

易方达沪深 300 指数证券投资基金
2010 年年度报告
2010 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

送出日期：二〇一一年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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 2011 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
§ 2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6	审计报告.....	13
6.1	管理层对财务报表的责任.....	13
6.2	注册会计师的责任.....	14
6.3	审计意见.....	14
§ 7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4	报表附注.....	18
§ 8	投资组合报告.....	38
8.1	期末基金资产组合情况.....	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	39
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	49
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	50

8.9	投资组合报告附注.....	50
§ 9	基金份额持有人信息.....	51
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	51
§ 10	开放式基金份额变动.....	51
§ 11	重大事件揭示.....	52
11.1	基金份额持有人大会决议.....	52
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4	基金投资策略的改变.....	52
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8	其他重大事件.....	54
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§ 13	备查文件目录.....	58
13.1	备查文件目录.....	58
13.2	存放地点.....	58
13.3	查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 指数证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300 指数
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
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
报告期末基金份额总额	10,957,507,611.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	本基金主要采取完全复制法，即按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
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	本基金是指数型股票基金，属于证券投资基金中的高风险、高收益品种，理论上其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

2.3 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	尹东
	联系电话	020-38799008	010-67595003
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-38799488	010-66275865
注册地址		广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市体育西路189号城建大	北京市西城区闹市口大街1号

	厦25、26、27、28楼	院1号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	梁棠	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市体育西路189号城建大厦28楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市体育西路189号城建大厦25楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年 8 月 26 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-36,252,271.52	189,652,028.16
本期利润	-1,067,287,430.23	1,068,114,010.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0921	0.0766
本期加权平均净值利润率	-9.89%	7.42%
本期基金份额净值增长率	-11.85%	7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-602,514,110.79	175,040,263.10
期末可供分配基金份额利润	-0.0550	0.0160
期末基金资产净值	10,354,993,500.29	11,690,699,331.44
期末基金份额净值	0.945	1.072
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	-5.50%	7.20%

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. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4. 本基金合同于 2009 年 8 月 26 日生效，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

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①	份额净值增长率标准差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	5.94%	1.69%	6.28%	1.68%	-0.34%	0.01%
过去六个月	21.00%	1.49%	20.94%	1.47%	0.06%	0.02%
过去一年	-11.85%	1.51%	-11.78%	1.50%	-0.07%	0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.50%	1.42%	0.82%	1.62%	-6.32%	-0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 指数证券投资基金

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

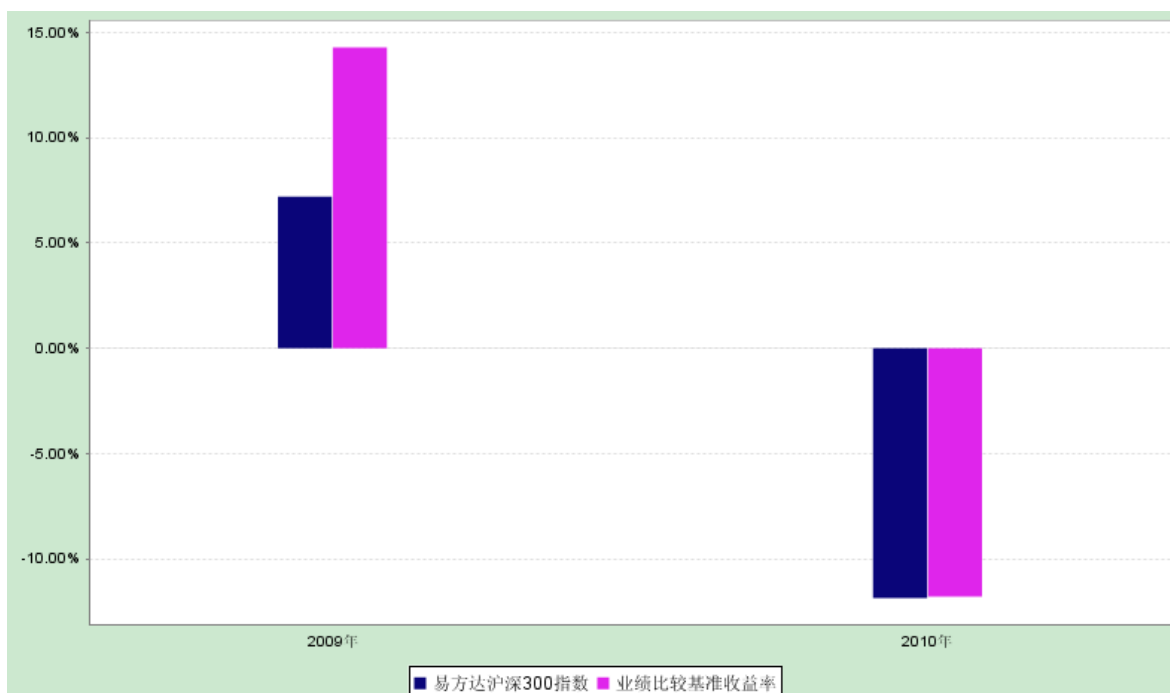
(2009 年 8 月 26 日至 2010 年 12 月 31 日)



注：1. 易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同中关于基金投资比例的约定：

- (1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
 - (2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
 - (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
 - (4) 本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资沪深 300 指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；
 - (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
 - (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
 - (7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
 - (8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
 - (9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
 - (10) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
 - (11) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
 - (12) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
- 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。
2. 本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。
 3. 本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为-5.50%，同期基金业绩比较基准收益率为 0.82%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日，2009 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2009 年 8 月 26 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 1.2 亿元。截至 2010 年 12 月 31 日，公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、广东盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务资格。

自成立以来，易方达基金管理有限公司秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健的增长”的经营理念，努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务，为投资者创造最佳的回报。

截至 2010 年 12 月 31 日，易方达基金管理有限公司共管理 1 只封闭式基金、23 只开放式基金，具体包括基金科瑞和易方达科讯股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达 50 指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型基金、易方达策略成长二号混合型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达增强回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深 300 指数基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金联接基金、易方达亚洲精选股票型基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达岁丰添利债券型基金。同时，公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、易方达沪深 300 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达 50 指数基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金联接基金的基金经理、指数与量化投资部总经理助理	2009-08-26	-	7 年	博士研究生，历任融通基金管理有限公司基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理。

