

# 信息披露

## (上接B031版)

传真:021-68150040  
客户服务电话:05694  
网址:www.bx168.com.cn  
(90) 华鑫证券  
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)单元  
办公地址:上海市肇嘉浜路750号  
法定代表人:俞萍  
联系人:杨莉娟  
联系电话:021-64376936  
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918  
传真:021-54663529  
网址:www.cfsc.com.cn  
(91) 华信证券  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼  
法定代表人:杨晓敏  
电话:021-68784818  
网址:shhxzq.com.cn  
(92) 汇通证券  
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号  
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号  
法定代表人:孙名扬  
联系人:周俊  
联系电话:0451-85863726  
传真:0451-82337279  
客户服务电话:400-666-2288  
网址:www.hztz.com.cn  
(93) 金证证券  
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层  
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层  
法定代表人:陆涛  
联系人:马晓静  
联系电话:0755-83026022  
客户服务电话:400-8888-228  
传真:0755-83025625  
网址:www.jzq.cn  
(94) 九州证券  
注册地址:西宁城中区西大街11号  
法定代表人:曲国辉  
联系人:何强  
联系电话:010-63980326  
客户服务电话:4006543218  
传真:010-63889326-9043  
网址:www.jiuzhou.com.cn  
(95) 广源证券  
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
法定代表人:李刚  
联系人:付瑞  
联系电话:029-81887063  
客户服务电话:400-860-8866  
传真:029-88476711  
网址:www.kysec.com  
(96) 民生证券  
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座P40-43  
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座P40-43  
法定代表人:赵建东  
联系人:李静  
客户服务电话:400-889-5618  
网址:www.mszq.com.cn  
(97) 南京证券  
注册地址:江苏省南京市大钟亭8号  
法定代表人:步国何  
联系人:孙秀玉  
联系电话:025-83367889-4107  
客户服务电话:400-828-5888  
传真:025-83320066  
网址:www.njzq.com.cn  
(98) 平安证券  
注册地址:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
办公地址:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
法定代表人:谢永林  
联系人:石珊珊  
联系电话:021-38631117  
客户服务电话:05611-8  
传真:0755-82400862  
网址:stock.pingan.com.cn  
(99) 齐商银行  
注册地址:山东省济南市经七路98号  
法定代表人:李伟  
联系人:马晓勇  
联系电话:021-20315255  
客户服务电话:05638  
传真:021-2031537  
网址:www.qibank.com.cn  
(100) 日信证券  
注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号  
法定代表人:孔佑松  
联系人:陈文彬  
联系电话:010-83891716  
客户服务电话:400-660-9839  
传真:010-66412537  
网址:www.rxzq.com.cn  
(101) 瑞银证券  
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
法定代表人:程京彦  
联系人:冯强  
联系电话:010-58328373  
客户服务电话:400-887-8827  
传真:010-58328170  
网址:www.ubs.com.cn  
(102) 山西证券  
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  
法定代表人:侯巍  
联系人:郭强  
联系电话:0351-8696950  
客户服务电话:05673或400-666-1618  
传真:0351-8696619  
网址:www.i618.com.cn  
(103) 上海证券  
注册地址:上海市西藏中路336号  
办公地址:上海市西藏中路336号  
法定代表人:龚德雄  
联系人:张琳  
联系电话:021-53519888  
客户服务电话:021-962518  
传真:021-53519888  
网址:www.shzq.com.cn  
(104) 申万宏源证券  
注册地址:上海浦东新区世纪大道1600号  
办公地址:上海浦东新区世纪大道1600号  
法定代表人:李梅  
联系人:曹静  
联系电话:021-33388888  
客户服务电话:0562或4008095523  
传真:021-33388224  
网址:www.swhysc.com  
(105) 世纪证券  
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层  
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层  
法定代表人:秦晓峰  
联系人:陈新东  
联系电话:0755-83119511  
开放式基金咨询电话:0755-83195611  
开放式基金业务传真:0755-83196451  
网址:www.sczq.com.cn  
(111) 湘财证券  
注册地址:湖北武汉汉阳东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼  
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼  
法定代表人:余磊  
联系人:崔成  
电话:027-87618567  
传真:027-87618963  
客户服务电话:4008050000  
公司网站:htp://www.txzq.com/  
(108) 万联证券  
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层  
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层  
法定代表人:张建军  
联系人:王鑫  
联系电话:020-38286651  
客户服务电话:400-8888-133  
开放式基金业务传真:020-22373718-1013  
网址:www.wlzq.com.cn  
(109) 西部证券  
注册地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层  
办公地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层  
法定代表人:刘建武  
联系人:刘莹  
联系电话:029-87406949  
客户服务电话:029-86582  
传真:029-87406710  
网址:www.westsec.com.cn  
(110) 西南证券  
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号  
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦  
法定代表人:余维佳  
联系人:余维佳  
联系电话:023-6786633  
客户服务电话:4008960606  
传真:023-63768212  
网址:www.swsc.com.cn  
(111) 湘财证券  
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层  
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层  
法定代表人:林波波  
联系人:赵明华  
联系电话:021-6963410-8920  
开放式基金咨询电话:400-888-1561  
开放式基金业务传真:021-68865680  
网址:www.xscs.com.cn  
(112) 新时代证券  
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
法定代表人:刘汝军  
联系人:田芳芳  
联系电话:010-82661146  
客户服务电话:4008989898  
网址:www.xsdzq.cn  
(113) 信达证券  
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人:张志刚  
联系人:唐静  
联系电话:010-63081000  
客户服务电话:400-800-8899

