

**易方达亚洲精选股票型证券投资基金  
2015 年半年度报告  
2015 年 6 月 30 日**

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
送出日期：二〇一五年八月二十六日

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 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 2015 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	境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5	信息披露方式 .....	6
2.6	其他相关资料 .....	6
3	主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2	基金净值表现 .....	7
4	管理人报告 .....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....	9
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	9
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
5	托管人报告 .....	11
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
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	11
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	12
6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1	资产负债表 .....	12
6.2	利润表 .....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	14
6.4	报表附注 .....	15
7	投资组合报告 .....	31
7.1	期末基金资产组合情况 .....	31
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	32
7.3	期末按行业分类的权益投资组合 .....	32
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..	32
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动 .....	37
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	43
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.8	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	
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明 细	44
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	44
7.11	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
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..	45
9	开放式基金份额变动 .....	45
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 .....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8	其他重大事件 .....	49
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	易方达亚洲精选股票型证券投资基金
基金简称	易方达亚洲精选股票 (QDII)
基金主代码	118001
交易代码	118001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 1 月 21 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,722,054,585.33 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚洲企业，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将基于对全球及亚洲宏观经济，各类资产的风险与收益水平的综合分析与判断在不同区域和行业间进行积极的资产配置。在构建投资组合方面，本基金坚持价值投资的理念，以自下而上的基本面分析、深入的公司研究、对股票价值的评估作为股票投资的根本依据，辅以自上而下的宏观经济分析、国别/地区因素分析、行业分析，争取获得超越比较基准的回报。固定收益品种与货币市场工具的投资将主要用于回避投资风险、取得稳定回报，同时，保持必要的灵活性，及时把握重大的投资机会。
业绩比较基准	MSCI AC 亚洲除日本指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

### 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	中国工商银行股份有限公司

信息披 露 负责人	姓名	张南	蒋松云
	联系电话	020-38797888	010—66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38799488	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街 55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	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	姜建清

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	无	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 号渣打银 行大厦 32 楼
办公地址		无	香港九龙观塘光观塘路三百八十八号 渣打中心 15 楼
邮政编码		无	无

## 2.5 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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 43 楼

## 2.6 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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40 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(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	33,821,592.64
本期利润	-24,112,130.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0192
本期加权平均净值利润率	-1.97%
本期基金份额净值增长率	19.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	-337,020,420.64
期末可供分配基金份额利润	-0.1957
期末基金资产净值	1,623,194,522.31
期末基金份额净值	0.943
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.70%

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	-12.20%	2.32%	-4.27%	0.90%	-7.93%	1.42%
过去三个月	16.56%	2.73%	-0.51%	0.90%	17.07%	1.83%
过去六个月	19.22%	2.07%	4.01%	0.78%	15.21%	1.29%
过去一年	21.83%	1.61%	1.23%	0.72%	20.60%	0.89%
过去三年	22.63%	1.19%	19.53%	0.80%	3.10%	0.39%
自基金合同生效起至今	-5.70%	1.28%	9.13%	1.06%	-14.83%	0.22%

##### 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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金  
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  
(2010 年 1 月 21 日至 2015 年 6 月 30 日)



- 注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。  
2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-5.70%，同期业绩比较基准收益率为9.13%。

## 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，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司、广东新三联投资发展有限公司等多个子公司。易方达秉承“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增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004年10月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008年2月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2015年6月30日，易方达旗下共管理82只开放式基金、1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，资产管理总规模5348.85

亿元。

#### 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		
张坤	本基金的基金经理、易方达 中小盘股票型证券投资基 金的基金经理	2014-04-08	-	7年	硕士研究 生，曾任易 方达基金管 理有限公司 研究部行业 研究员、基 金投资部基 金经理助 理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应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，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

##### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年以来，美国经济的复苏势头出现了一定反复，非农就业人数低于预期，美元指数再度走弱，市场对美联储的加息时点的预期有所推后。大宗商品方面，大部分商品如原油和铁矿石等在低位徘徊。在这种情况下，短期内全球没有通胀的压力，全球流动性水平维持宽松的状态。中国方面，政府继续采取了一系列货币政策和财政政策来对冲经济下滑。货币政策方面，延续了去年四季度以来的宽松基调，央行在 2 月、5 月和 6 月各进行了一次降息，2 月、4 月和 6 月各进行了一次降准。财政政策方面，加快了部分基建项目的审批速度。在二者的综合作用下，经济出现了一定的企稳迹象。

本基金在上半年的股票仓位基本稳定，并对结构进行了调整。市场配置方面，增加了香港市场的配置比例。行业方面，增加了券商、TMT、环保等行业的配置，降低了金融、地产等行业的配置。个股方面，增加了业务模式有特色、估值水平合理的中小市值公司的投资比例。

### 4.5.2 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 0.943 元，本报告期份额净值增长率为 19.22%，同期业绩比较基准收益率为 4.01%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于短期内全球没有通胀压力，美国量化宽松的退出和加息时点有较大概率推后，这将有利于全球的股票市场。

对美国市场来说，其估值水平已达到近几年的较高水平，企业的 ROE 也处于高位，在这种情况下，更宜寻找美国以外市场的超额收益机会。中国经济处于企稳之中，其尾部风险已经基本消除。特别是香港市场中，中国公司的估值从纵向和横向来看均属于很低的水平。在这种风险收益背景下适宜积极寻找投资机会，特别是一些经营模式有特色的中小市值公司。

在此背景下，本基金计划以精选行业和个股为根本来获取超额收益。行业方面，选择市场空间广阔、竞争格局稳定的行业；个股方面，重点选择长期逻辑清晰、竞争壁垒高和管理优秀的两类企业：一是经过时间考验的行业龙头公司，二是经营模式有特色的中小公司。通过分享这些优秀企业的成长为投资者带来源回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 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