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。

3.根据 2010 年 12 月 31 日《易方达基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》，自 2011 年 1 月 1 日起林飞不再担任易方达沪深 300 指数证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年是中国经历国际金融危机后，经济进入常态化的开始。前期刺激政策带来经济复苏的同时，也逐渐催生出价格泡沫，商品房价格较早地表现出来，随后通胀趋向全面化，11 月份 CPI 创两年多来的新高达 5.1%。经济政策在本年度全面转向，针对房地产市场的严厉调控政策于二季度初出台，银监会开始清查地方政府融资平台贷款项目。央行货币政策日趋严厉，商业银行存款准备金率加至历史最高位，存贷款基准利率年内两度上调。在如此经济环境和政策背景下，A 股市场走出震荡下跌行情，上证指数全年跌幅达 14.31%。与此同时，长期经济结构调整的预期逐步反映在股市上，成长股对周期股、小盘股对大盘股的分化愈演愈烈。钢铁、房地产、金融、化工等传统周期类股票明显跑输大盘，年度跌幅普遍达 20%以上，而电子元器件、医药生物、食品饮料、新能源等消费类或新经济类股票则普遍上涨 20%以上。

报告期内，上证指数下跌 14.31%，沪深 300 指数同期跌幅 12.51%。作为标准型指数基金，本基金跟随指数成分股的调整作出日常操作，保持基金组合与标的指数权重基本一致，年内本基

金净值跟随基准指数出现一定幅度的下跌。

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 0.945 元，本报告期份额净值增长率为-11.85%，同期基准指数收益率为-11.78%，年化跟踪误差 0.93%，在合同规定的控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股市涨跌是对宏观经济周期波动的反映，中国经济增长的波动幅度较大是决定 A 股市场大幅波动的根源。2011 年仍是经济常态化的延续，各类宏观调控政策亦将趋于正常化，全年来看，中国经济有望走出前低后高的走势，通胀终将得以控制。目前沪深股市的 2011 年整体动态市盈率约 15 倍左右，处于历史较低水平，流动性紧缩导致的市场短期下跌将为长期投资者带来投资良机。大消费、新能源、新科技以及轻资产的先进制造业有可能成为市场长期配置的方向。长期来看，我国仍处于快速的城市化、工业化进程中，经济仍将在较长时期内保持高增速。本基金对市场长期走势看好，短期需警惕流动性收紧给股市带来的压力。

作为被动投资的基金产品，沪深 300 指数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未来长期稳定的增长提供良好的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规变化和业务发展的实际需要、以及不断细化深化的监管要求，重点围绕“三个底线”进一步完善公司内控，继续强化对制度执行情况的监督检查，合理确保了公司各项业务运作管理的合法合规和审慎经营。

主要工作及措施如下：

(1) 推动各部门全面梳理和检讨业务流程中存在的风险点，强化风险管理导向，促进业务流程优化，努力保持公司良好的内控环境。与此同时，加强制度本身的规范和基础工作，促进员工对制度的知晓、了解和落实执行，提高制度的权威性。

(2) 不断促进监察稽核工具方法和流程的完善，提高监察稽核工作的计划性。坚持对投资、交易等业务的运作进行日常合规性监察检查，不断摸索改进监控方法和手段，适应业务发展的需要；并根据监管要求和内控需要，对投资交易、销售宣传、运营维稳、反洗钱、人员规范、客户服务等方面进行了一系列专项检查，以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，对所发

现的合规问题或风险隐患及时向业务部门提出、向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

(3) 开展了全面的 IT 内审工作，逐步建立 IT 内审的工作框架，摸索形成了相关的工作方法和流程。本年度公司成立了信息技术治理委员会，从组织上进一步加强公司的信息技术规划管理和制度流程规范。

(4) 积极深入参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议；负责公司日常法律事务、合同审查，检查督促客户投诉的及时反馈处理。

(5) 牵头推动公司反洗钱制度建设以及相关工作流程和规则的不断完善，明确落实相关部门的职责，组织相关部门开展反洗钱系统开发测试、反洗钱宣传培训、信息调研与意见反馈、数据组织报送和工作总结报告等工作，并进行了较全面的反洗钱内部审计与整改检查，进一步贯彻落实反洗钱法规精神和工作要求。

(6) 按照法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

(7) 积极开展或配合人力资源部进行各类监察合规培训，促进公司合规文化建设。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期出现亏损，不进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20380 号

易方达沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的易方达沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“易方达沪深 300 指数基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作

编制财务报表是易方达沪深 300 指数基金的基金管理人易方达基金管理有限公司管理层的责任。

这种责任包括：

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2)选择和运用恰当的会计政策；

(3)作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了易方达沪深 300 指数基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 薛竞 金毅

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2011-03-21

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	209,118,151.26	172,647,174.46
结算备付金		1,314,271.29	37,857,940.93
存出保证金		-	1,416,598.21
交易性金融资产	7.4.7.2	10,144,072,198.02	11,439,558,544.33
其中：股票投资		9,702,357,198.02	11,040,878,544.33
基金投资		-	-
债券投资		441,715,000.00	398,680,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		15,053,410.86	13,788,058.64
应收利息	7.4.7.5	7,892,927.79	354,306.29
应收股利		-	-
应收申购款		11,842,924.06	138,806,982.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		10,389,293,883.28	11,804,429,605.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17,188,871.57	-
应付赎回款		4,085,624.06	92,546,486.20
应付管理人报酬		4,570,380.60	4,956,669.44
应付托管费		1,371,114.15	1,487,000.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,110,701.46	8,423,769.29
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,973,691.15	6,316,348.65
负债合计		34,300,382.99	113,730,274.41
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	10,957,507,611.08	10,908,506,149.33
未分配利润	7.4.7.10	-602,514,110.79	782,193,182.11
所有者权益合计		10,354,993,500.29	11,690,699,331.44
负债和所有者权益总计		10,389,293,883.28	11,804,429,605.85

注：1. 本基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日，2009 年度实际报告期间为 2009 年 8 月 26 日至 2009 年 12 月 31 日。

2. 报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.945 元，基金份额总额 10,957,507,611.08 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同 生效日）至2009年12月31 日
一、收入		-981,808,611.20	1,119,305,070.81
1. 利息收入		10,164,583.99	25,979,444.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,549,080.85	11,007,700.37
债券利息收入		8,615,503.14	6,137,018.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,834,724.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,233,582.73	205,620,181.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-81,214,726.56	203,209,204.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,641,520.06	452,489.91
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	109,806,789.23	1,958,486.67
3. 公允价值变动收益（损失以	7.4.7.16	-1,031,035,158.71	878,461,982.36

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7. 4. 7. 17	5,828,380.79	9,243,463.29
减: 二、费用		85,478,819.03	51,191,060.29
1. 管理人报酬		53,961,609.41	25,152,581.84
2. 托管费		16,188,482.73	7,545,774.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 18	12,537,020.64	17,237,854.64
5. 利息支出		110,940.48	-
其中: 卖出回购金融资产支出		110,940.48	-
6. 其他费用	7. 4. 7. 19	2,680,765.77	1,254,849.30
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-1,067,287,430.23	1,068,114,010.52
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-1,067,287,430.23	1,068,114,010.52

