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

2015 第二季度 报告

2015年6月30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：二〇一五年七月二十日

§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2015年7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。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达沪深300ETF发起式联接
基金主代码	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8月26日
报告期末基金份额总额	3,186,494,724.41份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金投资于目标ETF 的比例不低于基金资产净值的90%。在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，本基金决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在正常市场情况下，力争将年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为沪深300ETF的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。
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

2.1.1目标基金基本情况

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
基金主代码	510310
基金运作方式	交易型开放式（ETF）、发起式
基金合同生效日	2013年3月6日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月25日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2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	本基金主要采取完全复制法，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相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

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4月1日－2015年6月30日）
1.本期已实现收益	854,429,126.28
2.本期利润	543,431,608.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.1612
4.期末基金资产净值	4,456,012,438.90
5.期末基金份额净值	1.3984

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

3.2 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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.55%	2.43%	9.98%	2.48%	0.57%	-0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

累计净值增长率与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6月30日）

注：1.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为39.84%，同期业绩比较基准收益率为42.49%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2013-11-14	-	7年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。

注：1.此处的"任职日期"和"离任日期"分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次，其中1次为为指数组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；1次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

中国政府重视经济下行压力，经济托底政策多管齐下，通过降息降准、地方债务置换、放松房地产政策等一系列手段，试图缓解经济增速过快下滑以及通货紧缩的风险。今年二季度以来，全国房地产市场销售大幅回暖，固定资产投资、社会消费品零售、贸易顺差和社会融资总额等宏观经济指标显示中国经济可能出现企稳迹象。与宏观经济走向有所不同的是，A股市场在二季度冲高回落。上证指数4月份上涨18.5%，5月份上涨3.8%，6月份下跌7.3%，二季度整体上涨14.1%。以中小板、创业板指数为代表的新兴成长股在二季度分别上涨15.3%和22.4%，以上证50、沪深300指数为代表的周期蓝筹股相对滞涨，分别上涨4.2%和10.4%，价值与成长风格分化仍较为明显。

作为被动型指数基金，报告期内，本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深300指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.3984元，本报告期份额净值增长率为10.55%，同期业绩比较基准收益率为9.98%，年化跟踪误差0.935%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换，努力做到调速不减势、量增质更优。但短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免，这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复苏进程有所反复，宏观经济政策也将在稳增长、保就业的"下限"和防通胀的"上限"之间动态平衡，当经济运行处于预期的合理区间内，则以调结构为主要着力点。就今年二季度中国经济运行实际情况来看，政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险，并加大"区间调控、定向调控和预调微调"的力度。从长期来看，通过推动新型城镇化和产业升级以稳定要素投入、提高全要素生产率，将是中国经济长期可持续增长的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

尽管A股市场自2014年下半年以来进入快速上涨通道，估值水平得到大幅修复。但目前以沪深300指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值仍处于较低位置，仍具有中长期投资价值。作为被动投资的基金，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,528,440.74	0.07
	其中：股票	3,528,440.74	0.07
2	基金投资	4,186,306,680.39	88.97
3	固定收益投资	170,800,000.00	3.63
	其中：债券	170,800,000.00	3.63
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	293,595,016.61	6.24
8	其他资产	50,809,195.60	1.08
9	合计	4,705,039,333.34	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）、发起式	易方达基金管理有限公司	4,186,306,680.39	93.95

5.3报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,533,377.00	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	252,780.00	0.01
F	批发和零售业	14,032.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	790.74	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	497,524.00	0.01
J	金融业	740,637.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	224,100.00	0.01
S	综合	265,200.00	0.01
	合计	3,528,440.74	0.08

5.4报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	000917	电广传媒	11,600	497,524.00	0.01
2	600703	三安光电	14,700	460,110.00	0.01
3	000166	申万宏源	24,500	398,125.00	0.01
4	002353	杰瑞股份	7,900	350,365.00	0.01
5	600000	浦发银行	16,700	283,232.00	0.01
6	002456	欧菲光	8,100	273,294.00	0.01
7	600256	广汇能源	25,500	265,200.00	0.01
8	002310	东方园林	6,600	252,780.00	0.01
9	000793	华闻传媒	10,800	224,100.00	0.01
10	002008	大族激光	4,600	132,112.00	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,800,000.00	3.83
	其中：政策性金融债	170,800,000.00	3.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	170,800,000.00	3.83

