易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第二季度 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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年七月十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达深证100ETF联接
基金主代码	110019
交易代码	110019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月1日
报告期末基金份额总额	10,941,196,421.95份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争最终将年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。
业绩比较基准	深证100价格指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金为深证100ETF的联接基金，主要通过投资于深证100ETF追踪业绩比较基准表现，业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。因此，本基金具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。理论上，本基金预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达深证100交易型开放式指数基金
基金主代码	159901
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年3月24日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月24日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品概况

投资目标	紧密跟踪目标指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即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。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例，以此构建本基金实际的投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证100价格指数
风险收益特征	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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-61,530,511.37
2.本期利润	-697,968,853.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0698
4.期末基金资产净值	7,209,147,531.33
5.期末基金份额净值	0.6589

注：1.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；

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

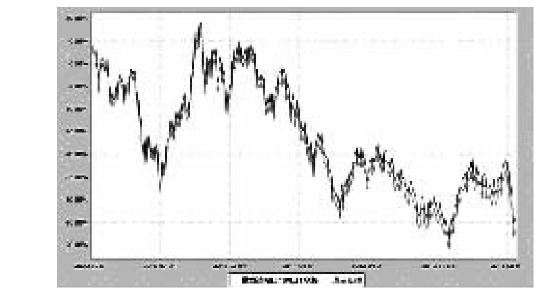
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.24%	1.49%	-10.12%	1.51%	0.88%	-0.02%

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

易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2009年12月1日至2013年6月30日）



注：1.基金合同中关于基金投资比例的约定：

（1）本基金资产中投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（2）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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。

（3）本基金可不受《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%。

（4）法律法规和基金合同规定的其他限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

因证券市场波动、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。法律法规另有规定时，从其规定。

2.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。

3.本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为-34.11%，同期业绩比较基准收益率为-36.86%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理	2009-12-1	–	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。
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、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理	2010-9-27	–	6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"离任日期"为公告确定的解聘日期，林飞的"任职日期"为基金合同生效之日，王建军的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

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 公平交易专项说明

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年二季度GDP同比增速预计较2013年一季度基本持平或略有下滑，二季度宏观经济整体延续了一季度以来的弱复苏格局。从工业增加值角度来看，2013年二季度各月工业增加值同比增速较一季度基本持平并略有下滑。从各项经济活动指标来看，名义社会商品零售总额同比增速较一季度基本持平，固定资产投资同比增速则一季度略有下滑，进出口同比增速与一季度相比总体有所下滑。在二季度整体经济相对一季度更为偏弱的格局之下，CPI整体维持在相对较低的水平。货币供应方面M1和M2同比增速在二季度出现了回落的势头，银行间市场短期利率一度出现剧烈波动，整体货币市场流动性趋紧。在货币供应由相对宽松到趋紧的变化以及整体经济复苏力度更加偏弱的交互影响之下，市场在二季度出现了单边大幅下跌的走势，并且年初以来的大小盘风格分化进一步加剧。上证指数涨幅为-11.51%，深证100价格指数涨幅为-10.67%，作为被动型指数基金，深证100ETF联接基金的单位净值跟随业绩比较基准出现了较大幅度的下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.6589元，本报告期份额净值增长率为-9.24%，同期业绩比较基准收益率为-10.12%，年化跟踪误差为0.7017%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.4.3 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，宏观经济整体复苏趋势具有较大的不确定性，趋势性上升的市场利率对经济复苏的负面冲击仍需进一步观察。经济结构转型进入到一个相对艰难的区间，宏观经济存在面临一些短期阵痛的可能。海外经济方面，欧洲经济整体复苏仍然乏力，美国经济复苏的趋势则相对较为明显。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性和潜在的内生增长力，本基金对中国经济中长期的前景持相对乐观的判断，目前市场整体估值水平合理并处于历史相对偏低区域，当前市场整体估值水平已经对未来经济可能的艰难状况有所预期。同时，深证100指数行业分布均衡合理，指数成分股成长性较高，深证100指数中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金，深证100ETF联接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。期望深证100ETF联接基金为投资者分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	78,276,387.78	1.01
	其中：股票	78,276,387.78	1.01
2	基金投资	6,724,660,051.25	87.08
3	固定收益投资	349,228,000.00	4.52
	其中：债券	349,228,000.00	4.52
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
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	银行存款和结算备付金合计	557,921,922.94	7.22
7	其他各项资产	12,393,496.97	0.16
8	合计	7,722,479,858.94	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	6,724,660,051.25	93.28

