

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基联接基金

[2015] 年度报告摘要

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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8月20日复核了本报中的财务指标、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。

本年度报告摘要能摘要自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达恒生中国企联接(ODDI)
基金代码	110031
交易方式	申购赎回
基金合同生效日	2012年3月21日
基金管理人	易达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金总资产	2,424,564,547.04份
基金合同的延续	

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，力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开放式指数证券投资基，主要通过投资于易方达恒生中国企业ETF份额，实现对标的指数的紧密跟踪。本基金将通过在一级市场申购ETF份额，再通过二级市场卖出ETF份额，从而采用实物申购或赎回方式或二级市场交易的方式进行基金份额的转换，从而实现对标的指数的跟踪。为进行被动管理，应付赎回，降低跟踪误差以及提高资金效率，本公司可能会适时调整基金的资产配置，从而可能对基金的收益造成影响。	本基金的资产配置比例为：现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过5%，股票投资比例不低于85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过5%，股票投资比例不低于85%。
投资策略	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证券投资基，实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现将与易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基的业绩表现密切相关。此外，本基金将主要通过投资于香港上市的证券交易所上市的股票，从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算) 收益率x0.96+活期存款利息(税后) x0.04
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

2.2.1 目标基金基本情况

投资目标	紧密跟踪标的指数，力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开放式指数证券投资基，主要通过投资于易方达恒生中国企业ETF份额，实现对标的指数的紧密跟踪。本基金将通过在一级市场申购ETF份额，再通过二级市场卖出ETF份额，从而采用实物申购或赎回方式或二级市场交易的方式进行基金份额的转换，从而实现对标的指数的跟踪。为进行被动管理，应付赎回，降低跟踪误差以及提高资金效率，本公司可能会适时调整基金的资产配置，从而可能对基金的收益造成影响。	本基金的资产配置比例为：现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过5%，股票投资比例不低于85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过5%，股票投资比例不低于85%。
投资策略	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证券投资基，实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现将与易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基的业绩表现密切相关。此外，本基金将主要通过投资于香港上市的证券交易所上市的股票，从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算) 收益率x0.96+活期存款利息(税后) x0.04
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

2.2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，力求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
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证券投资基，实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现将与易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基的业绩表现密切相关。此外，本基金将主要通过投资于香港上市的证券交易所上市的股票，从而实现对标的指数的紧密跟踪。	本基金的资产配置比例为：现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过5%，股票投资比例不低于85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过5%，股票投资比例不低于85%。
投资策略	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证券投资基，实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现将与易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基的业绩表现密切相关。此外，本基金将主要通过投资于香港上市的证券交易所上市的股票，从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算) 收益率x0.96+活期存款利息(税后) x0.04
风险收益特征	本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的回报，具有与标的指数相当的风险收益特征。本基金主要投资于境外证券市场，承担汇率风险以及境外市场的风险。

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
法定代表人	张志洲	臧震
信息披露负责	020-38790088	966569
电子邮箱	service@fund.eastmoney.com	tongyuan@cboc.com.cn
客户服务电话	400 881 0088	966569
传真	020-38790488	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	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
中文名称	香港汇丰银行有限公司	香港汇丰大酒店一号
注册地址	无	香港九龙深水埗区1号汇丰中心1期6楼
办公地址	无	香港九龙深水埗区1号汇丰中心1期6楼
邮政编码	无	无

2.5 信息披露方式

项目	披露投资顾问	披露境外资产托管人
披露基金半年度报告的代理人互联网网址	http://www.efund.com.cn	
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路90号广州银行大厦43楼	

3 主要会计数据和财务指标

项目	金额单位：人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	27,920,264.64
本期利润	-181,807,076.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1330
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1715
期末基金资产净值	2,840,438,162.02
期末基金份额净值	1.1715

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 资金价值表现

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(%)	份额净值增长 率标准差(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去一个月	-5.80%	1.74%	-7.03%	1.74%	1.23%	0.06%
过去三个月	1.22%	4.65%	1.08%	3.26%	-0.10%	
过去六个月	3.67%	1.61%	7.04%	1.59%	-4.27%	-0.06%
过去一年	18.84%	1.36%	23.15%	1.42%	-4.75%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至 今	17.15%	1.20%	26.60%	1.20%	-9.45%	-0.10%

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



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。
2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为17.15%，同期业绩比较基准收益率为26.60%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理的情况

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1亿元人民币，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京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、广东三盛股权投资有限公司等三个子公司。易达秉承“诚信于市场，取信于社会”的经营理念，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，易达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月，易达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月，易达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008年2月，易达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2015年6月30日，易达旗下共持有2只开放式基金，15只封闭式基金和多个全国社保基金投资组合、企业年金及特定客户资产管理业务，资产总规模5343.85亿元。

4.2 基金经理（基金经理）的基本情况

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内基金运作遵规守信的说明

本报告期内，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，以诚信为本，取信于社会，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

4.4 管理人对公平交易情况的专项说明

本基金未聘请境外投资顾问。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

本基金管理人通过建立纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.6 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本基金未聘请境外投资顾问。

4.7 管理人对报告期内基金投资决策的主要内容简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.8 管理人对报告期内基金运作遵规守信的情况说明

本报告期内，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，以诚信为本，取信于社会，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

4.9 管理人对公平交易情况的专项说明

本基金未聘请境外投资顾问。

4.10 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同