易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业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、净值表现和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。

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	易方达瑞享混合	
基金主代码	001437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月26日	
报告期末基金份额总额	159,264,662.96份	
投资目标	本基金在控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值。	
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例,严格遵守低估值的股票投资逻辑,以绝对收益为目标,力争获得稳健、持续的投资收益。	
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率(税后)+2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
下属分级基金的交易代码	001437	001438
报告期末下属分级基金的份额总额	159,192,620.56份	72,042.39份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
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)	
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
1.本期已实现收益	259,862.51	13,185,989.79
2.本期利润	328,730.51	13,186,006.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0015
4.期末基金资产净值	193,066,570.48	72,165.10
5.期末基金份额净值	1.213	1.002

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本报告期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

易方达瑞享混合I

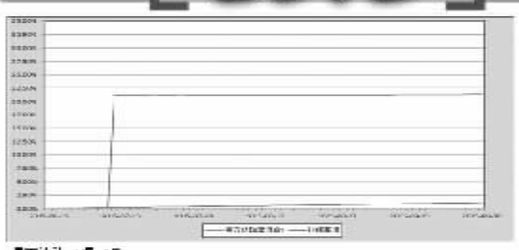
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.30%	2.64%	1.00%	0.01%	20.30%	2.63%

易方达瑞享混合E

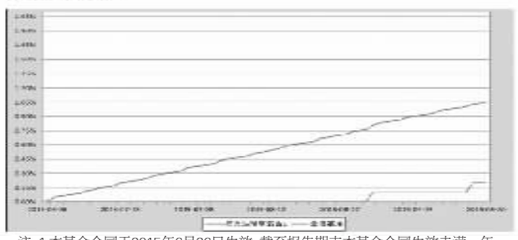
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.20%	0.02%	1.00%	0.01%	-0.80%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月26日至2015年9月30日)
易方达瑞享混合I



易方达瑞享混合E



注:1.本基金合同于2015年6月26日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3. 自基金合同生效至报告期末,I类基金份额净值增长率为21.30%,E类基金份额净值增长率为0.20%,同期业绩比较基准收益率为1.05%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
廖振华	本基金的基金经理、易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理	2015-06-26	-	7年	硕士研究生,曾任招商证券研究员,易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年前三季度,A股市场先涨后跌。年初至6月中市场指数普遍快速、大幅上涨,但在6月中旬触及高点后又快速下跌,并在三季度延续了下跌趋势。2015年三季度,上证综指、深证成指、沪深300指数、中小板指和创业板指分别下跌了28.63%、30.34%、28.39%、26.57%、27.14%。2015年前三季度,上证综指、深证成指和沪深300指数分别下跌了5.62%、9.32%和9.36%,已回吐了前期的全部涨幅;中小板指和创业板指分别上涨了24.14%和41.51%,由于前期涨幅巨大,即使经历了大幅下跌,仍保留了可观的年内涨幅。

前三季度,政府采取了一系列的货币政策和财政政策应对宏观经济的下滑,多次进行了降息和降准,同时加快了基建项目的审批速度。此外,政府为了促进经济结构的转型升级,第一次在总理政府工作报告中提出"互联网+"和"把一批新兴产业培育成主导产业",并通过政府在各层面的简政放权和一系列对小微企业的扶植措施实质性地推动"大众创业、万众创新";国务院还提出"中国制造2025"规划以提升我国制造业的发展质量和持续竞争力。但是,政策作用的充分发挥需要一定时间,而短期场内融资和场外配资规模迅速增长推动指数快速、大幅上涨,加大了市场的投机氛围和风险积累。6月份以来,部分个股出现下跌引发高杠杆配资账户的平仓,并扩散到其他杠杆资金,市场风险偏好转变,出现了剧烈回调。整体看,互联网、计算机软件、传媒、通讯等为代表的新兴行业相关指数表现仍明显好于以传统行业为主的行业指数。

由于新股发行暂停,本基金前期执行的绝对收益策略受到限制,期内仍然坚守绝对收益的思路,回避了股票市场较大的下跌损失,通过存款、回购等货币管理工具确保基金的保值增值。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金I类基金份额净值为1.213元,本报告期份额净值增长率为21.30%;E类基金份额净值为1.002元,本报告期份额净值增长率为0.20%;同期业绩比较基准收益率为1.00%。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,经济方面,随着政府稳定汽车、地产行业等托底宏观经济的措施的进一步出台,前期的政策也将逐步显现效果,经济已经逐步出现了一些企稳的迹象。证券市场方面,在经历了前期的大幅回调后,无论在以中小市值公司为主的创业板、中小板内,还是在以大市值公司为主的主板内,均出现了一批股价调整至中长期合理价值区间的优质公司,未来市场进一步大幅下跌的风险不大,我们对宏观经济的看法也逐步转向乐观。