本报告期内，本基金托管人在对易方达亚洲精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达亚洲精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 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：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	99,752,054.78	21,008,734.02
结算备付金		306,841.12	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,583,506,984.19	229,695,551.55
其中：股票投资		1,583,506,984.19	229,695,551.55
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		206,179,839.66	-
应收利息	6.4.7.5	6,208.15	710.10
应收股利		3,621,174.47	-
应收申购款		4,885,773.12	438,004.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		1,898,258,875.49	251,143,000.22
<b>负债和所有者权益</b>	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		270,704,986.70	779,660.69
应付管理人报酬		2,577,844.35	311,101.60
应付托管费		601,497.04	72,590.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	57,545.69	-
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	1,122,479.40	210,095.08
负债合计		275,064,353.18	1,373,447.74
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,722,054,585.33	315,600,999.47
未分配利润	6.4.7.10	-98,860,063.02	-65,831,446.99
所有者权益合计		1,623,194,522.31	249,769,552.48
负债和所有者权益总计		1,898,258,875.49	251,143,000.22

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.943 元，基金份额总额 1,722,054,585.33 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-5,778,505.55</b>	<b>-985,378.84</b>
1.利息收入		227,798.11	7,052.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	227,798.11	7,052.61
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资收入		-	-
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）		69,479,899.32	-1,465,805.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,932,268.78	-2,467,463.55
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	55,302,410.79	12,531.32
股利收益	6.4.7.16	12,245,219.75	989,127.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	-57,933,723.62	432,413.84

填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-19,151,361.23	39,834.92
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,598,881.87	1,124.86
<b>减：二、费用</b>		<b>18,333,625.43</b>	<b>1,102,250.27</b>
1. 管理人报酬		8,646,670.79	503,921.29
2. 托管费		2,017,556.55	117,581.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,538,631.81	301,517.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	130,766.28	179,229.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-24,112,130.98</b>	<b>-2,087,629.11</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-24,112,130.98</b>	<b>-2,087,629.11</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	315,600,999.47	-65,831,446.99	249,769,552.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,112,130.98	-24,112,130.98
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）	1,406,453,585.86	-8,916,485.05	1,397,537,100.81
其中：1.基金申购款	2,731,298,510.10	-28,892,551.73	2,702,405,958.37
2.基金赎回款	-1,324,844,924.24	19,976,066.68	-1,304,868,857.56
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）	1,722,054,585.33	-98,860,063.02	1,623,194,522.31
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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	93,348,750.25	-19,079,428.49	74,269,321.76

净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,087,629.11	-2,087,629.11
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)	-9,047,974.98	2,096,856.29	-6,951,118.69
其中: 1.基金申购款	2,100,029.57	-506,714.40	1,593,315.17
2.基金赎回款	-11,148,004.55	2,603,570.69	-8,544,433.86
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)	84,300,775.27	-19,070,201.31	65,230,573.96

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: 刘晓艳, 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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金(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[2008]1064 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2009]367 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的批复》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《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案, 本基金基金合同于 2010 年 1 月 21 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 592,067,217.31 份基金份额, 其中认购资金利息折合 107,302.70 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司, 境外资产托管人为渣打银行(香港)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》、《易方达亚洲精选股票型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本报告期末的财务状况以及本报告期间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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外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) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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 2015年6月30日
活期存款	99,752,054.78
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	99,752,054.78

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,640,281,584.27	1,583,506,984.19	-56,774,600.08

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	1,640,281,584.27	1,583,506,984.19	-56,774,600.08	

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

#### 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 2015年6月30日
应收活期存款利息	6,208.15
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	-
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	-
合计	6,208.15

#### 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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	57,545.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	57,545.69

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,018,342.86
预提费用	104,136.54
合计	1,122,479.40

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	315,600,999.47	315,600,999.47
本期申购	2,731,298,510.10	2,731,298,510.10
本期赎回(以“-”号填列)	-1,324,844,924.24	-1,324,844,924.24
本期末	1,722,054,585.33	1,722,054,585.33

#### 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	-68,396,659.03	2,565,212.04	-65,831,446.99
本期利润	33,821,592.64	-57,933,723.62	-24,112,130.98
本期基金份额交易产生的变动数	-302,445,354.25	293,528,869.20	-8,916,485.05
其中：基金申购款	-584,431,344.81	555,538,793.08	-28,892,551.73
基金赎回款	281,985,990.56	-262,009,923.88	19,976,066.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-337,020,420.64	238,160,357.62	-98,860,063.02

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	226,509.81
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	987.48
其他	300.82
合计	227,798.11

#### 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
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,451,899,582.95
减：卖出股票成本总额	1,449,967,314.17
买卖股票差价收入	1,932,268.78

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出权证成交总额	55,302,410.79
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	55,302,410.79

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,245,219.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,245,219.75

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-57,933,723.62
——股票投资	-57,933,723.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-57,933,723.62

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,598,881.87
合计	1,598,881.87

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	7,538,631.81
银行间市场交易费用	-
合计	7,538,631.81

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	89,260.15
银行汇划费	8,546.02
银行间账户维护费	4,500.00
其他	13,583.72
合计	130,766.28

注：“其他”主要包含支付给交易所的结算服务费用和存托凭证托管机构的存托服务费用。

**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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
渣打银行(香港)有限公司(以下简称“渣打银行”)	境外资产托管人
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会

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

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股票交易。

###### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,646,670.79	503,921.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,060,185.94	74,875.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,017,556.55	117,581.63

注：本基金的托管费（包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 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

