

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券 投资基金

2013 年半年度报告

2013 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：二〇一三年八月二十八日

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 2013 年 8 月 21 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 2013 年 3 月 6 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.....	6
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合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
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.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	47
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.10 投资组合报告附注.....	47

8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	48
9 开放式基金份额变动.....	49
10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
11 备查文件目录.....	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金简称	易方达沪深300ETF发起式
基金主代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	交易型开放式（ETF）、发起式
基金合同生效日	2013年3月6日
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	1,213,866,852份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月25日

2.2 基金产品说明

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

	的市场组合相似的风险收益特征。
--	-----------------

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	田青
	联系电话	020-38797888	010-67595096
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-38799488	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中 路 3 号 4004-8 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江 东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼	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	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上 海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 中国保险大厦 36 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（2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日）
---------------	---

本期已实现收益	10,143,207.86
本期利润	-135,783,341.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1165
本期加权平均净值利润率	-11.94%
本期基金份额净值增长率	-13.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-159,301,516.99
期末可供分配基金份额利润	-0.1312
期末基金资产净值	1,054,565,335.01
期末基金份额净值	0.8688
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.12%

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 2013 年 3 月 6 日生效，合同生效当期的相关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

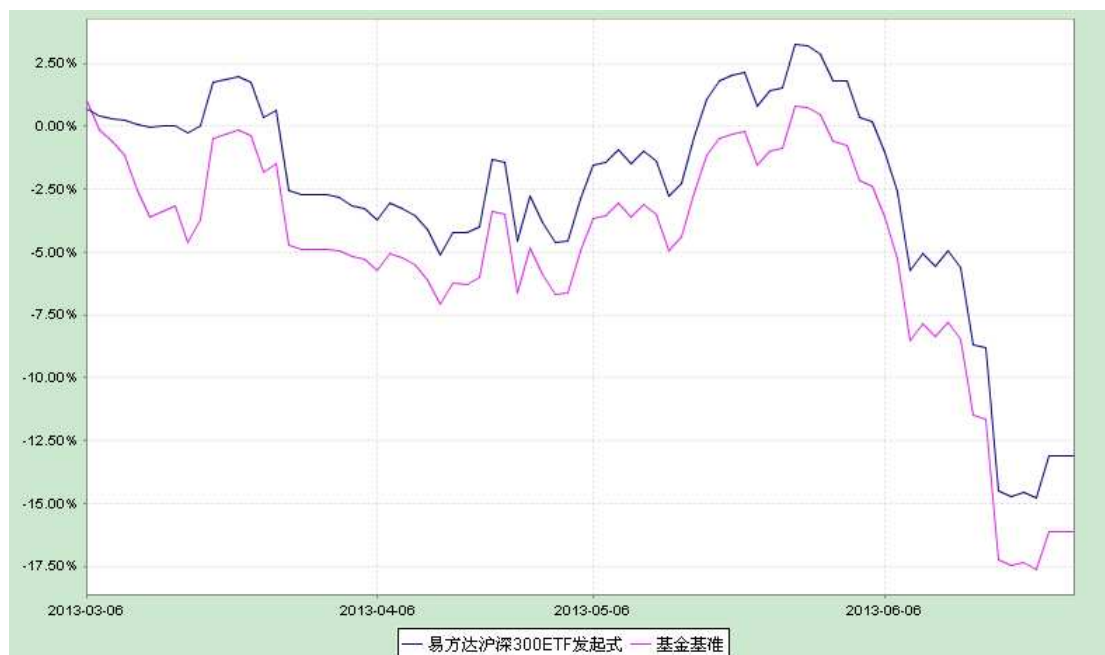
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-14.66%	1.86%	-15.57%	1.86%	0.91%	0.00%
过去三个月	-10.71%	1.44%	-11.80%	1.45%	1.09%	-0.01%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-13.12%	1.33%	-16.10%	1.41%	2.98%	-0.08%

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 交易型开放式指数发起式证券投资基金

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

(2013 年 3 月 6 日至 2013 年 6 月 30 日)



注：1. 本基金合同于 2013 年 3 月 6 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 基金合同中关于基金投资比例的约定：

(1) 本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；

(2) 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%；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%；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%；法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(4) 本基金参与股票发行申购，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；

(5) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的 100%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

(6) 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%；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%；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%；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%；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；

(7) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制；

(8) 作为完全复制指数的证券投资基金，本基金不受、不计入《证券投资基金运作管理办法》第三十一条的下列限制：①一只基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；②同一基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

(9) 因证券及期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整或成份股市场价格变化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。法律法规另有规定的，从其规定。

3. 本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4. 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-13.12%，同期业绩比较基准收益率为-16.10%。

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 2013 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 2013 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、44 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

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、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）、易方达月月利理财债券型证券投资基金、易方达双月利理财债券型证券投资基金、易方达天天理财货币市场基金、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金、易方达保证金收益货币市场基金、易方达信用债债券型证券投资基金、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金。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		
林飞	本基金的基金经理、易方达50指数证券投资基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方	2013-03-06	-	10年	博士研究生，曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深300指数证券投资基金的基金经理。

	达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理				
林伟斌	本基金的基金经理	2013-03-06	-	5年	博士研究生，曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼指数量化研究员。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 4 次，为纯被动指数基金或量化组合因投资策略需要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

