

**易方达创业板交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2015 年半年度报告  
2015 年 6 月 30 日**

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

送出日期：二〇一五年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末投资目标基金明细.....	32
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.7 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.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.9 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.....	38
7.10 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.....	38

7.11	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	38
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.13	投资组合报告附注 .....	38
8	基金份额持有人信息 .....	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	39
9	开放式基金份额变动 .....	40
10	重大事件揭示 .....	40
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	40
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4	基金投资策略的改变 .....	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8	其他重大事件 .....	42
11	备查文件目录 .....	44
11.1	备查文件目录 .....	44
11.2	存放地点 .....	44
11.3	查阅方式 .....	44

## 2 基金简介

### 2.1 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联接基金
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
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
报告期末基金份额总额	240,713,198.26 份
基金合同存续期	不定期

#### 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

### 2.2 基金产品说明

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全被动指数基金，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。

### 2.2.1 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、市场流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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南
	联系电话	020-38797888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-38799488	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510620	100140
法定代表人	刘晓艳	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>

基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼
-------------	--------------------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	281,280,424.88
本期利润	275,680,774.57
加权平均基金份额本期利润	1.0332
本期加权平均净值利润率	36.91%
本期基金份额净值增长率	73.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	393,587,112.03
期末可供分配基金份额利润	1.6351
期末基金资产净值	730,152,022.13
期末基金份额净值	3.0333
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	203.33%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

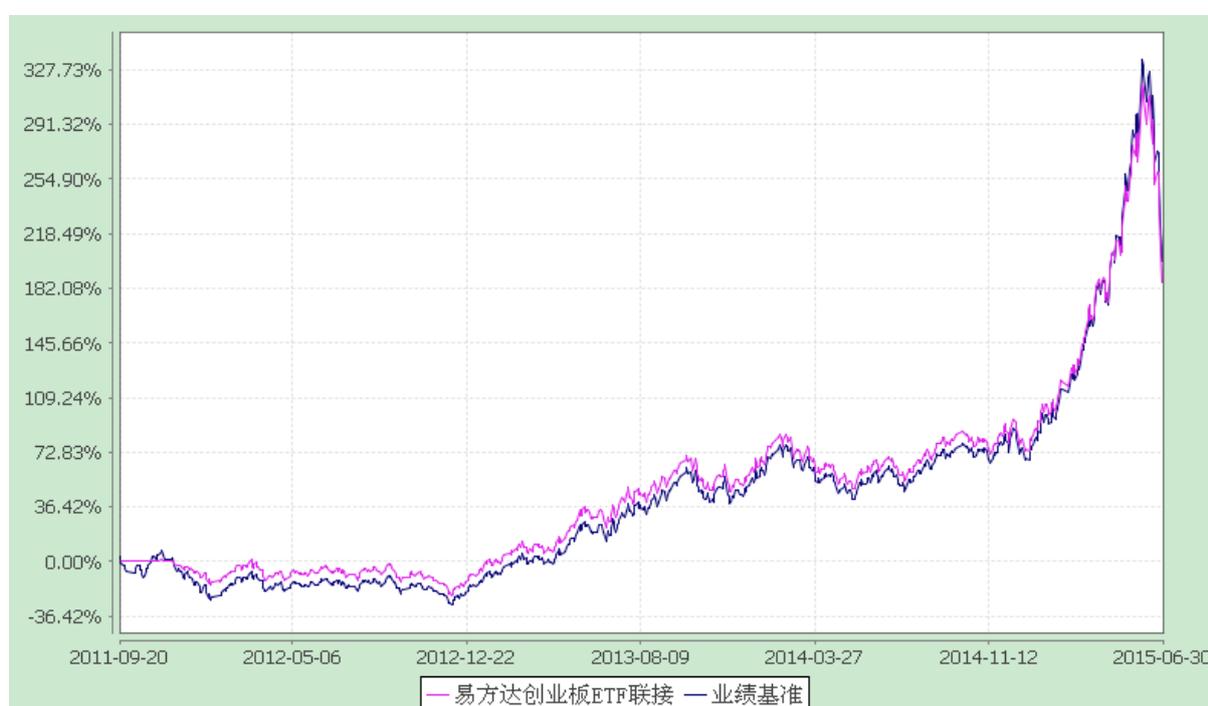
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-19.56%	4.36%	-18.35%	4.30%	-1.21%	0.06%
过去三个月	14.36%	3.34%	21.41%	3.34%	-7.05%	0.00%