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

##### 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 2015年1月1日至2015年6月30 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
期初持有的基金份额	249,064,757.16	-
期间申购/买入总份额	103,197,220.32	-
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	352,261,977.48	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	20.46%	-

注：基金管理人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。

#### 6.4.10.4.2 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 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例
广东省易方达教 育基金会	20,160,282.26	1.17%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行	80,868,314.92	217,510.68	782,882.09	4,503.73
渣打银行	18,883,739.86	8,999.13	11,354,636.97	2,547.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和渣打银行（香港）有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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（2015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
940 HK	China Animal Health care Ltd.	2015-03-30	重大事项	4.10	-	-	850,000	3,230,137.15	3,485,656.20	-
967 HK	Sound Global Ltd.	2015-03-16	重大事项	5.52	-	-	700,000	4,062,763.79	3,864,189.00	-

##### 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 2015 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 2015 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，投资于股票及其他权益类证券占基金资产的比例不低于 60%，其中投资于在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外），合计不低于股票资产的 80%（亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业）。理论上其

风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家 / 地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家 / 地区投资的风险。

#### 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（本基金为进行避险和组合的有效管理可以投资衍生品），或者基金所投资证券之发行人出现违约（包括国家信用风险）、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。基金管理人通过严格的投资备选库制度和交易对手备选库制度及分散化投资方式防范信用风险。期末本基金没有进行衍生品投资和债券投资。

##### 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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金在短时间内购买以及售出金融工具，成交价格较远地偏离了真实价值。当某国 / 地区的资本市场规模较小，金融市场不发达，某金融品种流通市值较低，参与机构数量较少，成交不活跃，以及基金需要在短时间内进行大量交易时，有可能发生流动性风险，导致基金难以快速建仓，或在出现大额赎回时，被迫在不利价格大量抛售证券，使基金净值遭受不利影响。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，主要投资的交易所流动性较好，因

此本基金面临的流动性风险较小。

#### 6.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。

##### 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 2015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	99,752,054.78	-	-	-	99,752,054.78
结算备付金	306,841.12	-	-	-	306,841.12
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,583,506,984.19	1,583,506,984.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	206,179,839.66	206,179,839.66
应收利息	-	-	-	6,208.15	6,208.15
应收股利	-	-	-	3,621,174.47	3,621,174.47
应收申购款	151,426.95	-	-	4,734,346.17	4,885,773.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	100,210,322.85	-	-	1,798,048,552.64	1,898,258,875.49
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	270,704,986.70	270,704,986.70
应付管理人报酬	-	-	-	2,577,844.35	2,577,844.35
应付托管费	-	-	-	601,497.04	601,497.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	57,545.69	57,545.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,122,479.40	1,122,479.40
负债总计	-	-	-	275,064,353.18	275,064,353.18
利率敏感度缺口	100,210,322.85	-	-	1,522,984,199.46	1,623,194,522.31
上年度末 2014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	21,008,734.02	-	-	-	21,008,734.02
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	229,695,551.55	229,695,551.55
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	-	-	-	710.10	710.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	19,908.72	-	-	418,095.83	438,004.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,028,642.74	-	-	230,114,357.48	251,143,000.22
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-

交易性金融负债				-	-	-
衍生金融负债		-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款		-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	779,660.69	779,660.69	
应付管理人报酬	-	-	-	311,101.60	311,101.60	
应付托管费	-	-	-	72,590.37	72,590.37	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	
应付交易费用	-	-	-	-	-	
应交税费	-	-	-	-	-	
应付利息	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	
递延所得税负债				-	-	-
其他负债				210,095.08	210,095.08	
负债总计		-	-	1,373,447.74	1,373,447.74	
利率敏感度缺口	21,028,642.74	-	-	228,740,909.74	249,769,552.48	

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 分析	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31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

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2015年6月30日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
<b>以外币计价的资产</b>				
银行存款	12,471,608.22	6,413,157.44	39.55	18,884,805.21
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	140,910,226.64	1,442,596,757.55	-	1,583,506,984.19
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	20,474,549.72	161,383,637.22	-	181,858,186.94
应收利息	-	-	0.01	0.01
应收股利	-	3,621,174.47	-	3,621,174.47
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>173,856,384.58</b>	<b>1,614,014,726.68</b>	<b>39.56</b>	<b>1,787,871,150.82</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>173,856,384.58</b>	<b>1,614,014,726.68</b>	<b>39.56</b>	<b>1,787,871,150.82</b>
<b>项目</b>	<b>上年度末</b>			
	<b>2014年12月31日</b>			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>				
银行存款	9,587,978.89	8,586,907.55	40.16	18,174,926.60
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	26,380,875.30	203,314,676.25	-	229,695,551.55
衍生金融资产	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>35,968,854.19</b>	<b>211,901,583.80</b>	<b>40.16</b>	<b>247,870,478.15</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>35,968,854.19</b>	<b>211,901,583.80</b>	<b>40.16</b>	<b>247,870,478.15</b>

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设 分析	除汇率外其他因素保持不变		
	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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
假设人民币对一揽子货币平均升值 5%		-88362449.97	-12,393,523.91
假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%		88362449.97	12,393,523.91

#### 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	上年度末
----	-----	------

	2015 年 6 月 30 日		2014 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	1,583,506,984 .19	97.55	229,695,551.5 5	91.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,583,506,984 .19	97.55	229,695,551.5 5	91.96

#### 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		
	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)	
分析		本期末	上年度末
	2015 年 6 月 30 日	2014 年 12 月 31 日	
1.业绩比较基准上升 5%		79175349.03	11,484,777.55
2.业绩比较基准下降 5%		-79175349.03	-11,484,777.55

