易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达创新驱动混合
基金主代码	000603
交易代码	000603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月13日
报告期末基金份额总额	3,306,947,044.34份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于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、货币市场工具及其他金融工具的比例。在资产配置的基础上,本基金重点关注所在行业景气度较高且具有可持续性、所在行业竞争格局良好、管理层素质较高的创新驱动型公司。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债总财富指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其风险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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-205,802,485.72
2.本期利润	1,096,478,222.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.3151
4.期末基金资产净值	4,262,501,441.53
5.期末基金份额净值	1.289

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	32.48%	2.55%	9.79%	0.83%	22.69%	1.72%

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

易方达创新驱动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2月13日至2015年12月31日)

注:1.本基金合同于2015年2月13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,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(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。

3. 自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为28.90%,同期业绩比较基准收益率为7.26%。

§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		
宋昆	本基金的基金经理、易方达科讯混合型证券投资基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、公募基金投资部总经理	2015-02-13	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、公募基金投资部总经理助理、公募基金投资部副总经理
樊正伟	本基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达积极成长证券投资基金的基金经理助理	2015-03-14	-	5年	硕士研究生,曾任中国银行深圳分行职员,易方达基金管理有限公司渠道经理、研究员。

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

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6次,其中5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年四季度,上证综指上涨15.93%,沪深300指数上涨16.49%,创业板综指上涨39.11%,均呈现快速上涨的局面。板块方面,四季度中信一级行业指数均为正收益,涨幅最大的一级行业包括:综合、计算机、通信等,涨幅较小的包括钢铁、煤炭、银行等。

本基金延续了之前的投资思路,认为中国的经济转型将经历相当长的一段时间,在这个过程中,新产业、新技术、新商业模式值得高度关注。与此同时,报告期内本基金根据市场变化,在股票仓位和行业配置上做出了调整应对。

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1.289元,本报告期份额净值增长率为32.48%,同期业绩比较基准收益率为9.79%。

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

市场在经过了三季度的剧烈下跌之后在四季度迎来反弹,成长股在反弹中表现突出,部分公司股价创出新高,一些股票的估值又上升到了较高水平。与此同时,由于经济下行压力持续加大,预计中央政府会继续实施针对部分领域的财政刺激,同时保持较为宽松的货币环境。综合上述宏观经济局面、财政货币政策以及市场估值环境,我们认为市场将处于相对均衡的状态,我们的工作重点是寻找细分行业中的优秀个股,继续挑选行业成长性好、具备战略视野、公司治理良好、市值合理的标的进行配置。

放眼中长期,能使中国经济进一步恢复活力的依然是不断崛起的新兴产业。随着人类走进移动互联、云计算时代,以机器人为代表的人工智能将在制造业中承担举足轻重的作用。从繁重的生产中解放出来的人类,对于自身的需求必将更加重视,娱乐、医疗、环保、教育、体育产业必将迎来黄金发展时期。

最后,衷心感谢持有人对本基金的信任和支持,我们将努力工作,力争回报大家的信任。

§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	3,965,614,212.04	85.09
	其中:股票	3,965,614,212.04	85.09
2	固定收益投资	206,960,268.00	4.44
	其中:债券	206,960,268.00	4.44
	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	478,775,838.40	10.27
7	其他资产	8,903,738.31	0.19
8	合计	4,660,254,056.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	1,155,015,607.80	27.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,200,000.00	1.72
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	85,027,548.42	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	23,791,545.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,315,246,753.19	54.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,474,072.00	0.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	128,908,263.99	3.02
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	68,830,060.44	1.61
R	文化、体育和娱乐业	41,190,109.50	0.97
S	综合	53,930,251.70	1.27
	合计	3,965,614,212.04	93.03