过去六个月	73.70%	2.72%	88.36%	2.73%	-14.66%	-0.01%
过去一年	79.99%	2.14%	97.04%	2.16%	-17.05%	-0.02%
过去三年	223.21%	1.85%	270.08%	1.88%	-46.87%	-0.03%
自基金合同生效起至今	203.33%	1.75%	217.83%	1.88%	-14.50%	-0.13%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2011年9月20日至2015年6月30日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 203.33%，同期业绩比较基准收益率为 217.83%。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日,注册资本1.2亿元,旗下设有北京、广州、上海、成都、南京分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司、广东新三联投资发展有限公司等多个子公司。易方达秉承“取信于市场,取信于社会”的宗旨,坚持“在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的

经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至 2015 年 6 月 30 日，易方达旗下共管理 82 只开放式基金、1 只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，资产管理总规模 5348.85 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 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、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、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、易方达并购重组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、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理	2011-09-20	-	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。
3. 为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 3 次，其中 2 次为为指数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非指数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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年 GDP 同比增速为 7%，其中一二季度基本持平，整体经济出现企稳的迹象。从工业增加值角度来看，四月份开始工业增加值同比增速呈现出明显的逐步企稳势头。CPI 整体仍维持在较低的水平，同时 PPI 仍处于长期的负增长状态。三月底左右政府适时出台了相关刺激房地产市场的相应措施，随后二季度内房地产销量得以持续回升。上半年货币供应量整体呈现宽松状态，市场增量资金入市明显，上证指数一度冲破 5100 点。随后在清理场外配资业务的影响下，市场出现了

快速的大幅回撤，呈现出明显的去杠杆特征。虽然六月底央行出台了降息、降准的紧急政策，但是市场快速下跌的趋势在六月底仍未得到有效遏制。2015 年上半年上证指数涨幅为 32.23%，创业板价格指数涨幅为 94.23%，作为被动型指数基金，创业板 ETF 联接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 3.0333 元，本报告期份额净值增长率为 73.70%，同期业绩比较基准收益率为 88.36%，年化跟踪误差为 3.0941%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 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。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已成为政府经济工作的重点。尽管二季度末股市在去杠杆的背景下，市场快速回调，但是市场向好的坚实基础仍在。股市的暴跌更多来自恐慌情绪导致的，经过近期的调整，场外配资的风险已经大量释放，经过快速下跌后的风险释放，市场正给长线资金带来良好的布局机会。

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，房地产政策的调整、货币政策的适当放松、定向的增加投资以及对中小微企业扶持力度的加强等综合经济手段，有利于稳定整体经济的增长和促进结构调整。同时，国家层面的“一带一路”战略将极大的促进国内企业的“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。创业板指数行业分布主要集中在新兴产业，指数成分股市值小、成长性高、弹性大。创业板指数成分股主要为小市值股票，虽然其估值水平普遍较主板大市值股票高，但鉴于当前中国经济转型期的大背景和新兴产业未来的发展前景，创业板指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金，创业板 ETF 联接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。期望创业板 ETF 联接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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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管理人——易方达基金管理有限公司在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投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,811,822.55	15,446,729.66
结算备付金		52,672,642.73	11,392,953.19
存出保证金		386,400.44	254,784.11
交易性金融资产	6.4.7.2	725,737,304.52	517,719,585.13
其中：股票投资		15,045,395.60	3,622,664.50
基金投资		670,625,908.92	494,070,920.63
债券投资		40,066,000.00	20,026,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		54,954,149.31	72,953.05
应收利息	6.4.7.5	734,669.79	253,704.69
应收股利		-	-
应收申购款		13,844,930.95	14,815,191.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	29,328.60	8,174.10
资产总计		868,171,248.89	559,964,075.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		136,199,078.74	33,861,964.57
应付管理人报酬		39,567.79	19,256.67
应付托管费		7,913.55	3,851.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,021,009.54	60,076.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	751,657.14	531,159.78
负债合计		138,019,226.76	34,476,308.91
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	240,713,198.26	300,914,694.28
未分配利润	6.4.7.10	489,438,823.87	224,573,072.72
所有者权益合计		730,152,022.13	525,487,767.00
负债和所有者权益总计		868,171,248.89	559,964,075.91