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	830,270.42	0.01
B	采矿业	3,685,343.96	0.05
C	制造业	47,193,156.07	0.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	681,302.48	0.01
E	建筑业	501,521.07	0.01
F	批发和零售业	1,299,599.01	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,667,277.88	0.04
J	金融业	6,907,965.68	0.10
K	房地产业	8,957,003.85	0.12
L	租赁和商务服务业	632,810.93	0.01
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,597,646.97	0.04
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	1,311,347.46	0.02
S	综合	1,011,142.00	0.01
	合计	78,276,387.78	1.09

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000538	云南白药	52,927	4,446,397.27	0.06
2	000002	万 科A	443,852	4,371,942.20	0.06
3	002241	歌尔声学	88,629	3,216,346.41	0.04
4	000651	格力电器	102,741	2,574,689.46	0.04
5	000858	五 粮 液	126,762	2,540,310.48	0.04
6	000001	平安银行	222,676	2,220,079.72	0.03
7	002230	科大讯飞	40,644	1,877,752.80	0.03
8	000024	招商地产	73,638	1,787,930.64	0.02
9	002038	双鹭药业	28,897	1,693,364.20	0.02
10	000568	泸州老窖	70,221	1,669,855.38	0.02

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	59,934,000.00	0.83
3	金融债券	289,294,000.00	4.01
	其中：政策性金融债	289,294,000.00	4.01
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	349,228,000.00	4.84

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120228	12国开28	1,400,000	139,930,000.00	1.94
2	120238	12国开38	800,000	79,728,000.00	1.11
3	1001060	10央行票据60	600,000	59,934,000.00	0.83
4	130201	13国开01	400,000	39,780,000.00	0.55
5	120419	12农发19	300,000	29,856,000.00	0.41

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告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。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	306,732.71
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	8,736,178.35
5	应收申购款	3,350,585.91
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,393,496.97

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	9,951,507,594.92
本报告期基金总申购份额	1,657,588,717.26
减：本报告期基金总赎回份额	667,899,890.23
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	10,941,196,421.95

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2.《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3.《易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照；

6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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
二〇一三年七月十七日

易方达增强回报债券型证券投资基金

2013 第二季度 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
报告送出日期：二〇一三年七月十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达增强回报债券	
基金主代码	110017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年3月19日	
报告期末基金份额总额	4,086,068,804.45份	
投资目标	通过主要投资于债券品种，力争为基金持有人创造较高的当期收益和总回报，实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种（含可转换债券）、新股（含增发）申购及套利性股票投资之间的配置：1）基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2）对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；3）基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析，预测新股申购的收益率以及风险；4）套利性投资机会的投资期间及预期收益率；5）股票市场走势的预测；6）可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。	
业绩比较基准	中债总指数(全价)	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
下属两级基金的交易代码	110017	110018
报告期末下属两级基金的份额总额	2,400,003,600.04份	1,686,065,204.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)	
	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
1.本期已实现收益	44,564,107.84	27,785,921.79
2.本期利润	-15,658,067.50	-7,211,363.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0062	-0.0042
4.期末基金资产净值	2,784,222,332.42	1,926,336,851.79
5.期末基金份额净值	1.160	1.143

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、易方达增强回报债券A：

阶段	净值增长率①	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	-0.09%	0.25%	0.03%	0.13%	-0.12%	0.12%

2、易方达增强回报债券B：

阶段	净值增长率①	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	-0.17%	0.25%	0.03%	0.13%	-0.20%	0.12%