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	140230	14国开30	500,000	50,240,000.00	1.13
2	150307	15进出07	400,000	40,292,000.00	0.90
3	140223	14国开23	400,000	40,160,000.00	0.90
4	140443	14农发43	400,000	40,108,000.00	0.90

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1507	IF1507	25	32,826,000.00	1,344,200.00	在本报告期内，基金利用股指期货进行多头套保，以应对由于基金的大额申购而带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
公允价值变动总额合计（元）					1,344,200.00
股指期货投资本期收益（元）					237,160.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,344,200.00

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12投资组合报告附注

5.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,556,260.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,277,513.60
5	应收申购款	40,260,611.81
6	其他应收款	714,810.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,809,195.60

5.12.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000917	电广传媒	497,524.00	0.01	重大事项停牌
2	002353	杰瑞股份	350,365.00	0.01	重大事项停牌
3	002310	东方园林	252,780.00	0.01	重大事项停牌
4	000793	华闻传媒	224,100.00	0.01	重大事项停牌

5.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金管理人旗下子公司易方达资产管理有限公司于本报告期末持有易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金的基金份额为668,214.43份。

§6开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,150,911,814.58
报告期基金总申购份额	2,318,450,041.90
减：报告期基金总赎回份额	3,282,867,132.07
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,186,494,724.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会核准易方达沪深300指数证券投资基金募集的文件；

2.中国证监会《关于易方达沪深300指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；

3.《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》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.《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托管协议》；

6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一五年七月二十日

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30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：二〇一五年七月二十日

§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2015年7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。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达沪深300ETF发起式
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式（ETF）、发起式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	2,430,307,415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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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4月1日－2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,099,273,111.17
2.本期利润	571,662,031.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.2234
4.期末基金资产净值	4,409,761,902.45
5.期末基金份额净值	1.8145

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

3.2 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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.15%	2.58%	10.41%	2.61%	0.74%	-0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

累计净值增长率与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6月30日）

注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为81.45%，同期业绩比较基准收益率为70.54%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林飞	本基金的基金经理、易方达50指数证券投资基金的基金经理（自2007年2月10日至2015年6月5日）、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理（自2006年7月4日至2015年6月5日）、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理（自2009年12月1日至2015年6月5日）、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理	2013-03-06	2015-06-06	12年	博士研究生，曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深300指数证券投资基金的基金经理。
林伟斌	本基金的基金经理、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的基金经理、易方达黄金交易型开放式基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2013-03-06	-	7年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。

注：1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日，"离任日期"为公告确定的解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次，其中1次为为指数组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；1次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

中国政府重视经济下行压力，经济托底政策多管齐下，通过降息降准、地方债务置换、放松房地产政策等一系列手段，试图缓解经济增速过快下滑以及通货紧缩的风险。今年二季度以来，全国房地产市场销售大幅回暖，固定资产投资、社会消费品零售、贸易顺差和社会融资总额等宏观经济指标显示中国经济可能出现企稳迹象。与宏观经济走向有所不同的是，A股市场在二季度冲高回落。上证指数4月份上涨18.5%，5月份上涨3.8%，6月份下跌7.3%，二季度整体上涨14.1%。以中小板、创业板指数为代表的新兴成长股在二季度分别上涨15.3%和22.4%，以上证50、沪深300指数为代表的周期蓝筹股相对滞涨，分别上涨4.2%和10.4%，价值与成长风格分化仍较为明显。

作为被动型指数基金，报告期内，本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深300指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.8145元，本报告期份额净值增长率为11.15%，同期业绩比较基准收益率为10.41%，日跟踪偏离度的均值为0.03%，日跟踪误差为0.043%，年化跟踪误差0.661%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济将由高速增长阶段向中高速增长阶段转换，努力做到调速不减势、量增质更优。但短期内经济增速下降和部分传统行业的企业盈利下滑在所难免，这也是逐步适应经济增长新常态的必经阶段。现阶段中国经济的周期性波动、结构转型以及金融深化三者共振将导致复苏进程有所反复，宏观经济政策也将在稳增长、保就业的"下限"和防通胀的"上限"之间动态平衡，当经济运行处于预期的合理区间内，则以调结构为主要着力点。就今年二季度中国经济运行实际情况来看，政府在下一阶段仍会持续重视经济下行压力加大引起的困难和风险，并加大"区间调控、定向调控和预调微调"的力度。从长期来看，通过推动新型城镇化和产业升级以稳定要素投入、提高全要素生产率，将是中国经济长期可持续增长的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。