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 1,576,157,138.99 元，属于第二层次的余额为 7,349,845.20 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 229,695,551.55 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(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	1,583,506,984.19	83.42
	其中：普通股	1,449,637,179.31	76.37
	存托凭证	133,869,804.88	7.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	100,058,895.90	5.27
8	其他各项资产	214,692,995.40	11.31
9	合计	1,898,258,875.49	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	1,442,596,757.55	88.87
美国	140,910,226.64	8.68
合计	1,583,506,984.19	97.55

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	47,468,013.12	2.92
工业	343,045,350.00	21.13
非必需消费品	232,306,043.52	14.31
必需消费品	14,061,280.00	0.87
保健	281,444,147.94	17.34
金融	288,070,885.74	17.75
信息技术	350,976,728.47	21.62
电信服务	-	-
公用事业	26,134,535.40	1.61
合计	1,583,506,984.19	97.55

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量(股)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
1	Dongjiang Environm	东江环保股份有限	895 HK	香港证 券交易	香港	10,000,000	131,697,870.00	8.11

	ental Co Ltd.	公司		所				
2	Haitong Internatio nal Securities Group Ltd.	海通证券 股份有限 公司	665 HK	香港证 券交易 所	香港	22,000,000	121,445,940.00	7.48
3	Poly Culture Group Co Ltd.	保利文化 集团股份 有限公司	3636 HK	香港证 券交易 所	香港	4,470,000	108,748,924.70	6.70
4	Guotai Junan Internatio nal Holdings Ltd.	国泰君安 国际控股 有限公司	1788 HK	香港证 券交易 所	香港	25,000,000	99,562,012.50	6.13
5	Hua Han Bio-Phar maceutica l Holdings Ltd.	华瀚生物 制药控股 有限公司	587 HK	香港证 券交易 所	香港	80,000,000	91,478,760.00	5.64
6	Dynagree n Environm ental Protection Group Co. Ltd.	绿色动力 环保集团 股份有限 公司	1330 HK	香港证 券交易 所	香港	20,000,000	83,908,104.00	5.17
7	Kingsoft Corporati on Ltd.	金山软件 股份有限 公司	3888 HK	香港证 券交易 所	香港	3,600,000	74,239,745.40	4.57
8	Kingdee Internatio nal Software Group Co. Ltd.	金蝶国际 软件集团 有限公司	268 HK	香港证 券交易 所	香港	17,000,000	61,937,429.40	3.82
9	Shanghai Prime Machiner y Co. Ltd.	上海集优 机械股份 有限公司	2345 HK	香港证 券交易 所	香港	37,000,000	58,940,711.40	3.63
10	Guangdon g Yueyun	广东粤运 交通股份	3399 HK	香港证 券交易	香港	10,350,000	57,951,005.85	3.57

	Transportation Co. Ltd.	有限公司		所				
11	Coolpad Group Ltd.	酷派集团有限公司	2369 HK	香港证券交易所	香港	27,000,000	57,276,744.30	3.53
12	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co. Ltd.	北京同仁堂国药有限公司	8138 HK	香港证券交易所	香港	5,200,000	50,849,572.80	3.13
13	Cogobuy Group	科通芯城集团	400 HK	香港证券交易所	香港	6,000,000	50,534,128.80	3.11
14	Technovator International Ltd.	同方泰德国际科技有限公司	1206 HK	香港证券交易所	香港	9,500,000	49,296,011.10	3.04
15	Bloomage BioTechnology Corporation Ltd.	华熙生物科技有限公司	963 HK	香港证券交易所	香港	4,400,000	47,468,013.12	2.92
16	Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd.	李氏大药厂控股有限公司	950 HK	香港证券交易所	香港	3,200,000	32,503,349.76	2.00
17	United Laboratories International Holdings Ltd.	联邦制药国际控股有限公司	3933 HK	香港证券交易所	香港	7,000,000	30,968,714.70	1.91
18	Sunshine 100 China Holdings Ltd.	阳光100中国控股有限公司	2608 HK	香港证券交易所	香港	12,000,000	30,661,156.80	1.89
19	Qihoo 360 Technology Co Ltd.	-	QIHU US	纽约证券交易所	美国	55,000	22,760,627.12	1.40
20	Kangda International	康达国际环保有限	6136 HK	香港证券交易所	香港	8,000,000	22,270,346.40	1.37

	nal Environm ental Co. Ltd.	公司		所				
21	YY Inc.	-	YY US	纳斯达 克证券 交易所	美国	45,000	19,125,786.24	1.18
22	Get Nice Holdings Ltd.	结好控股 有限公司	64 HK	香港证 券交易 所	香港	50,000,000	18,532,335.00	1.14
23	Tianneng Power Internatio nal Ltd.	天能动力 国际有限 公司	819 HK	香港证 券交易 所	香港	6,200,000	18,090,713.40	1.11
24	Sinosoft Technolog y Group Ltd.	中国擎天 软件科技 集团有限 公司	1297 HK	香港证 券交易 所	香港	4,000,000	17,917,219.20	1.10
25	China Grand Pharmace utical and Healthcar e Holdings Ltd.	远大医药 健康控股 有限公司	512 HK	香港证 券交易 所	香港	10,000,000	17,033,976.00	1.05
26	TravelSky Technolog y Ltd.	中国民航 信息网络 股份有限 公司	696 HK	香港证 券交易 所	香港	1,800,000	16,210,667.16	1.00
27	Lansen Pharmace utical Holdings Ltd.	朗生医药 控股有限 公司	503 HK	香港证 券交易 所	香港	4,700,000	14,751,738.66	0.91
28	China Nepstar Chain Drugstore	-	NPD US	纽约证 券交易 所	美国	1,000,000	14,061,280.00	0.87
29	Dawnrays Pharmace utical (Holdings ) Ltd.	东瑞制药 (控股)有限 公司	2348 HK	香港证 券交易 所	香港	2,500,000	13,209,217.50	0.81
30	Chaowei	超威动力	951 HK	香港证	香港	3,285,000	13,082,448.44	0.81

