

# 易方达沪深 300 指数证券投资基金

## 2012 年半年度报告

2012 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

送出日期：二〇一二年八月二十四日

## 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。本半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 2012 年 8 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
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.....	11
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	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遵规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3	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.....	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6	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.....	44
7.7	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.....	44
7.8	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.....	44
7.9	投资组合报告附注.....	44
8	基金份额持有人信息.....	45

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
9	开放式基金份额变动.....	46
10	重大事件揭示.....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	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.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	48
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
12	备查文件目录.....	50
12.1	备查文件目录.....	50
12.2	存放地点.....	50
12.3	查阅方式.....	50

## 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	9,655,465,229.38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	020-38797888	010-67595003
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	yindong.zh@ccb.com
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 号城建大厦 25、26、27、28 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	叶俊英	王洪章

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-146,094,803.07
本期利润	305,914,876.89
加权平均基金份额本期利润	0.0326
本期加权平均净值利润率	4.14%
本期基金份额净值增长率	5.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-2,241,696,187.34
期末可供分配基金份额利润	-0.2322
期末基金资产净值	7,413,769,042.04
期末基金份额净值	0.7678
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-23.22%

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。

### 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
过去一个月	-5.27%	1.02%	-6.15%	1.04%	0.88%	-0.02%
过去三个月	1.44%	1.04%	0.28%	1.07%	1.16%	-0.03%
过去六个月	5.54%	1.24%	4.75%	1.26%	0.79%	-0.02%
过去一年	-17.17%	1.26%	-18.16%	1.28%	0.99%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-23.22%	1.32%	-19.56%	1.43%	-3.66%	-0.11%

#### 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 2012 年 6 月 30 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. 本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为-23.22%，同期基金业绩



比较基准收益率为-19.56%。

## 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2012年6月30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、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2012年6月30日,易方达基金管理有限公司共管理1只封闭式基金、33只开放式基金。封闭式基金有科瑞证券投资基金;开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、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证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深300指数证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定

期开放债券型证券投资基金。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		
张胜记	本基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金的基金经理	2011-01-01	-	7年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员。

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、交易流程，以及强化事后分析评估监督机制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。对于一级市场申购等场外交易，

按照公平交易原则完善了相关分配机制。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，本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 6 次，均为 ETF 基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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

2012 年上半年，中国经济数据比较疲软，GDP 增长 7.8%，而二季度仅为 7.6%，为近三年来的新低。从趋势上来看，部分经济先行指标已有企稳回升的迹象，1-5 月份商品房销售面积同比下降 12.4%，降幅明显收窄，6 月份工业增加值、发电量等数据出现环比提升。通胀水平逐月下降，6 月份 CPI 已降至 2.2%，为近 29 个月的新低，环比下降 0.6%，开始出现通缩。流动性方面，热钱净流出趋势明显，而央行政策放松力度在逐渐加大，两次降低存款准备金率、两次降息，6 月末广义货币余额 M2 同比增长 13.6%，连续两个月回升，市场流动性明显改善。同时，财政刺激政策也开始出台，国务院宣布安排 363 亿元财政补贴，促进家电、汽车、节能灯等产品消费。在经济数据下行、政策放松力度加大和流动性改善的背景下，A 股市场出现区间震荡走势，报告期内上证指数上涨 1.18%，估值较高的创业板指数出现下跌。不同行业间的结构性分化加剧，房地产、食品饮料、有色金属等行业走势强劲，整体涨幅达 15% 以上；而基本面较差的信息服务、钢铁、煤炭等板块跌幅居前。

报告期内，沪深 300 指数上涨 4.94%。作为标准型指数基金，本基金跟随指数的成分股变化进行日常调整操作，保证基金组合与指数权重基本一致。

#### 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 0.7678 元，本报告期份额净值增长率为 5.54%，同期基准指数收益率为 4.75%，年化跟踪误差 0.58%，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

大幅波动的主要原因。展望 2012 年下半年，通胀压力基本消失，保持经济增长将成为中央政策的首要目标，预计今后一段时间内“稳增长”措施还会继续推出。尽管目前经济形势仍不乐观，但政策发生作用需要时间，三、四季度经济增长见底回升的概率很大。A 股上市公司的经营业绩也将得到改善，随着货币投放力度的加大，股票市场的流动性状况已经明显改善，目前 A 股市盈率水平处于历史低位，市场趋势开始转好，而不同板块间的结构性分化可能会更加明显。

长期来看，推动我国经济增长的三大原动力依然存在。首先是制度改革，中国继续推进经济、文化、社会等领域的改革空间还比较大，有望释放出更多的生产力；第二是资源、技术与人力资本等生产要素的升级还在持续；最后是我国处于快速的工业化、城市化以及区域经济一体化进程中，中长期经济增长前景良好，本基金对市场的长期走势保持乐观。作为被动投资的基金产品，易方达沪深 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的增长提供良好的投资机会。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	109,585,253.49	153,007,225.91
结算备付金		6,402,241.55	121,536.00
存出保证金		77,500.18	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,463,483,390.33	6,327,054,501.18
其中：股票投资		6,910,918,047.43	5,974,099,444.28
基金投资		-	-
债券投资		552,565,342.90	352,955,056.90
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,685,253.11	1,855,935.88
应收股利		14,174,119.54	-
应收申购款		2,458,392.20	825,784.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,605,866,150.40	6,482,864,983.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		139,999,470.00	-
应付证券清算款		42,861,673.99	41,414,249.14
应付赎回款		2,351,982.91	2,208,320.71
应付管理人报酬		3,205,355.29	2,819,334.79
应付托管费		961,606.60	845,800.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,347,583.96	485,945.38
应交税费		-	-
应付利息		54,515.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,314,920.45	816,352.89
负债合计		192,097,108.36	48,590,003.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	9,655,465,229.38	8,844,591,300.74
未分配利润	6.4.7.10	-2,241,696,187.34	-2,410,316,321.06
所有者权益合计		7,413,769,042.04	6,434,274,979.68
负债和所有者权益总计		7,605,866,150.40	6,482,864,983.04

