易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金

【2016】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:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月18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2016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	2,799,454,936.00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,市场波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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-173,653,835.68
2.本期利润	-511,110,620.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1889
4.期末基金资产净值	5,266,230,336.90
5.期末基金份额净值	1.8812

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

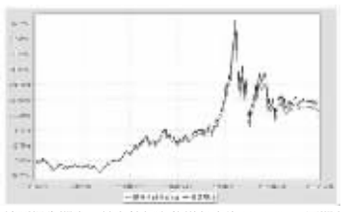
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.73%	1.05%	-8.74%	1.06%	0.01%	-0.01%

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2016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115.51%,同期业绩比较基准收益率为129.56%。

§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		
成曦	本基金的基金经理,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,易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,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,易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理	2016-05-07	-	8年	硕士研究生,曾任华泰联合证券资产管理部研究员;易方达基金管理有限公司集中交易室交易员,指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。

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12次,皆为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2016年四季度CPI从三季末的1.9上升至11月份的2.3,由生产资料带来的通胀压力开始有所体现;中国9、10、11、12月财新PMI分别为50.1、51.2、50.9、51.9,其中12月服务业PMI上升至53.4,企业景气度有所回升;在资金方面,人民币贷款10月6513亿元,11月7946亿元,相较上半年新增贷款速度,有明显下降。虽然地产调控政策导致房地产行业的经济刺激作用降低,但预计政府将通过财政政策支持和基建投资来托底经济;此外,稳定经济环境、防范风险也成为未来重要的政策目标。

报告期内本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

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1.8812元,本报告期份额净值增长率为-8.73%,同期业绩比较基准收益率为-8.74%,日跟踪偏离度的均值为0.01%,年化跟踪误差0.21%,在合同规定的目标控制范围之内。

§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	5,148,331,660.08	97.60
	其中:股票	5,148,331,660.08	97.60
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	73,745,701.42	1.40
7	其他资产	52,865,943.88	1.00
8	合计	5,274,943,305.38	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	395,057,668.32	7.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,328,413,083.15	44.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	46,817,053.92	0.89
F	批发和零售业	27,862,876.80	0.53
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	1,672,904,074.14	31.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	95,171,569.35	1.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	129,900,831.12	2.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	133,858,148.30	2.54
R	文化、体育和娱乐业	318,337,104.98	6.04
S	综合	-	-
	合计	5,148,322,410.08	97.76

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	300498	温氏股份	11,216,856	396,057,668.32	7.50
2	300104	乐视网	5,193,854	185,939,973.20	3.53
3	300059	东方财富	10,188,519	172,491,626.67	3.28
4	300070	碧水源	7,414,431	129,900,831.12	2.47
5	300017	网宿科技	2,356,334	126,323,065.74	2.40
6	300072	三聚环保	2,719,981	125,907,920.49	2.39
7	300024	机器人	5,835,638	124,765,940.44	2.37
8	300124	汇川技术	4,914,974	99,921,421.42	1.90
9	300136	信维通信	3,330,227	94,911,469.50	1.80
10	300315	掌趣科技	10,055,897	92,916,488.28	1.76

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	166,611.12
2	应收证券清算款	52,681,298.39
3	应收股利	-
4	应收利息	18,034.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,865,943.88

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	185,939,973.20	3.53	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	2,589,454,936.00
报告期基金总申购份额	3,236,000,000.00
减:报告期基金总赎回份额	3,026,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,799,454,936.00

§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
二〇一七年一月二十日

易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金

【2016】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:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月18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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达纯债1年定期开放债券
基金主代码	000111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月30日
报告期末基金份额总额	1,543,845,712.86份
投资目标	本基金投资目标是在追求本金安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期内,在投资组合平均久期与封闭运作期适当匹配的基础上,本基金将密切关注宏观经济走势,采取自上而下分析方法,预测未来利率走势和收益率曲线变动情况,确定资产的最优配置比例及久期配置策略。对于信用类固定收益品种,本基金在进行信用风险评估后,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略。开放运作期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期银行定期整存整取存款利率(税后)+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	易方达纯债1年定期开放债券A / 易方达纯债1年定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000111 / 000112
报告期末下属分级基金的份额总额	1,466,519,405.92份 / 77,326,306.94份

§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(2016年10月1日-2016年12月31日)	
	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C
1.本期已实现收益	14,096,060.57	656,065.19
2.本期利润	-18,114,323.07	-1,025,923.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0124	-0.0133
4.期末基金资产净值	1,532,610,977.15	80,003,375.01
5.期末基金份额净值	1.045	1.035

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

易方达纯债1年定期开放债券A

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	-1.14%	0.10%	0.64%	0.01%	-1.78%	0.09%

易方达纯债1年定期开放债券C

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	-1.24%	0.10%	0.64%	0.01%	-1.88%	0.09%