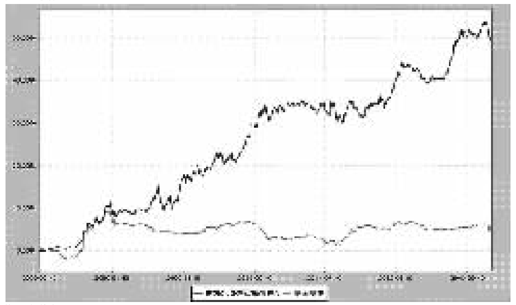
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达增强回报债券型证券投资基金

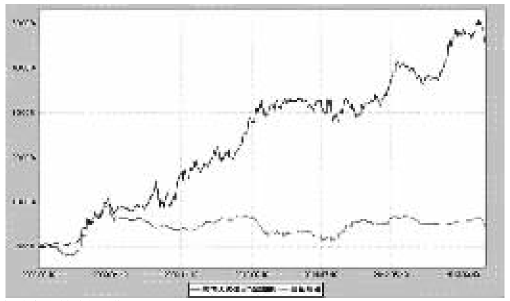
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2008年3月19日至2013年6月30日）

1. 易方达增强回报债券A：



2. 易方达增强回报债券B：



注：1. 基金合同中关于基金投资比例的约定：

（1）债券等固定收益资产的比例不低于基金资产的80%，其中，公司债、企业债、短期融资券、金融债等信用品种不低于固定收益类投资总额的50%，且可转换债券不高于基金资产净值的30%；股票等权益类品种不高于基金资产的20%；基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；

（2）本基金投资于同一公司发行的股票不得超过基金资产净值的10%；

（3）本基金投资于同一公司发行的债券不得超过基金资产净值的10%；

（4）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（5）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%；

（6）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%。；本基金管理人管理的全部证券投资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）本基金在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（8）本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金的总资产，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；

（9）中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制；

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整；对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个交易日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从10个交易日延长到3个月。法律法规如有变更，从其变更。

2. 本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3. 自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为50.65%，同期业绩比较基准收益率为5.50%；B类基金份额净值增长率为47.30%，同期业绩比较基准收益率为5.50%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟鸣远	本基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、固定收益总部总经理、固定收益投资部总经理	2008-3-19	–	13年	硕士研究生，曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益部经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理。
王晓晨	本基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、兼任易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2011-8-15	–	10年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管。

注：1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期，钟鸣远的"任职日期"为基金合同生效之日，王晓晨的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

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 公平交易专项说明

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年二季度监管层加强对金融市场的规范和监管，其力度远超出市场主流参与机构的预期，具体措施如规范银行间交易行为并防止利益输送、要求商业银行严格控制和管理非标准化债权资产投资行为、加强银行间票据监管，到季末对流动性风险的提示、警戒和引导等，一系列操作反映了监管层贯彻执行稳健货币政策的决心。在上期季报中我们已提到加强影子银行监管、清理不规范金融产品虽有利于金融市场提升风险定价能力，提升全社会资源配置效率，但同时也指出针对金融市场的规范和调整可能在短期内阻碍社会融资总量增长，进而影响经济复苏的力度，二季度的宏观经济数据部分印证这一判断。

从具体宏观经济数据看，工业增加值、物价等数据持续低于市场预期，经济平稳复苏的希望暂时落空。此外，市场对新一届政府"盘活存量资金、合理保持货币信贷总量"的宏观政策导向仍存在明显分歧；年初外汇占款大幅增加一度造成流动性泛滥，但资金面在进入6月份后快速趋紧让市场措手不及，证券市场在二季度呈现先上涨后大幅下跌的剧烈波动走势，沪深300指数二季度下跌11.8%，中债全价总指数仅上涨0.025%，债券市场3年以内短期品种收益率较季初大幅上行。