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.0333 元，基金份额总额 240,713,198.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>277,739,443.54</b>	<b>35,150,893.17</b>
1.利息收入		680,468.92	796,027.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	241,393.63	136,988.88
债券利息收入		439,075.29	659,038.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		278,817,473.67	38,882,640.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,979,908.36	721,629.76
基金投资收益	6.4.7.13	276,825,172.49	38,146,924.24
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	12,392.82	14,086.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,599,650.31	-6,344,006.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,841,151.26	1,816,231.72
<b>减：二、费用</b>		<b>2,058,668.97</b>	<b>916,296.87</b>
1. 管理人报酬		153,829.90	150,013.53
2. 托管费		30,765.98	30,002.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,663,882.08	539,790.01
5. 利息支出		-	864.16
其中：卖出回购金融资产支出		-	864.16
6. 其他费用	6.4.7.20	210,191.01	195,626.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>275,680,774.57</b>	<b>34,234,596.30</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>275,680,774.57</b>	<b>34,234,596.30</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	300,914,694.28	224,573,072.72	525,487,767.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	275,680,774.57	275,680,774.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-60,201,496.02	-10,815,023.42	-71,016,519.44
其中：1.基金申购款	1,052,819,863.70	2,069,870,492.57	3,122,690,356.27
2.基金赎回款	-1,113,021,359.72	-2,080,685,515.99	-3,193,706,875.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	240,713,198.26	489,438,823.87	730,152,022.13

项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	449,973,011.00	258,064,787.51	708,037,798.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,234,596.30	34,234,596.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	70,769,310.16	64,585,723.68	135,355,033.84
其中：1.基金申购款	949,124,755.04	652,552,450.91	1,601,677,205.95
2.基金赎回款	-878,355,444.88	-587,966,727.23	-1,466,322,172.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	520,742,321.16	356,885,107.49	877,627,428.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 740 号《关于核准易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 377,470,567.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 39,577.08 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项

具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述事项外, 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### 6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	19,811,822.55
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	19,811,822.55

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	18,328,903.05	15,045,395.60	-3,283,507.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	40,081,120.00	40,066,000.00	-15,120.00
	合计	40,081,120.00	40,066,000.00	-15,120.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	630,370,636.91	670,625,908.92	40,255,272.01	
其他	-	-	-	

合计	688,780,659.96	725,737,304.52	36,956,644.56
----	----------------	----------------	---------------

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	7,101.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,102.09
应收债券利息	722,310.14
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	156.51
合计	734,669.79

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	29,328.60
待摊费用	-
合计	29,328.60

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,020,809.54
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	1,021,009.54

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	560,242.40
预提费用	191,414.74
合计	751,657.14

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	300,914,694.28	300,914,694.28
本期申购	1,052,819,863.70	1,052,819,863.70
本期赎回（以“-”号填列）	-1,113,021,359.72	-1,113,021,359.72
本期末	240,713,198.26	240,713,198.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	129,659,070.27	94,914,002.45	224,573,072.72
本期利润	281,280,424.88	-5,599,650.31	275,680,774.57
本期基金份额交易产生的变动数	-17,352,383.12	6,537,359.70	-10,815,023.42
其中：基金申购款	1,029,335,413.69	1,040,535,078.88	2,069,870,492.57
基金赎回款	-1,046,687,796.81	-1,033,997,719.18	-2,080,685,515.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	393,587,112.03	95,851,711.84	489,438,823.87

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	179,281.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	56,702.88
其他	5,408.91
合计	241,393.63

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,311,323.16
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-2,331,414.80
合计	1,979,908.36

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	370,842,804.12
减：卖出股票成本总额	366,531,480.96
买卖股票差价收入	4,311,323.16

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	1,007,387,000.00
减：现金支付申购款总额	225,397,298.36
减：申购股票成本总额	784,321,116.44
申购差价收入	-2,331,414.80