	Power Holdings Ltd.	控股有限公司		券交易 所				
31	Essex Bio-technology Ltd.	亿胜生物科技有限公司	1061 HK	香港证券交易所	香港	3,456,000	12,591,515.06	0.78
32	E-House China Holdings Ltd.	-	EJ US	纽约证券交易所	美国	300,000	12,325,017.60	0.76
33	Tuniu Corp.	-	TOUR US	纳斯达克证券交易所	美国	110,000	12,118,377.92	0.75
34	Tarena International Inc.	-	TEDU US	纳斯达克证券交易所	美国	150,000	11,609,726.40	0.72
35	CW Group Holdings Ltd.	-	1322 HK	香港证券交易所	香港	2,500,000	10,547,658.75	0.65
36	Cheetah Mobile Inc.	-	CMCM US	纽约证券交易所	美国	60,000	10,531,287.36	0.65
37	Tian Ge Interactive Holdings Ltd.	天鸽互动控股有限公司	1980 HK	香港证券交易所	香港	2,500,000	9,207,021.75	0.57
38	E-Commerce China Dangdang Inc.	-	DANG US	纽约证券交易所	美国	140,000	7,694,576.96	0.47
39	Jilin Province Huinan Changlong Bio-pharmacy Co. Ltd.	吉林省辉南长生化药业股份有限公司	8049 HK	香港证券交易所	香港	2,500,000	7,531,225.50	0.46
40	China Biologic Products Inc.	-	CBPO US	纳斯达克证券交易所	美国	10,000	7,040,421.76	0.43
41	Phoenix	-	FENG US	纽约证	美国	130,000	6,294,562.56	0.39

	New Media Ltd.			券交易 所				
42	Autohome Inc.	-	ATHM US	纽约证 券交易 所	美国	20,000	6,179,626.88	0.38
43	LightInTheBox Holding Co Ltd.	-	LITB US	纽约证 券交易 所	美国	200,000	5,624,512.00	0.35
44	Noah Holdings Ltd.	-	NOAH US	纽约证 券交易 所	美国	30,000	5,544,423.84	0.34
45	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	呷哺呷哺 餐饮管理 (中国)控股 有限公司	520 HK	香港证 券交易 所	香港	1,400,000	4,802,634.90	0.30
46	Sound Global Ltd.	桑德国际 有限公司	967 HK	香港证 券交易 所	香港	700,000	3,864,189.00	0.24
47	China Animal Healthcare Ltd.	中国动物 保健品有 限公司	940 HK	香港证 券交易 所	香港	850,000	3,485,656.20	0.21

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。本基金持有的金山软件股份有限公司（3888 HK）中，通过港股通持有 1,000,000 股，市值 20,622,151.50 元，占资产净值的 1.27%，港股通证券代码为 03888。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	Hua Han Bio-Pharmaceutical Holdings Ltd.	587 HK	193,868,426.69	77.62
2	Haitong International Securities Group Ltd.	665 HK	165,517,471.53	66.27

3	Dongjiang Environmental Co. Ltd.	895 HK	121,332,154.07	48.58
4	Poly Culture Group Co. Ltd.	3636 HK	110,119,003.57	44.09
5	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	107,943,795.30	43.22
6	Dynagreen Environmental Protection Group Co. Ltd.	1330 HK	100,434,977.17	40.21
7	Kingsoft Corporation Ltd.	3888 HK	90,762,776.46	36.34
8	Guotai Junan International Holdings Ltd.	1788 HK	88,931,080.78	35.61
9	Bloomage BioTechnology Corporation Ltd.	963 HK	63,327,208.98	25.35
10	Sunshine 100 China Holdings Ltd.	2608 HK	61,695,890.00	24.70
11	China Pioneer Pharma Holdings Ltd.	1345 HK	61,512,781.85	24.63
12	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	58,203,410.52	23.30
13	Chinasoft International Ltd.	354 HK	55,206,830.60	22.10
14	Coolpad Group Ltd.	2369 HK	54,462,230.71	21.80
15	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co. Ltd.	8138 HK	51,789,892.42	20.74
16	Kangda International Environmental Co. Ltd.	6136 HK	51,785,542.94	20.73
17	Technovator International Ltd.	1206 HK	48,767,559.22	19.53
18	Cogobuy Group	400 HK	46,550,359.26	18.64
19	Shanghai Prime Machinery Co. Ltd.	2345 HK	46,533,237.70	18.63
20	E-House China Holdings Ltd.	EJ US	39,884,875.48	15.97
21	Peace Map Holding Ltd.	402 HK	34,668,434.51	13.88
22	Guangdong Yueyun Transportation Co. Ltd.	3399 HK	33,109,155.68	13.26
23	Qihoo 360 Technology Co. Ltd.	QIHU US	32,754,233.56	13.11
24	SSY Group Ltd.	2005 HK	32,255,339.29	12.91
25	NetDragon Websoft Inc.	777 HK	29,846,381.60	11.95
26	United Laboratories International Holdings Ltd.	3933 HK	28,268,941.44	11.32
27	Sinosoft Technology Group Ltd.	1297 HK	27,391,203.84	10.97
28	TravelSky Technology Ltd.	696 HK	26,443,716.74	10.59

