易方达中小板指数分级证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇一三年三月三十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2012年9月20日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达中小板指数分级		
基金主代码	161118		
交易代码	161118		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年9月20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	245,757,939.14份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年10月25日		
下属分级基金的基金简称	易方达中小板指数分级	易方达中小板指数分级A	易方达中小板指数分级B
下属分级基金的交易代码	161118	150106	150107
报告期末下属分级基金的份额总额	157,562,932.14份	44,097,503.00份	44,097,504.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式,以实现对业绩比较基准的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资,即按照中小板价格指数的成份股组成及权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以实现对业绩比较基准的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。		
业绩比较基准	中小板价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高预期风险、高预期收益品种。长期而言,其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。		
下属分级基金的风险收益特征	易方达中小板指数分级份额具有高预期风险、相对较高预期收益。	易方达中小板指数分级A份额具有低预期风险、相对预期收益稳定。	易方达中小板指数分级B份额具有高预期风险、相对高预期收益。

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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-38799488	010-66275865

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年9月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	-2,313,946.55
本期利润	-177,285.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0006
本期基金份额净值增长率	0.96%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0091
期末基金资产净值	248,120,138.92
期末基金份额净值	1.0096

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.本基金合同于2012年9月20日生效,2012年度的相关数据和指标按实际存续期计算。

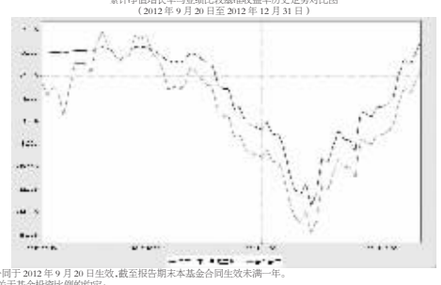
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.74%	1.12%	-0.60%	1.30%	1.34%	-0.18%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.96%	1.05%	-1.51%	1.36%	2.47%	-0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中小板指数分级证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年9月20日至2012年12月31日)



注:1.本基金合同于2012年9月20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)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(2)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(3)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(4)本基金股票资产占基金资产的比例为90%-95%。其中,本基金投资中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的90%;

(5)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(6)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(7)本基金持有的同一信用一信用级别资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(8)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(10)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(11)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(12)本基金投资流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的10%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的3%;因流通受限证券价格波动、基金规模变动、新股申购等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的,基金管理人应当停止主动买入流通受限证券并在流通受限期结束后启动流通受限证券;

(13)本基金投资于股指期货,还应遵循如下投资组合限制:

在任何交易日日终,本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的10%,卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日日终,本基金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;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)占基金资产的比例范围为90%-95%;本基金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%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

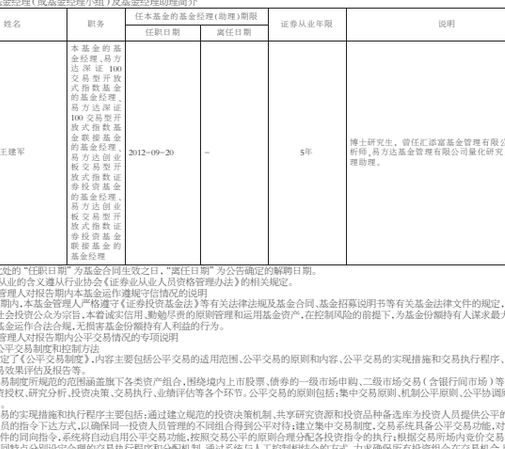
因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

3.本基金的建仓期为六个月,本报告期本基金处于建仓期内。

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0.96%,同期业绩比较基准收益率为-1.51%。

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

易方达中小板指数分级证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图



注:1.本基金合同生效日为2012年9月20日,2012年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定,分级运作期内,本基金(包括易基中小板份额、易基中小板A类份额、易基中小板B类份额)不进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司于2001年4月17日成立,注册资本1.2亿元。截至2012年12月31日,公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、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本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"立诚位规范的前提下,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,为投资者创造最优回报。

截至2012年12月31日,本公司旗下共管理39只开放式基金和1只封闭式基金,具体包括科瑞证券投资基金、易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深300指数证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达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、易方达量化行情股票型证券投资基金、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、易方达双禧增强债券型证券投资基金、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。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		
王建军	本基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理	2012-09-20	-	5年	博士研究生,曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师,易方达基金管理有限公司量化研究员,基金经理助理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易制度》,内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实施措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合,围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等投资管理活动,贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括:集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括:通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会;规范投资人员的指令下达方式,以确保同一投资人员管理的不同组合得到公平对待;建立集中交易制度,交易系统具备公平交易功能,对于满足公平交易执行条件的同向指令,系统将自动启用公平交易功能,按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行;根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制,通过系统与人工控制相结合的方式,力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待;建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制,对于发现的异常问题要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间(纯被动指数基金除外)确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易,投资人员须提供充分的投资决策依据,并经发起反向申请方的首席投资官/投资总监审批、集中交易室审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制,并借助相关技术系统,使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况,持续督促公平交易制度的落实执行,并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司风险管理部与监察部合作,利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对我司旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析,包括旗下各大类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四大类业务之间)的同向交易价差、各组合与其同类资产"其他所有组合"之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。在此基础上,以样本个数、平均溢价率及若为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率等为标准,筛选出需关注或者需说明的事项,及时提醒投资、交易人员注意,并对需要说明的情况要求投资、交易人员进行反馈说明。