2013 年上半年，中国经济复苏步伐出现了一定程度的放缓。新一届政府采取相对稳健的货币政策，着手规范“影子银行”及社会存量资金期限错配问题，尤其在二季度末流动性供给明显收紧。在企业盈利水平较弱和市场流动性相对紧张的双重压力下，上证指数上半年跌幅达 12.78%，而且创出近四年来的新低。市场结构分化进一步加剧，沪深 300 指数下跌 12.78%，中小板指数上涨 5.19%，创业板指数则大涨 41.72%。从行业表现来看，电子、信息服务、信息设备等科技类行业指数出现大幅上涨，医药、消费等行业表现稳定，煤炭、有色、钢铁等资源类行业则大幅下跌。

本基金于 2013 年 3 月 6 日正式成立，并于 3 月 25 日在上海证券交易所上市交易暨开放日常申购赎回。作为被动型指数基金，报告期内，本基金按照完全复制法紧密跟踪沪深 300 指数，取得与标的指数基本一致的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8688 元，本报告期份额净值增长率为-13.12%，同期业绩比较基准收益率为-16.10%，日跟踪偏离度的均值为 0.13%，日跟踪误差为 0.34%，年化跟踪误差 5.193%。因本报告期包含了本基金合同规定的建仓期，故跟踪误差等指标仍在调整之中，本基金建仓期结束之后的跟踪误差等指标已在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济仍将处于相对缓慢的复苏阶段。短期的经济增速下降和企业盈利下滑是中国经济结构转型所付出的代价，当前 A 股市场充分反映了短期内的中国经济状况。预计下一阶段的宏观政策将在稳增长、保就业的“下限”和防通胀的“上限”之间动态平衡，当经济运行保持在合理区间内，则以调结构为主要着力点。从长期看，新一届政府推动“城镇化”以维持相对高水平的劳动力供给和资本投入、通过产业转型升级以提高全要素生产率是中国经济可持续增长的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。目前，以沪深 300 指数为代表的高股息率、业绩稳定的蓝筹股板块估

值已经处于历史底部，中长期投资价值已经显现。

作为被动投资的基金，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场蓝筹股长期成长提供良好的投资工具。

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合规守信、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 交易型开放式指数发起式证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	8,860,402.27
结算备付金		390,215.85
存出保证金		681,583.45
交易性金融资产	6.4.7.2	1,042,110,424.24
其中：股票投资		1,042,110,424.24
基金投资		-
债券投资		-
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		528,253.49
应收利息	6.4.7.5	2,335.15
应收股利		3,341,925.86
应收申购款		-
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	63,594.54
资产总计		1,055,978,734.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日
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		-
应付证券清算款		369,488.05
应付赎回款		-
应付管理人报酬		476,825.91
应付托管费		95,365.16
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.7.7.7	72,404.06
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	399,316.66
负债合计		1,413,399.84
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,213,866,852.00
未分配利润	6.4.7.10	-159,301,516.99
所有者权益合计		1,054,565,335.01
负债和所有者权益总计		1,055,978,734.85

注: 1. 本基金合同生效日为 2013 年 3 月 6 日, 本报告期实际报告期间为 2013 年 3 月 6 日至 2013 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2013 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.8688 元, 基金份额总额 1,213,866,852.00 份。

6.2 利润表

会计主体: 易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期: 2013 年 3 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 3 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-131,864,501.66

1.利息收入		1,058,700.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,058,582.85
债券利息收入		117.57
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）		11,879,033.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,968,497.95
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	26,702.43
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	14,820,828.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-145,926,549.05
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	1,124,313.63
减：二、费用		3,918,839.53
1. 管理人报酬		1,840,109.69
2. 托管费		368,021.90
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,460,872.26
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	249,835.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-135,783,341.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-135,783,341.19

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 6 日，本报告期实际报告期间为 2013 年 3 月 6 日至 2013 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 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）	1,104,307,415.00	-	1,104,307,415.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-135,783,341.19	-135,783,341.19
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）	109,559,437.00	-23,518,175.80	86,041,261.20
其中：1. 基金申购款	1,139,559,437.00	-30,315,751.02	1,109,243,685.98
2. 基金赎回款	-1,030,000,000.00	6,797,575.22	-1,023,202,424.78
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）	1,213,866,852.00	-159,301,516.99	1,054,565,335.01

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 6 日，本报告期实际报告期间为 2013 年 3 月 6 日至 2013 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

基金管理人负责人：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 交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“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[2012]1762 号《关于核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的批复》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 交易型开放式指数发起式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 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金

份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 43,605.00 份基金份额。本基金为交易型开放式(ETF)、发起式基金,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,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2013 年 2 月 18 日至 2013 年 2 月 28 日,募集金额总额为 1,104,263,810.00 元人民币(含所募集股票市值)经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 011 号验资报告予以验证;有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 43,605.00 元,经普华永道中天验字(2013)第 009 号审验报告予以审验。

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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.4.1 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,惟本会计年度为 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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,在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 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,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;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于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。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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,以及由本基金申购赎回对价现金替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；
- (3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；
- (4) 在符合基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配最多 4 次，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；
- (5) 基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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的初始取得成本时，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；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