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7678 元，基金份额总额

9,655,465,229.38 份。

## 6.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>333,867,676.64</b>	<b>-57,634,934.53</b>
1.利息收入		8,596,664.48	7,053,554.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	448,960.34	576,139.76
债券利息收入		8,147,704.14	6,477,415.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-127,559,367.77	67,901,080.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-210,949,056.34	-4,229,908.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,657,407.02	-286,471.58
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	86,047,095.59	72,417,460.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	452,009,679.96	-135,316,399.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	820,699.97	2,726,829.91
<b>减：二、费用</b>		<b>27,952,799.75</b>	<b>38,558,623.28</b>
1. 管理人报酬		18,283,419.87	23,659,695.01
2. 托管费		5,485,026.00	7,097,908.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,996,035.05	6,023,570.93
5. 利息支出		209,205.85	575,107.60
其中：卖出回购金融资产支出		209,205.85	575,107.60
6. 其他费用	6.4.7.19	979,112.98	1,202,341.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		<b>305,914,876.89</b>	<b>-96,193,557.81</b>

号填列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		305,914,876.89	-96,193,557.81

### 6.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	8,844,591,300.74	-2,410,316,321.06	6,434,274,979.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	305,914,876.89	305,914,876.89
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）	810,873,928.64	-137,294,743.17	673,579,185.47
其中：1. 基金申购款	1,878,224,920.19	-364,563,342.16	1,513,661,578.03
2. 基金赎回款	-1,067,350,991.55	227,268,598.99	-840,082,392.56
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）	9,655,465,229.38	-2,241,696,187.34	7,413,769,042.04
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	10,957,507,611.08	-602,514,110.79	10,354,993,500.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-96,193,557.81	-96,193,557.81
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）	-1,815,038,263.39	34,644,922.06	-1,780,393,341.33
其中：1. 基金申购款	860,096,258.75	-42,384,047.38	817,712,211.37



2. 基金赎回款	-2,675,134,522.14	77,028,969.44	-2,598,105,552.70
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）	9,142,469,347.69	-664,062,746.54	8,478,406,601.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：叶俊英，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2012 年 6 月 30 日的

财务状况以及 2012 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 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收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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	109,585,253.49
定期存款	-
其他存款	-
合计	109,585,253.49

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,341,908,623.09	6,910,918,047.43	-1,430,990,575.66
债券	交易所市场	29,618,395.55	29,592,342.90	-26,052.65
	银行间市场	522,894,136.03	522,973,000.00	78,863.97
	合计	552,512,531.58	552,565,342.90	52,811.32
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,894,421,154.67	7,463,483,390.33	-1,430,937,764.34

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	27,380.24
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	2,592.90
应收债券利息	9,655,279.97
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	9,685,253.11

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,344,763.96
银行间市场应付交易费用	2,820.00
合计	1,347,583.96

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,556.96
预提费用	228,741.24
其他应付款	1,083,622.25
合计	1,314,920.45

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,844,591,300.74	8,844,591,300.74
本期申购	1,878,224,920.19	1,878,224,920.19
本期赎回（以“-”号填列）	-1,067,350,991.55	-1,067,350,991.55
本期末	9,655,465,229.38	9,655,465,229.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 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	-42,966,902.11	-2,367,349,418.95	-2,410,316,321.06
本期利润	-146,094,803.07	452,009,679.96	305,914,876.89
本期基金份额交易产生的变动数	-8,563,521.82	-128,731,221.35	-137,294,743.17
其中：基金申购款	-19,509,009.82	-345,054,332.34	-364,563,342.16
基金赎回款	10,945,488.00	216,323,110.99	227,268,598.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-197,625,227.00	-2,044,070,960.34	-2,241,696,187.34

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	415,859.79
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	17,638.42
其他	15,462.13
合计	448,960.34

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	737,406,443.25
减：卖出股票成本总额	948,355,499.59
买卖股票差价收入	-210,949,056.34

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	218,355,503.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	218,278,890.45
减：应收利息总额	2,734,020.35
债券投资收益	-2,657,407.02

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	86,047,095.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	86,047,095.59

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	452,009,679.96
——股票投资	452,076,509.54
——债券投资	-66,829.58
——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	452,009,679.96

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	820,699.97
合计	820,699.97

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	2,993,560.05
银行间市场交易费用	2,475.00
合计	2,996,035.05

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	79,563.12
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	9,634.89
银行间账户维护费	9,000.00
指数使用费	731,336.85
其他费用	400.00
合计	979,112.98

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 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。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	463,335,148.04	21.42%	276,882,134.35	8.14%

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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	383,744.36	20.86%	321,371.04	23.90%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	224,969.31	7.87%	61,055.07	3.32%

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。

该类佣金协议的服务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等。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,283,419.87	23,659,695.01
其中：支付销售机构的客户维护费	3,718,417.04	4,715,090.08

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。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,485,026.00	7,097,908.55

