易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

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
报告期末基金份额总额	1,213,866,852份
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。
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

§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	4,383,865.87
2.本期利润	-124,177,993.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1023
4.期末基金资产净值	1,054,565,335.01
5.期末基金份额净值	0.8688

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

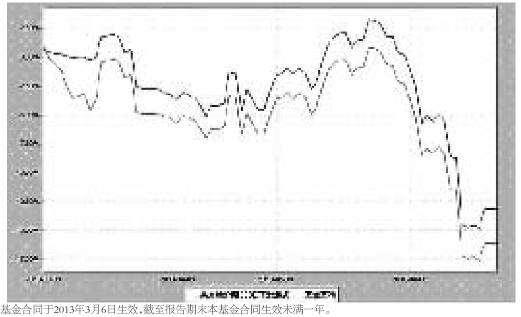
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.71%	1.44%	-11.80%	1.45%	1.09%	-0.01%

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

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金

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

(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联接基金的基金经理、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	2013-3-6	-	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。
林伟斌	本基金的基金经理	2013-3-6	-	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,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,二季度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,二季度上证指数创出近四年来的新低,跌幅达11.51%。市场结构分化进一步加剧,沪深300指数下跌11.8%,创业板指数则上涨16.76%。从行业表现来看,仅电子、信息服务等科技类行业指数出现上涨,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-10.71%,同期业绩比较基准收益率为-11.80%,日跟踪偏离度的均值为0.03%,日跟踪误差为0.04%,年化跟踪误差0.695%,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,中国经济仍将处于相对缓慢的复苏阶段。从中长期看,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。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。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。

§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	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5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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	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

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	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

5.4 报告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。

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

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。

5.7 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
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

5.9.4 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。

5.9.5 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	1,109,826,403
本报告期基金总申购份额	524,040,449
减:本报告期基金总赎回份额	420,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,213,866,852

注:期初基金总份额包含场外份额615,518,988份;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514,040,449份。

§7 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%	

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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

易方达恒生中国企业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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	易方达恒生国企联接(QDII)
基金主代码	110031
交易代码	110031
基金运作方式	契约型开放式、指数基金、联接基金
基金合同生效日	2012年8月21日
报告期末基金份额总额	147,870,632.80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	本基金为易方达恒生中国企业ETF的联接基金,主要通过投资于易方达恒生中国企业ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行易方达恒生中国企业ETF的投资。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率,本基金可投资恒生中国企业指数成份股及备选成份股、恒生中国企业指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算)收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金是ETF 联接基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。 本基金主要通过投资于易方达恒生中国企业ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与恒生中国企业指数的表现密切相关。此外,本基金通过主要投资于易方达恒生中国企业ETF 间接投资于香港证券市场,需承担汇率风险以及境外市场的风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
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:无
	中文名称:无

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510900
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2012年8月9日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年10月22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	交通银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品概况

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。同时,本基金可适当借出证券,以更好实现本基金的投资目标。本基金主要采取完全复制法进行投资,即参考恒生中国企业指数的成份股组成及权重构建股票投资组合,并根据恒生中国企业指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。当市场流动性不足、法规规定本基金不能投资关联方股票等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品进行替代。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率,本基金可投资恒生H股指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在3%以内。
业绩比较基准	恒生中国企业指数(使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金属股票指数基金,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,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的中国企业,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

§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	-711,358.01
2.本期利润	-19,015,660.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1230
4.期末基金资产净值	131,330,207.00
5.期末基金份额净值	0.8881

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

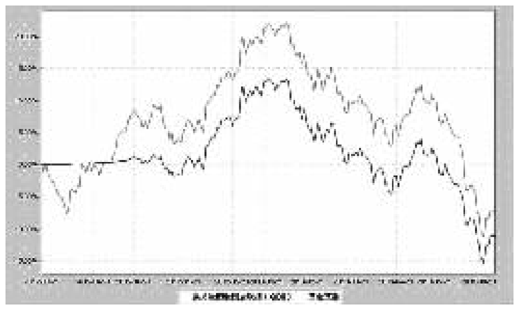
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.36%	1.36%	-14.96%	1.45%	2.60%	-0.09%