发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

(2) 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进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。2013 年 1 月 1 日以前，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	8,860,402.27
定期存款	-
其他存款	-
合计	8,860,402.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,188,036,973.29	1,042,110,424.24	-145,926,549.05
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,188,036,973.29	1,042,110,424.24	-145,926,549.05

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
----	-----

	2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,901.08
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	158.04
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	276.03
合计	2,335.15

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	63,594.54
合计	63,594.54

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	72,404.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	72,404.06

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
可退替代款	2,178.30
应付替代款	181,808.43
预提费用	126,329.58
其他应付款	89,000.35
合计	399,316.66

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,104,307,415.00	1,104,307,415.00
本期申购	1,139,559,437.00	1,139,559,437.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,030,000,000.00	-1,030,000,000.00
本期末	1,213,866,852.00	1,213,866,852.00

注：1. 本基金合同于 2013 年 3 月 6 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,104,307,415.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 43,605.00 份基金份额。

2. 本基金自 2013 年 3 月 25 日起开始办理申购业务和赎回业务。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,143,207.86	-145,926,549.05	-135,783,341.19
本期基金份额交易产生的变动数	-287,423.33	-23,230,752.47	-23,518,175.80
其中：基金申购款	5,537,293.65	-35,853,044.67	-30,315,751.02
基金赎回款	-5,824,716.98	12,622,292.20	6,797,575.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,855,784.53	-169,157,301.52	-159,301,516.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	140,526.73
定期存款利息收入	884,633.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,987.27
其他	2,435.52
合计	1,058,582.85

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,474,229.95
股票投资收益——赎回差价收入	-1,494,268.00
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-2,968,497.95

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	492,912,853.28
减：卖出股票成本总额	494,387,083.23
买卖股票差价收入	-1,474,229.95

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	997,232,344.08
减：现金支付赎回款总额	232,873,599.08
减：赎回股票成本总额	765,853,013.00
赎回差价收入	-1,494,268.00

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	622,820.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	596,000.00
减：应收利息总额	117.57
债券投资收益	26,702.43

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 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,820,828.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,820,828.86

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
------	-------------------------------------

1. 交易性金融资产	-145,926,549.05
——股票投资	-145,926,549.05
——债券投资	-
——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	-145,926,549.05

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	549,725.14
替代损益收入	427,933.80
基金合同生效前利息收入	146,654.69
合计	1,124,313.63

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
交易所市场交易费用	1,460,872.26
银行间市场交易费用	-
合计	1,460,872.26

注：交易所市场交易费用中包含场外申赎引起的交易费用 132,718.08 元。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
审计费用	38,870.91
信息披露费	87,458.67
银行汇划费	794.00
上市费	11,405.46
指数使用费	110,406.64
其他	900.00
合计	249,835.68

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
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
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、申购赎回代办证券公司

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 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	259,426,696.01	9.39%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末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 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013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	101,428.14	16.11%	-	-

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 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,840,109.69
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	368,021.90

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日
-------	------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	10,002,600.00	0.82%
广发证券	2,062,426.00	0.17%

注：粤财信托、广发证券投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,860,402.27	140,526.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

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（2013 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
000999	华润三九	2013-06-03	重大事项	29.60	2013-08-19	26.51	91,807	2,753,996.61	2,717,487.20	-
600547	山东黄金	2013-04-03	重大	32.13	2013-07-01	28.77	80,496	2,706,903.62	2,586,336.48	-

			事 项							
600598	北大荒	2013-05-27	重大 事项	8.35	2013-07-19	8.35	171,459	1,275,636.82	1,431,682.65	-
601918	国投新集	2013-05-16	重大 事项	7.55	2013-08-23	5.05	132,882	1,153,043.30	1,003,259.10	-
601989	中国重工	2013-05-17	重大 事项	4.52	-	-	1,029,255	4,938,938.24	4,652,232.60	-

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 2013 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为 0,无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 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同责任,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。

于 2013 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 0.00%。

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 2013 年 6 月 30 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有三方机构评级的短期融资券。

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 2013 年 6 月 30 日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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。

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。

本基金申购赎回采用一篮子股票的形式,流动性风险低于其他类型的基金。

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 2013 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	8,860,402.27	-	-	-	8,860,402.27
结算备付金	390,215.85	-	-	-	390,215.85
存出保证金	681,583.45	-	-	-	681,583.45
交易性金融资产	-	-	-	1,042,110,424.24	1,042,110,424.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	528,253.49	528,253.49
应收利息	-	-	-	2,335.15	2,335.15
应收股利	-	-	-	3,341,925.86	3,341,925.86
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	63,594.54	63,594.54
资产总计	9,932,201.57	-	-	1,046,046,533.28	1,055,978,734.85
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	-	-	-	369,488.05	369,488.05
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	476,825.91	476,825.91
应付托管费	-	-	-	95,365.16	95,365.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	72,404.06	72,404.06
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	399,316.66	399,316.66
负债总计	-	-	-	1,413,399.84	1,413,399.84
利率敏感度缺口	9,932,201.57	-	-	1,044,633,133.44	1,054,565,335.01

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 2013 年 6 月 30 日
	1. 市场利率下降25个基点	-
	2. 市场利率上升25个基点	-

注：本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2013 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,042,110,424.24	98.82
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,042,110,424.24	98.82

