

易方达沪深300指数证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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:二〇一二年四月二十四日
§ 重要提示

基金管理人和托管人承诺保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理公司根据本基金合同约定，于2012年4月20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，确认本报告不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资有风险，投资人应在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 易方达沪深300指数

基金主代码 110020

交易代码 110020

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2009年8月26日

报告期末基金份额总额 9,185,595,871.02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 本基金主要采取完全复制法，即按照沪深300指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征 本基金是指数增强型基金，属于证券投资基金中的高风险、高收益品种，理论上的风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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

§ 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(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -50,827,708.81

2.本期利润 250,901,109.12

3.加权平均基金份额本期利润 0.0277

4.期末基金份额净值 6,952,584,726.90

5.期末基金份额总额 9,185,595,871.02份

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,即本期利润=本期已实现收益+本期利息收入-本期股利收入-本期其他收入-本期管理人报酬、托管人报酬、销售服务费、赎回费、申购费、转换费等费用。

2.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将低于所列数字。

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

过去三个月 4.04% 1.43% 1.44% -0.42% -0.01%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

易方达沪深300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历史走势对比图

(2009年8月6日至2012年3月31日)

注:1.易方达沪深300指数证券投资基金合同中关于基金投资比例的约定:

①本基金不得持有权证,其所持有的股票资产不得超过基金资产净值的30%;

②本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司股票,不超过该股票的10%;

③本基金投资于进入全国银行间同业市场的债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

④本基金投资股票和基金资产的比例为0%-95%,其中投资于沪深300指数成分股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%;

⑤本基金持有的全部资产支持证券的比例,不超过基金资产净值的20%;

⑥本基金持有的全部资产支持证券,其类别不得超过基金资产净值的10%;

⑦本基金持有的同一机构发行的资产支持证券的类别,不超过该类资产支持证券规模的10%;

⑧本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

⑨本基金投资于信用级别为BBB以上(含BBB)的资产支持证券,基金持有资产支持证券期间,如果其信用评级下降,不再符合投资标准,所在评级报告发布之日起个月内予以全部卖出;

⑩本基金投资于进入全国银行间同业市场的债券回购的资金余额不得超过基金总资产,本基金在申报的股票账户上单只股票的余额不得超过该股票账户总资产的10%;

⑪本基金任何一只买入的股票的总市值,不得高于上一年度日基金资产净值的0.5%;

⑫本基金持有的现金比例不得低于上一年度日基金资产净值的0.5%;

⑬如果法律对本基金合同约定的投资范围限制进行了变更,以变更后的为准。法律法规或监管部门取消上述限制,本基金可投资于新的品种;

⑭本基金投资于国债期货、股指期货、商品期货等金融衍生品,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

⑮本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

⑯本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

⑰本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

⑱本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

⑲本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

⑳本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉑本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉒本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉓本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉔本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉕本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉖本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉗本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉘本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉙本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉚本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉛本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉜本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉝本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉞本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉟本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;

㉟本基金投资于境外证券市场的,在控制风险的前提下,为基金投资提供风险管理工具,从而提高基金的抗风险能力;