

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 第四季度 报告

2014年12月31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
报告送出日期: 二〇一五年一月二十日

1.1 重要提示
 基金管理人的董事会及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规定,于2014年1月15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,也不保证最低收益。
 基金过往业绩并不预示其未来业绩,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。
 本报告期内本基金无分红事项。
 本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	易方达沪深300ETF联接基金
基金代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2009年7月24日
跟踪标的名称	中证300指数
跟踪标的指数	中证300指数的净值增长率,追求跟踪标的净值增长率的最小化。

投资目标
 本基金通过投资于目标ETF实现对沪深300指数的跟踪,本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值90%,组合净值增长率、跟踪误差、溢价率等指标均符合基金合同约定。本基金采用被动式投资策略,跟踪标的指数,力求跟踪标的指数的净值增长率,力争实现与目标ETF基金份额净值增长率相近,相关风险控制在基金合同约定的范围内。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值90%,组合净值增长率、跟踪误差、溢价率等指标均符合基金合同约定。本基金采用被动式投资策略,跟踪标的指数,力求跟踪标的指数的净值增长率,力争实现与目标ETF基金份额净值增长率相近,相关风险控制在基金合同约定的范围内。

3.1 主要财务指标

项目	单位:人民币元
1.本期已实现收益	124,426,416.94
2.本期利润	1,849,238,791.20
3.期末可供分配基金份额利润	0.5286
4.期末基金份额净值	1.290,677,629.43
5.期末基金份额净值增长率	11.19%

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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	业绩比较基准收益率②	①-②
过去三个月	40.67%	1.53%	41.63%
过去六个月	40.67%	1.53%	41.63%
过去一年	40.67%	1.53%	41.63%

3.2.2 基金合同生效以来本基金资产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
 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
 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
 (2009年7月24日至2014年12月31日)

3.3 主要财务指标和基金净值表现

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	银行存款	1,000,000.00	100.000000	1.37
2	买入返售金融资产	400,000.00	57,615,000.00	0.79
3	应收利息	500,000.00	5,000,000.00	0.06
4	应收股利	400,000.00	4,000,000.00	0.05
5	其他资产	500,000.00	5,000,000.00	0.41

3.4 投资组合报告
 3.4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	权益投资	1,000,000.00	100.000000	1.37
2	固定收益投资	400,000.00	57,615,000.00	0.79
3	金融资产	500,000.00	5,000,000.00	0.06
4	其他资产	400,000.00	4,000,000.00	0.05
5	其他	500,000.00	5,000,000.00	0.41

3.5 投资组合报告附注
 3.5.1 报告期内本基金投资的前十名证券名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4 投资组合报告附注
 3.5.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.4.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.2.3 股指期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.3 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.3.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.3.2 本基金投资国债期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.3.3 国债期货投资对本基金资产净值的影响程度

3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 报告期内本基金投资的前十名股票名称

序号	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	存折存款	33,935,641.00	3,393,564.10	4.41
2	应收证券利息	35,904,304.00	3,590,430.40	4.61
3	应收股利	4,625,749.23	462,574.92	5.94
4	银行存款	2,817,682,000.00	281,768,200.00	3.61
5	其他资产	11,147,040.00	1,114,704.00	1.44
6	持有待售资产	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	66,794,908.83	6,679,490.83	8.67

3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2.2 本基金投资股指期货的投资策略
 3.5.4.4.4.4.4.4.4.4