尽管A股市场自2014年下半年以来进入快速上涨通道，估值水平得到大幅修复。但目前以沪深300指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估值仍处于较低位置，仍具有中长期投资价值。作为被动投资的基金，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,374,481,516.82	98.41
	其中：股票	4,374,481,516.82	98.41
2	固定收益投资	829,720.10	0.02
	其中：债券	829,720.10	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,848,503.29	0.67
7	其他资产	40,047,846.07	0.90
8	合计	4,445,207,586.28	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,506,778.20	0.24
B	采矿业	191,573,513.86	4.34
C	制造业	1,459,673,729.63	33.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	182,376,190.22	4.14
E	建筑业	193,140,986.74	4.38
F	批发和零售业	91,549,627.78	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	182,743,025.25	4.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,044,286.77	5.69
J	金融业	1,475,143,833.98	33.45
K	房地产业	174,359,673.25	3.95
L	租赁和商务服务业	44,256,999.61	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	35,324,436.64	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,814,708.22	0.11
R	文化、体育和娱乐业	53,594,159.41	1.22
S	综合	24,379,567.26	0.55
	合计	4,374,481,516.82	99.20

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,046,622	167,700,206.68	3.80
2	600036	招商银行	6,236,266	116,742,899.52	2.65
3	600016	民生银行	10,326,837	102,648,759.78	2.33
4	600030	中信证券	2,974,627	80,047,212.57	1.82
5	601166	兴业银行	4,319,700	74,514,825.00	1.69
6	600000	浦发银行	4,253,323	72,136,358.08	1.64
7	600837	海通证券	3,056,985	66,642,273.00	1.51
8	601766	中国中车	3,464,292	63,604,401.12	1.44
9	601328	交通银行	7,365,187	60,689,140.88	1.38
10	000651	格力电器	913,699	58,385,366.10	1.32

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	829,720.10	0.02
8	其他	-	-
9	合计	829,720.10	0.02

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	5,710	829,720.10	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	742,615.05
2	应收证券清算款	39,296,486.15
3	应收股利	-
4	应收利息	8,744.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,047,846.07

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,168,307,415
报告期基金总申购份额	426,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	1,164,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,430,307,415

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	11,471,258.00	0.4720%	10,002,600.00	0.4116%	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	11,471,258.00	0.4720%	10,002,600.00	0.4116%	-

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；

2.《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合同》；

3.《易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件和营业执照；

9.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一五年七月二十日

易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30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：二〇一五年七月二十日

§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2015年7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。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达沪深300非银联接
基金主代码	000950
交易代码	000950
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月22日
报告期末基金份额总额	1,442,965,330.22份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为沪深300非银行金融ETF的联接基金，沪深300非银行金融ETF是采用完全复制法实现对沪深300非银行金融指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于沪深300非银行金融ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将年化跟踪误差控制在4%以内。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或证券二级市场交易的方式进行沪深300非银行金融ETF的投资。本基金还可适度参与沪深300非银行金融ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可以参与股指期货交易，但必须根据风险管理的原则，以套期保值为目的。
业绩比较基准	沪深300非银行金融指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是ETF联接基金，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于易方达沪深300非银行金融ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。
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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512070
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2014年6月26日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014年7月18日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2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	本基金主要采取完全复制法，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相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	沪深300非银行金融指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

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4月1日－2015年6月30日）
1.本期已实现收益	233,993,370.99
2.本期利润	-40,962,084.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0191
4.期末基金资产净值	1,505,022,996.68
5.期末基金份额净值	1.0430

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

3.2 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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.04%	2.99%	-7.59%	3.03%	0.55%	-0.04%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015年1月22日至2015年6月30日）

注：1.本基金合同于2015年1月22日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为4.30%，同期业绩比较基准收益率为3.21%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余海燕	本基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证50指数分级证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2015-01-22	-	10年	硕士研究生，曾任汇丰银行Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