未来随着经济基本面的改善,A股市场仍具备上行的潜力,但短期需要时间进行市场的自我修复,只有当市场恢复到一个机制正常的状态时,A股市场才会吸引更多的投资者。

基于对经济和证券市场的判断,我们认为未来一个阶段的市场将体现出较强的选股优势。市场系统性下跌将让我们再次获得用较低成本买到优质企业的机会。我们将继续坚持绝对收益的思路,严格控制基金的回撤水平,为投资者争取更高的绝对收益。

由于7月初A股的IPO市场发行暂停,以新股申购为主的绝对收益策略将难以实施,我们将继续通过债券及流动性较好的货币市场工具投资作为下一阶段的主要投资策略。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	106,110,000.00	50.71
	其中:债券	106,110,000.00	50.71
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	69,950,424.93	33.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	31,578,860.56	15.09
7	其他资产	1,612,754.52	0.77
8	合计	209,252,040.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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
本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,910,000.00	26.36
	其中:政策性金融债	50,910,000.00	26.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	55,200,000.00	28.58
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	106,110,000.00	54.94

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150207	15国开07	400,000	40,872,000.00	21.16
2	041555012	15重汽CP001	100,000	10,077,000.00	5.22
3	041576002	15杭城建CP001	100,000	10,061,000.00	5.21
4	041551023	15沪强生CP001	100,000	10,043,000.00	5.20
5	150202	15国开02	100,000	10,038,000.00	5.20

5.6 报告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。

5.7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。

5.8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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,542,672.01
5	应收申购款	70,082.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,612,754.52

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
报告期期初基金份额总额	160,122,734.71	53,678,966.58
报告期基金总申购份额	159,465,842.91	40,000,262,481.01
减:报告期基金总赎回份额	160,395,957.06	40,053,869,405.20
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	159,192,620.56	72,042.39

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
单位:份

项目	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	-	-
报告期买入/申购总份额	158,645,384.75	-
报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期末管理人持有的本基金份额	158,645,384.75	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	99.66	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	转入	2015-08-05	45,766,387.28	55,423,095.00	-
2	转入	2015-08-19	56,118,641.62	67,959,675.00	-
3	转入	2015-08-28	56,760,355.85	68,736,790.93	-
合计			158,645,384.75	192,119,560.93	

§8备查文件目录

8.1备查文件目录
1.中国证监会准予易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金注册的文件;
2.《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3.《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点
广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一五年十月二十四日

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商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、净值表现和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。

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	易方达上证中盘ETF
基金主代码	510130
交易代码	510130
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年3月29日
报告期末基金份额总额	95,885,089.00份
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。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资,即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生,基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,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,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
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	-76,575,054.70
2.本期利润	-157,019,165.84
3.加权平均基金份额本期利润	-1.6157
4.期末基金资产净值	335,339,190.69
5.期末基金份额净值	3.4973

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.本基金已于2010年5月28日进行了基金份额折算,折算比例为0.34394741。

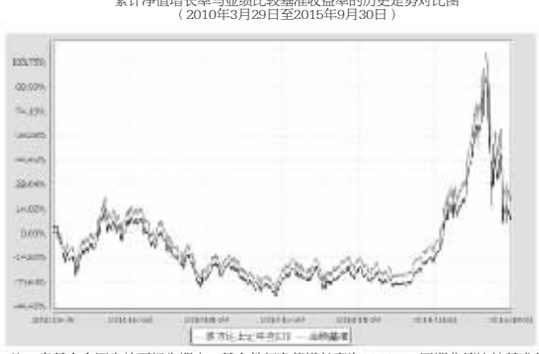
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	-30.26%	3.90%	-31.39%	3.95%	1.13%	-0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010年3月29日至2015年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为20.29%,同期业绩比较基准收益率为8.53%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张胜记	本基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金的基金经理、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的基金经理、易方达50指数证券投资基金的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、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助理	2010-03-29	-	10年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员,易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内,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2次,其中1次为指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金经理管理的基金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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度,国内经济增速仍在低位徘徊。8月工业增加值同比增长6.1%,固定资产投资增速9.1%,继续回落。地产投资增速回落到-1.1%,全国地产销售面积同比增长15%,增速回落。物价水平整体低迷,8月份消费品价格指数CPI为2%,工业品出厂价格指数PPI为-5.9%;货币投放力度加大,广义货币供应量M2同比增长13.3%处于较高水平。在经济基本面情况不佳的背景下,政府政策的放松力度进一步加大。报告期内,央行再次降息25个bp、降低银行存款准备金率0.5个百分点,同时改革银行存款准备金考核制度,由现行的时点法改为平均法考核日均比例,效果相当于再降准1个百分点左右。汇率方面,央行决定完善人民币兑美元汇率中间价报价制度,每日中间价的形成主要参考上日银行间外汇市场收盘汇率,出现一次性贬值3%左右。另一方面,进一步刺激住房消费,在不实施"限购"措施的城市,对居民家庭首次购买普通住房的商业性个人住房贷款,最低首付款比例向下调整5个百分点至25%;进一步刺激汽车消费,要求地方不得对新能源车限行限购,以及1.6升排量以下乘用车购置税减半。