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出



关联方名称						
中国建设银行	-	-	-	-	490,000,000.00	575,107.60

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	156,419,798.25	156,419,798.25
期间申购/买入总份额	-	-
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	156,419,798.25
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	1.62%	1.71%

##### 6.4.10.4.2 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。

##### 6.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	109,585,253.49	415,859.79	181,679,576.86	550,004.93

##### 6.4.10.6 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 2012年1月1日至2012年6月30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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	600518	康美药业	配股发行	637,035	4,382,800.80

广发证券	600005	武钢股份	配股发行	1,557,849	5,764,041.30
------	--------	------	------	-----------	--------------

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未发生利润分配。

**6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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。

**6.4.12.2 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	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000059	辽通化工	2012-06-26	重大事项	7.91	2012-07-03	8.15	893,194	9,044,773.03	7,065,164.54	-
002500	山西证券	2012-05-15	重大事项	8.19	-	-	704,099	6,276,981.04	5,766,570.81	-

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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 139,999,470.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值 总额
1101096	11央行票据96	2012-07-04	96.98	500,000	48,490,000.00
110414	11农发14	2012-07-04	100.18	120,000	12,021,600.00
110020	11付息国债20	2012-07-05	100.37	800,000	80,296,000.00
合计		-	-	1,420,000	140,807,600.00

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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、事中的风险管理和事后的风险评估”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。

##### 6.4.13.2 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。本基金管理人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 2012 年 6 月 30 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 2.30%(2011 年 12 月 31 日: 0.46%)。

##### 6.4.13.2.1 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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
A-1	140,946,200.55	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	391,623,912.57	324,914,890.71
合计	532,570,113.12	324,914,890.71

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。

##### 6.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日
AAA	29,650,509.75	29,871,329.54
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	29,650,509.75	29,871,329.54

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。

#### 6.4.13.3 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 6.4.12 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	109,585,253.49	-	-	-	109,585,253.49
结算备付金	6,402,241.55	-	-	-	6,402,241.55
存出保证金	-	-	-	77,500.18	77,500.18
交易性金融资产	522,973,000.00	29,592,342.90	-	6,910,918,047.43	7,463,483,390.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,685,253.11	9,685,253.11
应收股利	-	-	-	14,174,119.54	14,174,119.54
应收申购款	338,667.54	-	-	2,119,724.66	2,458,392.20
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	639,299,162.58	29,592,342.90	-	6,936,974,644.92	7,605,866,150.40
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	139,999,470.00	-	-	-	139,999,470.00
应付证券清算款	-	-	-	42,861,673.99	42,861,673.99
应付赎回款	-	-	-	2,351,982.91	2,351,982.91
应付管理人报酬	-	-	-	3,205,355.29	3,205,355.29
应付托管费	-	-	-	961,606.60	961,606.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,347,583.96	1,347,583.96
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	54,515.16	54,515.16
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,314,920.45	1,314,920.45
负债总计	139,999,470.00	-	-	52,097,638.36	192,097,108.36
利率敏感度缺口	499,299,692.58	29,592,342.90	-	6,884,877,006.56	7,413,769,042.04
上年度末2011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	153,007,225.91	-	-	-	153,007,225.91
结算备付金	121,536.00	-	-	-	121,536.00

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	323,185,000.00	-	29,770,056.90	5,974,099,444.28	6,327,054,501.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,855,935.88	1,855,935.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	60,423.24	-	-	765,360.83	825,784.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	476,374,185.15	-	29,770,056.90	5,976,720,740.99	6,482,864,983.04
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	-	-	-	41,414,249.14	41,414,249.14
应付赎回款	-	-	-	2,208,320.71	2,208,320.71
应付管理人报酬	-	-	-	2,819,334.79	2,819,334.79
应付托管费	-	-	-	845,800.45	845,800.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	485,945.38	485,945.38
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	816,352.89	816,352.89
负债总计	-	-	-	48,590,003.36	48,590,003.36
利率敏感度缺口	476,374,185.15	-	29,770,056.90	5,928,130,737.	6,434,274,979.

				63	68
--	--	--	--	----	----

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	637,611.24	454,076.99
2. 市场利率上升25个基点	-635,668.33	-452,900.82	

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人采用 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011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	6,910,918,047.43	93.22	5,974,099,444.28	92.85
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,910,918,047.43	93.22	5,974,099,444.28	92.85

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准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	上年度末
		2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升5%	365,747,398.99	316,156,593.16
2. 业绩比较基准下降5%	-365,747,398.99	-316,156,593.16	

**6.4.14 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

## (i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

## (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 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 6,927,678,654.98 元，第二层级的余额为 535,804,735.35 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 5,991,541,629.14 元，第二层级的余额为 335,512,872.04 元，无属于第三层级的余额)。

(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。

**7 投资组合报告****7.1 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	6,910,918,047.43	90.86
	其中：股票	6,910,918,047.43	90.86
2	固定收益投资	552,565,342.90	7.26
	其中：债券	552,565,342.90	7.26
	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	115,987,495.04	1.52
6	其他各项资产	26,395,265.03	0.35
7	合计	7,605,866,150.40	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	43,399,027.74	0.59
B	采掘业	690,430,579.79	9.31
C	制造业	2,352,264,979.16	31.73
C0	食品、饮料	497,318,085.55	6.71
C1	纺织、服装、皮毛	19,892,379.72	0.27
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	127,110,331.32	1.71
C5	电子	79,418,575.75	1.07
C6	金属、非金属	552,348,832.83	7.45
C7	机械、设备、仪表	743,842,887.62	10.03
C8	医药、生物制品	330,085,714.51	4.45
C99	其他制造业	2,248,171.86	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	149,736,228.36	2.02
E	建筑业	191,004,340.15	2.58
F	交通运输、仓储业	197,977,199.58	2.67
G	信息技术业	203,300,817.24	2.74
H	批发和零售贸易	179,527,142.46	2.42
I	金融、保险业	2,151,605,815.36	29.02
J	房地产业	375,630,342.83	5.07
K	社会服务业	60,288,202.38	0.81

