

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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。

基金合同的基金份额持有人对本基金合同存续期间发生的任何情况，均不构成基金合同的任何部分。

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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达深证300ETF发起式
基金主代码	510300
交易代码	510300
基金运作方式	交易型开放式(ETF),发起式
基金合同生效日	2013年3月16日
报告期末基金份额总额	5,120,307,415份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于股票型基金，即公募基金指数基金或指数基金以及被动型基金，同时将少量资金投资于货币市场基金。本基金通过投资于股票型基金，以期获得与标的指数相似的收益。本基金通过投资于货币市场基金，以期获得稳定的现金流，从而降低组合的波动率。本基金将坚持既定的指数化投资策略，严格控制基金对目标指数的跟踪偏离度为投资目标，追求跟踪误差的最小化。本基金将为投资者分享中国证券市场蓝筹成长股长期良好的投资回报。
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
报告期天数	90天
报告期净值增长率	-0.06%
报告期净值增长率标准差	0.01%
报告期净值增长率相对基准收益率	0.17%
报告期净值增长率相对基准收益率的标准差	-0.01%

基金简称	易方达深证300ETF
基金主代码	510300
交易代码	510300
基金运作方式	交易型开放式(ETF),发起式
基金合同生效日	2013年3月16日
报告期末基金份额总额	5,120,307,415份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于股票型基金，即公募基金指数基金或指数基金以及被动型基金，同时将少量资金投资于货币市场基金。本基金通过投资于股票型基金，以期获得与标的指数相似的收益。本基金通过投资于货币市场基金，以期获得稳定的现金流，从而降低组合的波动率。本基金将坚持既定的指数化投资策略，严格控制基金对目标指数的跟踪偏离度为投资目标，追求跟踪误差的最小化。本基金将为投资者分享中国证券市场蓝筹成长股长期良好的投资回报。
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
报告期天数	90天
报告期净值增长率	-0.06%
报告期净值增长率标准差	0.01%
报告期净值增长率相对基准收益率	0.17%
报告期净值增长率相对基准收益率的标准差	-0.01%

§ 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

(2014年4月1日-2014年6月30日)

1.本期已实现收益

-5,539,999.04

2.本期利润

82,014,063.90

3.期末可供分配基金份额利润

4,446,774,465.72

4.期末基金资产净值

4,446,774,465.72

注：1.所列数据不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用实际收益水平要低于所列数字。
2.本公司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本报告期末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的标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.9% 0.88% -13.15% 0.00%

注：2.自基金合同生效以来，基金份额净值增长率和业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年3月1日至2014年6月30日)

注：3.1.按基金合同约定，本基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：3.2.自基金合同生效以来，基金份额净值增长率和业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年3月1日至2014年6月30日)

注：3.3.自基金合同生效以来，基金份额净值增长率和同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年3月1日至2014年6月30日)

注：3.4.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

离任日期

离任原因

离任日期