本季度初，我们认为经济走势和政策方向存在较大的不确定性，本基金采取了相对谨慎的策略，保持适度偏低的杠杆，维持适度偏低的债券比例，减持股票和可转债。本季度末，我们判断"现金为王"的局面将在半年报时点之后扭转，本基金增持了信用债和利率债，保持了适度偏高的杠杆。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A类基金份额净值为1.160元，本报告期份额净值增长率为-0.09% ，同期比较基准收益率为0.03% ；本基金 B类基金份额净值为1.143元，本报告期份额净值增长率为-0.17% ，同期业绩比较基准收益率为0.03% 。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年三季度，我们可以看到的是，新一届政府的主要施政思路已经非常明确，并逐步被市场所接受，包括对经济增速下滑的容忍度不断提高，不鼓励出台大规模经济刺激计划，加快推进经济体制改革，通过制度红利的释放以及经济自身的增长动力"稳中求进、稳中有为、稳中提质"。基于以上施政思路，稳健的货币政策将继续贯彻执行，下半年利率水平的中枢很大概率较上半年有所上移。另一方面，也存在一些不确定和存在市场分歧的地方，比如政府对经济增速下滑可以接受的底线在何处、何时需要推"稳"、具体通过什么措施进行经济结构调整以及调整到什么程度、利率中枢上行到什么程度等仍存在较大的不确定性，这些不确定性以及相应预期的变化可能带来风险资产的明显波动。

抛开这些不确定因素，从宏观基本面看，我们认为短期内经济增速下行的风险大于上行风险，通胀水平维持在低位，从大类资产的选择上看，固定收益资产较权益资产安全。基本面因素有利于债券市场，尤其是利率品种以及高等级信用债；随着企业盈利能力恶化和融资环境的收紧，中低等级信用债将受到一定冲击，尤其是周期性恶化行业以及部分过度扩张的民营企业，信用利差水平扩大的可能性较大；对于转债市场，其表现取决于流动性状况、正股以及股票市场整体的表现，在经济环境弱势的大背景下，转债市场难现系统性机会。

基于以上判断，易方达增强回报基金下一阶段的操作将采取谨慎稳妥的投资策略，保持适度偏低的杠杆，适度拉长组合久期，以利率债以及资质较好的信用债作为主要配置；保持原有股票品种，保持较低的可转债仓位并灵活调整仓位；同时努力把握国债、金融债、央行票据等高信用等级债券，企业债、公司债等高收益信用产品，以及可转换债券在不同市场环境下的阶段性机会，力争以理想的投资业绩回报基金持有人。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	28,336,000.00	0.40
	其中：股票	28,336,000.00	0.40
2	固定收益投资	6,758,276,984.21	96.22
	其中：债券	6,640,276,984.21	94.54
	资产支持证券	118,000,000.00	1.68
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	85,546,972.05	1.22
6	其他各项资产	151,411,815.50	2.16
7	合计	7,023,571,771.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	28,336,000.00	0.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	28,336,000.00	0.60

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601633	长城汽车	800,000	28,336,000.00	0.60

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	87,270,660.00	1.85
2	央行票据	–	–
3	金融债券	715,966,000.00	15.20
	其中：政策性金融债	715,966,000.00	15.20
4	企业债券	4,568,684,309.61	96.99
5	企业短期融资券	70,115,000.00	1.49
6	中期票据	329,336,000.00	6.99
7	可转债	868,905,014.60	18.45
8	其他	–	–
9	合计	6,640,276,984.21	140.97

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	2,286,880	237,721,176.00	5.05
2	113003	重工转债	2,060,920	225,299,774.40	4.78
3	122607	12渝地产	1,450,000	154,613,500.00	3.28
4	110015	石化转债	1,320,000	131,762,400.00	2.80
5	126018	08江铜债	1,439,380	128,680,572.00	2.73

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119032	澜沧江4	240,000	24,000,000.00	0.51
2	119030	澜沧江2	200,000	20,000,000.00	0.42
3	119025	侨城03	200,000	20,000,000.00	0.42
4	119031	澜沧江3	190,000	19,000,000.00	0.40
5	119024	侨城02	150,000	15,000,000.00	0.32
6	119027	侨城05	100,000	10,000,000.00	0.21
7	119026	侨城04	100,000	10,000,000.00	0.21

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	322,304.24
2	应收证券清算款	19,327,002.30
3	应收股利	–
4	应收利息	114,746,046.88
5	应收申购款	17,016,462.08
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	151,411,815.50