L	传播与文化产业	14,274,432.74	0.19
M	综合类	111,620,030.85	1.51
	合计	6,721,059,138.64	90.66

### 7.2.2 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	10,284,134.00	0.14
C	制造业	75,238,028.50	1.01
C0	食品、饮料	1,987,575.85	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	5,576,544.75	0.08
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,630,739.28	0.28
C5	电子	33,066,797.58	0.45
C6	金属、非金属	5,718,897.64	0.08
C7	机械、设备、仪表	8,257,473.40	0.11
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	23,470,131.00	0.32
E	建筑业	33,012,517.10	0.45
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	10,057,541.91	0.14
I	金融、保险业	23,142,870.08	0.31
J	房地产业	7,073,328.00	0.10
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	7,580,358.20	0.10
M	综合类	-	-
	合计	189,858,908.79	2.56

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	4,835,611	221,180,847.14	2.98

2	600036	招商银行	18,913,457	206,534,950.44	2.79
3	600016	民生银行	32,397,708	194,062,270.92	2.62
4	601328	交通银行	33,253,525	150,971,003.50	2.04
5	600519	贵州茅台	595,682	142,457,350.30	1.92
6	601166	兴业银行	10,829,751	140,570,167.98	1.90
7	600030	中信证券	10,687,008	134,976,911.04	1.82
8	600000	浦发银行	16,052,897	130,510,052.61	1.76
9	600837	海通证券	12,918,903	124,409,035.89	1.68
10	000002	万科 A	13,884,555	123,711,385.05	1.67
11	601398	工商银行	27,618,205	109,091,909.75	1.47
12	601088	中国神华	4,730,618	106,344,292.64	1.43
13	601601	中国太保	4,508,870	100,006,736.60	1.35
14	000858	五粮液	2,722,246	89,180,778.96	1.20
15	601288	农业银行	33,576,796	86,963,901.64	1.17
16	600111	包钢稀土	2,084,453	82,252,515.38	1.11
17	601668	中国建筑	21,514,700	71,859,098.00	0.97
18	600048	保利地产	6,142,803	69,659,386.02	0.94
19	000157	中联重科	6,301,182	63,200,855.46	0.85
20	000651	格力电器	3,020,195	62,971,065.75	0.85
21	601169	北京银行	6,311,045	61,658,909.65	0.83
22	600031	三一重工	4,374,969	60,899,568.48	0.82
23	601006	大秦铁路	8,530,077	59,966,441.31	0.81
24	000001	深发展 A	3,674,267	55,701,887.72	0.75
25	002024	苏宁电器	6,020,861	50,515,023.79	0.68
26	601818	光大银行	17,398,851	49,412,736.84	0.67
27	600900	长江电力	7,099,845	48,278,946.00	0.65
28	600887	伊利股份	2,293,103	47,192,059.74	0.64
29	600015	华夏银行	4,912,226	46,518,780.22	0.63
30	601857	中国石油	5,026,354	45,488,503.70	0.61
31	600050	中国联通	12,161,939	45,242,413.08	0.61
32	600104	上汽集团	3,162,720	45,195,268.80	0.61
33	600999	招商证券	3,830,566	44,472,871.26	0.60
34	601899	紫金矿业	11,335,752	43,982,717.76	0.59
35	000568	泸州老窖	1,006,245	42,574,225.95	0.57
36	600585	海螺水泥	2,869,075	42,519,691.50	0.57
37	600383	金地集团	6,413,998	41,562,707.04	0.56
38	600256	广汇能源	3,015,746	40,622,098.62	0.55
39	000063	中兴通讯	2,821,964	39,394,617.44	0.53
40	601628	中国人寿	2,151,645	39,375,103.50	0.53
41	002304	洋河股份	290,368	39,069,014.40	0.53
42	000983	西山煤电	2,259,860	35,253,816.00	0.48

