易方达并购重组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	易方达并购重组指数分级		
基金主代码	161123		
交易代码	161123		
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3日		
报告期末基金份额总额	2,577,729,914.06份		
投资目标	紧密追踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。		
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。但在因特殊情况导致基金无法完全投资于标的指数成份股时,基金管理人可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	中证万得并购重组指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金,主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现,其风险收益特征与标的指数相似。长期而言,其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金;A类份额具有预期风险、收益较低的特征;B类份额具有预期风险、收益较高的特征。		
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		
下属分级基金的基金简称	易方达重组分级	易方达重组分级A	易方达重组分级B
下属分级基金场内简称	重组分级	重组A	重组B
下属分级基金的交易代码	161123	150259	150260
报告期末下属分级基金的份额总额	2,307,864,402.05份	134,932,756.00份	134,932,756.00份
下属分级基金的风险收益特征	基础份额为股票型基金,其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	与基础份额相比,A类份额的预期收益和预期风险低于基础份额。	与基础份额相比,B类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。

§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	-435,243,753.84
2.本期利润	854,957,310.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.3139
4.期末基金资产净值	3,074,949,280.48
5.期末基金份额净值	1.1929

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

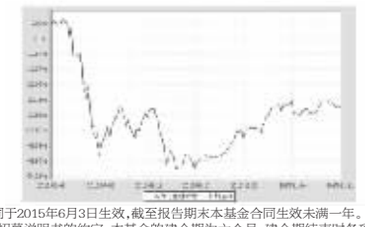
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	33.67%	2.14%	33.95%	1.98%	-0.28%	0.16%

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

易方达并购重组指数分级证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年6月3日至2015年12月31日)



注:1.本基金合同于2015年6月3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(第十五部分二、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-30.35%,同期业绩比较基准收益率为-30.13%。

§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、易方达创业板交易型开放式指数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联接基金的基金经理	2015-06-03	-	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%,并购重组指数涨幅为35.93%,作为被动型指数基金,并购重组指数分级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1.1929元,本报告期份额净值增长率为33.67%,同期业绩比较基准收益率为33.95%,年化跟踪误差为3.3282%,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。并购重组指数成份股均处于相应的行业资源整合、并购等事件过程之中,指数成分股市场预期较高、弹性较大。并购重组指数成分股整体估值水平虽然较主板大市值股票相对偏高,但鉴于当前中国经济转型期的大背景和产业创新融合的发展前景,并购重组指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金,并购重组指数分级基金将坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对业绩基准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。期望并购重组指数分级基金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,为各类不同风险偏好的投资者提供多样性的投资工具。

§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	2,855,779,131.31	86.82
	其中:股票	2,855,779,131.31	86.82
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	218,700,922.83	6.65
7	其他资产	214,948,155.19	6.53
8	合计	3,289,428,209.33	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	8,053,457.60	0.26
B	采矿业	55,397,139.00	1.80
C	制造业	1,285,658,864.79	41.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	186,365,927.03	6.06
E	建筑业	48,569,210.25	1.58
F	批发和零售业	219,416,969.76	7.14
G	交通运输、仓储和邮政业	77,155,210.66	2.51
H	住宿和餐饮业	64,181,905.76	2.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	387,567,922.02	12.60
J	金融业	28,410,386.01	0.92
K	房地产业	225,284,782.22	7.33
L	租赁和商务服务业	59,333,560.00	1.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,302,475.60	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	68,397,385.23	2.22
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	120,683,935.38	3.92
	合计	2,855,779,131.31	92.87

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	600900	长江电力	10,847,242	147,088,601.52	4.78
2	600649	城投控股	5,343,383	123,752,750.28	4.02
3	600739	辽宁成大	4,536,934	102,534,708.40	3.33
4	300315	掌趣科技	5,913,320	82,786,480.00	2.69
5	600654	中安消	2,338,936	67,454,914.24	2.19
6	600482	风帆股份	1,392,292	65,507,338.60	2.13
7	000415	渤海租赁	6,578,000	59,333,560.00	1.93
8	300383	光环新网	1,011,816	56,368,269.36	1.83
9	600547	山东黄金	2,637,959	55,397,139.00	1.80
10	600879	航天电子	3,083,149	55,095,872.63	1.79