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	225,299,774.40	4.78
2	110015	石化转债	131,762,400.00	2.80
3	110016	川投转债	101,237,648.00	2.15
4	110018	国电转债	75,309,086.40	1.60
5	110020	南山转债	49,955,999.10	1.06
6	110022	同仁转债	27,596,930.70	0.59
7	113001	中行转债	20,022,000.00	0.43

5.9.5 报告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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
本报告期期初基金份额总额	2,735,051,335.95	1,213,638,457.25
本报告期基金总申购份额	981,758,592.96	1,121,802,191.30
减：本报告期基金总赎回份额	1,316,806,328.87	649,375,444.14
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	2,400,003,600.04	1,686,065,204.41

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准易方达增强回报债券型证券投资基金募集的文件；

2.《易方达增强回报债券型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

4.《易方达增强回报债券型证券投资基金托管协议》；

5.基金管理人业务资格批件和营业执照；

6.基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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
二〇一三年七月十七日

易方达亚洲精选股票型证券投资基金

2013 第二季度 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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年七月十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2013年7月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	105,171,574.60份
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。
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
境外投资顾问	英文名称：无 中文名称：无
境外资产托管人	英文名称：Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited 中文名称：渣打银行(香港)有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,000,112.67
2.本期利润	-11,141,631.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1030
4.期末基金资产净值	82,290,543.30
5.期末基金份额净值	0.782

注：1.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。

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

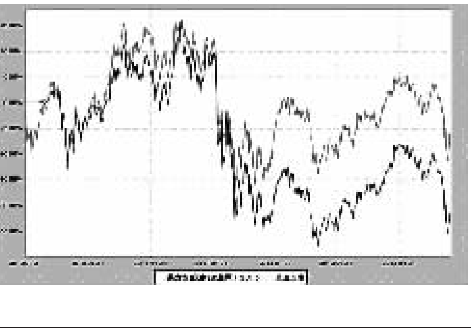
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.74%	1.21%	-7.43%	1.17%	-4.31%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010年1月21日至2013年6月30日）



注：1.基金合同中关于基金投资比例的约定：

（1）本基金主要投资于在亚洲地区（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），对以上两类企业的投资合计不低于股票资产的80%；其他不高于20%的股票资产可以根据投资策略投资于超出前述投资范围的其他市场的企业。上述亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业。

（2）本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%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的比例不高于40%。

（3）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

（4）本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的10%。

（5）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

（6）同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

（7）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（8）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的10%。但持有货币市场基金可以不受上述限制。

（9）同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%。

在基金合同生效6个月后，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓，以符合投资比例限制要求。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个工作日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从30个工作日延长到3个月。

法律法规或中国有关监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，履行适当程序后，基金可依据届时有效的法律法规适时合理地调整上述限制。

2.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

3.本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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-21.80%，同期业绩比较基准收益率为-6.28%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
Guan Yu (管宇)	本基金的基金经理、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2012-1-1	–	6年	硕士研究生，曾任道富环球资产管理公司(SSgA)数量分析师，易方达基金管理有限公司海外投资经理。

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

本基金没有聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

二季度全球经济的复苏势头弱于市场预期。由于欧元区各国实施紧缩的财政政策和金融体系持续地降杠杆，欧元区的经济依然在衰退的边缘挣扎。而中国经济增长偏弱，需求不足，制造业和进出口增速双双下滑。进入5月份，中国人民银行对于流动性的投放偏谨慎，导致国内银根趋紧，企业短期融资成本上升，经济活动下滑。二季度美国的经济维持弱复苏的状态，但是市场预期美联储即将退出量化宽松政策，未来央行资产负债表的收缩将导致全球流动性收紧。由于投资者对于宏观政策和经济走势的悲观预期，资金从新兴市场和大宗商品等资产类别撤离，亚太地区股市从5月下旬开始同步下跌。能源、金融、工业和原材料等周期性的行业的跌幅明显。市场存量资金持续流入需求波动受宏观经济影响较小的医疗保健，消费品和电信传媒行业，进一步推高了这些行业的相对估值。

