

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：二〇一五年三月二十七日

## § 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。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金经理签发。

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2015年3月23日复核了本报吿中的财务指标、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摘要。

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，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料已审计。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，请投资者注意查阅。

本报告期自2014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联接基金
基金代码	161003
交易账户	161003
基金运作方式	契约型开放式，指数基金，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
份额期末余额	65,089,698.52份
基金份额的存续期	不定期

## 2.1.1 目标基金基本情况

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
基金代码	161000
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
基金销售机构上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年8月22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	交通银行股份有限公司

## 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将通过股票被动投资，主要通过股票被动投资，实现对标的指数的跟踪。本基金将主要采取完全复制法进行投资，即申购并持有的中国企业的成份股构成和权重与该指数构成和权重相同，根据中国企业在该指数中的地位和重要性，定期对基金的资产配置进行调整，从而确保基金的资产配置能够尽可能地与标的指数的构成和权重相一致。本基金将通过定期和不定期的公开公平交易制度和控制方法，定期对基金的资产配置进行调整，从而确保基金的资产配置能够尽可能地与标的指数的构成和权重相一致。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为恒生中国企业交易型开放式指数基金(161000)最近一个交易日的收盘价乘以1.05%后的加权平均数。
风险收益特征	本基金是ETP联接基金，通过股票型基金的运作，分享中国经济发展的成果，本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相似，本基金属于股票型基金，是高风险、高收益的投资品种。
风险收益特征	本基金主要通过投资于易方达恒生中国企业交易型开放式指数基金(161000)实现对标的指数的跟踪，因此本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相似，本基金属于股票型基金，是高风险、高收益的投资品种。

## 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将通过股票被动投资，主要通过股票被动投资，实现对标的指数的跟踪。本基金将主要采取完全复制法进行投资，即申购并持有的中国企业的成份股构成和权重与该指数构成和权重相同，根据中国企业在该指数中的地位和重要性，定期对基金的资产配置进行调整，从而确保基金的资产配置能够尽可能地与标的指数的构成和权重相一致。本基金将通过定期和不定期的公开公平交易制度和控制方法，定期对基金的资产配置进行调整，从而确保基金的资产配置能够尽可能地与标的指数的构成和权重相一致。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为恒生中国企业交易型开放式指数基金(161000)最近一个交易日的收盘价乘以1.05%后的加权平均数。
风险收益特征	本基金是ETP联接基金，通过股票型基金的运作，分享中国经济发展的成果，本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相似，本基金属于股票型基金，是高风险、高收益的投资品种。
风险收益特征	本基金主要通过投资于易方达恒生中国企业交易型开放式指数基金(161000)实现对标的指数的跟踪，因此本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相似，本基金属于股票型基金，是高风险、高收益的投资品种。

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	陈军	汤晓惠
联系电话	020-38778888	95559
电子邮箱	service@efund.com.cn	tangy@cboc.com
客户服务电话	400 881 8088	95559
传真	020-38799488	021-62701216

## 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
注册地址	无	无
办公地址	无	无
办公电话	无	无

## 2.5 投资运作方式

基金管理人声明正刊网网址	http://www.efund.com.cn
基金管理人声明备查公告网址	广州市天河区珠江新城珠江东街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

项目	2014年	2013年	2012年8月21日至2012年12月31日
本期已实现收益	451,700.06	9,384,631.49	21,266,370.44
本期利润	9,295,366.45	-8,444,894.95	37,816,500.22
加权平均基金份额利润	0.0977	-0.0543	0.0224
本期基金份额净值增长率	12.66%	-6.85%	7.68%

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将低于相应的净值。

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.期末可供分配利润，为来年未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金于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。

5.基金净值表现指标

6.2.1 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(%)	业绩比较基 准收益率(%)	收益类型差 值(%)
过去三个月	14.36%	14.91%	1.44%
过去六个月	14.63%	14.50%	1.23%
过去一年	12.66%	11.0%	10.70%
过去三年	-	-	-
过去五年	-	-	-
自基金合同生效以来	13.00%	11.2%	1.78%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 自基金合同生效以来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

3.2.4 对于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净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

(2012年8月21日至2014年12月31日)

注1:本基金的业绩比较基准已经转换为人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金净值增长率为13.00%，同期业绩比较基准收益率为17.28%。

3.2.5 基金合同生效以来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

3.2.6 对于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净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

(2012年8月21日至2014年12月31日)

注:本基金合同生效日为2012年8月21日，基金合同生效当期的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2012年8月21日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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

经中国证监会证监许可[2001]4号文批准，本基金管理人于2001年4月17日成立，注册资本1.2亿元，旗下设有北京、广州、上海、南京、成都分公司和香港子公司，资产管理部门。本基金管理人秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在规范的前提下，通过专业运作和团队合作实践稳健经营”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，本基金管理人取得全国社会保障基金投资管理资格；2006年5月，获得企业年金基金投资管理人资格；2007年12月，获得合格境内机构投资者（QDII）资格；2008年7月，获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日，本基金管理人旗下共管理9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组合规模达4200亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理助理）及其管理基金的经历

本基金管理人目前没有基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要人员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 代理人对报告期内本基金运作遵规守信的情况的说明

本基金的管理人严格按照《证券投资基金从业人员职业道德行为准则》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不从事违法违规、损害基金持有人利益的行为。

4.4 代理人对报告期内公司治理情况的专项说明

本基金的管理人严格按照《证券投资基金从业人员职业道德行为准则》的规定，建立健全的内部控制制度，完善公司治理结构，促进公司规范运作。

4.5 公平交易制度和控制方法

本基金的管理人制定了《公平交易制度》，并经公司董事会审议通过。

4.6 基金管理人对报告期内公司公平交易制度的执行和监督情况的说明

本基金的管理人严格按照《公平交易制度》的规定，执行公平交易制度。

4.7 基金管理人对报告期内公司异常交易的专项说明

本基金的管理人严格按照《异常交易监控指引》的规定，执行异常交易监控制度。

4.8 基金管理人对报告期内公司内幕交易的专项说明

本基金的管理人严格按照《内幕交易监控指引》的规定，执行内幕交易监控制度。

4.9