# 易方达黄金交易型开放式证券投资基金

2015年9月30日

## 【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 | 易方达黄金ETF |
| 场内简称 | 黄金ETF |
| 基金主代码 | 159934 |
| 交易代码 | 159934 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2013年11月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 38,862,646.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产净值的95%。为紧密追踪业绩比较基准的表现,本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。当黄金现货实盘合约流动性不足或黄金现货延期交收合约投资成本更低时,本基金可适当投资于黄金现货延期交收合约。为降低基金费用对跟踪偏离度与跟踪误差的影响,本基金可以将持有的黄金现货合约借出给信誉良好的机构,取得租赁收入。 |
| 业绩比较基准 | 上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约收盘价 |
| 风险收益特征 | 本基金追踪上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约收盘价表现,具有与上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约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 | -1,228,999.66 |
| 2.本期利润 | -2,766,859.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0971 |
| 4.期末基金资产净值 | 89,309,013.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.2981 |

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2013年12月11日进行了基金份额折算,折算比例为0.40739099。

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 | -2.01% | 0.96% | -1.89% | 0.96% | -0.12% | 0.00% |

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

易方达黄金交易型开放式证券投资基金
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
(2013年11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-6.38%,同期业绩比较基准收益率为-5.76%。

§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 | | |
| 林伟斌 | 本基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、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、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理 | 2013-11-29 | - | 7年 | 博士研究生,曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员,易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。 |

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公平交易制度的专项说明

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

进入2015年7月份,美国二季度宏观经济数据略超预期,导致美联储将在三季度末加息的预期加剧,国际黄金价格出现了一波快速下跌,COMEX黄金价格7月单月下跌了6.55%。进入8月份,美联储三季度加息预期降温,美元指数回调,以及人民币汇率贬值等因素,使得国际黄金价格稍有反弹。最终,三季度COMEX黄金期货价格下跌4.89%,最低下探至1072美元/盎司,创2011年以来新低。在国际黄金价格下跌和人民币汇率贬值的对冲作用下,三季度国内黄金现货实盘合约价格最终仅下跌1.89%。

作为被动管理型基金,报告期内,本基金紧密跟踪上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约价格,取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

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2.2981元,本报告期份额净值增长率为-2.01%,同期业绩比较基准收益率为-1.89%,年化跟踪误差为0.076%,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

展望下一阶段,尽管美国经济正在缓慢复苏,美联储试图扭转金融危机以来过度宽松的货币信用局面,但是美国以及欧元区仍会在较长时期内维持低利率以刺激经济增长,长期国债实际利率仍将维持历史低位。由于全球经济复苏基础比较脆弱,黄金价格容易受市场情绪和投资者风险偏好的扰动,中短期内的国际黄金价格走势可能会比较反复。从长期看,全球经济的"再平衡"已经开始,发达经济体与新兴市场之间的产业结构再平衡、贸易结构再平衡、全球资本流动再平衡仍然充满变数。黄金价格长期的基本面因素并没有改变,黄金作为保值和避险工具,仍将持续吸引投资者入场。

作为被动投资的基金,本基金将继续坚持既定的投资策略,以严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪偏离为投资目标,追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者利用黄金进行长期保值和中短期避险提供良好的投资工具。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2015年7月28日至2015年8月19日,本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | 89,028,320.00 | 99.56 |
| 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 | 339,978.94 | 0.38 |
| 7 | 其他资产 | 49,905.97 | 0.06 |
| 8 | 合计 | 89,418,204.91 | 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

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

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Au99.99 | AU9999 | 386,240 | 89,028,320.00 | 99.69 |

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,079.51 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 47,826.46 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 49,905.97 |

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

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 22,362,646.00 |
| 报告期基金总申购份额 | 39,300,000.00 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 22,800,000.00 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 38,862,646.00 |

§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黄金交易型开放式证券投资基金募集的文件;

2.《易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》;

