

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:2015年10月24日
重要提示
基金管理人的董事及董事会全体成员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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年10月21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。
基金过往业绩并不代表其未来表现,投资者投资需谨慎。
报告期为2015年7月1日至9月30日。
本基金的财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金名称:易方达沪深300交易型发起式证券投资基金联接基金
基金代码:1100200
交易代码:1100200
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年9月16日
报告期末基金份额总额:4,716,790,194.50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。

本基金主要通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整。但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于指数型基金,但也可投资于货币型基金、债券型基金和货币市场基金。

业绩比较基准

沪深300指数收益率×96%+货币市场基金收益率×4%

本基金的业绩比较基准为沪深300指数基金的预期收益,该预期收益水平高于沪深300指数,本基金主要投资于指数型基金,但也可投资于货币型基金、债券型基金和货币市场基金,本基金主要通过投资沪深300指数基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪,具有与业绩比较基准相仿的风险收益特征。

基金管理人

易方达基金管理有限公司
中国建设银行股份有限公司

2.1 本基金的基本情况

基金名称:易方达沪深300交易型发起式证券投资基金

基金代码:6101010
交易代码:6101010
基金运作方式:契约型(ETP),发起式

基金合同生效日:2013年3月6日

基金的上市地:上海证券交易所

上市日期:2013年3月5日

基金管理人

易方达基金管理有限公司
中国建设银行股份有限公司

2.2 本基金的产品利润

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。

本基金主要通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整。但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

业绩比较基准

沪深300指数收益率×96%+货币市场基金收益率×4%

本基金的业绩比较基准为沪深300指数基金的预期收益,该预期收益水平高于沪深300指数,本基金主要投资于指数型基金,但也可投资于货币型基金、债券型基金和货币市场基金,本基金主要通过投资沪深300指数基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪,具有与业绩比较基准相仿的风险收益特征。

基金管理人

易方达基金管理有限公司
中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -46,699,320.48

2.本期利润 -1,524,518,076.30

3.期初平均基金份额利润 -0.3183

4.期末基金份额净值 4,882,518,007.25

5.期末基金份额净值 -0.3061

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购交易基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金利息收入、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.基金净值表现

3.21报告期末基金份额净值增长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(②)

业绩比较基准收益率(③)

准收益差率(④)

①③

②④

过去三个月 -20.06% 3.06% -27.07% 3.11% 1.08% -0.12%

3.22基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深300交易型发起式证券投资基金 累计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
(2009年8月26日至2015年9月30日)

注:自基金合同生效日至报告期末,基金份额净值增长率为3351%,同期业绩比较基准收益率为394%。

5.3 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(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 22,406,444.79

2.本期利润 -1,446,021,450.98

3.期初平均基金份额利润 -0.2987

4.期末基金份额净值 4,732,061,318.38

5.期末基金份额净值 -0.3063

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购交易基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金利息收入、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.基金净值表现

3.21报告期末基金份额净值增长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(②)

业绩比较基准收益率(③)

准收益差率(④)

①③

②④

过去三个月 -20.06% 3.39% -28.93% 3.34% 0.39% -0.01%

3.22基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深300交易型发起式证券投资基金 累计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
(2013年3月6日至2015年9月30日)

注:自基金合同生效日至报告期末,基金份额净值增长率为30.13%,同期业绩比较基准收益率为22.12%。

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 22,406,444.79

2.本期利润 -1,446,021,450.98

3.期初平均基金份额利润 -0.2987

4.期末基金份额净值 4,732,061,318.38

5.期末基金份额净值 -0.3063

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购交易基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金利息收入、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.基金净值表现

3.21报告期末基金份额净值增长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(②)

业绩比较基准收益率(③)

准收益差率(④)

①③

②④

过去三个月 1.80% 0.08% 1.03% 0.01% 0.77% 0.07%

3.22基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深300交易型发起式证券投资基金 累计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
(2013年3月6日至2015年9月30日)

注:自基金合同生效日至报告期末,基金份额净值增长率为3351%,同期业绩比较基准收益率为394%。

4.2 管理人报告

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 8,474,911.98

2.本期利润 4,772,981.13

3.期初平均基金份额利润 0.0210

4.期末基金份额净值 107,512,762.71

5.期末基金份额净值 -0.1027

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购交易基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金利息收入、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.基金净值表现

3.21报告期末基金份额净值增长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(②)

业绩比较基准收益率(③)

准收益差率(④)

①③

②④

过去三个月 1.81% 0.07% 1.03% 0.01% 0.78% 0.06%

3.22基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深300交易型发起式证券投资基金 累计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
(2013年3月6日至2015年9月30日)

注:自基金合同生效日至报告期末,基金份额净值增长率为3351%,同期业绩比较基准收益率为394%。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场及基金未来走势的展望

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.4 管理人对行业及上市公司的评价

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.5 管理人对估值方法的说明

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.6 管理人对流动性风险的评价

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.7 管理人对投资组合的评价

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.8 管理人对风险的揭示

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.9 管理人对投资策略的说明

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.10 管理人对所持基金的评价

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.11 管理人对所持基金的展望

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

4.12 管理人对所持基金的声明

本基金将根据宏观经济、证券市场及基金未来走势的判断,结合对宏观经济、证券市场的分析,在控制风险的前提下,通过投资于标的指数成分股及权重股,并根据标的指数成分股及权重股的变动进行相应的调整,但本基金将根据市场情况,在适当时候,通过投资于标的指数成分股之外的股票,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资于股票型基金、债券型基金和货币市场基金。

<div data-bbox="8