

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

2014 年度报告摘要

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
送出日期:二〇一四年八月二十七日

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,并对基金的真实性和完整性承担个别及连带法律责任。本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。
基金经理对本基金的持续监督和管理,并承担相应的责任。
基金投资组合报告中关于基金业绩表现的说明,在任何情况下不构成投资建议,投资者应根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。
基金投资组合报告中关于基金业绩表现的说明,在任何情况下不构成投资建议,投资者应根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。

本年度报告年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告书所载财务数据未经审计。
本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

基金名称	易方达沪深300ETF联接型开放式基金
基金代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月6日
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
报告期末基金总资产	6,649,800,525.26
报告期基金份额总额	6,649,800,525.26
报告期净值	不适用

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金代码	161010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
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
报告期末基金总资产	6,494,900,525.26
报告期基金份额总额	6,494,900,525.26
报告期净值	不适用

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于与标的指数成分股相似的股票组合,本基金投资于标的ETF的比例不低于基金资产净值的95%。在综合考虑流动性、风险、成本等因素的基础上,本基金将采用一级市场或二级市场交易方式申购和赎回ETF的策略,本基金还可适当参与一级市场新股申购,以期获得超额收益。本基金将通过定期调整和不定期调整两种方式,力争将本基金的跟踪误差控制在标的指数的0.5%以内,并力求在扣除相关费用后将基金的跟踪误差控制在0.25%以内。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金,但低于股票型基金,具有中等风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于与标的指数成分股相似的股票组合,本基金投资于标的ETF的比例不低于基金资产净值的95%。在综合考虑流动性、风险、成本等因素的基础上,本基金将采用一级市场或二级市场交易方式申购和赎回ETF的策略,本基金还可适当参与一级市场新股申购,以期获得超额收益。本基金将通过定期调整和不定期调整两种方式,力争将本基金的跟踪误差控制在标的指数的0.5%以内,并力求在扣除相关费用后将基金的跟踪误差控制在0.25%以内。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金,但低于股票型基金,具有中等风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金经理

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	陈南	田青
信息披露负责人	020-38797888	010-67595096
电子邮箱	csm@fundsf.com.cn	tianq@cjcb.com
客户服务电话	400 881 8088	010-67595096
传真	020-38799488	010-66275883

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东二路30号广州银行大厦43层
3 主要财务指标和基金净值表现	
金额单位:人民币元	
3.1 主要会计数据和财务指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

项目	本期	上年同期
本期利润	-279,702,011.61	-0.42%
加权平均基金份额本期利润	-0.42%	
本期基金份额净值增长率	-5.63%	
3.1.2 期末资产和负债	报告期(2014年6月30日)	
可供分配基金份额利润	-0.2998	
基金资产净值	4,547,944,010.03	
报告期净值	0.7002	

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	本期	上年同期
本期利润	-42,310,371.80	
加权平均基金份额本期利润	-0.42%	
本期基金份额净值增长率	-5.63%	
3.1.2 期末资产和负债	报告期(2014年6月30日)	
可供分配基金份额利润	-0.2998	
基金资产净值	4,547,944,010.03	
报告期净值	0.7002	

3.2 基金份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率为同期业绩比较基准收益率差额	①-②	③-④
过去一个月	1.13%	0.73%	0.39%
过去三个月	1.86%	0.82%	0.83%
过去六个月	-5.63%	0.98%	-6.70%
过去一年	0.27%	-1.44%	1.11%
过去两年	-24.47%	1.22%	-27.40%
自基金合同生效以来	-29.98%	1.27%	-28.64%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

项目	本期	上年同期
本期利润	-279,702,011.61	-0.42%
加权平均基金份额本期利润	-0.42%	
本期基金份额净值增长率	-5.63%	
3.2.2 期末资产和负债	报告期(2014年6月30日)	
可供分配基金份额利润	-0.2998	
基金资产净值	4,547,944,010.03	
报告期净值	0.7002	

3.3 主要财务指标和基金净值表现

项目	本期	上年同期
本期利润	-42,310,371.80	
加权平均基金份额本期利润	-0.42%	
本期基金份额净值增长率	-5.63%	
3.2.2 期末资产和负债	报告期(2014年6月30日)	
可供分配基金份额利润	-0.2998	
基金资产净值	4,547,944,010.03	
报告期净值	0.7002	

3.4 管理人报告

基金管理人及其他基金信息披露义务人	易方达基金管理有限公司
姓名	陈南
信息披露负责人	020-38797888
电子邮箱	csm@fundsf.com.cn
客户服务电话	400 881 8088
传真	020-38799488

3.5 会计数据和财务指标

项目	本期	上年同期
本期利润	-42,310,371.80	
加权平均基金份额本期利润	-0.42%	
本期基金份额净值增长率	-5.63%	
3.5.2 期末资产和负债	报告期(2014年6月30日)	
可供分配基金份额利润	-0.2998	
基金资产净值	4,547,944,010.03	
报告期净值	0.7002	

3.6 会计数据和财务指标

项目	本期	上年同期
本期利润	-42,310,371.80	
加权平均基金份额本期利润	-0.42%	
本期基金份额净值增长率	-5.63%	
3.5.2 期末资产和负债</		