运用上述方法,我们对2012年度公司旗下管理的所有组合两两组合之间的同向交易价差情况进行了分析。统计显示,本报告期内,由于基金经理相互独立操作,存在因交易策略、价格限制策略、交易习惯等不同,以及由于市场波动而不同投资人员所管理的基金下单时间不同导致个别组合之间同日同向交易出现比较明显价差的情况,即在10874对组合中有7对组合过去一年的同日同向交易价差符合筛选条件。未发现公司旗下投资组合同向交类同一股票时存在不公平公关现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有23次,原因均为旗下指数基金因被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易。

4.4 管理人对报告期内投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年前三个季度GDP同比增速出现了连续下滑走势,至四季度开始企稳并有所回升。从货币供应的角度来看,M1和M2同比增速在上半年持续下滑之后,从三季度开始出现了持续回升的走势。CPI从年初开始逐步下降,从三季度开始基本保持在一个相对较低的水平。基于年初以来CPI和宏观经济的持续下降,上半年市场对调控放松的预期较高,市场震荡上行。下半年在实体经济持续下滑的影响之下,市场出现了极度悲观的情绪,市场基本处于单边下跌状态,直至四季度宏观经济指标连续呈示回好之后市场才开始企稳并有所反弹。上证指数全年涨幅为3.17%,中小板指数涨幅为-1.38%。

本基金成立于2012年9月20日,本报告期包含了本基金合同约定的建仓期。本基金为中小板指数分级基金,本基金的A、B级子基金于2012年10月25日在深交所成功申请上市交易。报告期内本基金根据实体经济的变化及市场情绪的波动,采取了相对灵活偏谨慎的建仓策略,在报告期内本基金获得了一定的相对业绩基准的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0096元,本报告期份额净值增长率为0.96%,同期业绩比较基准收益率为-1.51%,年化跟踪误差为10.7117%。因本报告期本基金仍处于合同规定的建仓期之内,故跟踪误差等指标仍在调整之中。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段市场,宏观经济体将保持平稳发展,宏观经济政策短期的重点仍将突出稳定经济增长,中长期的重点仍是在保持经济总量平稳快速发展的前提下,通过著力完善体制机制来加速推动经济结构的转型。短期内在适当扩大基础设施投资、拉动内需以及促进出口等方面的政策力度可能仍有所增强,宏观经济在未来一两个季度内继续保持企稳并回升的概率较大。海外经济方面,欧洲主权债务危机虽暂时有所缓解但隐忧仍存,美国经济复苏的趋势相对较为明显。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性和韧性的内生增长力,本基金对中国经济中长期的前景持相对乐观的判断。中小板指数行业分布主要集中在新兴产业,指数成分股市值偏小、成长性高、弹性较大。中小板指数成分股整体估值水平虽然较主板大市值股票相对偏高,但鉴于当前中国经济转型期的大背景和新兴产业未来的发展前景,中小板指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金,中小板指数分级基金将坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对业绩基准的跟踪偏离为投资目标,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望中小板指数分级基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会,为各类不同风险偏好的投资者提供多样性的投资工具。

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,公司资监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。

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.efunds.com.cn网站的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超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	002024	苏宁电器	17,751,178.71	7.15
2	002304	洋河股份	16,670,951.90	6.72
3	002415	海康威视	7,413,143.18	2.99
4	002422	科伦药业	6,785,492.89	2.73
5	002142	宁波银行	6,431,378.27	2.59
6	002155	陕州矿业	6,423,833.33	2.59
7	002241	歌尔声学	5,874,261.19	2.37
8	002236	大华股份	5,676,434.27	2.29
9	002230	科大讯飞	5,214,951.32	2.10
10	002081	金螳螂	5,212,120.22	2.10
11	002202	金风科技	5,003,815.12	2.02
12	002038	双鹭药业	4,866,115.19	1.96
13	002008	大族激光	4,741,632.27	1.91
14	002385	大北农	4,520,596.00	1.82
15	002029	七匹狼	4,406,223.87	1.78
16	002007	华兰生物	4,389,904.62	1.77
17	002310	东方园林	4,365,786.74	1.76
18	002353	杰瑞股份	4,342,434.29	1.75
19	002450	康得新	4,263,691.60	1.72
20	002092	中泰化学	3,936,021.01	1.59