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 2013 年 6 月 30 日
	1. 业绩比较基准上升5%	52,411,078.07
	2. 业绩比较基准下降5%	-52,411,078.07

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) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 1,029,719,426.21 元, 属于第二层级的余额为 12,390,998.03 元, 无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌等交易不活跃情况、或属于非公开发行等情况, 本基金于上述事项影响期间不将相关股票的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金本报告期初未持有公允价值归属于第三层级的金融工具; 本基金本期净转入/(转出)第三层级 0.00 元。

(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	1,042,110,424.24	98.69
	其中: 股票	1,042,110,424.24	98.69
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	9,250,618.12	0.88
6	其他各项资产	4,617,692.49	0.44
7	合计	1,055,978,734.85	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 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	6,238,602.41	0.59
B	采矿业	75,391,527.69	7.15
C	制造业	371,546,784.62	35.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,966,618.83	3.22
E	建筑业	42,111,690.35	3.99
F	批发和零售业	27,441,203.96	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	22,332,960.48	2.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,834,601.25	2.07
J	金融业	352,631,647.86	33.44
K	房地产业	59,382,188.49	5.63
L	租赁和商务服务业	6,625,195.80	0.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,243,122.54	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,815,595.56	0.27
S	综合	13,548,684.40	1.28
	合计	1,042,110,424.24	98.82

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

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	600016	民生银行	5,101,934	43,723,574.38	4.15

2	600036	招商银行	3,597,744	41,733,830.40	3.96
3	601318	中国平安	756,766	26,305,186.16	2.49
4	601166	兴业银行	1,721,436	25,425,609.72	2.41
5	000002	万 科 A	2,193,967	21,610,574.95	2.05
6	600000	浦发银行	2,528,013	20,931,947.64	1.98
7	600837	海通证券	2,029,516	19,036,860.08	1.81
8	601398	工商银行	4,667,199	18,762,139.98	1.78
9	600519	贵州茅台	93,719	18,028,724.03	1.71
10	600030	中信证券	1,741,602	17,642,428.26	1.67
11	601328	交通银行	3,543,382	14,421,564.74	1.37
12	601288	农业银行	5,628,093	13,845,108.78	1.31
13	000651	格力电器	545,371	13,666,997.26	1.30
14	601088	中国神华	744,917	12,618,893.98	1.20
15	601601	中国太保	710,020	11,310,618.60	1.07
16	601668	中国建筑	3,388,053	11,078,933.31	1.05
17	601818	光大银行	3,656,330	10,566,793.70	1.00
18	600887	伊利股份	320,239	10,017,075.92	0.95
19	600104	上汽集团	747,062	9,868,689.02	0.94
20	600048	保利地产	967,468	9,587,607.88	0.91
21	601169	北京银行	1,192,700	9,505,819.00	0.90
22	000001	平安银行	928,939	9,261,521.83	0.88
23	600256	广汇能源	712,417	9,232,924.32	0.88
24	000858	五 粮 液	430,166	8,620,526.64	0.82
25	601006	大秦铁路	1,343,185	7,978,518.90	0.76
26	600900	长江电力	1,118,086	7,737,155.12	0.73
27	600999	招商证券	710,455	7,388,732.00	0.70
28	601688	华泰证券	870,050	7,012,603.00	0.66
29	600015	华夏银行	773,623	6,978,079.46	0.66
30	600383	金地集团	1,010,039	6,928,867.54	0.66
31	600111	包钢稀土	328,164	6,848,782.68	0.65
32	600518	康美药业	347,627	6,684,867.21	0.63
33	000538	云南白药	78,676	6,609,570.76	0.63
34	600585	海螺水泥	451,653	6,043,117.14	0.57
35	601857	中国石油	788,034	5,996,938.74	0.57
36	600050	中国联通	1,915,029	5,974,890.48	0.57
37	000527	美的电器	474,169	5,889,178.98	0.56
38	000895	双汇发展	149,624	5,751,546.56	0.55
39	000063	中兴通讯	445,886	5,685,046.50	0.54
40	600535	天士力	140,052	5,483,035.80	0.52
41	000157	中联重科	995,679	5,406,536.97	0.51
42	600406	国电南瑞	349,031	5,211,032.83	0.49

