

易方达生物科技指数分级证券投资基金

[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监事会在报告期间不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时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、投资组合报告等内容，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金销售机构在销售基金时，应向投资人充分揭示投资风险，投资人应当以书面形式确认接受基金的销售条款。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于本基金前，请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告中财务资料未经审计。

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:易方达生物分级

基金代码:161122

交易代码:161122

基金运作方式:契约型开放式、分级基金

基金合同生效日:2015年6月6日

报告期末基金份额总额:231,077,313.78份

投资目标:紧密地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金主要选取能够较好地反映医药生物行业整体特征的股票作为投资对象，并将其所持有的股票资产不低于基金资产净值的80%投资于标的指数成分股，其余资产投资于固定收益类金融工具，以严格控制基金净值相对于标的指数的跟踪误差。

投资策略:本基金通过量化分析，精选具有高成长性的细分行业，指数成份股市值大小、成长性、高增长、生物科技术指数成份股整体估值水平虽然相对较低，但鉴于当前经济转型期的大环境和新兴产业未来的广阔发展前景，生物科技术指数成份股长期的投资价值依然存在。

本基金为被动管理的基金，生物科技术指数成份股将定期的调整投资策略，以严格控制基金净值相对于标的指数的跟踪误差。

本基金管理人以诚信为本，勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。投资人投资于本基金前，请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告中财务资料未经审计。

报告期自2015年10月1日起至12月31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10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -9,224,767.07

2.本期利润 73,159,760.06

3.期初平均基金份额利润 0.0203

4.期末基金份额净值 289,377,612.19

5.期末基金份额净值 289,377,612.19

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示数字。

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扣除本期费用后的余额。

3.基金销售服务费率为零的，本期利润即为本期已实现收益。

4.期末基金资产净值=基金总资产-基金总负债。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

注: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扣除本期费用后的余额。

3.基金销售服务费率为零的，本期利润即为本期已实现收益。

4.期末基金资产净值=基金总资产-基金总负债。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

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示数字。

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扣除本期费用后的余额。

3.基金销售