鉴于亚洲股票市场目前的估值低于历史均值，而企业的股本回报高于历史平均水平，基金经理认为亚洲区股市目前具有长期投资的价值。本基金在二季度的股票仓位维持在90%左右，股票组合在行业配置方面针对金融股和工业股等估值相对较低的周期性行业作了超额配置，低配了原材料、医疗保健和消费品行业，其他行业基本上保持均衡配置。在国别配置上股票组合超配了估值较低中国和韩国等国家/地区，低配了印度、台湾、新加坡和马来西亚等国家/地区。由于本季度中国和韩国这两个超配的市场回调幅度大于区内其他市场，基金组合从国别配置方面取得负超额收益（-1.24%）。本季度亚洲市场结构分化明显，小市值成长股是资金追逐的主要标的。由于基金组合的在选股主要倾向价值型标的，个股选择方面的负超额收益较大，是本季度股票组合落后于业绩基准的主要原因。

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0.782元，本报告期份额净值增长率为-11.74%，同期业绩比较基准收益率为-7.43%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前全球的通胀水平较低，而各主要经济体的复苏尚不稳定。当前市场对于美联储退出量宽政策已形成了充分的预期，但是基金经理判断美联储的退出策略将遵循渐进灵活的原则，会力争避免阻碍实体经济复苏的势头。亚洲地区是全球经济增长最高的地区，大量的贸易和经济活动在区域内部进行，抵御外部风险的能力明显高于其他新兴市场国家。在全球流动性总量依然过剩的环境下，一旦经济增长和宏观政策的不确定性消除，过剩的流动性有条件回流估值相对吸引的亚洲市场，而今年以来不断强化的结构性分化的行情在下半年有逆转的可能。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	74,272,852.94	86.62
	其中：普通股	67,069,724.48	78.22
	存托凭证	7,203,128.46	8.40
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	8,236,392.65	9.61
8	其他各项资产	3,239,632.99	3.78
9	合计	85,748,878.58	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	32,997,029.75	40.10
韩国	13,728,881.40	16.68
美国	7,618,337.10	9.26
泰国	6,637,495.61	8.07
印度尼西亚	5,705,881.21	6.93
新加坡	4,604,831.85	5.60
马来西亚	2,980,396.02	3.62
合计	74,272,852.94	90.26

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。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	6,111,096.52	7.43
材料	1,818,812.45	2.21
工业	9,127,007.18	11.09
非必需消费品	1,829,994.54	2.22
必需消费品	3,317,952.90	4.03
保健	0.00	0.00
金融	28,760,518.36	34.95
信息技术	11,213,115.41	13.63
电信服务	9,014,133.44	10.95
公用事业	3,080,222.14	3.74
合计	74,272,852.94	90.26

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Samsung Electronics Co Ltd	–	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	700	5,082,326.29	6.18
2	China Minsheng Banking Corp Ltd	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	香港	600,000	3,627,488.70	4.41
3	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	香港	53,000	3,419,589.15	4.16
4	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港证券交易所	香港	730,000	3,192,333.44	3.88
5	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	香港	260,000	2,725,475.48	3.31
6	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	–	TSM US	纽约证券交易所	美国	23,000	2,603,457.03	3.16
7	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港证券交易所	香港	900,000	2,286,895.05	2.78
8	China Petroleum & Chemical Corp	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	香港	494,000	2,148,486.52	2.61
9	Hutchison Whampoa Ltd	和记黄埔有限公司	13 HK	香港证券交易所	香港	33,000	2,143,635.53	2.60
10	Chongqing Rural Commercial Bank	重庆农村商业银行股份有限公司	3618 HK	香港证券交易所	香港	800,000	2,096,519.60	2.55

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 报告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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	1,111,410.72
3	应收股利	775,069.08
4	应收利息	233.75
5	应收申购款	8,971.13
6	其他应收款	1,343,948.31
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,239,632.99

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	110,052,559.07
本报告期基金总申购份额	1,480,559.89
减：本报告期基金总赎回份额	6,361,544.36
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	105,171,574.60

§7 备查文件目录

7.1 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；

7.基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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
二〇一三年七月十七日