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	002153	石基信息	2,560,900	386,695,900.00	9.07
2	300333	兆日科技	4,498,505	215,928,240.00	5.07
3	300383	光环新网	3,850,474	214,509,906.54	5.03
4	002137	麦达数字	8,920,445	205,170,235.00	4.81
5	002019	亿帆鑫富	4,585,058	183,402,320.00	4.30
6	300302	同有科技	2,376,037	172,143,880.65	4.04
7	300352	北信源	2,742,276	171,118,022.40	4.01
8	300379	东方通	1,393,506	170,969,251.14	4.01
9	002467	二六三	7,026,297	147,481,974.03	3.46
10	300188	美亚柏科	2,814,099	142,674,819.30	3.35

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	200,280,000.00	4.70
	其中:政策性金融债	200,280,000.00	4.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	6,680,268.00	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	206,960,268.00	4.86

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	150413	15农发13	1,500,000	150,165,000.00	3.52
2	150416	15农发16	500,000	50,115,000.00	1.18
3	110031	航信转债	51,450	6,680,268.00	0.16

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	1,430,612.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,147,163.56
5	应收申购款	4,325,962.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,903,738.31

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	6,680,268.00	0.16

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	3,387,485,333.03
报告期基金总申购份额	962,385,345.57
减:报告期基金总赎回份额	1,042,923,634.26
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,306,947,044.34

§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.中国证监会注册易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达创新驱动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
二〇一六年一月二十二日

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达创业板ETF
场内简称	创业板
基金主代码	159915
交易代码	159915
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	1,623,454,936.00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,即按照创业板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调整而发生变化、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时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。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。本基金可以参与股指期货交易,但必须根据风险管理的原则,以套期保值为目的。
业绩比较基准	创业板指数
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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	1,023,588,808.65
2.本期利润	1,118,990,592.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.5971
4.期末基金资产净值	4,131,209,464.55
5.期末基金份额净值	2.5447

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2011 年11月30 日进行了基金份额折算,折算比例为1.14558776。

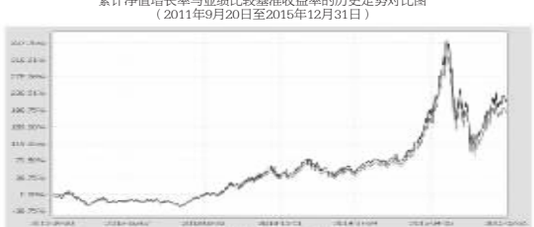
3.2 基金净值表现

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	29.93%	2.61%	30.32%	2.55%	-0.39%	0.06%

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

易方达创业板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
(2011年9月20日至2015年12月31日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为191.52%,同期业绩比较基准收益率为217.54%。

§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		
王建军	本基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2011-09-20	-	8年	博士研究生,曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师,易方达基金管理有限公司量化研究员、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,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6次,其中5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年第四季度GDP同比增速预计仍略低于7%,基本与三季度同比增速持平。从工业增加值角度来看,四季度各月分工业增加值同比增速呈现微弱的企稳势头。四季度CPI在三季度出现一定的反弹之后逐步回落,整体继续维持在相对较低的水平,同时PPI仍处于长期的负增长状态。从进出口同比增速来看,四季度整体进出口表现较弱,其中进口同比增速较出口同比增速更弱,贸易盈余持续扩大。从固定资产投资的情况来看,四季度累计完成同比增速较三季度略有下滑。同时,四季度社会零售品消费总额同比增速则较三季度有明显的企稳回升。2015年第四季度上证指数涨幅为15.93%,创业板价格指数涨幅为30.32%,作为被动型指数基金,创业板ETF联接基金的单位净值跟随业绩比较基准出现了较大幅度的上涨。

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2.5447元,本报告期份额净值增长率为29.93%,同期业绩比较基准收益率为30.32%,日跟踪偏离度的均值为0.0725%,日跟踪误差为0.1045%,年化跟踪误差为1.6182%,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