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,145,062,145.75
减：卖出/赎回基金成本总额	868,236,973.26
基金投资收益	276,825,172.49

#### 6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,392.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,392.82

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-5,599,650.31
——股票投资	-3,571,627.77
——债券投资	43,600.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-2,071,622.54
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-5,599,650.31

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	3,841,151.26
合计	3,841,151.26

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,663,682.08
银行间市场交易费用	200.00
合计	1,663,882.08

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	42,647.22
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	9,776.27
银行间账户维护费	9,000.00
其他	-
合计	210,191.01

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	153,829.90	150,013.53
其中：支付销售机构的客户维护费	504,061.70	522,342.33

注：1.本基金的管理费按调整后的前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日基金持有的创业板 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2.客户维护费按日提，按季支付，具体公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的客户维护费

E 为前一日代销机构保有该基金份额的基金资产净值

R 为代销机构的客户维护费率

对于非工作日，则按照前一工作日的保有资产市值计算当日客户维护费。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	30,765.98	30,002.72

注：本基金的托管费按调整后的前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的创业板 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达资产管理 有限公司	276,587.87	0.11%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	19,811,822.55	179,281.84	19,066,914.55	104,454.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 249,090,335 份和 343,749,336 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 17.82% 和 39.00%。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300071	华谊嘉信	2015-05-21	重大事项	13.66	-	-	7,200	101,437.89	98,352.00	-
300074	华平股份	2015-06-29	重大事项	15.39	2015-07-14	16.00	3,840	87,586.36	59,097.60	-
300096	易联众	2015-05-28	重大事项	39.55	-	-	6,800	265,363.44	268,940.00	-
300113	顺网科技	2015-05-05	重大事项	57.70	2015-08-06	51.93	60,800	3,515,384.02	3,508,160.00	-
300197	铁汉生态	2015-06-16	重大事项	36.03	-	-	300	9,310.24	10,809.00	-
300212	易华录	2015-06-30	重大事项	59.94	2015-07-13	54.00	2,000	159,849.00	119,880.00	-
300228	富瑞特装	2015-06-24	重大事项	90.91	2015-07-30	81.82	1,000	99,965.00	90,910.00	-
300288	飞利信	2015-06-	重大事	54.26	-	-	5,200	273,618.00	282,152.00	-

7		-02	项							
300291	华录百纳	2015-06-30	重大事项	37.76	2015-07-13	34.65	2,800	151,200.00	105,728.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。本基金属股票基金，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，采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于创业板 E T F，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此本基金具有与标的指数相似的风险收益特征。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2014 年 12 月 31 日：0.00%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
--------	-------------------	---------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	40,788,310.14	20,273,956.16
合计	40,788,310.14	20,273,956.16

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有三方机构评级的短期融资券。3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,811,822.55	-	-	-	19,811,822.55
结算备付金	52,672,642.73	-	-	-	52,672,642.73
存出保证金	386,400.44	-	-	-	386,400.44
交易性金融资产	40,066,000.00	-	-	685,671,304.52	725,737,304.5

					2
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	54,954,149.31	54,954,149.31
应收利息	-	-	-	734,669.79	734,669.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,844,930.95	13,844,930.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	29,328.60	29,328.60
资产总计	112,936,865.72	-	-	755,234,383.17	868,171,248.89
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	136,199,078.74	136,199,078.74
应付管理人报酬	-	-	-	39,567.79	39,567.79
应付托管费	-	-	-	7,913.55	7,913.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,021,009.54	1,021,009.54
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	751,657.14	751,657.14
负债总计	-	-	-	138,019,226.76	138,019,226.76
利率敏感度缺口	112,936,865.72	-	-	617,215,156.41	730,152,022.13
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	15,446,729.66	-	-	-	15,446,729.66
结算备付金	11,392,953.19	-	-	-	11,392,953.19
存出保证金	254,784.11	-	-	-	254,784.11
交易性金融资产	20,026,000.00	-	-	497,693,585.13	517,719,585.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	72,953.05	72,953.05
应收利息	-	-	-	253,704.69	253,704.69
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	556,494.63	-	-	14,258,697.35	14,815,191.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	8,174.10	8,174.10
资产总计	47,676,961.59	-	-	512,287,114.32	559,964,075.91
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	33,861,964.57	33,861,964.57
应付管理人报酬	-	-	-	19,256.67	19,256.67
应付托管费	-	-	-	3,851.33	3,851.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	60,076.56	60,076.56
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	531,159.78	531,159.78
负债总计	-	-	-	34,476,308.91	34,476,308.91
利率敏感度缺口	47,676,961.59	-	-	477,810,805.41	525,487,767.00

