易方达财富快线货币市场基金

【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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄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	易方达财富快线货币		
基金主代码	000647		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年6月17日		
报告期末基金份额总额	8,149,586,871.08份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达财富快线货币A	易方达财富快线货币B	易方达财富快线货币Y
下属分级基金的交易代码	000647	000648	000920
报告期末下属分级基金的份额总额	5,878,349,539.53份	1,232,967,976.32份	1,038,269,355.23份

注:自2014年12月3日起,易方达财富快线货币市场基金增设Y类份额类别。

§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)		
	易方达财富快线货币A	易方达财富快线货币B	易方达财富快线货币Y
1.本期已实现收益	35,600,248.79	2,663,756.13	7,985,148.38
2.本期利润	35,600,248.79	2,663,756.13	7,985,148.38
3.期末基金资产净值	5,878,349,539.53	1,232,967,976.32	1,038,269,355.23

注:1.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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.自2014年12月3日起,本基金增设Y类份额类别。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达财富快线货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7973%	0.0022%	0.3456%	0.0000%	0.4517%	0.0022%

易方达财富快线货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8581%	0.0022%	0.3456%	0.0000%	0.5125%	0.0022%

易方达财富快线货币Y

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7971%	0.0022%	0.3456%	0.0000%	0.4515%	0.0022%

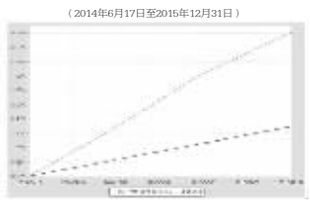
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达财富快线货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

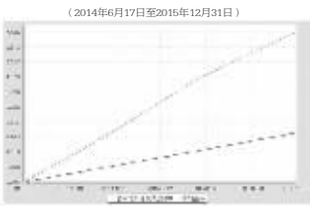
易方达财富快线货币A

(2014年6月17日至2015年12月31日)



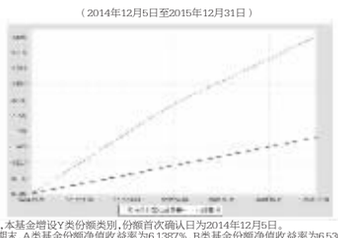
易方达财富快线货币B

(2014年6月17日至2015年12月31日)



易方达财富快线货币Y

(2014年12月5日至2015年12月31日)



注:1.自2014年12月3日起,本基金增设Y类份额类别,份额首次确认日为2014年12月5日。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为6.1387%,B类基金份额净值收益率为6.5307%,同期业绩比较基准收益率为2.1337%。Y类基金份额净值收益率为4.1287%,同期业绩比较基准收益率为1.4808%。

§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		
石大锤	本基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天宝货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理	2014-06-17	-	6年	6硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司基金经理、易方达基金管理有限公司基金经理、易方达基金管理有限公司量中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁莹	本基金的基金经理、易方达交易型债券型证券投资基金的基金经理、易方达天宝货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达货币市场基金的基金经理助理、易方达月利理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理	2015-03-17	-	5年	6硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员、易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,石大锤的"任职日期"为基金合同生效之日,梁莹的"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年第四季度,中国宏观经济运行出现边际改善,工业增加值和社会消费品零售增速企稳,CPI与PPI增速止跌。美联储12月底加息靴子落地,人民币兑美元期货汇率贬值预期加强,长端利率跌幅有所收窄。资本市场方面,经过三季度的快速下跌,A股市场在四季度出现整体反弹,上证指数上涨15.93%,深证综指上涨34.49%。大小盘风格分化明显,上证50指数和沪深300指数分别上涨12.80%和16.49%,中证500指数和创业板指数分别上涨24.40%和30.32%。