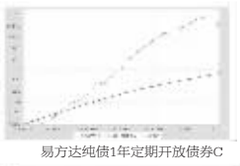
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金

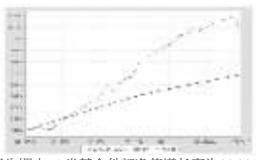
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年7月30日至2016年12月31日)

易方达纯债1年定期开放债券A



易方达纯债1年定期开放债券C



注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为22.82%,C类基金份额净值增长率为21.40%,同期业绩比较基准收益率为11.45%。

§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		
李一硕	本基金的基金经理,易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理,易方达瑞银灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理,易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理,易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助理,易方达纳如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理助理	2015-03-14	-	8年	硕士研究生,曾任瑞银证券有限公司研究员,中国国际金融有限公司研究员,易方达基金管理有限公司研究员。

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12次,皆为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

四季度初,随着房地产市场限购限贷政策的出台,机构对于经济下行的预期增加,同时配置需求也在持续释放,这些因素共同带动债券市场收益率下行,尤其是中长端利率债品种表现良好。

不过11月后市场开始明显转向。特朗普当选为美国总统后,美国基建投资需求上升及通胀走高的预期不断扩散,导致美国国债收益率不断攀升。最关键的是,国内制造业投资复苏的迹象也越来越明显。PPI价格增速自9月份转正后,11月同比增长达到3.3%,大幅超出市场预期。在工业品价格上升的背景下,工业企业收入大幅攀升,同时企业利润也有明显改善,回到全年高点水平。

国内经济基本面改善的同时,11月以来银行间市场流动性也不断收紧,导致回购利率持续攀升。在债市收益率上升的背景下,由于资产端收缩传导的链条较长,去杠杆过程带来的市场调整剧烈程度超出预期。总体而言,由于短期流动性冲击的影响较大,收益率曲线熊市变平。与11月初相比,12月下旬收益率达到最高点时1年国开行金融债上升156bp,10年国开债收益率上行81bp,上升幅度超过了2013年"钱荒"时的水平。12月下旬以后,随着央行持续投放流动性,资金面极度紧张的状况得到了缓解,收益率较此前高点出现了一定幅度的回落。

操作上,考虑到四季度初债券市场估值水平已经较高,收益率下行及信用债利差压缩的空间均非常有限,四季度组合维持中性偏低的杠杆及久期水平。但由于短端收益率上行幅度非常明显以及资金利率持续高企,组合净值在此期间有所回撤。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.045元,本报告期份额净值增长率为-1.14%;C类基金份额净值为1.035元,本报告期份额净值增长率为-1.24%;同期业绩比较基准收益率为0.64%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,301,653,728.10	91.40
	其中:债券	2,301,653,728.10	91.40
	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	130,800,396.20	5.19
	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	48,066,813.63	1.91
7	其他资产	37,612,911.01	1.49
8	合计	2,518,133,848.94	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,169,006,728.10	72.49
5	企业短期融资券	567,802,000.00	35.21
6	中期票据	564,845,000.00	35.03
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,301,653,728.10	142.73

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	112425	16司钢02	700,000	68,663,000.00	4.26
2	112093	11亚迪01	633,093	63,435,918.60	3.93
3	101452027	14电网MTN002	600,000	60,306,000.00	3.74
4	011698587	16淮南矿3CP008	600,000	59,688,000.00	3.70
5	011698149	16皖能源3CP001	500,000	49,900,000.00	3.09

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本基金本报告期没有投资股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,289.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,600,621.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,612,911.01

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

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	1,469,967,466.02	77,574,653.69
报告期基金总申购份额	-	-
减:报告期基金总赎回份额	3,448,060.10	248,346.75
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	1,466,519,405.92	77,326,306.94

§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纯债1年定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2.《易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3.《易方达纯债1年定期开放债券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
二〇一七年一月二十日

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2016】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:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月18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2016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	537,211,496.80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金融动指数基金,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,市场波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。

§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

投资目标	报告期(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,899,801.50
2.本期利润	-94,857,850.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1896
4.期末基金资产净值	1,076,954,308.75
5.期末基金份额净值	2.0047

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

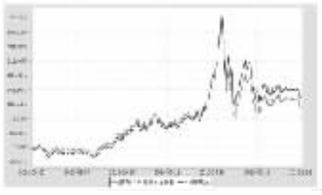
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.42%	1.00%	-8.30%	1.01%	-0.12%	-0.01%

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联接基金

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2016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100.47%,同期业绩比较基准收益率为123.76%。

§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		
成曦	本基金的基金经理,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,易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,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,易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理	2016-05-07	-	8年	硕士研究生,曾任华泰联合证券资产管理部研究员;易方达基金管理有限公司集中交易室交易员,指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。

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