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	54,210.62	34,489.55
	2.市场利率上升 25 个基点	-54,009.60	-34,371.16

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,045,395.60	2.06	3,622,664.50	0.69
交易性金融资产—基金投资	670,625,908.92	91.85	494,070,920.63	94.02
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	685,671,304.52	93.91	497,693,585.13	94.71

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2015 年 6 月 30 日	2014 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	36,513,654.55	24,194,970.98
	2.业绩比较基准下降 5%	-36,513,654.55	-24,194,970.98

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 681,127,275.92 元，属于第二层次的余额为 44,610,028.60 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 3,610,010.50 元，第二层次 514,109,574.63 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 19 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

##### (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

##### (d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,045,395.60	1.73
	其中：股票	15,045,395.60	1.73
2	基金投资	670,625,908.92	77.25
3	固定收益投资	40,066,000.00	4.61
	其中：债券	40,066,000.00	4.61
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	72,484,465.28	8.35
8	其他各项资产	69,949,479.09	8.06
9	合计	868,171,248.89	100.00

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)	易方达基金管理有限公司	670,625,908.92	91.85

## 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	68,034.00	0.01

C	制造业	5,113,242.40	0.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	132,457.00	0.02
F	批发和零售业	-	-
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	7,553,197.60	1.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	693,851.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	70,560.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	273,224.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	309,460.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	831,369.60	0.11
S	综合	-	-
	合计	15,045,395.60	2.06

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300113	顺网科技	60,800	3,508,160.00	0.48
2	300068	南都电源	42,996	896,466.60	0.12
3	300059	东方财富	11,200	706,608.00	0.10
4	300178	腾邦国际	11,500	415,265.00	0.06
5	300104	乐视网	8,000	414,080.00	0.06
6	300199	翰宇药业	12,000	387,960.00	0.05
7	300024	机器人	4,800	370,848.00	0.05
8	300168	万达信息	6,600	324,192.00	0.04
9	300027	华谊兄弟	8,200	312,748.00	0.04
10	300003	乐普医疗	7,300	296,161.00	0.04
11	300287	飞利信	5,200	282,152.00	0.04

12	300070	碧水源	5,600	273,224.00	0.04
13	300133	华策影视	10,000	270,000.00	0.04
14	300096	易联众	6,800	268,940.00	0.04
15	300101	振芯科技	4,200	233,520.00	0.03
16	300017	网宿科技	4,600	213,532.00	0.03
17	300124	汇川技术	3,800	182,400.00	0.02
18	300058	蓝色光标	11,400	180,234.00	0.02
19	300253	卫宁软件	3,400	176,800.00	0.02
20	300033	同花顺	1,800	154,782.00	0.02
21	300010	立思辰	5,400	154,008.00	0.02
22	300002	神州泰岳	9,800	149,352.00	0.02
23	300001	特锐德	7,040	144,812.80	0.02
24	300273	和佳股份	4,800	142,992.00	0.02
25	300170	汉得信息	5,800	140,882.00	0.02
26	300075	数字政通	3,700	139,453.00	0.02
27	300072	三聚环保	3,800	128,060.00	0.02
28	300267	尔康制药	3,600	122,724.00	0.02
29	300315	掌趣科技	9,000	121,950.00	0.02
30	300212	易华录	2,000	119,880.00	0.02
31	300244	迪安诊断	1,400	117,516.00	0.02
32	300216	千山药机	2,400	117,168.00	0.02
33	300274	阳光电源	3,800	116,166.00	0.02
34	300251	光线传媒	4,600	114,540.00	0.02
35	300077	国民技术	2,600	110,604.00	0.02
36	300291	华录百纳	2,800	105,728.00	0.01
37	300020	银江股份	3,800	104,500.00	0.01
38	300015	爱尔眼科	3,200	103,232.00	0.01
39	300146	汤臣倍健	2,600	102,128.00	0.01
40	300071	华谊嘉信	7,200	98,352.00	0.01
41	300202	聚龙股份	2,400	96,960.00	0.01
42	300271	华宇软件	2,200	96,382.00	0.01
43	300088	长信科技	3,400	93,500.00	0.01
44	300182	捷成股份	1,800	92,700.00	0.01
45	300037	新宙邦	2,400	91,848.00	0.01
46	300228	富瑞特装	1,000	90,910.00	0.01
47	300005	探路者	3,300	90,420.00	0.01
48	300347	泰格医药	2,600	88,712.00	0.01
49	300288	朗玛信息	1,500	87,795.00	0.01
50	300115	长盈精密	2,600	86,606.00	0.01
51	300257	开山股份	3,400	82,280.00	0.01
52	300055	万邦达	3,400	82,246.00	0.01
53	300039	上海凯宝	5,000	77,750.00	0.01
54	300207	欣旺达	3,200	77,504.00	0.01
55	300054	鼎龙股份	2,800	74,228.00	0.01