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

8.4.2 累计卖出金额超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	002024	苏宁电器	1,504,110.58	0.61
2	002029	七匹狼	1,442,126.80	0.58
3	002008	大族激光	1,330,656.70	0.54
4	002310	东方园林	1,241,775.28	0.50
5	002037	久联发展	1,027,098.56	0.41
6	002089	新海宜	1,022,620.61	0.41
7	002121	科陆电子	1,010,224.00	0.41
8	002109	兴化股份	977,309.01	0.39
9	002422	科伦药业	820,195.55	0.33
10	002128	露天煤业	791,884.42	0.32
11	002304	洋河股份	772,044.75	0.31
12	002225	濮耐股份	685,370.68	0.28
13	002080	中材科技	657,269.93	0.26
14	002017	东信和平	634,789.41	0.26
15	002232	启明信息	631,720.78	0.25
16	002230	科大讯飞	602,013.77	0.24
17	002110	三钢闽光	524,409.96	0.21
18	002415	海康威视	391,177.18	0.16
19	002142	宁波银行	355,800.00	0.14
20	002068	黑猫股份	330,184.05	0.13

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	256,746,128.57
卖出股票收入(成交)总额	26,234,350.36

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

8.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	815.85
2	应收证券清算款	3,506,408.78
3	应收股利	-
4	应收利息	3,503.32
5	应收申购款	992,063.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,502,791.44

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
易方达中小板指数分级	1,138	138,456.00	10,098,924.40	6.41%	147,464,007.74	93.59%
易方达中小板指数分级A	215	205,104.67	32,651,477.00	74.04%	11,446,026.00	25.96%
易方达中小板指数分级B	762	57,870.74	9,149,959.00	20.75%	34,947,545.00	79.25%
合计	2,115	116,197.61	51,900,360.40	21.12%	193,857,578.74	78.88%

注:对于分级基金,下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额,对于合计数,比例的分母采用下属基金份额的合计数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

易方达中小板指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	10,000,583.00	22.68%
2	中银保险有限公司-传统保险产品	9,068,238.00	20.56%
3	人保投资控股有限公司-委托证券投资户	5,724,131.00	12.98%
4	中煤财产保险股份有限公司-平衡型投资组合	4,026,455.00	9.13%
5	浙商证券-农行-浙商汇金1号集合资产管理计划	2,252,345.00	5.11%
6	丁碧霞	1,531,631.00	3.47%
7	王敬	1,150,000.00	2.61%
8	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托R2007ZX106	699,539.00	1.59%
9	监群芳	497,175.00	1.13%
10	陶静	495,028.00	1.12%

易方达中小板指数分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信信托有限责任公司-新信债1期	3,737,210.00	8.47%
2	浙商证券-农行-浙商汇金1号集合资产管理计划	2,177,446.00	4.94%
3	丁碧霞	1,555,189.00	3.53%
4	邓慧珏	1,000,000.00	2.27%
5	任汉杰	994,029.00	2.25%
6	平安信托有限责任公司-新价值成长一期	850,000.00	1.93%
7	赵元龙	760,859.00	1.73%
8	兴业国际信托有限公司-新价值15期证券投资集合资金信托计划	720,400.00	1.63%
9	广发证券股份有限公司	650,000.00	1.47%
10	梁钦超	508,200.00	1.15%

注:(1)本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

(2)对于易方达中小板指数分级A,易方达中小板指数分级B前十名持有人份额比例的分母采用各自级别的份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	易方达中小板指数分级	0.00	0%
	易方达中小板指数分级A	0.00	0%
	易方达中小板指数分级B	0.00	0%
	合计	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。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达中小板指数分级	易方达中小板指数分级A	易方达中小板指数分级B
基金合同生效日(2012年9月20日)基金份额总额	401,094,727.69	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,575,239.63	-	-
减,基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	160,912,028.18	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-88,195,007.00	44,097,503.00	44,097,504.00
本报告期期末基金份额总额	157,562,932.14	44,097,503.00	44,097,504.00

注:本基金合同生效日为2012年9月20日。拆分变动份额包括本基金场内认购的份额的日动分离和三类份额之间的配对转换份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于2012年3月3日发布公告,自2012年3月1日起聘任肖坚先生、陈志民先生担任公司副总经理;基金管理人于2012年7月7日发布公告,自2012年7月5日起聘任陈彤先生担任公司副总经理;基金管理人于2012年12月5日发布公告,聘任范岳先生担任公司首席产品执行官。

2012年11月15日,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投托管业务部总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2012]961号)。聘任邹绍平为中国建设银行投托管业务部副总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2012]1036号)。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度审计费为50,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	282,980,478.93	100.00%	250,419.95	100.00%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注:a)本报告期内本基金无减少交易单元,新增招商证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中银国际证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司各一个交易单元,新增广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各两个交易单元。

b)本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元并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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	350,000,000.00	15.33%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	1,143,000,000.00	50.07%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	790,000,000.00	34.60%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券