注: 本基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日, 2009 年度实际报告期间为 2009 年 8 月 26 日至 2009 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 易方达沪深 300 指数证券投资基金

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	10,908,506,149.33	782,193,182.11	11,690,699,331.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-1,067,287,430.23	-1,067,287,430.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	49,001,461.75	-317,419,862.67	-268,418,400.92
其中: 1. 基金申购款	5,766,372,893.13	-403,626,570.40	5,362,746,322.73
2. 基金赎回款	-5,717,371,431.38	86,206,707.73	-5,631,164,723.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,957,507,611.08	-602,514,110.79	10,354,993,500.29

项目	上年度可比期间		
	2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,746,252,366.35	-	16,746,252,366.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,068,114,010.52	1,068,114,010.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,837,746,217.02	-285,920,828.41	-6,123,667,045.43
其中：1. 基金申购款	978,916,217.62	44,654,818.83	1,023,571,036.45
2. 基金赎回款	-6,816,662,434.64	-330,575,647.24	-7,147,238,081.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,908,506,149.33	782,193,182.11	11,690,699,331.44

注：本基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日，2009 年度实际报告期间为 2009 年 8 月 26 日至 2009 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：梁棠，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 指数证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,539,280.61 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业

务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债

表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利自动转为基金份额；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别证券投资公允价值时采用的估值方法如下：

(1)非公开发行有明确锁定期的股票的估值

(i) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

(ii) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理。

(2)长期停牌股票的估值

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的长期停牌股票进行估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。

(3) 银行间同业市场交易的债券的估值

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券，参照中国证券业协会证券投资基金估值工作小组关于固定收益品种的估值处理标准，选取中央国债登记结算有限责任公司按现金流量折现法独立计算的价格进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	209,118,151.26	172,647,174.46
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	209,118,151.26	172,647,174.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,853,547,524.37	9,702,357,198.02	-151,190,326.35
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	443,097,850.00	441,715,000.00

	合计	443,097,850.00	441,715,000.00	-1,382,850.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,296,645,374.37	10,144,072,198.02	-152,573,176.35
项目		上年度末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		10,162,416,561.97	11,040,878,544.33	878,461,982.36
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	398,680,000.00	398,680,000.00	-
	合计	398,680,000.00	398,680,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,561,096,561.97	11,439,558,544.33	878,461,982.36

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	28,029.43	36,440.71
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	460.00	13,250.20
应收债券利息	7,864,438.36	304,615.38
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	7,892,927.79	354,306.29

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,109,776.46	8,402,226.24
银行间市场应付交易费用	925.00	21,543.05
合计	3,110,701.46	8,423,769.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,380,767.99	4,970,378.21
预提费用	470,000.00	121,000.00
其他应付款	1,122,923.16	1,224,970.44
合计	3,973,691.15	6,316,348.65

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,908,506,149.33	10,908,506,149.33
本期申购	5,766,372,893.13	5,766,372,893.13
本期赎回（以“-”号填列）	-5,717,371,431.38	-5,717,371,431.38
本期末	10,957,507,611.08	10,957,507,611.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	175,040,263.10	607,152,919.01	782,193,182.11
本期利润	-36,252,271.52	-1,031,035,158.71	-1,067,287,430.23
本期基金份额交易产生的变动数	-2,076,311.83	-315,343,550.84	-317,419,862.67
其中：基金申购款	91,766,613.12	-495,393,183.52	-403,626,570.40
基金赎回款	-93,842,924.95	180,049,632.68	86,206,707.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,711,679.75	-739,225,790.54	-602,514,110.79

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
活期存款利息收入	1,355,594.96	10,781,656.92
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	44,727.44	209,995.03
其他	148,758.45	16,048.42
合计	1,549,080.85	11,007,700.37

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
卖出股票成交总额	4,198,330,819.55	2,324,617,110.09
减：卖出股票成本总额	4,279,545,546.11	2,121,407,905.53
买卖股票差价收入	-81,214,726.56	203,209,204.56

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	598,840,613.92	4,523,729,955.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	589,976,129.39	4,488,418,731.16
减：应收利息总额	4,222,964.47	34,858,734.82
债券投资收益	4,641,520.06	452,489.91

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	109,806,789.23	1,958,486.67

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	109,806,789.23	1,958,486.67

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,031,035,158.71	878,461,982.36
——股票投资	-1,029,652,308.71	878,461,982.36
——债券投资	-1,382,850.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,031,035,158.71	878,461,982.36

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
基金赎回费收入	5,828,380.79	8,908,236.19
基金合同生效前利息收入	-	335,227.10
合计	5,828,380.79	9,243,463.29

注：本基金基金合同生效前认购资金实际产生的利息与注册登记系统确认的利息折份额的差额，在本基金成立后划入基金资产，确认为其他收入。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
交易所市场交易费用	12,533,495.64	17,212,804.64
银行间市场交易费用	3,525.00	25,050.00
合计	12,537,020.64	17,237,854.64

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日

审计费用	170,000.00	121,000.00
信息披露费	300,000.00	99,000.00
指数使用费	2,158,464.33	1,006,103.28
债券托管账户维护费	18,000.00	1,500.00
银行划款手续费	34,301.44	25,986.02
证券账户开户费	-	900.00
其他	-	360.00
合计	2,680,765.77	1,254,849.30

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
广东盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年8月26日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
广发证券	1,554,899,548.03	19.34%	788,089,978.59	5.44%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	3,767,611.05	3.94%	-	-

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,263,366.47	18.68%	395,918.05	12.73%
关联方名称	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	640,327.05	5.26%	424,171.34	5.05%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

关联方交易单元租用合同范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	53,961,609.41	25,152,581.84
其中：支付销售机构的客户维护费	11,613,595.10	5,298,372.25

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生效 日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,188,482.73	7,545,774.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年8月26日（基金合同生 效日）至2009年12月31日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	156,419,798.25	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	156,419,798.25	-

期末持有的基金份额占基金总 份额比例	1.43%	-
-----------------------	-------	---

注：基金管理人本报告期持有本基金份额变动相关的申购费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 8 月 26 日（基金合同生效日） 至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	209,118,151.26	1,355,594.96	172,647,174.46	10,781,656.92

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002353	杰瑞股份	公开发行	500	29,750.00
上年度可比期间 2009 年 8 月 26 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	600033	福建高速	公开增发	247,411	1,590,852.73

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌	期末	复牌日期	复牌	数量（股）	期末	期末	备
------	------	------	----	----	------	----	-------	----	----	---