56	300238	冠昊生物	1,800	73,386.00	0.01
57	300205	天喻信息	2,400	72,360.00	0.01
58	300011	鼎汉技术	2,000	70,840.00	0.01
59	300332	天壕节能	2,800	70,560.00	0.01
60	300157	恒泰艾普	4,600	68,034.00	0.01
61	300004	南风股份	1,000	68,000.00	0.01
62	300171	东富龙	2,400	67,416.00	0.01
63	300134	大富科技	2,400	67,080.00	0.01
64	300043	互动娱乐	4,400	66,044.00	0.01
65	300137	先河环保	2,800	64,064.00	0.01
66	300034	钢研高纳	1,800	63,882.00	0.01
67	300352	北信源	1,400	60,760.00	0.01
68	300074	华平股份	3,840	59,097.60	0.01
69	300122	智飞生物	2,000	57,700.00	0.01
70	300014	亿纬锂能	2,000	53,000.00	0.01
71	300006	莱美药业	1,200	51,480.00	0.01
72	300183	东软载波	1,800	51,300.00	0.01
73	300052	中青宝	1,600	51,040.00	0.01
74	300295	三六五网	400	46,156.00	0.01
75	300118	东方日升	3,600	43,308.00	0.01
76	300177	中海达	2,200	43,098.00	0.01
77	300355	蒙草抗旱	2,200	39,402.00	0.01
78	300363	博腾股份	800	37,568.00	0.01
79	300386	飞天诚信	200	28,696.00	0.00
80	300148	天舟文化	1,320	28,353.60	0.00
81	300197	铁汉生态	300	10,809.00	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300104	乐视网	43,567,047.04	8.29
2	300168	万达信息	29,975,736.32	5.70
3	300024	机器人	29,403,417.34	5.60
4	300027	华谊兄弟	27,619,513.75	5.26
5	300070	碧水源	25,689,833.75	4.89
6	300059	东方财富	22,311,898.03	4.25
7	300253	卫宁软件	20,703,547.08	3.94
8	300002	神州泰岳	19,050,057.22	3.63