43	600028	中国石化	1,245,865	5,207,715.70	0.49
44	600031	三一重工	688,093	5,167,578.43	0.49
45	600011	华能国际	948,703	5,066,074.02	0.48
46	002024	苏宁云商	1,003,991	5,029,994.91	0.48
47	002241	歌尔声学	138,382	5,021,882.78	0.48
48	600089	特变电工	595,333	4,792,430.65	0.45
49	600315	上海家化	106,297	4,782,302.03	0.45
50	601989	中国重工	1,029,255	4,652,232.60	0.44
51	601628	中国人寿	338,766	4,637,706.54	0.44
52	000423	东阿阿胶	118,584	4,586,829.12	0.43
53	600795	国电电力	1,945,912	4,436,679.36	0.42
54	600019	宝钢股份	1,116,163	4,386,520.59	0.42
55	000100	TCL 集团	1,921,080	4,360,851.60	0.41
56	000069	华侨城 A	824,019	4,260,178.23	0.40
57	601899	紫金矿业	1,784,915	4,248,097.70	0.40
58	601117	中国化学	445,613	4,242,235.76	0.40
59	600276	恒瑞医药	153,543	4,047,393.48	0.38
60	600739	辽宁成大	308,303	4,044,935.36	0.38
61	600332	广州药业	117,428	4,023,083.28	0.38
62	002304	洋河股份	73,433	3,987,411.90	0.38
63	600690	青岛海尔	365,406	3,986,579.46	0.38
64	002236	大华股份	103,905	3,972,288.15	0.38
65	000625	长安汽车	426,192	3,959,323.68	0.38
66	601009	南京银行	469,423	3,957,235.89	0.38
67	601988	中国银行	1,458,641	3,952,917.11	0.37
68	600309	万华化学	244,240	3,912,724.80	0.37
69	601766	中国南车	1,065,070	3,834,252.00	0.36
70	601901	方正证券	688,863	3,809,412.39	0.36
71	000024	招商地产	156,153	3,791,394.84	0.36
72	002081	金螳螂	133,100	3,789,357.00	0.36
73	000568	泸州老窖	158,454	3,768,036.12	0.36
74	002353	杰瑞股份	54,127	3,734,763.00	0.35
75	600066	宇通客车	200,809	3,680,828.97	0.35
76	000725	京东方 A	1,656,786	3,678,064.92	0.35
77	000338	潍柴动力	211,732	3,673,550.20	0.35
78	002038	双鹭药业	62,124	3,640,466.40	0.35
79	002450	康得新	127,155	3,557,796.90	0.34
80	600637	百视通	125,811	3,522,708.00	0.33
81	601299	中国北车	932,390	3,505,786.40	0.33
82	601336	新华保险	141,626	3,499,578.46	0.33
83	601991	大唐发电	679,600	3,493,144.00	0.33

84	002415	海康威视	91,048	3,217,636.32	0.31
85	600085	同仁堂	146,952	3,215,309.76	0.30
86	601633	长城汽车	90,676	3,211,743.92	0.30
87	600703	三安光电	163,038	3,202,066.32	0.30
88	600804	鹏博士	302,365	3,202,045.35	0.30
89	601377	兴业证券	352,364	3,199,465.12	0.30
90	002594	比亚迪	106,172	3,175,604.52	0.30
91	601788	光大证券	308,867	3,150,443.40	0.30
92	600489	中金黄金	332,332	3,087,364.28	0.29
93	000581	威孚高科	89,671	2,994,114.69	0.28
94	600600	青岛啤酒	78,662	2,987,582.76	0.28
95	000783	长江证券	376,197	2,975,718.27	0.28
96	600010	宝钢股份	723,094	2,964,685.40	0.28
97	600362	江西铜业	187,537	2,951,832.38	0.28
98	601186	中国铁建	695,293	2,920,230.60	0.28
99	000983	西山煤电	357,100	2,913,936.00	0.28
100	002422	科伦药业	54,394	2,899,744.14	0.27
101	600583	海油工程	439,358	2,842,646.26	0.27
102	601390	中国中铁	1,158,172	2,825,939.68	0.27
103	002142	宁波银行	326,853	2,768,444.91	0.26
104	000012	南 玻 A	297,527	2,758,075.29	0.26
105	000402	金 融 街	548,854	2,749,758.54	0.26
106	600252	中恒集团	197,350	2,739,218.00	0.26
107	000009	中国宝安	247,212	2,719,332.00	0.26
108	000999	华润三九	91,807	2,717,487.20	0.26
109	600196	复星医药	258,171	2,705,632.08	0.26
110	000768	中航飞机	300,737	2,676,559.30	0.25
111	600340	华夏幸福	79,753	2,595,162.62	0.25
112	600009	上海机场	217,566	2,593,386.72	0.25
113	600547	山东黄金	80,496	2,586,336.48	0.25
114	000970	中科三环	193,137	2,518,506.48	0.24
115	601669	中国水电	867,311	2,497,855.68	0.24
116	601699	潞安环能	207,810	2,485,407.60	0.24
117	600100	同方股份	359,200	2,464,112.00	0.23
118	600348	阳泉煤业	271,539	2,454,712.56	0.23
119	000792	盐湖股份	144,191	2,442,595.54	0.23
120	002570	贝因美	86,905	2,428,994.75	0.23
121	002146	荣盛发展	169,693	2,394,368.23	0.23
122	000562	宏源证券	270,096	2,374,143.84	0.23
123	000623	吉林敖东	162,175	2,364,511.50	0.22
124	600649	城投控股	337,351	2,334,468.92	0.22