			原因	估值单 价		开盘单 价		成本总额	估值总额	注
000059	辽通化工	2010-12-02	重大 事项	11.59	-	-	1,127,694	11,577,432.69	13,069,973.46	-
000652	泰达股份	2010-11-22	重大 事项	7.78	-	-	1,977,410	16,573,172.02	15,384,249.80	-
000959	首钢股份	2010-10-29	重大 事项	4.42	-	-	2,471,838	12,259,314.80	10,925,523.96	-
600518	康美药业	2010-12-28	配股 停牌	19.71	2011-1-6	17.29	2,123,451	22,754,432.25	41,853,219.21	
600664	哈药股份	2010-12-29	重大 事项	22.57	2011-02-16	24.83	1,338,920	22,803,170.62	30,219,424.40	-
600816	安信信托	2010-06-02	重大 事项	13.60	-	-	670,239	10,493,172.60	9,115,250.40	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险监控和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。公司通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2009 年 12 月 31 日：0.00%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年末 2009 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	449,579,438.36	398,984,615.38
合计	449,579,438.36	398,984,615.38

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年末 2009 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险

主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	209,118,151.26	-	-	-	209,118,151.26
结算备付金	1,314,271.29	-	-	-	1,314,271.29
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	441,715,000.00	-	-	9,702,357,198.02	10,144,072,198.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,053,410.86	15,053,410.86
应收利息	-	-	-	7,892,927.79	7,892,927.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	10,025,021.75	-	-	1,817,902.31	11,842,924.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	662,172,444.30	-	-	9,727,121,438.98	10,389,293,883.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	17,188,871.57	17,188,871.57
应付赎回款	-	-	-	4,085,624.06	4,085,624.06
应付管理人报酬	-	-	-	4,570,380.60	4,570,380.60
应付托管费	-	-	-	1,371,114.15	1,371,114.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,110,701.46	3,110,701.46
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,973,691.15	3,973,691.15
负债总计	-	-	-	34,300,382.99	34,300,382.99
利率敏感度缺口	662,172,444.30	-	-	9,692,821,055.99	10,354,993,500.29
上年度末2009年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	172,647,174.46	-	-	-	172,647,174.46
结算备付金	37,857,940.93	-	-	-	37,857,940.93
存出保证金	-	-	-	1,416,598.21	1,416,598.21
交易性金融资产	398,680,000.00	-	-	11,040,878,544.33	11,439,558,544.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	13,788,058.64	13,788,058.64
应收利息	-	-	-	354,306.29	354,306.29
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	115,717,871.16	-	-	23,089,111.83	138,806,982.99

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	724,902,986.55	-	-	11,079,526,619.30	11,804,429,605.85
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	92,546,486.20	92,546,486.20
应付管理人报酬	-	-	-	4,956,669.44	4,956,669.44
应付托管费	-	-	-	1,487,000.83	1,487,000.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	8,423,769.29	8,423,769.29
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,316,348.65	6,316,348.65
负债总计	-	-	-	113,730,274.41	113,730,274.41
利率敏感度缺口	724,902,986.55	-	-	10,965,796,344.89	11,690,699,331.44

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	1. 市场利率下降 25 个基点	204,577.28	193,971.90
2. 市场利率上升 25 个基点	-204,376.60	-193,784.27	

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

公司采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,702,357,198.02	93.70	11,040,878,544.33	94.44
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,702,357,198.02	93.70	11,040,878,544.33	94.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	1. 业绩比较基准上升 5%	512, 572, 178. 26	580, 852, 396. 28	
2. 业绩比较基准下降 5%	-512, 572, 178. 26	-580, 852, 396. 28		

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**(1) 公允价值****(a) 不以公允价值计量的金融工具**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分

为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 9,581,789,556.79 元，第二层级的余额为 562,282,641.23 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 10,804,988,358.89 元，第二层级的余额为 634,570,185.44 元，无属于第三层级的余额)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，并于限售期满后从第二层级转入第一层级(2009 年度：同)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,702,357,198.02	93.39
	其中：股票	9,702,357,198.02	93.39
2	固定收益投资	441,715,000.00	4.25
	其中：债券	441,715,000.00	4.25
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	210,432,422.55	2.03
6	其他各项资产	34,789,262.71	0.33
7	合计	10,389,293,883.28	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	32,967,708.97	0.32
B	采掘业	1,245,868,798.75	12.03
C	制造业	3,450,098,626.80	33.32
C0	食品、饮料	563,731,018.60	5.44
C1	纺织、服装、皮毛	37,107,090.30	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	237,105,192.34	2.29
C5	电子	48,812,010.10	0.47
C6	金属、非金属	795,705,513.62	7.68
C7	机械、设备、仪表	1,259,132,057.85	12.16
C8	医药、生物制品	475,888,032.15	4.60
C99	其他制造业	32,617,711.84	0.31
D	电力、煤气及水的生产和供应业	238,147,949.72	2.30
E	建筑业	267,951,706.78	2.59
F	交通运输、仓储业	427,447,715.52	4.13
G	信息技术业	346,046,362.28	3.34
H	批发和零售贸易	294,404,254.21	2.84
I	金融、保险业	2,546,517,186.22	24.59
J	房地产业	520,598,954.52	5.03
K	社会服务业	90,421,183.04	0.87
L	传播与文化产业	14,122,800.00	0.14
M	综合类	218,648,700.81	2.11
	合计	9,693,241,947.62	93.61

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	9,115,250.40	0.09
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	9,115,250.40	0.09

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	5,903,646	331,548,759.36	3.20
2	600036	招商银行	22,059,157	282,577,801.17	2.73
3	601328	交通银行	37,126,923	203,455,538.04	1.96
4	600016	民生银行	39,799,888	199,795,437.76	1.93
5	600000	浦发银行	15,169,790	187,953,698.10	1.82
6	601166	兴业银行	7,391,166	177,757,542.30	1.72
7	601398	工商银行	39,385,405	166,994,117.20	1.61
8	600030	中信证券	12,267,160	154,443,544.40	1.49
9	601088	中国神华	5,882,726	145,362,159.46	1.40
10	000002	万科A	17,056,814	140,207,011.08	1.35
11	601601	中国太保	5,608,974	128,445,504.60	1.24
12	600519	贵州茅台	674,768	124,103,330.56	1.20
13	000858	五粮液	3,387,904	117,323,115.52	1.13
14	002024	苏宁电器	7,596,561	99,514,949.10	0.96