29	Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd.	950 HK	26,364,384.21	10.56
30	Pacific Online Ltd.	543 HK	26,288,340.36	10.53
31	YY Inc.	YY US	25,944,375.13	10.39
32	Tian Ge Interactive Holdings Ltd.	1980 HK	25,745,202.30	10.31
33	Galaxy Entertainment Group Ltd.	27 HK	25,465,470.39	10.20
34	Beijing Jingneng Clean Energy Co., Ltd.	579 HK	25,137,056.40	10.06
35	Wisdom Holdings Group	1661 HK	24,942,255.63	9.99
36	Sunac China Holdings Ltd.	1918 HK	24,938,212.76	9.98
37	Colour Life Services Group Co., Ltd.	1778 HK	24,325,103.78	9.74
38	Get Nice Holdings Ltd.	64 HK	24,226,262.48	9.70
39	Tarena International Inc.	TEDU US	23,925,671.94	9.58
40	SouFun Holdings Ltd.	SFUN US	23,916,254.22	9.58
41	Value Partners Group Ltd.	806 HK	23,786,429.34	9.52
42	Luoyang Glass Co. Ltd.	1108 HK	23,287,874.55	9.32
43	HC International, Inc.	2280 HK	21,700,890.75	8.69
44	Dawnrays Pharmaceutical (Holdings) Ltd.	2348 HK	20,112,640.05	8.05
45	CIMC Enric Holdings Ltd.	3899 HK	19,318,377.20	7.73
46	Fufeng Group Ltd.	546 HK	18,568,217.40	7.43
47	Sinotrans Ltd.	598 HK	18,552,908.72	7.43
48	China Nepstar Chain Drugstore	NPD US	17,756,367.80	7.11
49	Tianneng Power International Ltd.	819 HK	17,069,905.69	6.83
50	China NT Pharma Group Co. Ltd.	1011 HK	16,915,277.28	6.77
51	Nanjing Panda Electronics Co. Ltd.	553 HK	16,594,036.64	6.64
52	Intime Retail (Group) Co. Ltd.	1833 HK	15,257,271.70	6.11
53	Tong Ren Tang Technologies Co. Ltd.	1666 HK	15,007,379.57	6.01
54	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co. Ltd.	1385 HK	14,806,514.66	5.93
55	China Traditional Chinese Medicine Co. Ltd.	570 HK	13,954,080.76	5.59
56	Chaowei Power Holdings Ltd.	951 HK	13,882,422.26	5.56

57	Canvest Environmental Protection Group Co. Ltd.	1381 HK	13,520,711.69	5.41
58	Chanjet Information Technology Co. Ltd.	1588 HK	13,108,956.37	5.25
59	Shanghai Jin Jiang Int'l Hotels (Group) Co. Ltd.	2006 HK	13,077,058.53	5.24
60	Tuniu Corp.	TOUR US	13,030,365.94	5.22
61	Autohome Inc.	ATHM US	12,728,956.95	5.10
62	New China Life Insurance Co. Ltd.	1336 HK	12,617,197.17	5.05
63	Consun Pharmaceutical Group Ltd.	1681 HK	12,580,740.38	5.04
64	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd.	512 HK	12,195,817.65	4.88
65	China Distance Education Holdings Ltd.	DL US	12,134,600.72	4.86
66	21Vianet Group Inc.	VNET US	11,019,008.48	4.41
67	Xiamen International Port Co. Ltd.	3378 HK	10,914,950.87	4.37
68	CGN Power Co., Ltd.	1816 HK	10,817,340.14	4.33
69	Lansen Pharmaceutical Holdings Ltd.	503 HK	10,747,065.81	4.30
70	LightInTheBox Holding Co. Ltd.	LITB US	10,373,937.93	4.15
71	CW Group Holdings Ltd.	1322 HK	10,299,204.25	4.12
72	CGN Meiya Power Holdings Co., Ltd.	1811 HK	10,046,495.41	4.02
73	BYD Electronic (International) Co. Ltd.	285 HK	9,838,317.31	3.94
74	TCL Communication Technology Holdings Ltd.	2618 HK	9,284,459.97	3.72
75	Fu Shou Yuan International Group Ltd.	1448 HK	9,219,336.96	3.69
76	China Zhongwang Holdings Ltd.	1333 HK	9,153,431.41	3.66
77	Essex Bio-technology Ltd.	1061 HK	9,016,495.70	3.61
78	E-Commerce China Dangdang Inc.	DANG US	9,014,964.98	3.61
79	Q Technology (Group) Co. Ltd.	1478 HK	8,789,212.66	3.52
80	Haichang Holdings Ltd.	2255 HK	8,652,027.54	3.46
81	Cheetah Mobile Inc.	CMCM US	8,414,595.67	3.37
82	Ozner Water International	2014 HK	7,491,902.85	3.00

	Holding Ltd.			
83	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd.	3836 HK	7,458,741.52	2.99
84	Phoenix New Media Ltd.	FENG US	7,204,870.34	2.88
85	Jilin Province Huinan Changlong Bio-pharmacy Co. Ltd.	8049 HK	7,074,000.82	2.83
86	China Power New Energy Development Co. Ltd.	735 HK	7,009,637.42	2.81
87	China Suntien Green Energy Corporation Ltd.	956 HK	6,832,914.03	2.74
88	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	520 HK	6,789,742.95	2.72
89	Huadian Fuxin Energy Corporation Ltd.	816 HK	6,718,144.14	2.69
90	Sinopec Kantons Holdings Ltd.	934 HK	6,692,612.17	2.68
91	Skyworth Digital Holdings Ltd.	751 HK	6,508,103.66	2.61
92	Xinchen China Power Holdings Ltd.	1148 HK	5,983,400.58	2.40
93	New Universe International Group Ltd.	8068 HK	5,957,954.89	2.39
94	BBI Life Sciences Corporation	1035 HK	5,932,873.52	2.38
95	PAX Global Technology Ltd.	327 HK	5,644,510.82	2.26
96	LifeTech Scientific Corporation	1302 HK	5,601,773.75	2.24
97	Xueda Education Group	XUE US	5,031,238.10	2.01

