

# 易方达深证100交易型开放式指数基金

## [2014] 第二季度报告

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

报告送达日期:二〇一四年七月二十一日

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2014年7月16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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

招募说明书全文

报告期天数

自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达深证100ETF
基金代码	159901
交易代码	159901
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年3月24日
报告期末基金份额总额	18,624,833,170.00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。
基金的管理费	本基金主要收取管理费，即基金按约定的比例收取的积极作用及其权属机构，并根据其持有的基金份额及其变更情况定期调整。
投资策略	但在投资操作中，基金管理人将根据市场情况和投资时机的变化，适时调整基金资产的配置比例，以求在风险控制的前提下实现基金资产的增值。
业绩比较基准	深证100指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益特征与股票型基金相似，主要采取完全复制的指数基金的投资策略，具有与标的指数（即深证100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	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	-240,032,128.80
1.本期已实现收益		376,829,554.27
2.期初现金 余额		0.00
3.报告期内基金份额本期利润		9,791,618,891.29
4.期末现金及货币等价物		0.00
5.期末可供分配基金份额净值		9,819,478,389.00
6.期末可供分配利润		100.00

注:上表中的股票投资项包含短期回购到期代款净值增加,而5.2的合计项不含可退货币代款净值增加。

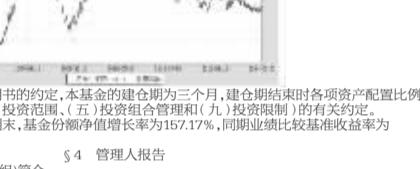
§ 5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

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	28,095,599.04	0.29
B 制造业	224,166,104.77	2.29
C 制造业	5,780,630,682.32	59.03
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,292,077.49	0.89
E 批发、零售业	86,185,526.70	0.88
F 批发、零售业	191,433,667.26	1.96
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 信息技术、软件和信息技术服务业	754,143,796.68	7.70
J 金融业	1,012,636,433.85	10.34
K 房地产业	744,067,179.37	7.60
L 租赁和商务服务业	196,629,640.72	2.01
M 科学研究、技术服务和地质勘查业	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	304,002,644.04	3.10
O 国防、武警、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-
R 文化、体育和娱乐业	238,146,132.28	2.43
S 综合	79,315,537.57	0.81
合计	9,726,144,846.03	99.33

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率变动及其同期间业绩比较基准收益率变动的比较

易方达深证100交易型开放式指数基金

累计净值增长率与业绩比较基准的历史走势图对比如图(2006年3月24日至2014年6月30日)



注:1.本基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十六部分(一)“投资范围、(五)投资组合比例、(九)投资限制”的有关规定。  
2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为157.17%,同期业绩比较基准收益率为0.5257%。

3.本基金已于2006年4月14日进行了基金份额折算,折算比例为0.94948342。

4.本基金已于2010年11月19日进行了基金份额折算,折算比例为1.5,即每一份基金份额拆成5份。

5.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。

6.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。

招募说明书全文

报告期天数

自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§ 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

报告期初基金资产净值(亿元)

报告期末基金资产净值(亿元)

任职时间

离职时间

说明

是否辞职

辞职原因

辞职日期

辞职原因

辞职日期

说明

是否辞职

辞职原因