

深证300交易型开放式指数证券投资基金

2014 年度报告摘要

深证300交易型开放式指数证券投资基金2014年度报告摘要

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告期:2014年6月30日
1.1 重要提示
基金管理人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。本基金已经公开披露,以上披露内容签字日期为报告编制日期。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定,于2014年6月21日核对了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、费用计提和支付情况等信息,保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人对本基金的报告文本未作任何修改,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告书经基金管理人半年度报告正文披露,阅读半年度报告正文。
本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2.2 基金简介

基金基本情况	汇添富深证300ETF	上年度末
场内简称	深300ETF	
基金代码	159912	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金合同生效日	2011年9月16日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
基金名称	汇添富深证300ETF	
基金总份额	100,948,991.00份	
基金合同存续期	不定期	
基金类别	深圳证券交易所	
基金投资目标	2011-11-24	

2.2 基金产品说明	深证300交易型开放式指数证券投资基金	上年度可比期间
投资目标	深证300指数的成份股,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
投资策略	本基金主要投资于深证300指数成份股,精选行业龙头,集中投资于深证300指数成份股,同时本基金通过投资目标ETF,跟踪深证300指数,并辅以现金管理,以达到基金的既定投资目标。	
业绩比较基准	深证300指数收益率	
风险收益特征	本基金属股票型基金,风险预期与股票市场指数相当。	

2.3 基金管理人和基金托管人	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
地址	上海市浦东新区浦东南路1388号	北京市西城区复兴门内大街1号
信息披露负责人	董晓电话 021-28932888	010-66105799
电子邮箱	service@99tong.com	custody@99tong.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式	基金管理人互联网网址	www.99tong.com
基金管理人半年度报告公告的管理人互联网网址	www.99tong.com	
基金管理人半年度报告公告的管理人互联网网址	www.99tong.com	

2.5 主要财务指标和基金净值表现	金额单位:人民币元				
报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)					
本期末基金资产总值	-1,006,559.43				
本期末基金资产净值	-4,099,464.73				
本期末基金资产净值增长率	-0.0374				
本期末基金资产净值增长率	-3.6%				
3.1.2 本期利润和回报	报告期(2014年6月30日)				
可供分配基金份额利润	-0.1330				
期末可供分配利润	90,120,353.61				
注:1.本报告期未进行利润分配,收入为货币资金、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为可供分配利润加上本期公允价值变动收益。 2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(例如:基金的认购赎回费等),计算费用后实际收益水平要以定期报告为准。					
3.3 期末可供分配利润采用货币资金形式负债表中未分配利润与本期利润的孰低。					
3.2.1 基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差额(%)	①	②-④
过去一个月	2.36%	0.96%	2.01%	0.97%	0.35%
过去三个月	3.70%	0.96%	2.97%	0.97%	0.73%
过去六个月	-3.6%	1.16%	-4.07%	1.17%	0.44%
过去一年	6.33%	1.23%	6.06%	1.23%	0.27%
成立以来	-13.30%	1.32%	-17.83%	1.40%	4.53%
注:本基金的基金合同生效日为2011年9月16日,至本报告期未满两年。 3.2.2 基金份额持有人以来自份额累计净值增长变动及其与同行业业绩比较基准收益率变动的比较					