43	601688	华泰证券	3,333,732	35,004,186.00	0.47
44	600518	康美药业	2,207,498	34,039,619.16	0.46
45	600547	山东黄金	1,020,480	33,512,563.20	0.45
46	000069	华侨城 A	5,215,194	33,272,937.72	0.45
47	601989	中国重工	6,311,453	32,756,441.07	0.44
48	600019	宝钢股份	7,535,305	32,552,517.60	0.44
49	000338	潍柴动力	1,085,372	32,224,694.68	0.43
50	000527	美的电器	2,912,700	32,185,335.00	0.43
51	000792	盐湖股份	912,513	30,815,564.01	0.42
52	600739	辽宁成大	1,957,331	30,534,363.60	0.41
53	600489	中金黄金	1,412,973	30,407,178.96	0.41
54	000423	东阿阿胶	750,475	30,026,504.75	0.41
55	600795	国电电力	11,040,465	29,809,255.50	0.40
56	600362	江西铜业	1,190,705	28,469,756.55	0.38
57	601988	中国银行	9,755,741	27,511,189.62	0.37
58	601699	潞安环能	1,320,139	27,379,682.86	0.37
59	000538	云南白药	459,898	27,262,753.44	0.37
60	000629	攀钢钒钛	4,136,200	27,216,196.00	0.37
61	600690	青岛海尔	2,310,928	27,084,076.16	0.37
62	000895	双汇发展	434,531	26,888,778.28	0.36
63	600348	阳泉煤业	1,724,723	26,388,261.90	0.36
64	601788	光大证券	1,960,955	25,825,777.35	0.35
65	600089	特变电工	3,780,162	25,591,696.74	0.35
66	600276	恒瑞医药	886,903	25,462,985.13	0.34
67	601600	中国铝业	4,122,734	25,437,268.78	0.34
68	601009	南京银行	2,981,026	25,398,341.52	0.34
69	600406	国电南瑞	1,355,965	25,342,985.85	0.34
70	000024	招商地产	988,290	24,242,753.70	0.33
71	600028	中国石化	3,818,600	24,057,180.00	0.32
72	601299	中国北车	5,920,875	23,742,708.75	0.32
73	601168	西部矿业	2,734,354	23,406,070.24	0.32
74	601766	中国南车	5,068,419	23,111,990.64	0.31
75	000100	TCL 集团	11,214,780	22,766,003.40	0.31
76	000402	金融街	3,473,368	22,681,093.04	0.31
77	000425	徐工机械	1,536,088	22,027,501.92	0.30
78	000783	长江证券	2,380,911	21,666,290.10	0.29
79	600309	烟台万华	1,550,784	20,702,966.40	0.28
80	601898	中煤能源	2,625,320	20,319,976.80	0.27
81	000630	铜陵有色	1,019,414	19,674,690.20	0.27
82	601186	中国铁建	4,415,701	19,649,869.45	0.27
83	600029	南方航空	4,255,000	19,615,550.00	0.26

84	600068	葛洲坝	3,001,214	19,597,927.42	0.26
85	600600	青岛啤酒	511,433	19,531,626.27	0.26
86	600100	同方股份	2,280,696	19,203,460.32	0.26
87	601111	中国国航	3,106,467	19,104,772.05	0.26
88	601390	中国中铁	7,385,004	18,979,460.28	0.26
89	600642	申能股份	4,069,813	18,761,837.93	0.25
90	600535	天士力	417,227	18,241,164.44	0.25
91	000878	云南铜业	1,015,764	18,182,175.60	0.25
92	600150	中国船舶	790,656	18,161,368.32	0.24
93	600010	包钢股份	3,685,675	17,986,094.00	0.24
94	000060	中金岭南	2,071,137	17,853,200.94	0.24
95	000623	吉林敖东	1,026,261	17,795,365.74	0.24
96	600123	兰花科创	983,162	17,755,905.72	0.24
97	600009	上海机场	1,390,523	17,715,263.02	0.24
98	601958	金铂股份	1,388,485	17,592,104.95	0.24
99	600369	西南证券	1,536,143	17,373,777.33	0.23
100	601618	中国中冶	6,987,459	17,328,898.32	0.23
101	600549	厦门钨业	391,501	17,190,808.91	0.23
102	601666	平煤股份	1,693,289	17,136,084.68	0.23
103	000709	河北钢铁	6,269,975	17,117,031.75	0.23
104	600875	东方电气	954,614	17,106,682.88	0.23
105	600583	海油工程	2,789,332	16,987,031.88	0.23
106	000012	南玻 A	1,882,873	16,945,857.00	0.23
107	600196	复星医药	1,638,901	16,897,069.31	0.23
108	002142	宁波银行	1,654,518	16,512,089.64	0.22
109	000039	中集集团	1,236,950	16,451,435.00	0.22
110	601117	中国化学	2,830,100	16,329,677.00	0.22
111	600085	同仁堂	933,802	16,294,844.90	0.22
112	600177	雅戈尔	1,916,228	16,268,775.72	0.22
113	601991	大唐发电	2,869,275	16,154,018.25	0.22
114	600188	兖州煤业	849,100	16,115,918.00	0.22
115	002422	科伦药业	344,164	16,058,692.24	0.22
116	601377	兴业证券	1,528,791	16,021,729.68	0.22
117	600660	福耀玻璃	2,041,764	15,966,594.48	0.22
118	601998	中信银行	3,948,696	15,794,784.00	0.21
119	600143	金发科技	2,645,144	15,791,509.68	0.21
120	000009	中国宝安	1,564,427	15,644,270.00	0.21
121	002415	海康威视	573,678	15,604,041.60	0.21
122	600005	武钢股份	5,791,079	15,578,002.51	0.21
123	000581	威孚高科	567,465	15,548,541.00	0.21
124	000728	国元证券	1,408,544	15,367,215.04	0.21