3.《易方达黄金交易型开放式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

# 易方达沪深300量化增强证券投资基金

2015年9月30日

## 【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:中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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 | 易方达沪深300量化增强 |
| 基金主代码 | 110030 |
| 交易代码 | 110030 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年7月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 309,167,235.81份 |
| 投资目标 | 本基金为指数增强型股票基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,主要通过运用量化策略进行投资组合管理,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要策略为复制标的指数,投资组合将以标的指数的构成为基础,主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果,结合基金管理人的长期研究与实践应用,利用多因子量化模型预测股票超额回报,在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合,获取超额收益,实现对投资组合的主动增强。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金中的指数增强型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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 | -76,803,745.88 |
| 2.本期利润 | -221,806,783.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.5963 |
| 4.期末基金资产净值 | 491,431,507.76 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5895 |

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

| 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 | -27.31% | 3.39% | -27.06% | 3.18% | -0.25% | 0.21% |

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

易方达沪深300量化增强证券投资基金
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
(2012年7月5日至2015年9月30日)

注:1.根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2013年6月7日起,由"沪深300指数收益率×80%+活期存款利率(税后)×20%"变更为"沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为58.95%,同期业绩比较基准收益率为28.90%。

§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 | | |
| 罗山 | 本基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、指数与量化投资部副总经理 | 2013-01-08 | - | 19年 | 博士研究生,曾任巴克莱银行纽约分行衍生品交易部董事、新加坡分行信用产品交易部董事,苏格兰皇家银行香港分行权益及信用产品部总经理,加拿大皇家银行香港分行结构化产品部总经理,诚信资本合伙人,五矿证券公司副总裁,安信证券资产管理部副总经理,易方达基金管理有限公司指数及量化投资部资深投资经理。 |

注:1.此处的"任职日期"和"离任日期"分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

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

报告期内本基金投资策略主要以追求有纪律、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。

4.4.2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1.5895元,本报告期份额净值增长率为-27.31%,同期业绩比较基准收益率为-27.06%,年化跟踪误差5.318%,各项指标均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

管理人预计2015年四季度央行将延续比较宽松的货币政策,有进一步降息降准的可能性,财政刺激政策将持续加码,以保证经济的逐步企稳回升。如我们在半年报中所预期,三季度以沪深300的蓝筹股获取了相对中小股票的较大的超额收益。但三季度市场的整体下行大幅降低了股市的人气,成交量不断萎缩,这种低迷的态势短期内难以出现根本性的逆转,我们预计四季度股市将以震荡为主。

下一阶段管理人将维持现有权益类资产比例。在组合构建的过程中,管理人将会坚持既定量化策略,利用定量的方法,根据多因子模型的预测,通过优化的方法构建权益类的投资组合。与此同时,管理人将结合量化投研团队的研究成果,根据市场变化对量化投资策略进行优化和补充,勤勉尽职,力争为投资者继续提供持续稳健的超额收益。

§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 | 464,086,986.15 | 94.11 |
| | 其中:股票 | 464,086,986.15 | 94.11 |
| 2 | 固定收益投资 | 121,248.50 | 0.02 |
| | 其中:债券 | 121,248.50 | 0.02 |
| | 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 | 28,356,358.89 | 5.75 |
| 7 | 其他资产 | 565,361.57 | 0.11 |
| 8 | 合计 | 493,129,955.11 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资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 | 560,700.00 | 0.11 |
| B | 采矿业 | 1,972,707.00 | 0.40 |
| C | 制造业 | 22,620,720.14 | 4.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 271,215.00 | 0.06 |
| E | 建筑业 | 1,813,436.00 | 0.37 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 960,685.36 | 0.20 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,041,117.64 | 0.21 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 113,036.00 | 0.02 |
| L | 租赁和商务服务业 | 980,233.32 | 0.20 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 153,522.00 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 195,693.00 | 0.04 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | 718,933.88 | 0.15 |
| | 合计 | 31,401,999.34 | 6.39 |