15	000651	格力电器	5,212,744	94,507,048.72	0.91
16	601169	北京银行	7,681,190	87,872,813.60	0.85
17	600690	青岛海尔	2,993,864	84,456,903.44	0.82
18	600050	中国联通	14,939,539	79,926,533.65	0.77
19	000001	深发展 A	4,971,122	78,494,016.38	0.76
20	601899	紫金矿业	9,395,571	77,137,637.91	0.74
21	601857	中国石油	6,705,075	75,230,941.50	0.73
22	000983	西山煤电	2,810,062	75,000,554.78	0.72
23	000063	中兴通讯	2,658,271	72,570,798.30	0.70
24	601668	中国建筑	21,144,300	72,313,506.00	0.70
25	601006	大秦铁路	9,098,077	71,146,962.14	0.69
26	600837	海通证券	7,337,183	70,730,444.12	0.68
27	600585	海螺水泥	2,349,183	69,723,751.44	0.67
28	600089	特变电工	3,616,371	67,481,482.86	0.65
29	600547	山东黄金	1,274,578	67,183,006.38	0.65
30	600362	江西铜业	1,480,489	66,873,688.13	0.65
31	600497	驰宏锌锗	2,598,276	66,749,710.44	0.64
32	600900	长江电力	8,722,045	66,025,880.65	0.64
33	600111	包钢稀土	871,973	62,293,751.12	0.60
34	600348	国阳新能	2,146,423	61,559,411.64	0.59
35	600048	保利地产	4,837,432	61,435,386.40	0.59
36	000157	中联重科	4,264,740	60,303,423.60	0.58
37	600028	中国石化	7,430,600	59,890,636.00	0.58
38	600019	宝钢股份	9,367,205	59,856,439.95	0.58
39	600015	华夏银行	5,276,026	57,508,683.40	0.56
40	601628	中国人寿	2,678,304	57,047,875.20	0.55
41	601699	潞安环能	932,463	55,612,093.32	0.54
42	600887	伊利股份	1,450,607	55,500,223.82	0.54
43	601168	西部矿业	2,939,266	55,375,771.44	0.53
44	600256	广汇股份	1,309,334	54,900,374.62	0.53
45	000792	盐湖钾肥	811,436	53,749,520.64	0.52
46	600031	三一重工	2,468,056	53,384,051.28	0.52
47	601766	中国南车	6,997,619	52,832,023.45	0.51
48	002202	金风科技	2,320,071	51,737,583.30	0.50
49	600489	中金黄金	1,281,905	51,712,047.70	0.50
50	000568	泸州老窖	1,244,662	50,906,675.80	0.49
51	000338	潍柴动力	961,762	50,367,475.94	0.49
52	600795	国电电力	16,275,365	49,802,616.90	0.48
53	601288	农业银行	18,167,300	48,688,364.00	0.47
54	600739	辽宁成大	1,602,454	48,265,914.48	0.47
55	600383	金地集团	7,805,298	48,236,741.64	0.47

56	000423	东阿阿胶	943,665	48,221,281.50	0.47
57	000895	双汇发展	534,400	46,492,800.00	0.45
58	600068	葛洲坝	3,687,014	42,769,362.40	0.41
59	000425	徐工机械	745,275	42,629,730.00	0.41
60	601958	金钼股份	1,744,875	42,295,770.00	0.41
61	600415	小商品城	1,199,981	42,047,334.24	0.41
62	601299	中国北车	5,914,300	41,932,387.00	0.40
63	600518	康美药业	2,123,451	41,853,219.21	0.40
64	601989	中国重工	3,518,933	41,488,220.07	0.40
65	600875	东方电气	1,173,722	40,962,897.80	0.40
66	600406	国电南瑞	567,158	40,869,405.48	0.39
67	000630	铜陵有色	1,152,295	40,387,939.75	0.39
68	601111	中国国航	2,935,267	40,154,452.56	0.39
69	601390	中国中铁	9,035,204	39,122,433.32	0.38
70	601988	中国银行	12,096,541	39,071,827.43	0.38
71	601919	中国远洋	4,036,247	37,940,721.80	0.37
72	601186	中国铁建	5,424,201	36,776,082.78	0.36
73	601009	南京银行	3,661,885	36,399,136.90	0.35
74	600029	南方航空	3,712,200	36,156,828.00	0.35
75	601898	中煤能源	3,270,712	35,519,932.32	0.34
76	000039	中集集团	1,520,824	34,963,743.76	0.34
77	000402	金融街	5,287,766	34,952,133.26	0.34
78	601600	中国铝业	3,415,882	34,637,043.48	0.33
79	601666	平煤股份	1,622,038	34,208,781.42	0.33
80	601618	中国中冶	8,703,759	34,031,697.69	0.33
81	600535	天士力	831,623	33,896,953.48	0.33
82	000069	华侨城 A	2,771,920	33,678,828.00	0.33
83	600100	同方股份	1,226,918	32,525,596.18	0.31
84	000009	中国宝安	1,921,927	32,230,715.79	0.31
85	601607	上海医药	1,419,178	30,994,847.52	0.30
86	000878	云南铜业	1,107,127	30,445,992.50	0.29
87	000528	柳工	819,640	30,326,680.00	0.29
88	600664	哈药股份	1,338,920	30,219,424.40	0.29
89	000538	云南白药	497,748	30,063,979.20	0.29
90	600188	兖州煤业	1,055,300	29,959,967.00	0.29
91	601727	上海电气	3,471,353	29,437,073.44	0.28
92	601788	光大证券	1,944,401	29,068,794.95	0.28
93	600104	上海汽车	1,964,288	28,835,747.84	0.28
94	600694	大商股份	607,469	28,787,955.91	0.28
95	000783	长江证券	2,547,111	28,782,354.30	0.28
96	600123	兰花科创	610,931	28,762,631.48	0.28