125	600066	宇通客车	680,610	15,286,500.60	0.21
126	601919	中国远洋	3,285,747	15,245,866.08	0.21
127	600415	小商品城	1,951,762	15,223,743.60	0.21
128	000937	冀中能源	995,249	15,197,452.23	0.20
129	600271	航天信息	794,553	15,024,997.23	0.20
130	002155	辰州矿业	774,527	14,994,842.72	0.20
131	600881	亚泰集团	2,717,603	14,946,816.50	0.20
132	600166	福田汽车	2,041,820	14,599,013.00	0.20
133	600376	首开股份	1,071,829	14,191,015.96	0.19
134	600115	东方航空	3,390,704	14,173,142.72	0.19
135	002202	金风科技	2,203,471	14,124,249.11	0.19
136	601808	中海油服	854,157	14,102,132.07	0.19
137	600694	大商股份	421,258	14,091,080.10	0.19
138	600809	山西汾酒	372,588	14,042,841.72	0.19
139	000768	西飞国际	1,776,954	13,949,088.90	0.19
140	000562	宏源证券	838,280	13,865,151.20	0.19
141	600153	建发股份	1,925,757	13,788,420.12	0.19
142	600058	五矿发展	614,943	13,731,677.19	0.19
143	601607	上海医药	1,271,309	13,564,867.03	0.18
144	600252	中恒集团	1,230,535	13,486,663.60	0.18
145	000933	神火股份	1,463,957	13,351,287.84	0.18
146	600741	华域汽车	1,482,113	13,294,553.61	0.18
147	000528	柳工	1,070,472	13,284,557.52	0.18
148	600497	驰宏锌锗	939,499	13,218,750.93	0.18
149	000625	长安汽车	2,708,194	13,215,986.72	0.18
150	000729	燕京啤酒	1,809,068	13,206,196.40	0.18
151	000869	张裕 A	194,988	13,114,892.88	0.18
152	601717	郑煤机	1,128,408	13,089,532.80	0.18
153	600655	豫园商城	1,649,343	12,996,822.84	0.18
154	000800	一汽轿车	1,181,801	12,834,358.86	0.17
155	000960	锡业股份	650,114	12,807,245.80	0.17
156	600395	盘江股份	474,764	12,761,656.32	0.17
157	000422	湖北宣化	1,030,179	12,619,692.75	0.17
158	600703	三安光电	919,832	12,518,913.52	0.17
159	000758	中色股份	659,753	12,515,514.41	0.17
160	600832	东方明珠	2,294,443	12,321,158.91	0.17
161	000999	华润三九	561,626	12,271,528.10	0.17
162	601018	宁波港	4,813,300	12,177,649.00	0.16
163	002106	莱宝高科	602,755	12,097,292.85	0.16
164	601333	广深铁路	4,053,766	11,918,072.04	0.16
165	600779	水井坊	490,451	11,903,245.77	0.16

166	600649	城投控股	1,648,094	11,899,238.68	0.16
167	601106	中国一重	3,751,235	11,853,902.60	0.16
168	600267	海正药业	677,715	11,846,458.20	0.16
169	600259	广晟有色	178,881	11,793,624.33	0.16
170	000825	太钢不锈	3,268,341	11,537,243.73	0.16
171	600804	鹏博士	1,919,898	11,404,194.12	0.15
172	000876	新希望	747,716	11,200,785.68	0.15
173	000401	冀东水泥	795,654	11,186,895.24	0.15
174	600839	四川长虹	5,297,228	11,177,151.08	0.15
175	600219	南山铝业	1,664,540	11,152,418.00	0.15
176	002385	大北农	574,818	11,151,469.20	0.15
177	600125	铁龙物流	1,310,685	11,114,608.80	0.15
178	600208	新湖中宝	2,672,388	11,036,962.44	0.15
179	002001	新和成	520,663	11,001,609.19	0.15
180	600588	用友软件	702,135	10,714,580.10	0.14
181	600320	振华重工	2,533,198	10,690,095.56	0.14
182	601888	中国国旅	378,653	10,685,587.66	0.14
183	002038	双鹭药业	327,516	10,546,015.20	0.14
184	601001	大同煤业	960,327	10,515,580.65	0.14
185	600811	东方集团	1,912,513	10,480,571.24	0.14
186	000898	鞍钢股份	2,679,151	10,448,688.90	0.14
187	600372	中航电子	565,714	10,177,194.86	0.14
188	600893	航空动力	781,356	10,165,441.56	0.14
189	002007	华兰生物	413,218	10,156,898.44	0.14
190	002310	东方园林	172,887	10,150,195.77	0.14
191	002092	中泰化学	1,324,528	10,132,639.20	0.14
192	601118	海南橡胶	1,463,685	10,055,515.95	0.14
193	600718	东软集团	1,167,272	10,050,211.92	0.14
194	601179	中国西电	2,499,900	9,949,602.00	0.13
195	601101	昊华能源	573,680	9,821,401.60	0.13
196	600216	浙江医药	389,715	9,801,332.25	0.13
197	600674	川投能源	1,414,634	9,789,267.28	0.13
198	601918	国投新集	796,212	9,721,748.52	0.13
199	600108	亚盛集团	1,966,208	9,693,405.44	0.13
200	600266	北京城建	637,684	9,686,419.96	0.13
201	600331	宏达股份	1,184,184	9,520,839.36	0.13
202	600895	张江高科	1,110,548	9,517,396.36	0.13
203	000718	苏宁环球	1,172,321	9,495,800.10	0.13
204	600062	华润双鹤	492,062	9,388,542.96	0.13
205	600997	开滦股份	885,419	9,270,336.93	0.13
206	000778	新兴铸管	1,375,716	9,203,540.04	0.12

