

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、董事和本基金份额持有人对本报告书所载资料不承担虚假记载、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责任。本年度报告书已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

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8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核意见不存在虚假记载、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。投资有风险，投资者在作出投资决策前应认真阅读本基金的招募说明书及定期报告。

本报告中部分数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2. 基金简介

易方达深证100交易型开放式指数基金	
基金简称	易方达深证100ETF
场内简称	深100ETF
基金主代码	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
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
报告期截至基金份额总额	18,624,833,170.00份
基金合同存续期	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月24日

2.2 基产品说明

紧密跟踪目标指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行

投资策略 相应调整。在特殊情况导致无法获得足额数量的股票时，基金管理人将采用优化方法最大限度地选择组合的个股权重比例，以此构建本基金实际的投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

业绩比较基准 深证100价格指数

本基金侧重股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币

市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数一致的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

风险收益特征

本基金管理人和基金托管人

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 中国银行股份有限公司

姓名 张南 王永民

信息披露义务人 联系电话 020-38797888 010-66594896

电子邮箱 csc@efunds.com.cn fcid@bankofchina.com

客户服务电话 400 881 8088 95566

传真 020-38799488 010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: <http://www.efunds.com.cn>

基金半年度报告备置地点 广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期实现收益 -566,491,339.27

本期利润 -708,119,887.88

加权平均基金份额本期利润 -0.0360

本期基金份额净值增长率 -6.48%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2014年6月30日)

本期末基金资产配置情况 0.3151

期末基金资产净值 9,791,618,891.29

期末基金份额净值 0.5257

注:1)所述基金的份额指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列示的份额。

2)本期每份认购金额即为收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额, 本期利润即为本期已实现收益扣除本期发生的管理费。

3)本基金已于2006年4月14日进行了基金分红, 每十份分红比例为0.94948324。

4)本基金于2010年1月19日进行了基金分红, 每十份分红比例为1.1, 即每一份基金份额折算1.1份。

5)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

3.2 基金份额表现

3.2.1 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 份额净值增长率(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.78% 0.91% 1.13% 0.92% 0.65% -0.01%

过去三个月 3.69% 0.90% 2.39% 0.92% 1.30% -0.02%

过去一年 -0.21% 1.22% -2.19% 1.23% 1.98% -0.01%

过去三年 -32.49% 1.39% -35.26% 1.40% 2.77% -0.01%

自基金合同生效至报告期末 157.17% 1.95% 147.06% 1.96% 10.11% -0.01%

成立以来至今 157.17% 1.95% 147.06% 1.96% 10.11% -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来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

报告期深证100交易型开放式指数基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(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3个月, 建仓期结束时各项资产配置比例符合合同第十九条(二)投资范围、投资比例和(九)投资限制的有关规定。

2)本基金的建仓期结束时, 报告期末基金资产配置比例为157.17%, 同期业绩比较基准收益率为-0.01%。

3)本基金于2010年1月19日进行了基金分红, 每十份分红比例为1.1, 即每一份基金份额折算1.1份。

4)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

5)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

6)本基金于2010年1月19日进行了基金分红, 每十份分红比例为1.1, 即每一份基金份额折算1.1份。

7)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

8)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

9)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

10)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

11)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

12)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

13)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

14)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

15)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

16)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

17)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

18)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

19)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

20)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

21)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

22)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

23)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

24)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

25)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

26)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

27)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

28)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

29)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

30)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

31)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

32)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

33)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

34)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

35)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

36)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

37)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

38)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

39)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

40)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

41)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

42)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

43)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

44)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

45)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

46)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

47)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

48)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点后五位变更为小数点后四位, 小数点后第四位舍去。

49)本基金于2011年4月22日将基金份额净值计算方法从小数点