9	300058	蓝色光标	16,952,861.22	3.23
10	300124	汇川技术	16,501,129.22	3.14
11	300003	乐普医疗	15,742,711.28	3.00
12	300017	网宿科技	13,698,794.22	2.61
13	300170	汉得信息	13,457,014.50	2.56
14	300315	掌趣科技	13,095,112.04	2.49
15	300077	国民技术	13,017,017.81	2.48
16	300273	和佳股份	12,178,777.43	2.32
17	300144	宋城演艺	11,956,876.13	2.28
18	300244	迪安诊断	11,702,569.79	2.23
19	300216	千山药机	11,624,495.74	2.21
20	300072	三聚环保	11,536,315.22	2.20
21	300274	阳光电源	11,149,267.09	2.12
22	300212	易华录	10,581,398.82	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	31,294,235.37	5.96
2	300104	乐视网	17,976,519.03	3.42
3	300168	万达信息	16,105,857.07	3.06
4	300002	神州泰岳	13,496,251.16	2.57
5	300024	机器人	13,300,058.98	2.53
6	300027	华谊兄弟	11,198,868.66	2.13
7	300070	碧水源	10,838,015.60	2.06
8	300017	网宿科技	8,256,312.29	1.57
9	300253	卫宁软件	8,131,295.00	1.55
10	300124	汇川技术	7,526,432.10	1.43
11	300033	同花顺	7,289,051.80	1.39
12	300058	蓝色光标	6,701,132.65	1.28
13	300003	乐普医疗	6,333,868.29	1.21
14	300274	阳光电源	6,076,385.52	1.16
15	300144	宋城演艺	5,699,329.74	1.08
16	300244	迪安诊断	5,481,609.13	1.04
17	300077	国民技术	5,480,463.00	1.04
18	300315	掌趣科技	5,458,632.30	1.04
19	300072	三聚环保	4,929,545.64	0.94
20	300170	汉得信息	4,907,194.40	0.93

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	808,581,606.27
卖出股票收入（成交）总额	370,842,804.12

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,066,000.00	5.49
	其中：政策性金融债	40,066,000.00	5.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	40,066,000.00	5.49

## 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140223	14 国开 23	200,000	20,080,000.00	2.75
2	150413	15 农发 13	200,000	19,986,000.00	2.74

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.9 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。

**7.10 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。

**7.11 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。

**7.12 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。

**7.13 投资组合报告附注**

**7.13.1** 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。

**7.13.2** 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。

**7.13.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	386,400.44
2	应收证券清算款	54,954,149.31
3	应收股利	-
4	应收利息	734,669.79
5	应收申购款	13,844,930.95
6	其他应收款	29,328.60
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,949,479.09

**7.13.4 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。

## 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情 况说明
1	300113	顺网科技	3,508,160.00	0.48	重大事项停 牌

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
37,876	6,355.30	12,563,633.65	5.22%	228,149,564.61	94.78%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	40,639.87	0.0169%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月20日）基金份额总额	377,470,567.39
本报告期期初基金份额总额	300,914,694.28
本报告期基金总申购份额	1,052,819,863.70
减：本报告期基金总赎回份额	1,113,021,359.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	240,713,198.26

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年6月2日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长城国瑞	1	1,179,424,410.39	100.00%	1,073,752.66	100.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元,厦门证券有限公司更名为长城国瑞证券有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下:

- 1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城国瑞	-	-	-	-	-	-	783,615,040.87	100.00%

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加龙湾农商银行为销售机构、在龙湾农商银行推出定期定额投资业务及参加龙湾农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-15
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海证券为销售机构、在上海证券推出定期定额投资业务及参加上海证券申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-19
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-26
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-31
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加长安银行为销售机构、在长安银行推出定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-02
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泉州银行为销售机构、在泉州银行推出定期定额投资业务及参加泉州银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-10
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加天津银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-16
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富滇银行为销售机构、在富滇银行推出定期定额投资业务及参加富滇银行申购	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-03

	与定期定额投资费率优惠活动的公告		
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加数米基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-05
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南海农商银行为销售机构、在南海农商银行推出定期定额投资业务及参加南海农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-17
11	易方达基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-20
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信建投期货为销售机构、在中信建投期货推出定期定额投资业务及参加中信建投期货申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-23
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-30
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞丰银行为销售机构、在瑞丰银行推出定期定额投资业务及参加瑞丰银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-30
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加利得基金为销售机构、参加利得基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-10
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加洛阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-24
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华兴银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-27
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加恒丰银行为销售机构、参加恒丰银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-28
19	易方达基金管理有限公司关于成立易方达国际控股有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-29
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加一路财富官方网站申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-28
21	易方达基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购单笔最低金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-29

22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-01
23	易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金在网上直销暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-09
24	易方达基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
25	易方达基金管理有限公司对市场上出现假冒公司客服电话进行诈骗活动的特别提示	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-25

## 11 备查文件目录

### 11.1 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联接基金募集的文件；
- 2.《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 4.《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇一五年八月二十六日