资本市场上,监管部门大力清理伞形信托、场外配资等不规范的加杠杆投资股票行为,资金流出效应明显,A股从高位大幅回落。报告期内,上证指数大跌28.63%,大小盘风格差异不大,在政府救市资金的支持下,大盘蓝筹股跌幅较小,上证中盘指数跌幅达31.4%。从行业表现来看,钢铁、采掘、非银行金融、家用电器等板块跌幅居前;银行、医药、食品饮料等行业跌幅较小。

上证中盘ETF基金属于完全跟踪指数的证券投资基金。报告期内,本基金跟随指数的成分股变化进行日常调整操作,控制基金组合与指数权重基本一致。

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3.4973元,本报告期份额净值增长率为-30.26%,同期业绩比较基准收益率为-31.39%,年化跟踪误差1.99%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股市涨跌是对宏观经济周期波动的反映,中国经济增长的波动幅度较大是决定A股市场大幅波动的主要原因。展望2015年第四季度,经历快速大幅下跌后的A股市场,整体估值过高的风险已经基本释放,清理不规范场外配资的行动已经接近尾声,投资者信心正在逐步恢复。另一方面,财政刺激政策将逐渐发挥效果,房地产、汽车等行业在政策鼓励下有望回暖,多次降息降准带来的货币宽松效应将进一步显现,中国经济的基本面前景良好,股市对长期资金的吸引力在不断增强。A股市场有望在震荡调整中逐渐走出底部、重新进入上升通道,业绩成长性高的板块将重新成为市场的主导。

长期来看,推动我国经济增长的三大原动力依然存在。首先是制度改革,十八届三中全会明确中国在推进经济、文化、社会等领域的改革路线,有望释放出更多的生产力;第二是资源、技术与人力资本等生产要素的升级还在持续;最后是我国处于快速的工业化、城市化以及区域经济一体化进程中,中长期经济增长前景良好,本基金对市场的长期走势保持乐观。作为完全被动投资基金,本基金下阶段将继续坚持完全复制基准指数的投资策略,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望上证中盘ETF为投资者分享中国经济的未来成长提供良好的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	330,013,726.78	98.25
	其中:股票	330,013,726.78	98.25
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,677,050.24	1.69
7	其他资产	197,213.97	0.06
8	合计	335,887,990.99	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	3,044,306.00	0.91
B	采矿业	18,859,384.90	5.62
C	制造业	117,403,695.26	35.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,026,611.47	9.25
E	建筑业	15,364,098.86	4.58
F	批发和零售业	12,942,601.24	3.86
G	交通运输、仓储和邮政业	24,993,311.78	7.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,027,117.19	4.78
J	金融业	41,057,858.28	12.24
K	房地产业	34,789,416.11	10.37
L	租赁和商务服务业	2,858,414.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	2,269,124.00	0.68
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	7,107,845.79	2.12
S	综合	2,269,941.90	0.68
	合计	330,013,726.78	98.41

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	181,906	8,402,238.14	2.51
2	601939	建设银行	1,476,634	7,648,964.12	2.28
3	600795	国电电力	1,510,800	6,088,524.00	1.82
4	601618	中国中冶	748,534	5,831,079.86	1.74
5	601919	中国远洋	491,200	5,712,656.00	1.70
6	600900	长江电力	398,077	5,712,404.95	1.70
7	600011	华能国际	629,076	5,441,507.40	1.62
8	600705	中航资本	346,100	5,264,181.00	1.57
9	601727	上海电气	455,300	5,113,019.00	1.52
10	601377	兴业证券	637,692	4,993,128.36	1.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7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。

5.8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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	180,992.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,097.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.18
8	其他	-
9	合计	197,213.97

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601618	中国中冶	5,831,079.86	1.74	重大事项停牌
2	601919	中国远洋	5,712,656.00	1.70	重大事项停牌
3	600900	长江电力	5,712,404.95	1.70	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	105,085,089.00
报告期基金总申购份额	751,200,000.00
减:报告期基金总赎回份额	760,400,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	95,885,089.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
2.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点
广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一五年十月二十四日

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商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、净值表现和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。

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

2.1基金产品概况

基金简称	易方达上证中盘ETF联接
基金主代码	110021
交易代码	110021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月31日
报告期末基金份额总额	214,660,890.75份
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。力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为上证中盘ETF的联接基金。上证中盘ETF是采用完全复制法实现对上证中盘指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于上证中盘ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,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各规、风险、收率、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上证中盘ETF的买卖。待指数引生金融产品推出以后,基金管理人在履行适当程序后,本基金可以选定运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为上证中盘ETF的联接基金,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于上证中盘ETF追踪业绩比较基准,具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510130
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年3月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年6月23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	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

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。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资,即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生,基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混