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

易方达恒生中国企业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

(2012年8月21日至2013年6月30日)



注:1.本基金合同于2012年8月21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:

本基金资产中投资于目标ETF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%。

若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30个工作日内采用合理的商业措施进行调整。法律法规另有规定时,从其规定。

3.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

4.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。

5.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-11.19%,同期业绩比较基准收益率为-7.02%。

§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		
张胜记	本基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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的基金经理、易方达沪深300指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达50指数证券投资基金的基金经理	2012-8-21	-	8年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员。

注:1.此处的"任职日期"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 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 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

本基金跟踪的恒生中国企业指数成分股均为在香港上市交易的内地公司,企业盈利增速的变化跟随国内经济周期的趋势。2013年第二季度,我国的经济复苏进程不及预期,整体走势疲软。1-5月规模以上工业增加值同比增长9.4%,有所减缓,发电量增速4.0%,反映出整体工业活动缓慢。房地产、汽车行业表现相对较好,前5个月商品房销售面积同比增长35.6%,汽车销量同比增长18%。通胀水平整体温和,1-5月份消费品价格指数CPI同比上涨2.4%,工业品出厂价格指数PPI继续通缩,同比下降达2.1%,工业企业利润增速回落。于是同时,中国央行加强对"影子银行"的清理和规范,流动性明显收紧,资金市场利率全面上扬, 人民币对港币升值幅度加大。另一方面,美国经济复苏态势良好,美股持续走强,日本央行在"安培经济学"政策的影响下,加大量化宽松的力度,日本股市表现较好,导致海外资金持续向发达市场回流。在经济基本面较差、资金外流两方面的影响下,二季度恒生中国企业指数下跌达14.54%(港币),有色金属、煤炭等行业跌幅居前。

本基金是易方达恒生中国企业交易型开放式指数基金(H股ETF)的联接基金,主要投资于H股ETF基金。报告期内,本基金依据申购赎回的情况进行日常操作,紧密跟踪比较基准,控制跟踪误差在较低水平上。

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0.8881元,本报告期份额净值增长率为-12.36%,同期业绩比较基准收益率为-14.96%,年化跟踪误差2.31%,在合同规定的控制范围之内。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

恒生中国企业指数的成分股均为内地公司,上市公司的基本面变化取决于国内经济的增长前景,但市场交易主体主要由欧美等海外资金构成,流动性受欧美等发达经济体的直接影响很大。展望2013年第三季度,流动性紧张带来的资金利率上行,将会打击弱复苏中的国内经济,抬高企业的资金成本,降低企业利润增速。但从长期来看,新一届政府规范影子银行的行为,有利于中国走出粗放式经济增长的老路,有利于经济结构调整和转型升级,有利于国内经济的长期健康稳定发展。香港股市将充分受益国内经济的健康发展,恒生中国企业指数的估值较低,具备一定的投资价值。

长期来看,我国经济仍处于制度改革红利的释放期,仍处于快速的工业化、城镇化以及区域经济一体化进程中,中长期经济增长前景良好,本基金对恒生中国企业指数的长期表现保持乐观。作为完全被动投资基金,下阶段本基金将继续采取紧密跟踪比较基准的投资策略,审慎管理基金资产,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,期望为投资者分享中国经济的未来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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	123,360,232.80	93.32
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	8,130,052.01	6.15
8	其他各项资产	705,163.83	0.53
9	合计	132,195,448.64	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	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	123,360,232.80	93.93

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.6 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。

5.7 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.9 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。

5.10 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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	123,360,232.80	93.93

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	53,966.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,161.17
5	应收申购款	650,035.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	705,163.83

5.11.4 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。

5.11.5 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	166,256,858.43
本报告期基金总申购份额	5,359,660.69
减:本报告期基金总赎回份额	23,745,886.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	147,870,632.80

