

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
送出日期:二〇一四年三月二十八日

5.1 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。本基金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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月24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。投资人投资于基金前应仔细阅读基金的招募说明书及基金合同。

本年度报告摘要向基金份额持有人披露，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

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2013年1月1日起至2013年12月31日止。

5.2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	110031
交易代码	110031
基金运作方式	契约型开放式,份额分级,联接基金
基金合同生效日	2012年8月21日
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
报告期末基金的份额总额	115,025,410.08份
基金份额的涨跌额	-不定期

2.2 基金产品说明

投资目标

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
基金名称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	610000
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2012年8月21日
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
报告期末基金的份额总额	115,025,410.08份
基金份额的涨跌额	-不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称

基金名称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	610000
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2012年8月21日
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
报告期末基金的份额总额	115,025,410.08份
基金份额的涨跌额	-不定期

2.2.1 基金产品说明

投资目标

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
本基金为易方达恒生中国企业交易型ETF的联接基金,主要通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。	本基金为易方达恒生中国企业交易型ETF的联接基金,主要通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。	
投资策略	本基金的主要投资策略为:1)资产配置策略:本基金将根据宏观经济形势、政策环境、市场状况等对股票、债券、货币市场工具等大类资产进行配置;2)股票投资策略:本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。	本基金的主要投资策略为:1)资产配置策略:本基金将根据宏观经济形势、政策环境、市场状况等对股票、债券、货币市场工具等大类资产进行配置;2)股票投资策略:本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(人民币计价)-0.5%×存款利率(税后)	X% X% X%
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险收益特征与标的指数相似,属于高风险、高收益的基金品种。	本基金为股票型基金,风险收益特征与标的指数相似,属于高风险、高收益的基金品种。

2.2.2 基金产品说明

投资目标

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
本基金为易方达恒生中国企业交易型ETF的联接基金,主要通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。	本基金为易方达恒生中国企业交易型ETF的联接基金,主要通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金通过投资于易方达恒生中国企业交易型ETF,紧密跟踪标的指数,并力争在扣除相关费用后获得与标的指数相似的收益。本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。	
投资策略	本基金的主要投资策略为:1)资产配置策略:本基金将根据宏观经济形势、政策环境、市场状况等对股票、债券、货币市场工具等大类资产进行配置;2)股票投资策略:本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。	本基金的主要投资策略为:1)资产配置策略:本基金将根据宏观经济形势、政策环境、市场状况等对股票、债券、货币市场工具等大类资产进行配置;2)股票投资策略:本基金将通过量化分析和基本面分析相结合的方法,精选出具有代表性的公司股票进行配置,力求在风险调整后的收益方面超越标的指数。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(人民币计价)-0.5%×存款利率(税后)	X% X% X%
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险收益特征与标的指数相似,属于高风险、高收益的基金品种。	本基金为股票型基金,风险收益特征与标的指数相似,属于高风险、高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目

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	交通银行股份有限公司
姓名	张伟	黄宇
信息披露负责人	020-38797988	95669
联系电话	电子邮件	csd@fund.eastmoney.com
客户服务电话	4000 881 8888	95669
传真	020-38797948	021-62071216

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	无	无
中行	无	无
注册地址	无	无
办公地址	无	无
邮政编码	无	无

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网址

基金年度报告备置地点

6.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

项目	本期	2013年1月21日至2013年12月31日	2012年1月21日至2012年12月31日
本期期间数据			
本利滚存收益	9,394,631.49	21,266,307.44	
本期利润	-844,094.96	37,816,500.22	
加权平均基金份额本期利润	-0.0054	0.0204	
本期基金份额净值增长率	-6.05%	7.68%	
2013年末			
2012年末			
本期期末可供分配基金份额利润	0.0030	0.0026	
期末基金总资产净值	116,301,200.06	316,260,531.60	
期末基金总份额净值	1.0000	1.0000	

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,计价费用影响实际收益水平要略低。

2.本期已实现收益指基金本期收入扣减去各种费用后的余额,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除非相关费用后的余额,即为本期实现收益。

3.本基金合同于2012年8月21日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金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

注:1.按基金合同和招募说明书的规定,本基金的建仓期为六月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同第十一部分(三)投资比例的有关规定。

2.本期的业绩评价基于基金管理人对本基金的定期报告和半年报。

3.自基金合同生效起报告期间,基金净值增长率变动率与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金自基金合同生效以来每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较