5.2.2指数投资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 | - | - |
| B | 采矿业 | 16,372,138.27 | 3.33 |
| C | 制造业 | 135,348,998.38 | 27.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,616,341.13 | 3.99 |
| E | 建筑业 | 16,488,723.19 | 3.36 |
| F | 批发和零售业 | 10,744,759.41 | 2.19 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,138,462.56 | 3.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,507,395.02 | 3.97 |
| J | 金融业 | 159,057,185.56 | 32.37 |
| K | 房地产业 | 21,901,267.92 | 4.46 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,972,077.82 | 0.60 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,270,741.32 | 0.67 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 127,144.00 | 0.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,524,777.23 | 1.73 |
| S | 综合 | 1,614,975.00 | 0.33 |
| | 合计 | 432,684,986.81 | 88.05 |

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股票投资明细

5.3.1期末指数投资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 | 601166 | 兴业银行 | 1,052,778 | 15,328,447.68 | 3.12 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 493,106 | 14,724,145.16 | 3.00 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 757,718 | 12,600,850.34 | 2.56 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 1,223,211 | 10,336,132.95 | 2.10 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 542,789 | 9,645,360.53 | 1.96 |
| 6 | 600837 | 海通证券 | 708,413 | 9,032,265.75 | 1.84 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 2,888,829 | 8,753,151.87 | 1.78 |
| 8 | 601377 | 兴业证券 | 1,093,684 | 8,563,545.72 | 1.74 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 1,771,909 | 7,654,646.88 | 1.56 |
| 10 | 601766 | 中国中车 | 539,668 | 6,999,493.96 | 1.42 |

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 600456 | 宝钛股份 | 196,100 | 2,753,244.00 | 0.56 |
| 2 | 002437 | 誉衡药业 | 96,590 | 2,339,409.80 | 0.48 |
| 3 | 000933 | 神火股份 | 555,261 | 2,248,807.05 | 0.46 |
| 4 | 600039 | 四川路桥 | 406,600 | 1,813,436.00 | 0.37 |
| 5 | 600199 | 金种子酒 | 183,423 | 1,456,378.62 | 0.30 |

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 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 121,248.50 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 121,248.50 | 0.02 |

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 | 110031 | 航信转债 | 950 | 121,248.50 | 0.02 |

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 | 319,481.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,515.76 |
| 5 | 应收申购款 | 239,364.16 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 565,361.57 |

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。

5.11.6期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.7期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 429,338,459.86 |
| 报告期基金总申购份额 | 152,670,578.04 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 272,841,802.09 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 309,167,235.81 |

§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

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 22,970,097.03 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 22,970,097.03 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 7.43 |

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量化衍伸股票型证券投资基金募集的文件;

2.中国证监会《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》;

3.《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《易方达沪深300量化增强证券投资基金托管协议》;

6.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

# 易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

2015年9月30日

## 【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:中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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 | 易方达沪深300医药ETF |
| 基金主代码 | 512010 |
| 交易代码 | 512010 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2013年9月23日 |
| 报告期末基金份额总额 | 38,644,002.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时,基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300医药卫生指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合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 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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 | 75,690.81 |
| 2.本期利润 | -15,842,463.58 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3736 |
| 4.期末基金资产净值 | 42,622,611.76 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1030 |

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。

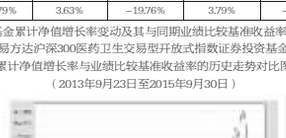
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -19.79% | 3.63% | -19.76% | 3.79% | -0.03% | -0.16% |

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

易方达沪深300医药卫生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
(2013年9月23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10.30%,同期业绩比较基准收益率为19.20%。

§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 | | |
| 林飞 | 本基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数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 | 2013-09-23 | - | 12年 | 博士研究生,曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理,易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理,易方达沪深300指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理。 |
| 余海燕 | 本基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资联接基金的基金经理、易方达上证50指数分级证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理 | 2013-09-23 | - | 10年 | 硕士研究生,曾任汇丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师,华宝兴业基金管理有限