注：1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日，"离任日期"为公告确定的解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次，其中1次为为指数组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；1次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在4月稳增长政策以及相关配套宽松的货币政策下，二季度国内宏观经济有所改善并呈现企稳迹象，特别是房地产销量的持续回升，以及电厂煤耗的转好等成为市场关注的亮点，从5、6月PMI数据来看经济短期有回升的态势。在总量政策方面，二季度仍维持相对宽松的环境。A股市场延续了一季度的积极做多热情，交易量也屡创日均两万多亿的历史新高，上证综指一度突破5100点的8年新高，随后在监管层要求清理场外配资等相关业务的背景下，市场出现了快速的大幅回撤，所有板块普跌，市场表现出了显著的去杠杆特征，央行在6月底意外宣布降息和降准并没有止住A股的大幅下挫，股指快速下跌导致的去杠杆自我实现过程在季度末仍在持续。在风格方面，二季度小盘股继续跑赢大盘股，二季度沪深300指数上涨10.41%，创业板指上涨30.95%。行业方面，轻工、军工、交运等受益于国企改革的板块领涨，非银、银行等金融板块表现相对落后。

本基金是沪深300非银行金融ETF的联接基金，报告期内非银行金融板块中的保险、证券行业基本面仍然积极向好，但基于去年以来非银板块累计涨幅较大以及监管层规范资本市场杠杆业务的大背景下，引发投资者情绪的改变，报告期内沪深300非银行金融指数表现相对落后，下跌8.12%。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0430元，本报告期份额净值增长率为-7.04%，同期业绩比较基准收益率为-7.59%，日跟踪偏离度的均值为0.034%，日跟踪误差为0.05%，年化跟踪误差为0.73%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济增速仍面临下行风险，但是偏松的货币政策以及积极的财政政策为市场提供了一个经济的"下跌期权"，宽松的流动性以及地方债务置换计划的出台和落实将有效降低金融系统债务问题的尾部风险。股市的宏观环境仍积极向好，改革的红利会逐步体现到企业盈利；居民大类资产配置转向A股将成为推动股市长期而持续的动力。尽管二季度末股市在去杠杆的背景下，市场快速回调，但是市场向好的坚实基础仍在，股市是居民资产配置和国企改革、大众创业的载体，这个大逻辑依然没有变，股市的暴跌更多来自恐慌情绪导致的，经过近期的调整，场外配资的风险已经大量释放，整体来看杠杆资金的风险已经处在可控的位置，经过快速下跌后的风险释放，市场正给长线资金带来良好的布局机会。

在宏观经济转型大背景下，金融市场从间接融资走向直接融资的大变革中，非银板块将是制度红利释放的最大受益者，伴随创新业务的深化，券商加杠杆过程将持续，带动行业业绩持续提升；大投行业务发展、券商核心竞争力转移。保险行业在2015年将极大受益于健康险和养老险政策，行业成长属性明显，估值弹性有望受到业绩增长得到进一步支撑；同时在大类资产重构过程中，保险股的权益弹性将回归，投资价值明显。今年以来非银板块表现大幅落后于市场，与其高弹性特征严重背离，在宽松政策的预期下，非银板块有望迎来补涨潜力。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，既为短期投资者提供"高弹性、高波动"的投资工具，又为长期看好非银行金融行业投资前景的投资者提供方便、高效的投资工具。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,426,862,202.79	91.16
3	固定收益投资	70,378,000.00	4.50
	其中：债券	70,378,000.00	4.50
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,853,266.90	1.97
8	其他资产	37,143,301.33	2.37
9	合计	1,565,236,771.02	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）	易方达基金管理有限公司	1,426,862,202.79	94.81

5.3报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.4报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,378,000.00	4.68
	其中：政策性金融债	70,378,000.00	4.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	70,378,000.00	4.68

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	150202	15国开02	700,000	70,378,000.00	4.68

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12投资组合报告附注

5.12.1本基金本报告期末未持有股票。

除华泰证券外，本基金的目标ETF投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据华泰证券股份有限公司2014年9月6日发布的《关于收到中国证监会行政监管措施决定书的公告》，中国人民银行南京分行于2014年6月对公司进行行政处罚。

在上述公告公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述处罚不会对华泰证券投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

5.12.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,348,120.32
2	应收证券清算款	10,192,897.61
3	应收股利	-
4	应收利息	1,028,552.67
5	应收申购款	24,573,730.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,143,301.33

5.12.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,618,372,242.31
报告期基金总申购份额	1,757,727,558.98
减：报告期基金总赎回份额	2,933,134,471.07
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,442,965,330.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会注册易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2.《易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3.《易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一五年七月二十日