97	000800	一汽轿车	1,785,641	28,659,538.05	0.28
98	600132	重庆啤酒	515,067	28,550,163.81	0.28
99	000933	神火股份	1,134,785	28,426,364.25	0.27
100	600583	海油工程	3,494,032	28,301,659.20	0.27
101	600018	上港集团	7,403,869	28,208,740.89	0.27
102	600309	烟台万华	1,465,418	28,121,371.42	0.27
103	000623	吉林敖东	818,613	27,865,586.52	0.27
104	600655	豫园商城	2,050,643	27,581,148.35	0.27
105	000012	南玻A	1,390,566	27,463,678.50	0.27
106	000709	河北钢铁	7,345,675	27,399,367.75	0.26
107	600166	福田汽车	1,127,460	27,374,728.80	0.26
108	000825	太钢不锈	5,084,141	27,149,312.94	0.26
109	600115	东方航空	4,113,631	27,067,691.98	0.26
110	000768	西飞国际	2,214,654	26,885,899.56	0.26
111	600352	浙江龙盛	2,241,421	26,291,868.33	0.25
112	600177	雅戈尔	2,353,958	25,705,221.36	0.25
113	600660	福耀玻璃	2,498,022	25,629,705.72	0.25
114	000401	冀东水泥	1,082,054	25,568,936.02	0.25
115	600546	山煤国际	737,827	25,528,814.20	0.25
116	000898	鞍钢股份	3,285,051	25,393,444.23	0.25
117	002142	宁波银行	2,032,518	25,203,223.20	0.24
118	601001	大同煤业	1,193,700	25,079,637.00	0.24
119	600058	五矿发展	765,143	25,020,176.10	0.24
120	000937	冀中能源	615,855	24,664,992.75	0.24
121	002007	华兰生物	507,614	24,563,441.46	0.24
122	600276	恒瑞医药	410,460	24,446,997.60	0.24
123	601688	华泰证券	1,770,346	24,289,147.12	0.23
124	600999	招商证券	1,277,897	24,228,927.12	0.23
125	600550	天威保变	1,042,561	24,072,733.49	0.23
126	600832	东方明珠	2,809,659	23,910,198.09	0.23
127	600143	金发科技	1,476,384	23,784,546.24	0.23
128	600150	中国船舶	350,184	23,724,966.00	0.23
129	600005	武钢股份	5,524,430	23,644,560.40	0.23
130	000960	锡业股份	714,821	23,374,646.70	0.23
131	600549	厦门钨业	488,401	23,243,003.59	0.22
132	600812	华北制药	1,457,527	22,897,749.17	0.22
133	000951	中国重汽	827,218	22,880,849.88	0.22
134	600196	复星医药	1,695,101	22,833,010.47	0.22
135	600881	亚泰集团	3,397,268	22,761,695.60	0.22
136	600271	航天信息	819,850	22,554,073.50	0.22
137	600642	申能股份	2,912,113	22,219,422.19	0.21

138	600997	开滦股份	1,101,819	22,179,616.47	0.21
139	601106	中国一重	3,654,800	21,709,512.00	0.21
140	600600	青岛啤酒	624,764	21,666,815.52	0.21
141	601998	中信银行	4,105,863	21,555,780.75	0.21
142	600009	上海机场	1,720,121	21,312,299.19	0.21
143	000758	中色股份	674,961	21,288,269.94	0.21
144	002155	辰州矿业	590,423	21,207,994.16	0.20
145	000969	安泰科技	904,545	20,967,353.10	0.20
146	000927	一汽夏利	2,555,261	20,825,377.15	0.20
147	600320	振华重工	3,154,098	20,596,259.94	0.20
148	000729	燕京啤酒	1,078,534	20,481,360.66	0.20
149	002422	科伦药业	126,795	19,972,748.40	0.19
150	000839	中信国安	1,657,592	19,857,952.16	0.19
151	002399	海普瑞	140,919	19,606,060.47	0.19
152	000680	山推股份	1,077,572	19,601,034.68	0.19
153	000024	招商地产	1,215,099	19,380,829.05	0.19
154	600395	盘江股份	593,264	19,310,743.20	0.19
155	600221	海南航空	2,134,942	19,150,429.74	0.18
156	601866	中海集运	4,196,720	18,801,305.60	0.18
157	600741	华域汽车	1,822,331	18,605,999.51	0.18
158	600811	东方集团	2,367,313	18,559,733.92	0.18
159	600582	天地科技	713,649	18,547,737.51	0.18
160	000778	新兴铸管	2,044,816	18,260,206.88	0.18
161	601179	中国西电	2,305,200	18,211,080.00	0.18
162	600085	同仁堂	528,561	18,119,071.08	0.17
163	000422	湖北宣化	956,549	18,030,948.65	0.17
164	000999	华润三九	701,810	17,931,245.50	0.17
165	002128	露天煤业	701,894	17,912,334.88	0.17
166	600125	铁龙物流	1,239,756	17,877,281.52	0.17
167	002304	洋河股份	79,708	17,854,592.00	0.17
168	600631	百联股份	1,163,934	17,749,993.50	0.17
169	600010	宝钢股份	4,624,675	17,527,518.25	0.17
170	600062	双鹤药业	613,362	17,474,683.38	0.17
171	000562	宏源证券	1,030,780	17,255,257.20	0.17
172	600331	宏达股份	1,112,284	17,251,524.84	0.17
173	601333	广深铁路	4,984,066	17,195,027.70	0.17
174	601818	光大银行	4,316,851	17,094,729.96	0.17
175	600376	首开股份	1,013,820	17,082,867.00	0.16
176	000728	国元证券	1,385,525	16,986,536.50	0.16
177	000061	农产品	963,457	16,966,477.77	0.16
178	600588	用友软件	719,612	16,738,175.12	0.16

179	600219	南山铝业	1,721,540	16,698,938.00	0.16
180	600598	北大荒	1,254,065	16,591,279.95	0.16
181	600108	亚盛集团	2,488,819	16,376,429.02	0.16
182	600169	太原重工	764,842	16,306,431.44	0.16
183	600208	新湖中宝	2,716,007	16,296,042.00	0.16
184	600649	城投控股	2,044,407	16,253,035.65	0.16
185	600601	方正科技	3,918,801	16,027,896.09	0.15
186	600312	平高电气	1,163,164	15,853,925.32	0.15
187	600516	方大炭素	1,126,912	15,788,037.12	0.15
188	600809	山西汾酒	228,858	15,683,638.74	0.15
189	600216	浙江医药	481,315	15,676,429.55	0.15
190	600635	大众公用	2,346,836	15,653,396.12	0.15
191	600118	中国卫星	625,702	15,529,923.64	0.15
192	600879	航天电子	1,154,220	15,512,716.80	0.15
193	600153	建发股份	2,367,880	15,509,614.00	0.15
194	000652	泰达股份	1,977,410	15,384,249.80	0.15
195	000100	TCL 集团	4,480,590	15,368,423.70	0.15
196	000876	新 希 望	732,766	15,351,447.70	0.15
197	601117	中国化学	2,609,900	15,085,222.00	0.15
198	600500	中化国际	1,266,500	15,008,025.00	0.14
199	000807	云铝股份	1,252,853	14,959,064.82	0.14
200	600432	吉恩镍业	575,703	14,726,482.74	0.14
201	600508	上海能源	519,129	14,686,159.41	0.14
202	600418	江淮汽车	1,381,100	14,681,093.00	0.14
203	002092	中泰化学	1,016,928	14,674,271.04	0.14
204	600595	中孚实业	1,056,223	14,575,877.40	0.14
205	600239	云南城投	781,882	14,519,548.74	0.14
206	600808	马钢股份	4,248,057	14,485,874.37	0.14
207	601888	中国国旅	465,553	14,418,176.41	0.14
208	600737	中粮屯河	894,783	14,182,310.55	0.14
209	600037	歌华有线	1,129,824	14,122,800.00	0.14
210	601158	重庆水务	1,691,500	13,988,705.00	0.14
211	601918	国投新集	992,212	13,940,578.60	0.13
212	600096	云天化	520,340	13,898,281.40	0.13
213	000021	长城开发	1,181,769	13,873,968.06	0.13
214	600779	水井坊	610,751	13,558,672.20	0.13
215	600316	洪都航空	505,833	13,536,091.08	0.13
216	600066	宇通客车	641,839	13,497,874.17	0.13
217	600008	首创股份	1,965,795	13,229,800.35	0.13
218	600839	四川长虹	3,553,862	13,149,289.40	0.13
219	000059	辽通化工	1,127,694	13,069,973.46	0.13