207	000061	农产品	1,584,542	9,190,343.60	0.12
208	600664	哈药股份	1,392,389	9,175,843.51	0.12
209	000969	安泰科技	742,445	9,080,102.35	0.12
210	600859	王府井	331,839	9,079,115.04	0.12
211	000839	中信国安	1,349,292	9,067,242.24	0.12
212	600132	重庆啤酒	416,600	8,994,394.00	0.12
213	600863	内蒙华电	1,124,476	8,883,360.40	0.12
214	002146	荣盛发展	801,901	8,740,720.90	0.12
215	601866	中海集运	3,427,120	8,670,613.60	0.12
216	600550	天威保变	984,602	8,595,575.46	0.12
217	002069	獐子岛	407,894	8,504,589.90	0.11
218	600352	浙江龙盛	1,474,321	8,447,859.33	0.11
219	600498	烽火通信	317,427	8,414,989.77	0.11
220	600971	恒源煤电	600,636	8,366,859.48	0.11
221	600118	中国卫星	657,303	8,275,444.77	0.11
222	600221	海南航空	1,695,742	8,275,220.96	0.11
223	600160	巨化股份	812,932	8,210,613.20	0.11
224	601558	华锐风电	1,158,056	8,117,972.56	0.11
225	601158	重庆水务	1,376,900	8,109,941.00	0.11
226	600169	太原重工	2,304,326	8,088,184.26	0.11
227	600316	洪都航空	617,092	8,040,708.76	0.11
228	600516	方大炭素	917,212	7,832,990.48	0.11
229	000807	云铝股份	1,324,619	7,802,005.91	0.11
230	601933	永辉超市	286,392	7,761,223.20	0.10
231	000680	山推股份	1,322,808	7,738,426.80	0.10
232	601992	金隅股份	1,162,891	7,733,225.15	0.10
233	600432	吉恩镍业	581,650	7,724,312.00	0.10
234	600598	北大荒	1,019,965	7,598,739.25	0.10
235	002299	圣农发展	522,630	7,546,777.20	0.10
236	600812	华北制药	1,185,197	7,537,852.92	0.10
237	600508	上海能源	414,651	7,517,622.63	0.10
238	002128	露天煤业	570,821	7,466,338.68	0.10
239	600109	国金证券	516,629	7,434,291.31	0.10
240	601098	中南传媒	772,769	7,403,127.02	0.10
241	600770	综艺股份	633,690	7,274,761.20	0.10
242	600970	中材国际	627,208	7,237,980.32	0.10
243	600170	上海建工	995,110	7,184,694.20	0.10
244	002073	软控股份	851,883	7,138,779.54	0.10
245	600528	中铁二局	1,046,450	7,074,002.00	0.10
246	000059	辽通化工	893,194	7,065,164.54	0.10
247	600418	江淮汽车	1,293,900	6,999,999.00	0.09



248	600500	中化国际	1,031,000	6,969,560.00	0.09
249	600037	歌华有线	912,524	6,871,305.72	0.09
250	600873	梅花集团	1,008,952	6,810,426.00	0.09
251	601369	陕鼓动力	705,048	6,528,744.48	0.09
252	000686	东北证券	366,729	6,285,735.06	0.08
253	002344	海宁皮城	240,886	6,282,306.88	0.08
254	000961	中南建设	502,460	6,260,651.60	0.08
255	000780	平庄能源	581,905	6,098,364.40	0.08
256	600595	中孚实业	1,086,390	6,062,056.20	0.08
257	600546	山煤国际	285,453	5,971,676.76	0.08
258	600456	宝钛股份	308,499	5,790,526.23	0.08
259	002500	山西证券	704,099	5,766,570.81	0.08
260	000559	万向钱潮	1,142,556	5,747,056.68	0.08
261	002431	棕榈园林	220,301	5,681,562.79	0.08
262	000968	煤气化	368,400	5,618,100.00	0.08
263	002122	天马股份	851,910	5,503,338.60	0.07
264	601099	太平洋	776,900	5,360,610.00	0.07
265	600183	生益科技	1,020,422	5,255,173.30	0.07
266	601718	际华集团	1,659,757	5,244,832.12	0.07
267	002405	四维图新	430,743	5,143,071.42	0.07
268	600096	云天化	385,840	5,116,238.40	0.07
269	600783	鲁信创投	320,250	5,111,190.00	0.07
270	000021	长城开发	946,069	5,089,851.22	0.07
271	002493	荣盛石化	318,897	4,888,691.01	0.07
272	002399	海普瑞	229,521	4,865,845.20	0.07
273	601258	庞大集团	752,001	4,587,206.10	0.06
274	002603	以岭药业	158,376	4,363,258.80	0.06
275	600307	酒钢宏兴	1,173,752	4,072,919.44	0.05
276	002378	章源钨业	122,830	3,888,797.80	0.05
277	601233	桐昆股份	414,600	3,623,604.00	0.05
278	601216	内蒙君正	476,240	3,319,392.80	0.04
279	601268	二重重装	484,801	2,971,830.13	0.04
280	002594	比亚迪	113,201	2,248,171.86	0.03

## 7.3.2 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	600011	华能国际	3,638,780	23,470,131.00	0.32
2	601669	中国水电	4,432,830	19,371,467.10	0.26
3	000725	京东方 A	9,839,040	18,792,566.40	0.25

4	002241	歌尔声学	391,182	14,274,231.18	0.19
5	600315	上海家化	363,308	14,172,645.08	0.19
6	002081	金螳螂	358,975	13,641,050.00	0.18
7	601901	方正证券	2,113,301	10,735,569.08	0.14
8	002353	杰瑞股份	212,044	10,284,134.00	0.14
9	600827	友谊股份	889,261	10,057,541.91	0.14
10	601633	长城汽车	463,903	8,257,473.40	0.11
11	601928	凤凰传媒	881,437	7,580,358.20	0.10
12	000046	泛海建设	1,582,400	7,073,328.00	0.10
13	000703	恒逸石化	388,340	6,458,094.20	0.09
14	601336	新华保险	183,084	6,268,796.16	0.08
15	601555	东吴证券	694,401	6,138,504.84	0.08
16	600022	山东钢铁	2,225,252	5,718,897.64	0.08
17	601566	九牧王	200,235	5,576,544.75	0.08
18	002570	贝因美	98,639	1,987,575.85	0.03