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

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	4,148,303.37
2	应收证券清算款	210,085,586.32
3	应收股利	-
4	应收利息	46,673.67
5	应收申购款	667,591.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	214,948,155.19

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	600649	城投控股	123,752,750.28	4.02	重大事项停牌
2	600654	中安消	67,454,914.24	2.19	重大事项停牌

§6开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达重组分级	易方达重组分级A	易方达重组分级B
报告期期初基金份额总额	2,490,484,362.38	205,965,950.00	205,965,950.00
报告期基金总申购份额	51,837,536.27	-	-
减:报告期基金总赎回份额	376,523,884.60	-	-
报告期基金拆分变动份额	142,066,388.00	-71,033,194.00	-71,033,194.00
报告期期末基金份额总额	2,307,864,402.05	134,932,756.00	134,932,756.00

注:拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额。

§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.中国证监会准予易方达并购重组指数分级证券投资基金募集注册的文件;

2.《易方达并购重组指数分级证券投资基金基金合同》;

3.《易方达并购重组指数分级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

易方达策略成长证券投资基金

【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	易方达策略成长混合
基金主代码	110002
交易代码	110002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月9日
报告期末基金份额总额	477,919,197.73份
投资目标	本基金通过投资兼具较高内在价值和良好成长性的股票,积极把握股票市场波动所带来的获利机会,努力为基金份额持有人追求较高的中长期资本增值。
投资策略	本基金为主动型股票基金,投资的总体原则是在价值区域内把握波动,在波动中实现研究的"溢价"。基金采取相对稳定的资产配置策略,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时,以雄厚的研究力量为依托,通过以价值成长比率(PEG)为核心的系统方法筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握行业/板块、个股的市场波动所带来的获利机会,为基金份额持有人追求较高的当期收益及长期资本增值。
业绩比较基准	上证A指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
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,高于债券型基金及货币市场基金。
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	114,151,122.50
2.本期利润	477,894,117.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.9828
4.期末基金资产净值	2,379,454,170.88
5.期末基金份额净值	4.979

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

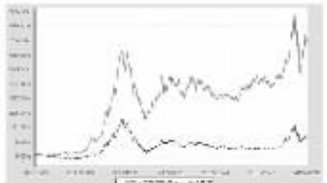
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.38%	2.23%	12.27%	1.18%	12.01%	1.05%

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

易方达策略成长证券投资基金

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

(2003年12月9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766.34%,同期业绩比较基准收益率为124.15%。

§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		
王勇	本基金的基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理、易方达医疗保健行业混合型证券投资基金的基金经理	2015-07-09	-	4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。
武阳	本基金的基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理助理	2015-08-05	-	4年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员。

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 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,国内宏观经济底部企稳,但仍处于低迷状态,经济结构转型继续推进。在经济新常态的背景下,政府提出供给侧改革的逻辑,预期明年经济结构将继续优化,但整体经济形势或存下行风险。预期财政和货币政策难有超预期之处。

A股市场在经历2015年三季度快速下跌后,四季度A股市场走出一波反弹行情,市场信心趋稳。其中,上证综指在四季度上涨15.93%,创业板指数上涨30.32%。

本基金在四季度加大了对成长型个股的配置,主要集中于计算机、传媒、医药、电子等新兴领域。

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4.979元,本报告期份额净值增长率为24.38%,同期业绩比较基准收益率为12.37%。

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

2016年是"十三五"规划的开局之年,"创新、协调、绿色、开放、共享"五大理念指导"十三五"的发展实践。在经济新常态的背景下,政府提出供给侧改革的逻辑,预期明年经济结构将继续优化,但整体经济形势或存下行风险。资本市场在制度层面将面临新的机遇和挑战,比如注册制以及战略新兴板的推出等。