注:本基金份额变动含易方达恒生国企联接(QDII)人民币、美元现汇、美元现钞份额。

§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恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;

2.《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;

3.《易方达恒生中国企业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

易方达沪深300量化增强证券投资基金

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。

根据中国证监会2013年6月7日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2013]742号),易方达量化衍伸股票型证券投资基金自2013年6月7日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。

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	易方达沪深300量化增强
基金主代码	110030
交易代码	110030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月5日
报告期末基金份额总额	60,031,723.86份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,主要通过运用量化策略进行投资组合管理,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要策略为复制标的指数,投资组合将以标的指数的构成为基础,主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果,结合基金管理人的长期研究与实践应用,利用多因子量化模型预测股票超额回报,在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合,获取超额收益,实现对投资组合的主动增强。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金中的指数增强型基金,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。
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

注:根据中国证监会2013年6月7日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2013]742号),易方达量化衍伸股票型证券投资基金自2013年6月7日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。修订后的《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》自2013年6月7日起正式生效。

§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	2,006,812.09
2.本期利润	-6,918,936.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1158
4.期末基金资产净值	59,615,049.56
5.期末基金份额净值	0.9931

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	-10.37%	1.38%	-11.35%	1.29%	0.98%	0.09%

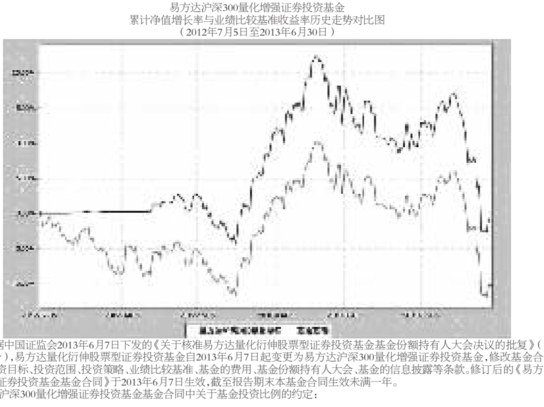
注:根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2013年6月7日起,由"沪深300指数收益率×80%+活期存款利率(税后)×20%"变更为"沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

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

易方达沪深300量化增强证券投资基金

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7月5日至2013年6月30日)



注:1.根据中国证监会2013年6月7日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2013]742号),易方达量化衍伸股票型证券投资基金自2013年6月7日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。修订后的《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》于2013年6月7日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)股票投资比例占基金资产净值的比例为90%-95%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

(2)本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%;

(3)本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)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%;

(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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(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%;

(11)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;

(12)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;

(13)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;

(14)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(15)本基金投资于股指期货,还应遵循如下投资组合限制:

① 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%。

② 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95%。

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。

③ 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)占基金资产净值的比例范围为90%-95%。

④ 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%。

⑤ 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。

(16)因证券、期货市场波动、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。

3.本基金自2013年6月7日起六个月内为建仓期,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-0.69%,同期业绩比较基准收益率为-10.21%。

5.根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2013年6月7日起,由"沪深300指数收益率×80%+活期存款利率(税后)×20%"变更为"沪深300指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

§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		
罗山	本基金的基金经理	2013-1-8	-	16年	博士研究生,曾任巴克莱银行纽约分行衍生品交易部董事、新加坡分行信用产品交易部董事,苏格兰皇家银行香港分行权益及信用产品部总经理,加拿大皇家银行香港分行结构化产品部总经理,诚信资本合伙人,五矿证券公司副总裁,安信证券资产管理部副总经理,易方达基金管理有限公司指数及量化投资部资深投资经理。

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 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

本报告期内管理人根据基金资产配置策略,保持权益类资产的投资比例在较高水平。同时,本基金管理人利用定量方法,综合考虑宏观经济、上市公司基本面、市场情绪与投资者预期等多种因素,建立多因子模型对个股的超额收益进行预测,并在综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素,通过投资组合优化器,构建风险调整后的最优投资组合。自2013年6月7日起,本基金变更为沪深300量化增强型基金,随后管理人严格遵照量化指数增强的投资模式进行操作,以标的指数的构成为基础,主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离标的指数,另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。本报告期内,基金股票组合相对沪深300指数获得了正的超额收益,策略的表现符合预期。