展望下一阶段市场,宏观经济整体复苏仍具有相当的不确定性。经济结构的转型和经济增长方式的转变以及潜在经济增速的下行等,是未来一段时间内宏观经济发展的核心问题,解决这一核心问题的有效手段则是进行供给侧改革。同时保持整体经济一定的增速以防范系统性风险,为结构转型创造稳定的环境也是政府经济工作的重点之一。

从中长期的角度来看,随着各项全面深入的市场化改革措施的逐步推进和实施,国内整体经济结构转型将逐渐成效。从短期角度来看,随着供给侧改革的推进,宏观经济整体上可能会有一定的阵痛期。同时,国家层面的"一带一路"战略将促进国内企业的"走出去"发展战略和化解国内相对过剩的传统工业产能,有利于经济结构的加速转型。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性和潜在的内生增长力,本基金对中国经济中长期的前景持相对乐观的判断。创业板指数行业分布主要集中在新兴产业,指数成分股市值小、成长性高、弹性大。创业板指数成分股主要为小市值股票,虽然其估值水平普遍较主板大市值股票高,但鉴于当前中国经济转型期的大背景和新兴产业未来的发展前景,创业板指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金,创业板ETF将坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望创业板ETF为投资者进一步分享中国经济的未来长期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	4,016,732,574.68	97.07
	其中:股票	4,016,732,574.68	97.07
2	固定收益投资	3,900,871.75	0.09
	其中:债券	3,900,871.75	0.09
	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	84,529,385.23	2.04
7	其他资产	32,870,908.45	0.79
8	合计	4,138,033,740.11	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

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	42,408,069.70	1.03
B	采矿业	20,095,706.40	0.49
C	制造业	1,757,434,245.96	42.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,851,335.56	0.89
F	批发和零售业	10,061,251.20	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,540,404,880.87	37.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	96,777,658.02	2.34
M	科学研究和技术服务业	23,890,144.01	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	103,845,546.54	2.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	101,238,887.76	2.45
R	文化、体育和娱乐业	283,802,537.66	6.87
S	综合	-	-
	合计	4,016,810,263.68	97.23

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	300104	乐视网	4,009,162	235,738,725.60	5.71
2	300059	东方财富	3,828,515	199,197,635.45	4.82
3	300024	机器人	1,645,534	112,719,079.00	2.73
4	300027	华谊兄弟	2,597,513	107,744,839.24	2.61
5	300070	碧水源	2,005,902	103,845,546.54	2.51
6	300017	网宿科技	1,569,743	94,168,882.57	2.28
7	300124	汇川技术	1,633,790	77,114,888.00	1.87
8	300408	三环集团	1,781,711	66,422,186.08	1.61
9	300058	蓝色光标	4,492,994	66,181,801.62	1.60
10	300003	乐普医疗	1,692,579	65,333,549.40	1.58

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(可交换债)	3,900,871.75	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,900,871.75	0.09

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	123001	蓝标转债	39,010	3,900,871.75	0.09

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	833,053.57
2	应收证券清算款	31,992,202.80
3	应收股利	-
4	应收利息	45,652.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,870,908.45

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	300104	乐视网	235,738,725.60	5.71	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	1,811,454,936.00
报告期基金总申购份额	6,559,194,541.00
减:报告期基金总赎回份额	6,747,194,541.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,623,454,936.00

注:总申购份额包含场外总赎回份额197,194,541份;总赎回份额包含场外总赎回份额197,194,541份。

§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创业板交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2.《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3.《易方达创业板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
二〇一六年一月二十二日

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达创业板ETF联接
基金主代码	110026
交易代码	110026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	377,728,750.51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。
投资策略	本基金为创业板ETF的联接基金。创业板ETF是采用完全复制法实现对创业板指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于创业板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合规、风险、效率,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创业板ETF的买卖。本基金可以参与股指期货交易,但必须根据风险管理的原则,以套期保值为目的。
业绩比较基准	创业板指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为创业板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创业板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	易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159915
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年9月20日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年12月9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,即按照创业板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调整而发生变化、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时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。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