注：1.买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	114,397,439.45	45.80
2	China Pioneer Pharma Holdings Ltd.	1345 HK	62,593,993.89	25.06
3	Hua Han Bio-Pharmaceutical Holdings Ltd.	587 HK	61,462,187.03	24.61
4	Peace Map Holding Ltd.	402 HK	60,901,154.96	24.38
5	Chinasoft International Ltd.	354 HK	58,410,099.47	23.39

6	Guotai Junan International Holdings Ltd.	1788 HK	43,529,778.11	17.43
7	NetDragon Websoft Inc.	777 HK	42,210,283.88	16.90
8	Sunac China Holdings Ltd.	1918 HK	40,688,451.28	16.29
9	E-House China Holdings Ltd.	EJ US	29,375,045.89	11.76
10	Sunshine 100 China Holdings Ltd.	2608 HK	29,113,192.60	11.66
11	Value Partners Group Ltd.	806 HK	26,241,459.23	10.51
12	Wisdom Holdings Group	1661 HK	25,428,490.76	10.18
13	SouFun Holdings Ltd.	SFUN US	24,793,779.16	9.93
14	Pacific Online Ltd.	543 HK	24,068,184.39	9.64
15	Galaxy Entertainment Group Ltd.	27 HK	23,947,738.10	9.59
16	Kangda International Environmental Co. Ltd.	6136 HK	23,944,112.11	9.59
17	SSY Group Ltd.	2005 HK	23,929,277.63	9.58
18	Fufeng Group Ltd.	546 HK	23,803,857.53	9.53
19	Beijing Jingneng Clean Energy Co., Ltd.	579 HK	23,310,173.39	9.33
20	China Traditional Chinese Medicine Co. Ltd.	570 HK	22,357,972.11	8.95
21	Colour Life Services Group Co., Ltd.	1778 HK	22,143,227.85	8.87
22	Luoyang Glass Co. Ltd.	1108 HK	20,975,802.22	8.40
23	China NT Pharma Group Co. Ltd.	1011 HK	20,788,532.34	8.32
24	Nanjing Panda Electronics Co. Ltd.	553 HK	20,128,444.82	8.06
25	HC International, Inc.	2280 HK	19,838,522.32	7.94
26	Sinotrans Ltd.	598 HK	17,808,874.33	7.13
27	CIMC Enric Holdings Ltd.	3899 HK	17,651,177.77	7.07
28	Intime Retail (Group) Co. Ltd.	1833 HK	16,971,790.95	6.79
29	Canvest Environmental Protection Group Co. Ltd.	1381 HK	16,409,524.05	6.57
30	New China Life Insurance Co. Ltd.	1336 HK	15,615,552.08	6.25
31	China Distance Education Holdings Ltd.	DL US	14,772,585.38	5.91
32	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co. Ltd.	1385 HK	14,569,105.99	5.83
33	China Zhongwang Holdings Ltd.	1333 HK	13,792,626.75	5.52
34	Tong Ren Tang Technologies Co. Ltd.	1666 HK	13,763,137.74	5.51
35	Shanghai Jin Jiang Int'l Hotels (Group) Co. Ltd.	2006 HK	13,168,375.49	5.27
36	Qihoo 360 Technology Co. Ltd.	QIHU US	12,695,476.95	5.08
37	Chanjet Information Technology Co. Ltd.	1588 HK	12,386,588.26	4.96
38	Xiamen International Port Co. Ltd.	3378 HK	12,365,627.80	4.95
39	Dawnrays Pharmaceutical (Holdings) Ltd.	2348 HK	12,122,665.46	4.85
40	Tian Ge Interactive Holdings Ltd.	1980 HK	11,722,052.16	4.69
41	21Vianet Group Inc.	VNET US	11,463,654.96	4.59
42	Consun Pharmaceutical Group Ltd.	1681 HK	11,336,992.91	4.54
43	Tarena International Inc.	TEDU US	11,172,678.95	4.47
44	BYD Electronic (International) Co. Ltd.	285 HK	10,185,824.65	4.08
45	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	2318 HK	10,110,329.64	4.05
46	Q Technology (Group) Co. Ltd.	1478 HK	9,957,064.88	3.99
47	CGN Power Co., Ltd.	1816 HK	9,866,621.19	3.95
48	Haitong Securities Co., Ltd.	6837 HK	9,514,439.08	3.81
49	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd.	3836 HK	9,014,744.55	3.61