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0.9931 元,本报告期份额净值增长率为-10.37% ,同期业绩比较基准收益率为-11.35% 。

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

2013年二季度后期,证券市场一度大幅下跌,包括沪深300在内的各主要指数相对2013年初的收益已由正转负,由于资金面的紧张和国内经济增速预期下降,短期市场气氛不容乐观。但随着以美国为首的发达国家经济与证券市场的复苏,全球的宏观经济呈现出较为乐观的态势。在此大环境中,预期企业盈利将有所好转,管理人预计市场继续大幅下跌的可能性将比较有限。

下一阶段管理人仍将坚持量化指数增强的投资模式,在严格控制组合跟踪误差的基础上,坚持既定量化策略,利用定量的方法,根据多因子模型的预测,通过优化的方法构建权益类的投资组合,力争在跟踪指数的基础上力求超越指数。与此同时,管理人将结合量化投研团队的研究成果,根据市场变化对量化多因子策略进行动态调整,力争为投资者提供持续稳健的超额收益。

§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	55,323,113.06	91.54
	其中:股票	55,323,113.06	91.54
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	4,897,272.20	8.10
6	其他各项资产	212,698.32	0.35
7	合计	60,433,083.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资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	941,896.00	1.58
B	采矿业	209,086.00	0.35
C	制造业	2,494,056.00	4.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	871,422.00	1.46
E	建筑业	116,162.00	0.19
F	批发和零售业	285,026.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	39,627.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,768.00	0.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	370,815.40	0.62
L	租赁和商务服务业	94,830.00	0.16
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	181,206.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	5,765,894.40	9.67

5.2.2 指数投资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	115,506.00	0.19
B	采矿业	5,346,319.00	8.97
C	制造业	13,121,086.30	22.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,550,865.00	2.60
E	建筑业	1,411,579.00	2.37
F	批发和零售业	1,429,459.00	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	2,243,991.76	3.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	842,004.00	1.41
J	金融业	18,927,580.60	31.75
K	房地产业	3,097,689.00	5.20
L	租赁和商务服务业	393,986.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	221,793.00	0.37
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	855,360.00	1.43
	合计	49,557,218.66	83.13

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	600000	浦发银行	362,600	3,002,328.00	5.04
2	601169	北京银行	317,300	2,528,881.00	4.24
3	600015	华夏银行	254,900	2,299,198.00	3.86
4	601088	中国神华	115,500	1,956,570.00	3.28
5	601318	中国平安	43,100	1,498,156.00	2.51
6	002142	宁波银行	149,500	1,266,265.00	2.12
7	600009	上海机场	105,303	1,255,211.76	2.11
8	600036	招商银行	107,500	1,247,000.00	2.09
9	600837	海通证券	116,800	1,095,584.00	1.84
10	600048	保利地产	102,900	1,019,739.00	1.71

5.3.2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

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	000690	宝新能源	186,600	871,422.00	1.46
2	000682	东方电子	209,000	528,770.00	0.89
3	000998	隆平高科	23,000	476,790.00	0.80
4	002041	登海种业	14,900	316,327.00	0.53
5	600199	金种子酒	20,400	275,604.00	0.46

5.4 报告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。

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

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。

5.7 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,495.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	51,172.19
4	应收利息	901.59
5	应收申购款	142,128.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	212,698.32

5.9.4 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。

5.9.5.1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。

5.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000998	隆平高科	476,790.00	0.80	重大事项停牌

§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	60,559,822.20
本报告期基金总申购份额	3,252,429.64
减:本报告期基金总赎回份额	3,780,527.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,031,723.86

§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量化衍伸股票型证券投资基金募集的文件;

2、中国证监会《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》;

3、《易方达沪深300量化增强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、《易方达沪深300量化增强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