220	002001	新 和 成	511,844	12,924,061.00	0.12
221	600596	新安股份	838,426	12,760,843.72	0.12
222	000046	泛海建设	1,415,055	12,707,193.90	0.12
223	000612	焦作万方	582,660	12,701,988.00	0.12
224	002028	思源电气	470,557	12,361,532.39	0.12
225	600804	鹏博士	1,416,362	12,279,858.54	0.12
226	600717	天津港	1,472,226	12,278,364.84	0.12
227	600675	中华企业	1,746,144	12,083,316.48	0.12
228	600663	陆家嘴	718,541	12,071,488.80	0.12
229	600895	张江高科	1,365,648	11,990,389.44	0.12
230	000725	京东方 A	3,790,500	11,977,980.00	0.12
231	000690	宝新能源	2,154,890	11,916,541.70	0.12
232	000968	煤 气 化	458,500	11,907,245.00	0.11
233	600481	双良节能	713,700	11,847,420.00	0.11
234	600266	北京城建	970,034	11,844,115.14	0.11
235	002146	荣盛发展	863,860	11,739,857.40	0.11
236	000625	长安汽车	1,232,030	11,716,605.30	0.11
237	600528	中铁二局	1,286,750	11,683,690.00	0.11
238	600325	华发股份	1,151,678	11,678,014.92	0.11
239	600210	紫江企业	2,015,633	11,650,358.74	0.11
240	000027	深圳能源	1,145,342	11,556,500.78	0.11
241	600269	赣粤高速	2,059,304	11,470,323.28	0.11
242	600183	生益科技	1,006,336	11,462,167.04	0.11
243	600220	江苏阳光	2,201,133	11,401,868.94	0.11
244	601101	昊华能源	239,950	11,292,047.00	0.11
245	000718	苏宁环球	1,201,137	11,230,630.95	0.11
246	002122	天马股份	845,710	11,214,114.60	0.11
247	000780	平庄能源	721,900	11,066,727.00	0.11
248	600517	置信电气	661,167	10,962,148.86	0.11
249	000959	首钢股份	2,471,838	10,925,523.96	0.11
250	600170	上海建工	735,135	10,725,619.65	0.10
251	600026	中海发展	1,115,576	10,709,529.60	0.10
252	600718	东软集团	656,477	10,529,891.08	0.10
253	600161	天坛生物	454,091	10,398,683.90	0.10
254	600456	宝钛股份	380,199	10,303,392.90	0.10
255	000900	现代投资	496,911	10,211,521.05	0.10
256	600380	健康元	920,320	10,187,942.40	0.10
257	000686	东北证券	451,029	10,053,436.41	0.10
258	000031	中粮地产	1,599,321	9,963,769.83	0.10
259	600863	内蒙华电	1,034,758	9,809,505.84	0.09
260	600674	川投能源	663,630	9,781,906.20	0.09

261	600369	西南证券	830,569	9,659,517.47	0.09
262	600428	中远航运	1,155,506	9,636,920.04	0.09
263	000667	名流置业	3,159,814	9,511,040.14	0.09
264	601369	陕鼓动力	385,209	9,167,974.20	0.09
265	600893	航空动力	288,199	9,014,864.72	0.09
266	600151	航天机电	679,023	8,929,152.45	0.09
267	600300	维维股份	1,488,277	8,780,834.30	0.08
268	000961	中南建设	759,860	8,685,199.80	0.08
269	002294	信立泰	120,026	8,664,676.94	0.08
270	600033	福建高速	2,420,023	8,591,081.65	0.08
271	601877	正泰电器	354,416	8,488,263.20	0.08
272	600611	大众交通	1,109,856	8,468,201.28	0.08
273	600823	世茂股份	619,300	8,366,743.00	0.08
274	002415	海康威视	88,190	8,316,317.00	0.08
275	600087	长航油运	1,704,322	8,283,004.92	0.08
276	002244	滨江集团	715,299	8,068,572.72	0.08
277	600109	国金证券	533,229	7,795,807.98	0.08
278	601107	四川成渝	1,159,930	7,690,335.90	0.07
279	002405	四维图新	141,104	7,684,523.84	0.07
280	600597	光明乳业	739,092	7,583,083.92	0.07
281	601268	二重重装	596,035	7,456,397.85	0.07
282	600004	白云机场	813,680	7,176,657.60	0.07
283	600006	东风汽车	1,423,430	6,889,401.20	0.07
284	600307	酒钢宏兴	709,376	6,703,603.20	0.06
285	600017	日照港	1,565,744	6,388,235.52	0.06
286	600748	上实发展	764,237	6,167,392.59	0.06
287	002242	九阳股份	402,556	6,066,518.92	0.06
288	601099	太平洋	530,255	5,758,569.30	0.06
289	002385	大北农	141,350	5,711,953.50	0.06
290	000685	中山公用	318,721	5,564,868.66	0.05
291	600350	山东高速	1,186,500	5,540,955.00	0.05
292	601139	深圳燃气	429,520	5,330,343.20	0.05
293	600657	信达地产	806,490	4,935,718.80	0.05
294	600703	三安光电	55,560	2,547,981.60	0.02
295	601808	中海油服	56,975	1,455,141.50	0.01

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600816	安信信托	670,239	9,115,250.40	0.09

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	139,501,677.74	1.19
2	600036	招商银行	112,043,107.52	0.96
3	601328	交通银行	91,571,040.62	0.78
4	600000	浦发银行	88,238,892.27	0.75
5	601398	工商银行	83,065,855.53	0.71
6	601166	兴业银行	82,940,599.09	0.71
7	601288	农业银行	66,487,135.27	0.57
8	600016	民生银行	64,989,231.87	0.56
9	000002	万科 A	62,694,299.24	0.54
10	601601	中国太保	62,276,244.09	0.53
11	601668	中国建筑	60,576,565.66	0.52
12	600887	伊利股份	55,420,190.91	0.47
13	600030	中信证券	49,934,711.81	0.43
14	000063	中兴通讯	45,242,168.41	0.39
15	000157	中联重科	43,164,995.08	0.37
16	600100	同方股份	41,194,692.92	0.35
17	600406	国电南瑞	40,752,567.78	0.35
18	601088	中国神华	39,452,698.12	0.34
19	600690	青岛海尔	39,275,016.68	0.34
20	600362	江西铜业	38,419,071.31	0.33