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
法定代表人:郭坚  
联系人:宁博宇  
电话:021-20665962  
传真:021-22066963  
客户服务电话:4008001003  
公司网站:www.hufund.com  
(139) 诺亚正行  
注册地址:上海市虹口区飞虹路360号9层3724室  
办公地址:上海杨浦区泰皇国际32号C栋2楼  
法定代表人:汪静波  
联系人:张杨  
电话:021-38500680  
传真:021-38509777  
客户服务电话:400-821-5399  
公司网站:www.noah-fund.com  
(140) 财顺资管  
注册地址:北京市海淀区月楼6号月楼SOHO大厦1幢9层1008-1012  
办公地址:北京市海淀区月楼6号月楼SOHO大厦1幢9层1008-1012  
法定代表人:赵春春  
联系人:李静  
电话:010-5763671  
传真:010-5763671  
客户服务电话:400-800-6885  
公司网站:www.qianjing.com www.nulj.net  
(141) 上海长量  
注册地址:上海市浦东新区高路路26号2202室  
办公地址:上海市浦东新区浦东大道665号裕景国际B座11层  
法定代表人:张欣伟  
联系人:毛明俊  
电话:021-20691832  
传真:021-20691861  
客服电话:021-602-2899  
公司网站:www.erichfund.com  
(142) 深圳新兰德  
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006W  
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦16层  
法定代表人:杨晓  
联系人:张燕  
电话:010-83363099  
传真:010-83363010  
客户服务电话:400-166-1188  
公司网站:htp://83.jrcm.cn  
(143) 晟世天下  
注册地址:北京市怀柔区九渡河黄坎村735号03室  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心座28层  
法定代表人:蒋强  
联系人:王正强、周超  
电话:01068170943、010-68170953  
传真:01068170900  
客户服务电话:4008188866  
公司网站: www.shengshijview.com  
(144) 敦本基金  
注册地址:深圳市南山区科技园一路1218号1栋202室  
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道368号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈南青  
联系人:陈俊彬  
联系电话:0571-81137494  
客户服务电话:400-766-123  
传真:0571-86904023  
网址:htp://www.fund123.cn/  
(145) 天天基金  
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号3C座  
法定代表人:其实  
联系人:潘世友  
联系电话:021-54509988  
客户服务电话:400-1818-188  
传真:021-64385308  
网址:www.1234567.com.cn  
(146) 同创资管  
注册地址:浙江省杭州市文二西路一元茂大厦903室  
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼  
法定代表人:吴强  
联系人:吴强  
联系电话:0571-88911818  
客户服务电话:4008-773-772  
传真:0571-86904023  
网址:www.5ifund.com  
(147) 万银财富  
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座3201  
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座3201  
法定代表人:王斐  
联系人:付少卿  
电话:010-59497361  
传真:010-59339074  
客服电话:400-081-6665  
公司网站:htp://www.wy-fund.com  
(148) 鑫鼎基金  
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504  
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504  
法定代表人:陈锦生  
联系人:梁云波  
电话:0592-3122767  
传真:0592-3122701  
客户服务电话:0592-3122716  
公司网站:www.xds.com.cn  
基金销售网站:www.dkhs.com.cn  
(149) 一路财富  
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702  
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号新世界广场A座2208  
法定代表人:吴昊  
联系人:刘栋栋  
电话:010-8312877  
传真:010-8312099  
客户服务电话:400-001-1566  
公司网站:www.yilucaifu.com  
(150) 宜信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区望京乡望花楼5号15层1509  
办公地址:北京市朝阳区望京乡望花楼5号15层1509  
法定代表人:王日明  
联系人:王日明  
电话:010-52856713  
传真:010-58894285  
客户服务电话:400-6099-200  
公司网站:www.yixinfund.com  
(152) 增财基金  
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室  
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室  
法定代表人:罗细安  
联系人:史丽娜  
电话:010-67000988  
传真:010-67000988-6000  
客户服务电话:400-001-8811  
公司网站:www.zvcv.com.cn  
(153) 宸信基金  
注册地址:北京大兴区义和庄乡沙岭镇京富街6号  
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号新闻大厦2层  
法定代表人:闫国斌  
联系人:王琳  
联系电话:010-62020088  
客户服务电话:400-888-6661  
传真:010-62020355  
网址: www.myfund.com  
(154) 中国国际期货  
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层  
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层  
法定代表人:王兵  
联系人:孟夏  
电话:010-59633961  
传真:010-59633966  
客户服务电话:96162  
公司网站:htp://www.citco.net/  
(155) 中期资产  
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1103号  
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层  
法定代表人:姜新  
联系人:侯英建  
电话:010-65807865  
传真:010-65807864  
客户服务电话:95162  
公司网站:www.citicofund.com  
(156) 中信建投证券  
注册地址:重庆市中区中山三路107号上站支楼平11-B、名义层11-A、8-B4、9-B-C  
办公地址:重庆市中区中山三路107号呈恒大厦11楼  
法定代表人:彭戈德  
联系人:刘芸  
电话:023-86769637  
传真:023-86769629  
客户服务电话:400-877-780  
公司网站:www.cfc108.com  
(157) 中邮证券  
注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层  
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层  
法定代表人:张洪  
联系人:洪斌  
电话:0755-23963913  
传真:0755-83217421  
客户服务电话:400-990-8826  
公司网站:htp://www.citistc.com  
(158) 众禄基金  
注册地址:深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼  
办公地址:深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼808  
法定代表人:薛峰  
联系人:廖彩芹  
电话:0755-3327960  
传真:0755-3327961  
客户服务电话:40086-788-887  
公司网站:www.zlfund.com www.jinnu.com  
(二) 基金注册登记机构  
名称:万达基金资产管理有限公司  
注册地址:广东珠海横琴新区宝中三路3号4004-8室  
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43F  
法定代表人:刘健雄  
电话:020-68850088  
传真:020-38790249  
联系人:余贵高  
(三) 律师事务所和经办律师  
名称:北京市天元律师事务所  
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
负责人:王丽华  
联系电话:(010) 88092188  
传真:(010) 88092158  
联系人:王立华  
经办律师:陈瑞、宋娟娟  
(四) 会计师事务所和经办注册会计师  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号延展大厦14楼  
办公地址:上海市静安区南京西路22号普华永道中心1楼