125	601168	西部矿业	430,673	2,329,940.93	0.22
126	601607	上海医药	217,120	2,307,985.60	0.22
127	601998	中信银行	621,612	2,306,180.52	0.22
128	600886	国投电力	676,956	2,288,111.28	0.22
129	000629	攀钢钒钛	973,405	2,287,501.75	0.22
130	600660	福耀玻璃	316,775	2,277,612.25	0.22
131	000800	一汽轿车	184,431	2,268,501.30	0.22
132	600674	川投能源	222,746	2,265,326.82	0.21
133	600029	南方航空	793,219	2,236,877.58	0.21
134	002375	亚厦股份	72,047	2,219,047.60	0.21
135	600352	浙江龙盛	235,552	2,209,477.76	0.21
136	000425	徐工机械	280,506	2,201,972.10	0.21
137	000060	中金岭南	327,287	2,166,639.94	0.21
138	601800	中国交建	531,741	2,153,551.05	0.20
139	002310	东方园林	54,941	2,103,690.89	0.20
140	600549	厦门钨业	77,153	2,059,985.10	0.20
141	601600	中国铝业	649,209	2,045,008.35	0.19
142	600005	武钢股份	911,876	2,042,602.24	0.19
143	600893	航空动力	123,072	2,028,226.56	0.19
144	601898	中煤能源	413,448	2,021,760.72	0.19
145	000039	中集集团	195,455	2,019,050.15	0.19
146	600150	中国船舶	124,537	2,013,763.29	0.19
147	600369	西南证券	262,396	2,012,577.32	0.19
148	600108	亚盛集团	307,879	2,007,371.08	0.19
149	600832	东方明珠	359,881	1,982,944.31	0.19
150	000963	华东医药	49,200	1,960,620.00	0.19
151	600123	兰花科创	154,751	1,957,600.15	0.19
152	600642	申能股份	514,045	1,953,371.00	0.19
153	002344	海宁皮城	101,594	1,941,461.34	0.18
154	600694	大商股份	66,369	1,920,055.17	0.18
155	600153	建发股份	303,303	1,907,775.87	0.18
156	601808	中海油服	133,794	1,885,157.46	0.18
157	000728	国元证券	222,575	1,882,984.50	0.18
158	002202	金风科技	348,165	1,876,609.35	0.18
159	002385	大北农	181,771	1,875,876.72	0.18
160	600497	驰宏锌锗	191,875	1,870,781.25	0.18
161	600068	葛洲坝	472,646	1,862,225.24	0.18
162	601555	东吴证券	271,582	1,860,336.70	0.18
163	600060	海信电器	177,700	1,846,303.00	0.18
164	600177	雅戈尔	301,788	1,843,924.68	0.17
165	600741	华域汽车	233,386	1,820,410.80	0.17

166	000729	燕京啤酒	318,135	1,816,550.85	0.17
167	600498	烽火通信	109,037	1,796,929.76	0.17
168	000709	河北钢铁	962,656	1,780,913.60	0.17
169	601618	中国中冶	1,100,339	1,771,545.79	0.17
170	601018	宁波港	867,311	1,751,968.22	0.17
171	600208	新潮中宝	565,412	1,747,123.08	0.17
172	601888	中国国旅	59,634	1,741,312.80	0.17
173	000630	铜陵有色	161,099	1,736,647.22	0.16
174	601958	金钼股份	218,587	1,733,394.91	0.16
175	600143	金发科技	356,842	1,723,546.86	0.16
176	600655	豫园商城	259,808	1,691,350.08	0.16
177	600881	亚泰集团	428,029	1,665,032.81	0.16
178	600271	航天信息	125,170	1,654,747.40	0.16
179	600863	内蒙华电	291,924	1,649,370.60	0.16
180	601111	中国国航	384,294	1,629,406.56	0.15
181	601933	永辉超市	138,883	1,620,764.61	0.15
182	600166	福田汽车	317,397	1,618,724.70	0.15
183	600718	东软集团	194,158	1,580,446.12	0.15
184	600516	方大炭素	194,299	1,573,821.90	0.15
185	000878	云南铜业	160,509	1,556,937.30	0.15
186	600415	小商品城	307,417	1,555,530.02	0.15
187	600062	华润双鹤	77,543	1,552,410.86	0.15
188	000876	新 希 望	157,603	1,552,389.55	0.15
189	600875	东方电气	150,241	1,550,487.12	0.15
190	600316	洪都航空	97,118	1,515,040.80	0.14
191	000046	泛海建设	309,866	1,512,146.08	0.14
192	600839	四川长虹	834,194	1,493,207.26	0.14
193	600811	东方集团	301,217	1,484,999.81	0.14
194	002007	华兰生物	65,297	1,474,406.26	0.14
195	002106	莱宝高科	95,981	1,473,308.35	0.14
196	600115	东方航空	574,655	1,471,116.80	0.14
197	601333	广深铁路	638,321	1,468,138.30	0.14
198	600118	中国卫星	103,471	1,467,218.78	0.14
199	601928	凤凰传媒	172,436	1,450,186.76	0.14
200	600267	海正药业	113,789	1,447,396.08	0.14
201	600809	山西汾酒	58,672	1,437,464.00	0.14
202	600598	北大荒	171,459	1,431,682.65	0.14
203	601238	广汽集团	191,223	1,407,401.28	0.13
204	601992	金隅股份	281,339	1,406,695.00	0.13
205	600376	首开股份	253,269	1,405,642.95	0.13
206	600157	永泰能源	239,812	1,402,900.20	0.13