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	134,210,015.19	1.15
2	601398	工商银行	123,364,646.23	1.06
3	600036	招商银行	122,534,923.27	1.05
4	601328	交通银行	90,529,501.00	0.77
5	601601	中国太保	82,477,919.22	0.71
6	600016	民生银行	80,850,969.36	0.69
7	601166	兴业银行	79,800,938.01	0.68
8	000002	万科 A	78,799,167.24	0.67

9	600030	中信证券	66,622,666.28	0.57
10	600104	上海汽车	63,505,697.29	0.54
11	600000	浦发银行	61,456,568.93	0.53
12	000651	格力电器	60,209,748.32	0.52
13	600900	长江电力	58,755,803.89	0.50
14	601088	中国神华	57,822,596.82	0.49
15	600100	同方股份	53,438,421.46	0.46
16	600031	三一重工	49,231,764.08	0.42
17	000063	中兴通讯	43,588,675.02	0.37
18	000858	五粮液	41,654,270.86	0.36
19	601169	北京银行	40,818,340.49	0.35
20	600011	华能国际	39,835,439.36	0.34

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,970,676,508.51
卖出股票收入（成交）总额	4,198,330,819.55

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	441,715,000.00	4.27
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	441,715,000.00	4.27

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1001015	10 央行票据 15	4,000,000	391,520,000.00	3.78
2	0801047	08 央行票据 47	500,000	50,195,000.00	0.48

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	15,053,410.86
3	应收股利	-
4	应收利息	7,892,927.79
5	应收申购款	11,842,924.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,789,262.71

8.9.4 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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	9,115,250.40	0.09	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
221,330	49,507.56	2,715,214,843.18	24.78%	8,242,292,767.90	75.22%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	455,059.53	0.0042%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年8月26日)基金份额总额	16,746,252,366.35
本报告期期初基金份额总额	10,908,506,149.33
本报告期基金总申购份额	5,766,372,893.13
减：本报告期基金总赎回份额	5,717,371,431.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,957,507,611.08

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续两年聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。本报告期内年度的审计费为人民币 170,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	3,285,137,214.07	40.86%	2,792,365.78	41.30%	-
广发证券	2	1,554,899,548.03	19.34%	1,263,366.47	18.68%	-
兴业证券	1	1,441,678,252.40	17.93%	1,225,423.31	18.12%	-
国海证券	1	517,498,573.89	6.44%	439,873.35	6.51%	-
招商证券	1	381,520,231.03	4.74%	309,987.76	4.58%	-
西南证券	1	268,289,287.42	3.34%	228,045.12	3.37%	-
平安证券	1	218,005,837.67	2.71%	185,305.10	2.74%	-
国泰君安	1	194,362,223.19	2.42%	165,206.75	2.44%	-
安信证券	1	179,116,257.95	2.23%	152,248.60	2.25%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增国信证券股份有限公司一个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		的比例		总额的 比例		
国信证券	91,851,762.60	96.06%	-	-	-	-
广发证券	3,767,611.05	3.94%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浦发银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-06
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海农村商业银行基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-18
3	易方达基金管理有限公司关于易方达沪深 300 指数基金在中国工商银行推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-22
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-29
5	易方达基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-02-03
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在国信证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-02-08
7	易方达基金管理有限公司关于增加瑞银证券为旗下部分开放式基金代销机构、在瑞银证券推出定期定额申购业务及参加瑞银证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-02-25
8	易方达基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金转换业务规则与“E 之道”网上交	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-02

	易费率的公告		
9	易方达基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-04
10	易方达基金管理有限公司关于增加江苏银行为旗下部分开放式基金代销机构及在江苏银行推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-08
11	易方达基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金转换业务规则与“E 之道”网上交易费率的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-10
12	易方达基金管理有限公司关于增加杭州银行为旗下部分开放式基金代销机构、在杭州银行推出定期定额申购业务及参加杭州银行网上银行与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-12
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-01
14	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-21
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-29
16	易方达基金管理有限公司关于旗下基金停牌股票复牌后估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-05
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在国海证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-05
18	易方达基金管理有限公司关于旗下基金持有的中信证券（证券代码：600030）采用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-06
19	易方达基金管理有限公司关于旗下基金停牌股票复牌后估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-07
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金持有的华夏银行（证券代码：600015）采用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-08
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在西南证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-13
22	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-01
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信银行个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-01

24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在申银万国证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-04
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-04
26	易方达基金管理有限公司关于开通兴业银行借记卡网上直销定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-21
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-30
28	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-01
29	易方达基金管理有限公司关于增加中山证券为旗下部分开放式基金代销机构及在中山证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-07
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在信达证券推出定期定额申购业务、参加信达证券非现场委托方式申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-14
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加日信证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-03
32	易方达基金管理有限公司关于增加厦门证券为旗下部分开放式基金代销机构及在厦门证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-05
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-20
34	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加银河证券定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-23
35	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-31
36	易方达基金管理有限公司关于旗下基金持有的中国平安（证券代码：601318）、深发展 A（证券代码：000001）采用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-03
37	易方达基金管理有限公司关于开通建设银行借记卡电话交易认、申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-06
38	易方达基金管理有限公司关于开通民生银	中国证券报、上海证	2010-09-13

	行借记卡基金直销网上交易和电话交易业务的公告	券报、证券时报	
39	易方达基金管理有限公司关于调整中国农业银行借记卡基金直销网上交易和电话交易优惠申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-16
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中投证券推出定期定额申购业务、参加中投证券定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-30
41	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-24
42	易方达基金管理有限公司关于旗下基金持有的工商银行（证券代码：601398）采用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-25
43	易方达基金管理有限公司关于旗下基金持有的双汇发展（证券代码：000895）采用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-03
44	易方达基金管理有限公司关于开通汇付天天盈网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-27
45	易方达基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
46	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2011 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
47	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
49	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2010 年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任本行副行长。

2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010 年 6 月 21 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010 年 7 月 1 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告, 每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

2010 年 9 月 15 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布公告, 张福荣先生担任本行监事长, 谢渡扬先生辞去本行监事、监事长职务。

2010 年 11 月 2 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 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.《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》;
- 3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
- 4.《易方达沪深 300 指数证券投资基金托管协议》;
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照;
- 6.基金托管人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 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

二〇一一年三月三十日