首席合伙人:李丹  
电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238880  
经办注册会计师:陈静、沈光金  
联系人:沈光金  
基金名称: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  
四、基金的投资目标  
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。  
七、基金的投资方向  
本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300ETF、沪深300指数成份股及备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在不改变本基金资产配置的情况下进行相应调整并履行相关程序。  
在条件许可的情况下,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则,具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关业务按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会。  
本基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金非现金基金资产的90%;本基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%;本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
本基金为以目标ETF为跟踪标的基金,主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,在正常市场情况下,力争本基金的投资净值增长率与业绩比较基准之间的年度跟踪误差控制在4%以内。如跟踪的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施跟踪误差进一步扩大。  
本基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金非现金基金资产的90%;本基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%;本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。  
本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申赎的方式或其他方式进行申购赎回。  
本基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。  
此外,为更好地实现投资目标,本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如期权、权证以及其他与标的指数的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金利用股指期货期货降低频繁调整股票仓位交易成本并同时减小跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。  
九、基金的业绩比较基准  
沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。  
十、基金的风险收益特征  
本基金为沪深300ETF的联接基金,其预期风险收益水平高于混合型公募基金、债券基金和货币市场基金;本基金主要通过投资沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。  
十一、基金的投资组合报告(未经审计)  
本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法律责任。  
本基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定,复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本投资组合报告有关数据的期间为2015年4月1日至2015年6月30日。  
1.报告期末基金投资组合情况

| 序号                | 项目               | 金额(元)            | 占基金资产净值的比例(%) |
|-------------------|------------------|------------------|---------------|
| 1                 | 权益投资             | 3,528,440.74     | 0.07          |
| 其中:股票             | 3,528,440.74     | 0.07             |               |
| 2                 | 基金投资             | 4,186,306,880.28 | 88.97         |
| 3                 | 固定收益投资           | 170,800,000.00   | 3.63          |
| 其中:债券             | 170,800,000.00   | 3.63             |               |
| 4                 | 资产支持证券           | -                | -             |
| 5                 | 贵金属投资            | -                | -             |
| 6                 | 金融衍生品投资          | -                | -             |
| 7                 | 买入返售金融资产         | -                | -             |
| 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -                |               |
| 8                 | 银行存款和结算备付金合计     | 283,506,016.61   | 6.24          |
| 9                 | 其他资产             | 50,809,156.60    | 1.08          |
| 合计                | 4,765,029,333.34 | 100.00           |               |

