57

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000876	新希望	1,521,099.00	0.05	重大事项停牌

§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
63,683	41,040.14	901,715,049.78	34.50%	1,711,844,019.79	65.50%

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	134,535.08	0.0051%

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(2009年12月1日)基金份额总额	18,924,975,988.28
本报告期期初基金份额总额	5,933,596,383.88
本报告期基金总申购份额	2,385,264,060.46
减：本报告期基金总赎回份额	5,705,301,374.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,613,559,069.57

§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

2015年6月2日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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7年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为40,000.00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	
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	417,534,909.66	25.00%	388,851.05	25.10%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	409,327,914.82	24.51%	381,207.83	24.60%	-
海通证券	1	842,962,477.66	50.48%	779,324.44	50.30%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	73,435,849.02	1.62%
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	564,414.60	0.01%
海通证券	-	-	-	-	-	-	4,448,034,395.26	98.36%

易方达基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日