50	CGN Meiya Power Holdings Co., Ltd.	1811 HK	9,014,332.70	3.61
51	Greentown China Holdings Ltd.	3900 HK	8,910,009.22	3.57
52	Fu Shou Yuan International Group Ltd.	1448 HK	8,564,574.55	3.43
53	YY Inc.	YY US	8,504,733.75	3.41
54	Huadian Fuxin Energy Corporation Ltd.	816 HK	8,396,752.78	3.36
55	TCL Communication Technology Holdings Ltd.	2618 HK	8,130,682.41	3.26
56	Haitong International Securities Group Ltd.	665 HK	7,960,901.25	3.19
57	Haichang Holdings Ltd.	2255 HK	7,938,292.25	3.18
58	Xueda Education Group	XUE US	7,895,982.39	3.16
59	China Power New Energy Development Co. Ltd.	735 HK	7,844,333.01	3.14
60	New Universe International Group Ltd.	8068 HK	7,627,003.42	3.05
61	China Electronics Corporation Holdings Co. Ltd.	85 HK	7,545,138.06	3.02
62	Sinopec Kantons Holdings Ltd.	934 HK	6,762,229.98	2.71
63	Sinosoft Technology Group Ltd.	1297 HK	6,619,253.18	2.65
64	Skyworth Digital Holdings Ltd.	751 HK	6,534,177.08	2.62
65	TravelSky Technology Ltd.	696 HK	6,514,804.24	2.61
66	China Suntien Green Energy Corporation Ltd.	956 HK	6,484,565.56	2.60
67	Autohome Inc.	ATHM US	6,364,074.52	2.55
68	AirMedia Group Inc.	AMCN US	6,235,003.93	2.50
69	PAX Global Technology Ltd.	327 HK	6,192,856.65	2.48
70	Ozner Water International Holding Ltd.	2014 HK	5,874,034.70	2.35
71	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	5,651,199.72	2.26
72	BBI Life Sciences Corporation	1035 HK	5,635,051.54	2.26
73	LifeTech Scientific Corporation	1302 HK	5,571,515.70	2.23
74	CRRC Corporation Ltd.	1766 HK	5,301,557.09	2.12
75	Xinchen China Power Holdings Ltd.	1148 HK	5,220,545.48	2.09
76	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	5,204,442.99	2.08

注：1. 卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,861,712,470.43
卖出收入（成交）总额	1,451,899,582.95

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

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

**7.11.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	206,179,839.66
3	应收股利	3,621,174.47
4	应收利息	6,208.15
5	应收申购款	4,885,773.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	214,692,995.40

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金可以将不高于 20% 的股票资产投资于除在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外）之外的其他企业，本报告期末该部分股票的投资比例为 0。

## 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
24,066	71,555.50	779,682,663.00	45.28%	942,371,922.33	54.72%

### 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	27,414,319.66	1.5920%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	>=100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年1月21日)基金份额总额	592,067,217.31
本报告期期初基金份额总额	315,600,999.47
本报告期基金总申购份额	2,731,298,510.10
减：本报告期基金总赎回份额	1,324,844,924.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,722,054,585.33

## 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

2015 年 6 月 2 日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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		比例	
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	948,386,456.61	22.66%	765,425.91	22.01%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	788,098,510.89	18.83%	692,615.61	19.91%	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	643,568,529.98	15.38%	644,230.07	18.52%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	808,222,334.64	19.31%	481,085.01	13.83%	-
Goldman Sachs International	1	591,537,942.30	14.14%	473,230.41	13.61%	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	1	258,417,758.23	6.18%	258,417.76	7.43%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	74,593,709.85	1.78%	105,441.66	3.03%	-
国信证券	1	47,583,552.41	1.14%	38,066.85	1.09%	-
长江证券	1	24,348,551.12	0.58%	19,478.84	0.56%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	-	-	-	-	-
Shin Han Investment Corp.	1	-	-	-	-	-
Hyundai Securities (Asia) Limited	1	-	-	-	-	-
Daishin Securities	1	-	-	-	-	-

(Asia) Ltd						
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	1	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	1	-	-	-	-	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	1	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
BOBOM International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Daewoo Securities	1	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	-	-	-	-	-
Woori Investment & Securities	1	-	-	-	-	-

注： a) 本报告期内本基金无减少交易账户，于如下证券经营机构 Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited 新增一个交易账户，于如下证券经营机构长江证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司各新增一个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质

量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

## 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旗下部分开放式基金增加龙湾农商银行为销售机构、在龙湾农商银行推出定期定额投资业务及参加龙湾农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-15
2	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年 1 月 19 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-15
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海证券为销售机构、在上海证券推出定期定额投资业务及参加上海证券申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-19
4	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新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、证券时报及基金管理人网站	2015-01-26
5	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莞银行申购及定期定额投资费	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理	2015-01-31

	率优惠活动的公告	人网站	
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加长安银行为销售机构、在长安银行推出定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-02
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泉州银行为销售机构、在泉州银行推出定期定额投资业务及参加泉州银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-10
8	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年 2 月 16 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-11
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加数米基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-05
10	易方达基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-20
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续参加中国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、证券时报及基金管理人网站	2015-03-30
12	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年 4 月 3 日和 4 月 7 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-31
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加利得基金为销售机构、参加利得基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-10
14	易方达亚洲精选股票型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-11
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富滇银行为销售机构、参加富滇银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-13
16	易方达亚洲精选股票型证券投资基金暂停申购、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-14
17	易方达亚洲精选股票型证券投资基金在非直销销售机构及网上交易恢复申购、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-22
18	易方达亚洲精选股票型证券投资基金在直销中心恢复申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-24
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加洛阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-24

20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华兴银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-27
21	易方达基金管理有限公司关于成立易方达国际控股有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-29
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加天津银行为销售机构、参加天津银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-30
23	易方达亚洲精选股票型证券投资基金在直销中心暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-07
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南洋商业银行为销售机构、参加南洋商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-11
25	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-20
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加一路财富官方网站申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-28
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和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、证券时报及基金管理人网站	2015-06-01
28	易方达基金管理有限公司对市场上出现假冒公司客服电话进行诈骗活动的特别提示	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
29	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建投期货为销售机构、参加中信建投期货申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-19
30	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、证券时报及基金管理人网站	2015-06-25
31	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-26
32	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2015 年 7 月 3 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-30

## 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亚洲精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的文件；
- 3.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 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

二〇一五年八月二十六日