

# 信息披露 Disclosure

## 易方达上证50指数分级证券投资基金

### [2015] 第三季度报告

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

报告送出日期：二〇一五年十月二十四日

重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，确认不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

**§ 2 基金产品概况**

基金简称：易方达上证50指数分级50分級

基金代码：6402048

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年6月16日

报告期末基金份额总额：769,764,832.20份

报告期末基金份额净值：1.0000元

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

投资策略：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股以及可能被调入成份股的股票，同时可少量投资于非成份股（包括A股、B股、债券、权证、货币市场工具、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金类理财产品、股票期权等金融衍生品）和现金类资产，以降低跟踪误差。本基金力争在扣除必要的交易费用后，使基金的净值增长率与标的指数的净值增长率的偏离程度控制在4%以内，年度跟踪误差控制在5%以内。

业绩比较基准：上证50指数收益率×95%+短期利率×5%

风险收益特征：从投资特征看，本基金属于股票型基金，风险等级为高风险，预期收益、预期风险均较高；从类别特征看，B类份额具有高风险、收益较高的特征。

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

报告期利润：2015年7月1日起至9月30日止。

**§ 3 主要财务指标和基金净值表现**

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -714,478,371.79

2.本期利润 -727,966,337.46

3.期间平均基金份额本期利润 -0.2622

4.期末基金份额净值 0.9977

5.期末基金资产净值 4,000.01

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. 期末基金份额净值=净资产/基金份额

4. 期末基金资产净值=基金资产总值-负债总值

5. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

6. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

7. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

8. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

9. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

10. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

11. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

12. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

13. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

14. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

15. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

16. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

17. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

18. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

19. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

20. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

21. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

22. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

23. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

24. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

25. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

26. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

27. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

28. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

29. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

30. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

31. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

32. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

33. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

34. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

35. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

36. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

37. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

38. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

39. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

40. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

41. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

42. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

43. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

44. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

45. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

46. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

47. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

48. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

49. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

50. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

51. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

52. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

53. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

54. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

55. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

56. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

57. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

58. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

59. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

60. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

61. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

62. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

63. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

64. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

65. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

66. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

67. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

68. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

69. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

70. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

71. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

72. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

73. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

74. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

75. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

76. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

77. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

78. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

79. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

80. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

81. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

82. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

83. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

84. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

85. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

86. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

87. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

88. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

89. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

90. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

91. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

92. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

93. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

94. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

95. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

96. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

97. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

98. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

99. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

100. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

101. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

102. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

103. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

104. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

105. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

106. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

107. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

108. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

109. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

110. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

111. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

112. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

113. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

114. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

115. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

116. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

117. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

118. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

119. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

120. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

121. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

122. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

123. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值

124. 本期基金份额净值增长率=净值增长/份额净值