207	000937	冀中能源	157,260	1,388,605.80	0.13
208	000061	农产品	230,764	1,386,891.64	0.13
209	601666	平煤股份	266,571	1,386,169.20	0.13
210	000839	中信国安	213,217	1,375,249.65	0.13
211	000422	湖北宜化	203,558	1,374,016.50	0.13
212	000758	中色股份	133,904	1,356,447.52	0.13
213	600546	山煤国际	112,149	1,327,844.16	0.13
214	002500	山西证券	217,560	1,287,955.20	0.12
215	002294	信立泰	44,500	1,287,830.00	0.12
216	600664	哈药股份	216,493	1,285,968.42	0.12
217	600372	中航电子	61,139	1,280,862.05	0.12
218	000960	锡业股份	104,367	1,273,277.40	0.12
219	002155	辰州矿业	158,058	1,270,786.32	0.12
220	600027	华电国际	402,483	1,267,821.45	0.12
221	600188	兖州煤业	133,773	1,257,466.20	0.12
222	000750	国海证券	121,840	1,257,388.80	0.12
223	600219	南山铝业	262,218	1,229,802.42	0.12
224	002001	新和成	82,265	1,212,586.10	0.11
225	002051	中工国际	43,399	1,209,530.13	0.11
226	600216	浙江医药	58,734	1,205,221.68	0.11
227	600827	友谊股份	174,230	1,196,960.10	0.11
228	601106	中国一重	590,718	1,193,250.36	0.11
229	601717	郑煤机	186,774	1,167,337.50	0.11
230	000528	柳工	178,520	1,160,380.00	0.11
231	601098	中南传媒	121,716	1,131,958.80	0.11
232	601099	太平洋	224,341	1,126,191.82	0.11
233	601158	重庆水务	216,778	1,116,406.70	0.11
234	601118	海南橡胶	266,292	1,102,448.88	0.10
235	600125	铁龙物流	206,322	1,093,506.60	0.10
236	000718	苏宁环球	185,231	1,089,158.28	0.10
237	000686	东北证券	66,537	1,080,560.88	0.10
238	600221	海南航空	533,656	1,077,985.12	0.10
239	600170	上海建工	156,649	1,071,479.16	0.10
240	000778	新兴铸管	217,223	1,066,564.93	0.10
241	002092	中泰化学	209,299	1,063,238.92	0.10
242	600058	五矿发展	96,777	1,054,869.30	0.10
243	000869	张裕 A	30,832	1,052,604.48	0.10
244	601258	庞大集团	177,907	1,051,430.37	0.10
245	601866	中海集运	537,529	1,032,055.68	0.10
246	600259	广晟有色	28,062	1,031,839.74	0.10
247	600266	北京城建	100,366	1,026,744.18	0.10

248	600395	盘江股份	112,132	1,026,007.80	0.10
249	600109	国金证券	87,788	1,009,562.00	0.10
250	000401	冀东水泥	122,163	1,004,179.86	0.10
251	601918	国投新集	132,882	1,003,259.10	0.10
252	600132	重庆啤酒	65,613	986,163.39	0.09
253	600588	用友软件	108,303	968,228.82	0.09
254	000933	神火股份	215,368	960,541.28	0.09
255	002299	圣农发展	103,225	933,154.00	0.09
256	600160	巨化股份	159,968	932,613.44	0.09
257	600895	张江高科	174,900	926,970.00	0.09
258	600403	大有能源	108,400	923,568.00	0.09
259	600970	中材国际	100,084	920,772.80	0.09
260	000969	安泰科技	117,328	910,465.28	0.09
261	000027	深圳能源	179,800	904,394.00	0.09
262	600096	云天化	113,058	903,333.42	0.09
263	600169	太原重工	383,162	892,767.46	0.08
264	600779	水井坊	77,308	885,949.68	0.08
265	600971	恒源煤电	112,922	869,499.40	0.08
266	601001	大同煤业	151,133	865,992.09	0.08
267	601101	昊华能源	108,389	859,524.77	0.08
268	600550	天威保变	154,990	846,245.40	0.08
269	600859	王府井	52,242	841,618.62	0.08
270	601139	深圳燃气	89,800	798,322.00	0.08
271	600528	中铁二局	164,759	797,433.56	0.08
272	600432	吉恩镍业	91,518	797,121.78	0.08
273	600997	开滦股份	139,512	795,218.40	0.08
274	002431	棕榈园林	41,775	792,054.00	0.08
275	002128	露天煤业	90,205	788,391.70	0.07
276	000807	云铝股份	209,306	778,618.32	0.07
277	000961	中南建设	79,405	776,580.90	0.07
278	002069	獐子岛	64,468	763,945.80	0.07
279	000539	粤电力 A	168,200	760,264.00	0.07
280	601369	陕鼓动力	111,025	749,418.75	0.07
281	600582	天地科技	109,651	703,959.42	0.07
282	000703	恒逸石化	78,436	675,333.96	0.06
283	600783	鲁信创投	50,411	669,458.08	0.06
284	002399	海普瑞	36,272	645,641.60	0.06
285	600508	上海能源	65,320	634,910.40	0.06
286	002673	西部证券	54,394	630,426.46	0.06
287	000059	辽通化工	136,044	616,279.32	0.06
288	000656	金科股份	52,560	609,170.40	0.06