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600036	招商银行	36,423,732.29	0.57
2	601288	农业银行	30,436,982.39	0.47
3	600016	民生银行	29,228,786.82	0.45
4	601318	中国平安	27,147,521.22	0.42
5	601398	工商银行	24,425,988.68	0.38
6	600011	华能国际	23,858,510.67	0.37
7	601328	交通银行	23,371,000.98	0.36
8	600030	中信证券	21,082,556.49	0.33
9	601166	兴业银行	20,708,103.51	0.32
10	600000	浦发银行	20,274,983.83	0.32
11	601669	中国水电	19,477,949.41	0.30
12	600519	贵州茅台	19,272,206.60	0.30
13	000725	京东方 A	18,416,684.50	0.29
14	600837	海通证券	17,600,200.77	0.27
15	601088	中国神华	17,544,962.79	0.27
16	000002	万科 A	16,555,853.33	0.26
17	600015	华夏银行	15,668,269.57	0.24
18	600252	中恒集团	14,663,021.87	0.23

19	000157	中联重科	14,112,178.88	0.22
20	600315	上海家化	14,023,611.48	0.22

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601398	工商银行	45,797,786.04	0.71
2	600016	民生银行	18,084,390.76	0.28
3	601318	中国平安	16,771,266.36	0.26
4	601727	上海电气	15,178,139.95	0.24
5	600519	贵州茅台	13,858,105.57	0.22
6	601166	兴业银行	12,903,394.20	0.20
7	600036	招商银行	12,521,288.24	0.19
8	600000	浦发银行	12,469,588.52	0.19
9	600030	中信证券	11,494,923.40	0.18
10	000002	万科A	11,069,831.02	0.17
11	601088	中国神华	10,633,499.39	0.17
12	600635	大众公用	9,841,557.53	0.15
13	600582	天地科技	9,827,219.45	0.15
14	600252	中恒集团	8,928,960.63	0.14
15	000027	深圳能源	8,586,255.05	0.13
16	600008	首创股份	8,527,917.76	0.13
17	600808	马钢股份	8,394,109.91	0.13
18	600837	海通证券	8,361,745.15	0.13
19	601601	中国太保	8,302,692.28	0.13
20	000858	五粮液	8,206,377.69	0.13

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。

#### 7.4.3 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	1,433,097,593.20
卖出股票收入（成交）总额	737,406,443.25

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。

#### 7.5 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	100,370,000.00	1.35
2	央行票据	252,101,000.00	3.40
3	金融债券	30,054,000.00	0.41
	其中：政策性金融债	30,054,000.00	0.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	140,448,000.00	1.89
6	中期票据	-	-
7	可转债	29,592,342.90	0.40
8	其他	-	-
9	合计	552,565,342.90	7.45

#### 7.6 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	1101094	11 央行票据 94	2,000,000	193,920,000.00	2.62
2	041251015	12 铁道 CP001	1,400,000	140,448,000.00	1.89
3	110020	11 付息国债 20	1,000,000	100,370,000.00	1.35
4	1101096	11 央行票据 96	500,000	48,490,000.00	0.65
5	110414	11 农发 14	300,000	30,054,000.00	0.41

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	77,500.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	14,174,119.54
4	应收利息	9,685,253.11
5	应收申购款	2,458,392.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,395,265.03

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	29,592,342.90	0.40

#### 7.9.5.1 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。

#### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
209,106	46,174.98	2,127,251,415.52	22.03%	7,528,213,813.86	77.97%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	683,516.09	0.0071%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 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	8,844,591,300.74
本报告期基金总申购份额	1,878,224,920.19
减：本报告期基金总赎回份额	1,067,350,991.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	9,655,465,229.38

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

基金管理人于 2012 年 3 月 3 日发布了《易方达基金管理有限公司高管人员变更公告》，经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]266 号文核准批复，自 2012 年 3 月 1 日起基金管理人聘任肖坚先生、陈志民先生担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
中信建投	2	872,499,162.85	40.34%	752,697.96	40.91%	-
中投证券	1	82,688,066.91	3.82%	67,184.88	3.65%	-
广发证券	1	463,335,148.04	21.42%	383,744.36	20.86%	-
兴业证券	1	258,506,260.85	11.95%	219,733.20	11.94%	-
国海证券	1	315,933,377.21	14.61%	271,813.76	14.77%	-
国信证券	1	170,087,408.85	7.86%	144,574.15	7.86%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

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服务；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。

### 10.7.2 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的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	6,288,000.00	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-05
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加财富里昂证券为代销机构及在财富里昂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	2012-01-19
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安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	2012-01-20



4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信证券（浙江）为代销机构及在中信证券（浙江）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	2012-02-16
5	易方达基金管理有限公司关于延长中国工商银行借记卡基金网上直销申购费率优惠期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-29
6	易方达基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-03
7	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	2012-03-31
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国泰君安证券自助式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	2012-04-09
9	易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-16
10	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	2012-04-27
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东吴证券网上交易系统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	2012-05-04
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在渤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	2012-05-21
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华融证券网上交易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	2012-05-29
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信万通证券为代销机构及在中信万通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	2012-06-11
15	易方达基金管理有限公司关于开通机构投资者网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-11
16	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	2012-06-29
17	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	2012-06-29

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 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  
二〇一二年八月二十四日