基于对当前经济发展态势的判断,本基金将持续关注经济结构调整背景下的行业投资机会。预期2016年有阶段性、结构性的投资机会,2016年的投资将主要围绕创新和改革展开,其中创新主要关注新兴行业的新技术、新模式,改革主要关注供给侧改革带来的变化。

本基金将不断加强对于新兴领域的研究,着重投资成长型行业和个股,不断优化医药健康、文化传媒、计算机与互联网、新能源和材料、高端制造等新兴领域的配置结构,争取为投资者创造良好的回报。

§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	2,100,325,650.37	86.49
	其中:股票	2,100,325,650.37	86.49
2	固定收益投资	100,230,000.00	4.13
	其中:债券	100,230,000.00	4.13
	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	219,431,643.13	9.04
7	其他资产	8,499,018.43	0.35
8	合计	2,428,486,311.93	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	27,161,522.60	1.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	919,869,960.95	38.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,390,175.00	2.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	140,358,070.37	5.90
G	交通运输、仓储和邮政业	12,311,574.00	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	564,764,545.43	23.74
J	金融业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	199,037,563.32	8.36
R	文化、体育和娱乐业	182,432,238.70	7.67
S	综合	-	-
	合计	2,100,325,650.37	88.27

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	300078	思创医惠	2,801,579	136,717,055.20	5.75
2	300188	美亚柏科	2,609,940	132,323,958.00	5.56
3	300333	兆日科技	2,542,300	122,030,400.00	5.13
4	300463	迈克生物	929,172	109,075,501.08	4.58
5	600763	通策医疗	2,047,010	100,344,430.20	4.22
6	002030	达安基因	2,401,391	98,889,281.38	4.16
7	300182	捷成股份	3,706,757	88,962,168.00	3.74
8	002462	嘉事堂	1,461,715	73,992,013.30	3.11
9	002280	联络互动	1,200,000	73,680,000.00	3.10
10	002642	荣之联	1,147,656	66,437,805.84	2.79

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	100,230,000.00	4.21
	其中:政策性金融债	100,230,000.00	4.21
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,230,000.00	4.21

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	150416	15农发16	1,000,000	100,230,000.00	4.21

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	2,946,814.96
2	应收证券清算款	3,933,508.07
3	应收股利	-
4	应收利息	1,322,937.82
5	应收申购款	295,757.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,499,018.43

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	492,698,498.31
报告期基金总申购份额	13,553,602.84
减:报告期基金总赎回份额	28,332,903.42
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	477,919,197.73

§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	10,154,142.97
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	10,154,142.97
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.12

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.中国证监会批准易方达策略成长证券投资基金设立的文件;

2.《易方达策略成长证券投资基金基金合同》;

3.《易方达策略成长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

易方达策略成长二号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	易方达策略成长二号混合
基金主代码	112002
交易代码	112002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月16日
报告期末基金份额总额	1,014,194,109.75份
投资目标	本基金通过投资兼具较高内在价值和良好成长性的股票,积极把握股票市场波动所带来的获利机会,努力为基金份额持有人追求较高的中长期资本增值。
投资策略	本基金投资的总体原则是在价值区域内把握波动,在波动中实现研究的"溢价"。基金采取相对稳定的资产配置策略,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时,以雄厚的研究力量为依托,通过以价值成长比率(PEG)为核心的系统方法筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握行业/板块、个股的市场波动所带来的获利机会,为基金份额持有人追求较高的当期收益及长期资本增值。
业绩比较基准	上证A指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
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,高于债券型基金及货币市场基金。
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	78,681,818.72
2.本期利润	418,091,388.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.4041
4.期末基金资产净值	2,101,505,114.22
5.期末基金份额净值	2.072

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	24.00%	2.03%	12.37%	1.18%	11.63%	0.85%

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

易方达策略成长二号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

(2006年8月16日至2015年12月31日)

注:自