作为被动型指数基金,报告期内,本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深300指数,取得与标的指数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1.1953元,本报告期份额净值增长率为15.48%,同期业绩比较基准收益率为15.65%,年化跟踪误差0.803%,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,中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换,短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免,这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复苏进程有所反复,宏观经济政策也将在稳增长、保就业的"下限"和防通胀的"上限"之间动态平衡,当经济运行处于预期的合理区间内,则以调结构为主要着力点。就今年中国经济运行实际情况来看,政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险,并加大"区间调控、定向调控和预调微调"的力度。从长期来看,通过供给侧改革、提高全要素生产率,将是中国经济长期可持续增长的关键手段,我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

目前以沪深300指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于较为合理的位置,具有中长期投资价值。作为被动投资的基金,本基金将继续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,追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

§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	固定收益投资	6,208,420,672.94	67.22
	其中:债券	6,208,420,672.94	67.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	280,000,820.00	3.03
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,480,485,353.42	26.86
4	其他资产	267,008,934.06	2.89
5	合计	9,235,915,780.42	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	18.23	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,081,205,939.19	13.27
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	94

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	7.75	13.27
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.43	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	47.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	10.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.05	13.27

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,871,661.39	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	400,361,503.93	4.91
	其中:政策性金融债	400,361,503.93	4.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,649,858,711.38	32.52
6	中期票据	201,828,686.75	2.48
7	同业存单	2,916,500,109.49	35.79
8	其他	-	-
9	合计	6,208,420,672.94	76.18
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111510403	15兴业CD403	3,000,000	300,000,000.00	3.68
2	111508207	15中信CD207	3,000,000	295,434,441.00	3.63
3	111510387	15兴业CD387	2,000,000	200,000,000.00	2.45
4	111593248	15成都农商银行CD012	2,000,000	198,568,260.93	2.44
5	111519055	15恒丰银行CD055	2,000,000	198,272,888.48	2.43
6	111519057	15恒丰银行CD057	2,000,000	198,238,068.57	2.43
7	111517166	15光大CD166	2,000,000	197,953,602.75	2.43
8	130211	13国开11	1,500,000	150,026,628.19	1.84
9	111519073	15恒丰银行CD073	1,500,000	148,474,486.80	1.82
10	111508192	15中信CD192	1,500,000	147,759,634.70	1.81

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	61次
报告期内偏离度的最高值	0.4313%
报告期内偏离度的最低值	0.2485%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3478%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.8.2本基金本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3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。

5.8.4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	-
3	应收利息	74,273,035.68
4	应收申购款	192,705,898.38
5	其他应收款	30,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	267,008,934.06

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达财富快线货币A	易方达财富快线货币B	易方达财富快线货币Y
报告期期初基金份额总额	4,455,675,820.19	288,074,728.99	973,047,813.61
报告期基金总申购份额	6,667,916,114.90	1,165,829,656.13	1,352,718,268.55
报告期基金总赎回份额	5,245,242,395.56	220,936,408.80	1,287,496,726.93
报告期期末基金份额总额	5,878,349,539.53	1,232,967,976.32	1,038,269,355.23

§7 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财富快线货币市场基金募集的文件;

2.《易方达财富快线货币市场基金基金合同》;

3.《易方达财富快线货币市场基金托管协议》;

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

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

【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	易方达沪深300ETF发起式
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式(ETF),发起式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	2,845,831,140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。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。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。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	沪深300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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	29,950,197.76
2.本期利润	750,380,762.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.2440
4.期末基金资产净值	4,329,738,427.88
5.期末基金份额净值	1.5214

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

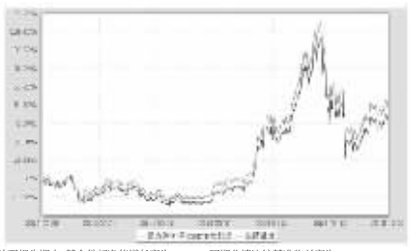
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.56%	1.67%	16.49%	1.67%	0.07%	0.00%

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

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

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3月6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52.14%,同期业绩比较基准收益率为42.25%。

