

基金管理人:易方达基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:二〇一六年三月二十五日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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责任。本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月22日核对了本报告中的财务报表、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要除摘要部分报告正文外，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料已审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意查阅。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 易方达黄金主题证券投资基金(LOF)

## [2015] 年度报告摘要

尽管国际黄金价格下跌超过了10%，但本基金在扣除费用后下跌仅不到4%。

4.5.2 报告期内本基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.609元，本报告期份额净值增长率为-3.94%，同期业绩比较基准收益率为-8.00%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2016年，全球经济复苏趋势将得以持续，预计美国经济将最早走出困境，在全球经济中最为亮眼。

美联储加息周期已经启动，但市场对于后续的节奏和步骤仍然仍有较多怀疑。根据对历史美国加息周期的研究，美联储指数步数将走强的幅度已经大幅下降，未来美联储加息只是在过去几年加息幅度最重要的指标将逐步退位，新的加息步伐将逐步出现。鉴于美元指数已达一个较为长期的顶部，我们认为将开始观察阶段配置黄金类资产的吸引力已经大为改善。

基于这些判断，我们维持了较高的黄金头寸，并保持相对美元资产的配置比例。相信基金将受益于黄金价格的上涨以及美元资产的相对升值。本基金在未来将力争用更主动、更积极的管理方式为投资者争取更好的回报。

4.7 关联方关系

关联方名称 与本基金的关系

易方达基金管理有限公司 基金管理人、基金销售机构

中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”) 基金托管人、基金销售机构

香港上海汇丰银行有限公司(以下简称“汇丰银行”) 汇券资产托管人

广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”) 基金管理人股东

广东信托投资公司(以下简称“财信信托”) 基金管理人股东

鹏城投资担保有限公司 基金管理人股东

广东省融资担保有限公司 基金管理人股东

广州市广永国际货运有限公司 基金管理人股东

易方达资产管理有限公司 基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

4.8.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

4.8.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

4.8.3 通过关联方交易单元进行的交易

4.8.4 应付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金。

4.8.5 关联方报酬

4.8.2.1 基金管理费

注:以下基金的管理费按前一天基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H = E × 1.5% ÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

4.8.2.2 基金托管费

注:本基金的托管费(包括境外托管费)按前一日基金资产净值的0.3%的年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.3% ÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金的托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

4.8.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券回购(含购回)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含购回)交易。

4.8.4 各关联方投资本基金的情况

4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司和香港上海汇丰银行有限公司保管，按同业利率定期存款利率计息。

4.8.6 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

4.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未持有处于转股期的可转换债券。

4.11 期末持有的股票投资

本基金本报告期未持有股票投资。

4.12 期末持有的债券投资

本基金本报告期未持有债券投资。

4.13 期末持有的贵金属投资

本基金本报告期未持有贵金属投资。

4.14 期末持有的权证投资

本基金本报告期未持有权证投资。

4.15 期末持有的其他投资

本基金本报告期未持有其他投资。

4.16 期末持有的买入返售金融资产

本基金本报告期未持有买入返售金融资产。

4.17 其他

本基金本报告期未持有其他资产。

4.18 期末持有的卖出回购金融资产总额

本基金本报告期未持有卖出回购金融资产总额。

4.19 期末持有的应收款项

本基金本报告期未持有应收款项。

4.20 期末持有的其他资产

本基金本报告期未持有其他资产。

4.21 期末持有的现金

本基金本报告期未持有现金。

4.22 期末持有的存出保证金

本基金本报告期未持有存出保证金。

4.23 期末持有的其他负债

本基金本报告期未持有其他负债。

4.24 期末持有的实收资本(股本)

本基金本报告期未持有实收资本(股本)。

4.25 期末持有的资本公积

本基金本报告期未持有资本公积。

4.26 期末持有的盈余公积

本基金本报告期未持有盈余公积。

4.27 期末持有的未分配利润

本基金本报告期未持有未分配利润。

4.28 期末持有的其他综合收益

本基金本报告期未持有其他综合收益。

4.29 期末持有的股权投资准备

本基金本报告期未持有股权投资准备。

4.30 期末持有的其他资产

本基金本报告期未持有其他资产。

4.31 期末持有的其他负债

本基金本报告期未持有其他负债。

4.32 期末持有的实收资本(股本)变动表

会 计 主 体:易方达黄金主题证券投资基金(LOF)

本 报 告 期:2015年1月1日至2015年12月31日

单 位:人民币元

资产 本期末 2015年12月31日 上年度末 2014年12月31日

货币资金 26,492,706.20 18,956,299.26

银行存款 19.16 18.06

存放中央银行款项 -

存放同业款项 -

拆放同业款项 -

买入返售金融资产 411,006,732.24 289,638,544.69

其中:股票型 9,141,678.00

债券型 26,496,886.69

基金型 411,006,732.24

应收票据 -

应收账款 -

预付款项 -

应收保费 -

应收分保账款 -

应收保单红利款 -

应收利息 3,321,269.07 5,778,373.03

应收股利 5,485.60 1,797.40

应收申购款 -

应收罚息 -

应收溢价 -

应收股息 366,717.54 120,206.09

应收申购款 -

递延所得税资产 344,791,888.71 310,494,052.10

存货 -

待摊费用 -

待处理财产损益 -

其他流动资产 6,709,127.00 2,376,256.62

应付职工薪酬 571,738.66 396,010.76

应付税费 114,347.73 79,603.96

应付手续费 10,163,666.07 7,607,792.93

应付股利 1,476,715.23 1,120,528.64

应付利息 440,791,888.71 310,494,052.10

负债 2015年12月31日 上年度末 2014年12月31日

短期借款 7,378,456.21 5,602,642.64

应付票据 1,430,167.02 1,885,542.62

应付账款 -

应付职工薪酬 -

应付股利 -

应付利息 1,774,711.00 1,774,711.00