2.期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称                      | 基金类型 | 运作方式            | 管理人         | 公允价值             | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|---------------------------|------|-----------------|-------------|------------------|---------------|
| 1  | 易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金 | 股票型  | 交易型开放式(ETF)、发起式 | 易方达基金管理有限公司 | 4,186,306,880.28 | 93.05         |

3.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)      | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 1,533,377.00 | 0.03          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -             |
| E  | 建筑业              | 262,780.00   | 0.01          |
| F  | 批发和零售业           | 14,022.00    | 0.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 790.74       | 0.00          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息技术、软件和信息技术服务业  | 497,534.00   | 0.01          |
| J  | 金融业              | 740,632.00   | 0.02          |
| K  | 房地产业             | -            | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -             |
| 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               | -            | -             |
| O  | 卫生和社会工作          | -            | -             |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 224,100.00   | 0.01          |
| S  | 综合               | 265,200.00   | 0.01          |
| 合计 |                  | 3,528,440.74 | 0.08          |

4.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

| 代码 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|---------------|
| 1  | 000917 | 电广传媒 | 11,600 | 497,534.00 | 0.01          |
| 2  | 600703 | 三安光电 | 14,700 | 460,110.00 | 0.01          |
| 3  | 000166 | 华芳纺织 | 24,500 | 388,125.00 | 0.01          |
| 4  | 002553 | 奥飞娱乐 | 7,900  | 350,365.00 | 0.01          |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 16,700 | 288,232.00 | 0.01          |
| 6  | 002456 | 优视光  | 9,300  | 272,294.00 | 0.01          |
| 7  | 002528 | 广汇能源 | 25,500 | 265,200.00 | 0.01          |
| 8  | 002310 | 东方网力 | 6,800  | 262,780.00 | 0.01          |
| 9  | 000783 | 华鲁恒兴 | 10,800 | 224,100.00 | 0.01          |
| 10 | 002038 | 天源兴  | 4,600  | 132,112.00 | 0.00          |

5.报告期末按品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元)        | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|------|----------------|---------------|
| 1  | 国债   | -              | -             |
| 2  | 央行票据 | -              | -             |
| 3  | 金融债  | 170,800,000.00 | 3.63          |
| 4  | 企业债  | -              | -             |
| 5  | 央行票据 | -              | -             |
| 6  | 中期票据 | -              | -             |
| 7  | 可转债  | -              | -             |
| 8  | 其他   | -              | -             |
| 9  | 合计   | 170,800,000.00 | 3.63          |

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)       | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 140220 | 14国开03 | 500,000 | 50,240,000.00 | 1.13          |
| 2  | 150307 | 15国开07 | 400,000 | 40,282,000.00 | 0.94          |
| 3  | 140223 | 14国开03 | 400,000 | 40,160,000.00 | 0.93          |
| 4  | 140440 | 14国开04 | 400,000 | 40,108,000.00 | 0.93          |

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十名资产支持证券投资明细  
无。  
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贵金属投资明细  
无。  
9.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  
无。  
10.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 序号                | 合约名称        | 持仓数量   | 公允价值(元) | 公允价值变动(元)     | 风险说明         |  |
|-------------------|-------------|--------|---------|---------------|--------------|--|
| 1                 | IF1507      | IF1507 | 25      | 32,826,000.00 | 1,344,200.00 | 在本报告期内,基金未利用股指期货进行套期保值,股指期货未对基金资产净值产生重大影响。 |
| 合计                | 公允价值变动合计(元) |        |         | 1,344,200.00  |              |  |
| 股指期货投资本期损益(元)     |             |        |         | 227,390.00    |              |  |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |             |        |         | 1,344,200.00  |              |  |