§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、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2013-03-06	-	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,中国宏观经济运行出现边际改善,工业增加值和社会消费品零售增速企稳,CPI与PPI增速止跌。美联储12月底加息靴子落地,人民币兑美元期货汇率贬值预期加强,长端利率跌幅有所收窄。资本市场方面,经过三季度的快速下跌,A股市场在四季度出现整体反弹,上证指数上涨15.93%,深证综指上涨34.49%。大小盘风格分化明显,上证50指数和沪深300指数分别上涨12.80%和16.49%,中证500指数和创业板指数分别上涨24.40%和30.32%。

作为被动型指数基金,报告期内,本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深300指数,取得与标的指数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1.5214元,本报告期份额净值增长率为16.56%,同期业绩比较基准收益率为16.49%,日跟踪偏离度的均值为0.02%,日跟踪误差为0.026%,年化跟踪误差0.396%,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,中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换,短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免,这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复苏进程有所反复,宏观经济政策也将在稳增长、保就业的"下限"和防通胀的"上限"之间动态平衡,当经济运行处于预期的合理区间内,则以调结构为主要着力点。就今年中国经济运行实际情况来看,政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险,并加大"区间调控、定向调控和预调微调"的力度。从长期来看,通过供给侧改革、提高全要素生产率,将是中国经济长期可持续增长的关键手段,我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

目前以沪深300指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值处于较为合理的位置,具有中长期投资价值。作为被动投资的基金,本基金将继续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,追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

§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	4,265,170,274.42	98.45
	其中:股票	4,265,170,274.42	98.45
2	固定收益投资	505,883.37	0.01
	其中:债券	505,883.37	0.01
	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	64,608,057.44	1.49
7	其他资产	1,974,919.54	0.05
8	合计	4,332,259,134.77	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	4,126,860.36	0.10
B	采矿业	134,623,142.78	3.11
C	制造业	1,390,086,035.58	32.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	174,007,950.01	4.02
E	建筑业	162,026,654.77	3.74
F	批发和零售业	94,768,420.70	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	157,375,220.02	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	280,353,023.23	6.48
J	金融业	1,442,366,291.15	33.31
K	房地产业	223,011,035.61	5.15
L	租赁和商务服务业	41,932,796.70	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,194,290.94	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,380,651.28	0.10
R	文化、体育和娱乐业	85,626,684.66	1.98
S	综合	32,291,216.63	0.75
	合计	4,265,170,274.42	98.51

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	601318	中国平安	4,657,535	167,671,260.00	3.87
2	600016	民生银行	12,607,871	121,539,876.44	2.81
3	601166	兴业银行	5,622,456	95,975,323.92	2.22
4	000002	万 科A	3,354,927	81,960,866.61	1.89
5	600036	招商银行	4,386,125	78,906,388.75	1.82
6	600000	浦发银行	3,974,468	72,613,530.36	1.68
7	601328	交通银行	10,006,327	64,440,745.88	1.49
8	600030	中信证券	3,292,573	63,711,287.55	1.47
9	600519	贵州茅台	271,075	59,145,854.25	1.37
10	600837	海通证券	3,427,505	54,223,129.10	1.25

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)	505,883.37	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	505,883.37	0.01

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	5,059	505,883.37	0.01

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根据中信证券股份有限公司2015年11月26日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。

根据海通证券股份有限公司2015年9月11日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》,因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案,被中国证监会予以警告及行政处罚。

根据海通证券股份有限公司2015年11月27日发布的《收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,被中国证监会予以立案调查。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对上述上市公司的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

除中信证券和海通证券之外,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	946,951.15
2	应收证券清算款	1,020,230.36
3	应收股利	-
4	应收利息	7,738.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,974,919.54

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	000002	万 科A	81,960,866.61	1.89	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	3,625,831,140
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	780,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,845,831,140

注:期初基金总份额包含场外份额127,523,725份;期末基金总份额包含场外份额117,523,725份;总赎回份额包含场外总赎回份额10,000,000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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,340,485.00	0.