3.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)	金额单位:人民币元			
本期末基金资产总值	-1,006,559.43				
本期末基金资产净值	-4,099,464.73				
本期末基金资产净值增长率	-0.0374				
本期末基金资产净值增长率	-3.6%				
3.1.2 本期利润和回报	报告期(2014年6月30日)				
可供分配基金份额利润	-0.1330				
期末可供分配利润	90,120,353.61				
注:1.本报告期未进行利润分配,收入为货币资金、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为可供分配利润加上本期公允价值变动收益。 2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(例如:基金的认购赎回费等),计算费用后实际收益水平要以定期报告为准。					
3.3 期末可供分配利润采用货币资金形式负债表中未分配利润与本期利润的孰低。					
3.2.1 基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差额(%)	①	②-④
过去一个月	2.36%	0.96%	2.01%	0.97%	-0.01%
过去三个月	3.70%	0.96%	2.97%	0.97%	-0.01%
过去六个月	-3.6%	1.16%	-4.07%	1.17%	-0.01%
过去一年	6.33%	1.23%	6.06%	1.23%	-0.03%
成立以来	-13.30%	1.32%	-17.83%	1.40%	-0.08%
注:本基金的基金合同生效日为2011年9月16日,至本报告期未满两年。 3.2.2 基金份额持有人以来自份额累计净值增长变动及其与同行业业绩比较基准收益率变动的比较					

3.2 本期利润	本期利润	本期利润	本期利润	本期利润	本期利润
项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
本期末基金资产总值	-1,006,559.43	-1,006,559.43	-1,006,559.43	-1,006,559.43	-1,006,559.43
本期末基金资产净值	-4,099,464.73	-4,099,464.73	-4,099,464.73	-4,099,464.73	-4,099,464.73
本期末基金资产净值增长率	-0.0374	-0.0374	-0.0374	-0.0374	-0.0374
本期末基金资产净值增长率	-3.6%	-3.6%	-3.6%	-3.6%	-3.6%
3.3 本期利润	报告期(2014年6月30日)				
可供分配基金份额利润	-0.1330	-0.1330	-0.1330	-0.1330	-0.1330
期末可供分配利润	90,120,353.61	90,120,353.61	90,120,353.61	90,120,353.61	90,120,353.61
注:1.本报告期未进行利润分配,收入为货币资金、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为可供分配利润加上本期公允价值变动收益。 2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(例如:基金的认购赎回费等),计算费用后实际收益水平要以定期报告为准。					
3.3 期末可供分配利润采用货币资金形式负债表中未分配利润与本期利润的孰低。					
3.2.1 基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差额(%)	①	②-④
过去一个月	2.36%	0.96%	2.01%	0.97%	-0.01%
过去三个月	3.70%	0.96%	2.97%	0.97%	-0.01%
过去六个月	-3.6%	1.16%	-4.07%	1.17%	-0.01%
过去一年	6.33%	1.23%	6.06%	1.23%	-0.03%
成立以来	-13.30%	1.32%	-17.83%	1.40%	-0.08%
注:本基金的基金合同生效日为2011年9月16日,至本报告期未满两年。 3.2.2 基金份额持有人以来自份额累计净值增长变动及其与同行业业绩比较基准收益率变动的比较					

3.3 本期利润	本期利润	本期利润	本期利润	本期利润	本期利润
项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
本期末基金资产总值	-1,006,559.43	-1,006,559.43	-1,006,559.43	-1,006,559.43	-1,006,559.43
本期末基金资产净值	-4,099,464.73	-4,099,464.73	-4,099,464.73	-4,099,464.73	-4,099,464.73
本期末基金资产净值增长率	-0.0374	-0.0374	-0.0374	-0.0374	-0.0374
本期末基金资产净值增长率	-3.6%	-3.6%	-3.6%	-3.6%	-3.6%
3.4 本期利润	报告期(2014年6月30日)				
可供分配基金份额利润	-0.1330	-0.1330	-0.1330	-0.1330	-0.1330
期末可供分配利润	90,120,353.61	90,120,353.61	90,120,353.61	90,120,353.61	90,120,353.61
注:1.本报告期未进行利润分配,收入为货币资金、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为可供分配利润加上本期公允价值变动收益。 2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(例如:基金的认购赎回费等),计算费用后实际收益水平要以定期报告为准。					
3.3 期末可供分配利润采用货币资金形式负债表中未分配利润与本期利润的孰低。					
3.2.1 基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差额(%)	①	②-④
过去一个月	2.36%	0.96%	2.01%	0.97%	-0.01%
过去三个月	3.70%	0.96%	2.97%	0.97%	