(2)本基金股指期货的投资政策  
①本基金股指期货的投资策略  
②本基金股指期货的投资目标  
③本基金股指期货的投资风险控制  
④本基金股指期货的投资风险管理  
⑤本基金股指期货的投资风险管理  
⑥本基金股指期货的投资风险管理  
⑦本基金股指期货的投资风险管理  
⑧本基金股指期货的投资风险管理  
⑨本基金股指期货的投资风险管理  
⑩本基金股指期货的投资风险管理  
⑪本基金股指期货的投资风险管理  
⑫本基金股指期货的投资风险管理  
⑬本基金股指期货的投资风险管理  
⑭本基金股指期货的投资风险管理  
⑮本基金股指期货的投资风险管理  
⑯本基金股指期货的投资风险管理  
⑰本基金股指期货的投资风险管理  
⑱本基金股指期货的投资风险管理  
⑲本基金股指期货的投资风险管理  
⑳本基金股指期货的投资风险管理  
㉑本基金股指期货的投资风险管理  
㉒本基金股指期货的投资风险管理  
㉓本基金股指期货的投资风险管理  
㉔本基金股指期货的投资风险管理  
㉕本基金股指期货的投资风险管理  
㉖本基金股指期货的投资风险管理  
㉗本基金股指期货的投资风险管理  
㉘本基金股指期货的投资风险管理  
㉙本基金股指期货的投资风险管理  
㉚本基金股指期货的投资风险管理  
㉛本基金股指期货的投资风险管理  
㉜本基金股指期货的投资风险管理  
㉝本基金股指期货的投资风险管理  
㉞本基金股指期货的投资风险管理  
㉟本基金股指期货的投资风险管理  
㊱本基金股指期货的投资风险管理  
㊲本基金股指期货的投资风险管理  
㊳本基金股指期货的投资风险管理  
㊴本基金股指期货的投资风险管理  
㊵本基金股指期货的投资风险管理  
㊶本基金股指期货的投资风险管理  
㊷本基金股指期货的投资风险管理  
㊸本基金股指期货的投资风险管理  
㊹本基金股指期货的投资风险管理  
㊺本基金股指期货的投资风险管理  
㊻本基金股指期货的投资风险管理  
㊼本基金股指期货的投资风险管理  
㊽本基金股指期货的投资风险管理  
㊾本基金股指期货的投资风险管理  
㊿本基金股指期货的投资风险管理

(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)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 | 流通受限的公允价值(元) | 占基金资产净值的比例(%) | 流通受限原因 |
|----|--------|------|--------------|---------------|--------|
| 1  | 000917 | 电广传媒 | 497,534.00   | 0.01          | 重大事项停牌 |
| 2  | 002553 | 奥飞娱乐 | 350,365.00   | 0.01          | 重大事项停牌 |
| 3  | 002310 | 东方网力 | 262,780.00   | 0.01          | 重大事项停牌 |
| 4  | 000783 | 华鲁恒兴 | 224,100.00   | 0.01          | 重大事项停牌 |

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分  
本基金管理人旗下子公司易方达资产管理有限公司于本报告期末持有易方达沪深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份额为608,214.43份。  
十二、基金的业绩  
基金管理人依照恪尽职守、诚信信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。  
基金合同生效日为2009年5月20日,基金合同生效以来(截至2015年6月30日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

| 序号                    | 净值增长率(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准(%) | 业绩比较基准标准差(%) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|-----------------------|----------|-------------|-----------|--------------|---------|---------|
| 基金合同生效至2009年12月31日    | 72.0%    | 1.55%       | 14.28%    | 1.91%        | -70.8%  | -0.76%  |
| 2010年1月1日至2010年12月31日 | -11.85%  | 1.51%       | -11.78%   | 1.50%        | -0.07%  | 0.01%   |
| 2011年1月1日至2011年12月31日 | -23.02%  | 1.22%       | -23.83%   | 1.23%        | 0.81%   | -0.01%  |
| 2012年1月1日至2012年12月31日 | 8.27%    | 1.19%       | 7.29%     | 1.22%        | 0.98%   | -0.03%  |
| 2013年1月1日至2013年12月31日 | -5.80%   | 1.32%       | -7.16%    | 1.32%        | 1.36%   | 0.00%   |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 60.53%   | 1.14%       | 40.69%    | 1.15%        | 2.24%   | -0.01%  |
| 2015年1月1日至2015年6月30日  | 24.87%   | 2.12%       | 25.29%    | 2.15%        | -0.42%  | -0.03%  |
| 基金合同生效至2015年6月30日     | 39.94%   | 1.30%       | 42.49%    | 1.43%        | -2.65%  | -0.07%  |

注:根据中国证监会2013年9月17日下发的《关于易方达沪深300指数证券投资基金基金合同持有人大会决议备案的公告》(基金部函[2013]812号),易方达沪深300指数证券投资基金自2013年9月17日起变更为易方达沪深30