289	002603	以岭药业	25,044	570,001.44	0.05
290	600873	梅花集团	140,492	557,753.24	0.05
291	000596	古井贡酒	26,082	544,592.16	0.05
292	000780	平庄能源	91,954	493,792.98	0.05
293	002269	美邦服饰	45,600	403,104.00	0.04
294	002378	章源钨业	19,509	363,842.85	0.03
295	603993	洛阳钼业	45,400	304,180.00	0.03
296	000156	华数传媒	14,500	233,450.00	0.02
297	000883	湖北能源	47,656	230,178.48	0.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	98,298,832.29	9.32
2	600036	招商银行	84,712,776.41	8.03
3	601166	兴业银行	61,046,906.78	5.79
4	601318	中国平安	59,878,460.90	5.68
5	600000	浦发银行	49,484,002.27	4.69
6	000002	万科 A	46,217,053.19	4.38
7	600030	中信证券	41,854,012.45	3.97
8	600837	海通证券	41,411,392.94	3.93
9	601328	交通银行	39,405,812.75	3.74
10	601398	工商银行	37,010,880.70	3.51
11	600519	贵州茅台	33,219,192.68	3.15
12	601088	中国神华	30,387,545.73	2.88
13	601288	农业银行	29,776,129.90	2.82
14	000651	格力电器	28,490,730.50	2.70
15	601601	中国太保	24,828,741.37	2.35
16	000001	平安银行	23,460,413.19	2.22
17	600104	上汽集团	21,849,898.77	2.07
18	601668	中国建筑	21,769,560.87	2.06
19	600048	保利地产	21,131,009.99	2.00
20	600887	伊利股份	20,303,088.60	1.93

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末基金资产净值 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	占期末基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	002106	莱宝高科	60,417,461.31	5.73
2	600221	海南航空	42,619,173.73	4.04
3	000002	万科 A	22,105,430.30	2.10
4	000651	格力电器	13,439,330.45	1.27
5	000001	平安银行	11,276,770.80	1.07
6	000858	五粮液	8,684,783.34	0.82
7	000157	中联重科	7,223,995.04	0.69
8	000538	云南白药	6,582,183.67	0.62
9	000046	泛海建设	6,499,342.43	0.62
10	002146	荣盛发展	6,263,557.13	0.59
11	002024	苏宁云商	5,759,740.53	0.55
12	000895	双汇发展	5,372,175.94	0.51
13	000423	东阿阿胶	5,314,700.87	0.50
14	002353	杰瑞股份	5,289,176.96	0.50
15	601988	中国银行	5,217,741.71	0.49
16	600150	中国船舶	5,208,852.17	0.49
17	002415	海康威视	5,157,403.16	0.49
18	002310	东方园林	4,998,949.95	0.47
19	002570	贝因美	4,877,309.61	0.46
20	002236	大华股份	4,870,315.05	0.46

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	2,271,267,301.52
卖出股票收入（成交）总额	492,912,853.28

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	681,583.45
2	应收证券清算款	528,253.49
3	应收股利	3,341,925.86
4	应收利息	2,335.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	63,594.54
8	其他	-
9	合计	4,617,692.49

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	持有份额	占总份额

			例		比例
1,688	719,115.43	1,158,270,503.00	95.42%	55,596,349.00	4.58%

注：持有人户数包含场外份额持有人户数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广东粤财信托有限公司	10,002,600.00	0.82%
2	中信证券股份有限公司	4,676,900.00	0.39%
3	中原证券股份有限公司	3,370,900.00	0.28%
4	许玉善	2,999,500.00	0.25%
5	汇丰人寿保险有限公司－积极进取投资账户	2,647,300.00	0.22%
6	招商证券股份有限公司	2,248,335.00	0.19%
7	广发证券股份有限公司	2,062,426.00	0.17%
8	李后定	2,025,282.00	0.17%
9	陈前玉	2,000,000.00	0.16%
10	中信建投证券股份有限公司	1,937,548.00	0.16%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
----	--------	--------------	--------	--------------	------------

基金管理人固有资金	-	-	-	-	
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	10,002,600.00	0.82%	10,002,600.00	0.82%	3 年
其他	-	-	-	-	
合计	10,002,600.00	0.82%	10,002,600.00	0.82%	

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,104,307,415.00
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	1,139,559,437.00
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	1,030,000,000.00
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,213,866,852.00

注：本基金合同生效日为 2013 年 03 月 06 日。期末基金总份额包含场外份额 1,129,559,437 份；总申购份额包含场外总申购份额 1,129,559,437 份。

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

本报告期内本基金管理人、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	
申银万国	4	1,475,394,108.32	53.39%	109,275.92	17.36%	-
招商证券	3	846,874,358.56	30.64%	347,570.94	55.22%	-
广发证券	2	259,426,696.01	9.39%	101,428.14	16.11%	-
平安证券	2	181,859,241.65	6.58%	71,159.51	11.31%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增广发证券股份有限公司、平安证券有限责任公司各两个交易单元，新增招商证券股份有限公司三个交易单元，新增申银万国证券股份有限公司四个交易单元。

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
申银万国	622,820.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

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	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-07
2	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-20
3	易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-20
4	易方达基金管理有限公司关于易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金场外日常申购、赎回业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-22
5	易方达基金管理有限公司关于新增易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-05-16
6	易方达基金管理有限公司关于易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金调整场外日常申购、赎回开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-05-31
7	易方达基金管理有限公司关于运用公司固	中国证券报、上海	2013-06-26

	有资金申购旗下开放式基金的公告	证券报、证券时报	
8	易方达基金管理有限公司关于成立易方达资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-29
9	易方达基金管理有限公司关于运用公司固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	2013-06-29

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 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
二〇一三年八月二十八日