易方达50指数证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

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
送出日期：二〇一三年八月二十八日

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达上证50指数
基金主代码	110003
交易代码	110003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月22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
报告期末基金份额总额	24,899,937,826.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，股票投资部分以上证50指数作为标的指数，资产配置上追求充分投资，不根据对市场时机的判断主动调整股票仓位，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的偏离风险，追求超越基准的收益水平。
业绩比较基准	上证50指数
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险、收益水平高于混合基金、债券基金及货币市场基金。本基金在控制与目标指数偏离风险的同时，力争获得超越基准的收益。长期来看，本基金具有与目标指数相近的风险水平。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	裴学敏
	联系电话	020-38797888	95559
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38799488	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013年1月1日至2013年6月30日）
本期已实现收益	-56,477,616.29
本期利润	-2,249,977,415.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0897
本期基金份额净值增长率	-13.29%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013年6月30日)**
期末可供分配基金份额利润	-0.4523
期末基金资产净值	15,371,400,613.60
期末基金份额净值	0.6173

注：1. 上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。

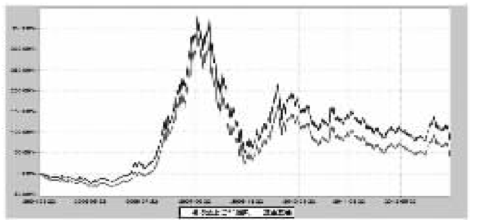
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-12.82%	1.89%	-15.69%	1.97%	2.87%	-0.08%
过去三个月	-9.86%	1.43%	-13.43%	1.54%	3.57%	-0.11%
过去六个月	-13.29%	1.58%	-16.43%	1.69%	3.14%	-0.11%
过去一年	-6.06%	1.38%	-9.16%	1.46%	3.10%	-0.08%
过去三年	-9.53%	1.33%	-14.66%	1.37%	5.13%	-0.04%
自基金合同生效起至今	86.22%	1.70%	44.85%	1.82%	41.37%	-0.12%

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50指数证券投资基金
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
（2004年3月22日至2013年6月30日）



注：1.基金合同中有关投资比例限制的约定：

(1) 由于《证券投资基金管理暂行办法》已经废止，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和本基金合同、招募说明书有关条款的规定，自2004年11月5日起本基金的业绩比较基准和资产配置比例适用如下规定：

1) 基金的业绩比较基准为：上证50指数；

2) 基金的资产配置比例限制为：在目前的法律法规限制下，本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，正常情况下股票投资占基金净资产的比例不低于90%。

(2) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时，基金管理人应在合理期限内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

2.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86.22%，同期业绩比较基准收益率为44.85%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日，注册资本1.2亿元。截至2013年6月30日，公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务资格。

自成立以来，易方达基金管理有限公司秉承"取信于市场，取信于社会"的宗旨，坚持"在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健的增长"的经营理念，努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务，为投资者创造最佳的回报。

截至2013年6月30日，易方达基金管理有限公司共管理1只封闭式基金、44只开放式基金。封闭式基金有科瑞证券投资基金；开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深300指数证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）、易方达月月利理财债券型证券投资基金、易方达双月利理财债券型证券投资基金、易方达天天理财货币市场基金、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金、易方达保证金收益货币市场基金、易方达信用债债券型证券投资基金、易方达沪深300量化增强证券投资基金。同时，公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林飞	本基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深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	2007-02-10	-	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。
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、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理	2012-09-28	-	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"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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年，国内经济增长7.6%，仍处于回落趋势当中。规模以上工业增加值同比增长9.3%，增速比一季度回落0.2个百分点。外需下滑明显，出口增长10.4%，回落8个百分点。大宗商品价格不断下跌，工业生产者出厂价格PPI同比下降2.2%，比去年同期扩大1.6个百分点；终端物价平稳，居民消费价格指数CPI同比上涨2.4%，上游企业的盈利恶化。中央政府主动推进经济结构的转型和升级，对经济向下波动的容忍度加大，报告期内没有采取较大的刺激政策，投资驱动的传统型企业利润增速普遍下滑。另一方面，央行加强对"影子银行"的清理和规范，流动性供给适度收紧，资金市场利率逐步攀升。在上市公司整体盈利增速变差、流动性收紧的影响下，A股市场出现了明显下跌。上证指数跌幅达12.8%，但板块之间的分化加剧，代表经济转型方向的医药、电子、传媒、移动互联网等新兴产业获得市场的热烈追捧，创业板指数涨幅达41.7%。上证50指数的成分股构成以金融、资源、建材等周期股为主，受到的冲击较大，上半年跌幅达16.4%。

本基金是跟踪上证50指数的增强型指数基金，股票仓位根据合同要求一直保持在90%以上，在行业配置上，基本与指数行业权重分布一致。报告期内根据对市场形势的判断，本基金进行了一些结构调整操作，主要是降低周期类股票权重，适当增加具备长期竞争力与长期成长前景股票的配置。取得了较好的效果，造成本基金报告期内的业绩表现超越了基准指数。

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0.6173元，本报告期份额净值增长率为-13.29%，同期基准指数收益率为-16.43%，年化跟踪误差2.47%，在合同规定的控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013下半年，流动性紧张带来的资金利率上行，将会抬高企业的资金成本，打击缓慢复苏中的国内经济，降低企业利润增速。另一方面，新一届政府宏观调控的思路逐渐明确和成熟，调控目标是要避免经济大起大落，使经济运行保持在合理区间，明确调控的"下限"就是稳增长、保就业，"上限"就是防范通货膨胀。这将有利于稳定市场对政府调控政策出台节奏、程度的预期，有利于稳步推进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。

上证50指数以金融、资源、消费等传统行业为主，整体估值较低，股息收益率较高，本基金根据基金合同的要求将继续保持90%以上的股票配置。另一方面，将继续深入研究各成分股的前景，在市场底部震荡的阶段，积极增加具有长期竞争力、业绩增长稳定的成分股配置，平衡组合的结构，力争为投资者带来超越基准指数的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013年上半年度，基金托管人在易方达50指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2013年上半年度，易方达基金管理有限公司在易方达50指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2013年上半年度，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达50指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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50指数证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产：		
银行存款	702,935,065.37	284,513,971.32
结算备付金	5,071,436.17	9,036,983.81
存出保证金	1,262,495.85	250,000.00
交易性金融资产	14,911,599,929.50	18,870,353,953.76
其中：股票投资	14,033,612,401.00	18,032,432,953.76
基金投资	-	-
债券投资	877,987,528.50	837,921,000.00
资产支持证券投资	-	-
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	16,290,204.10	5,674,062.16
应收股利	69,174,632.03	-
应收申购款	6,692,273.78	107,892,834.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	15,713,026,036.80	19,277,721,805.13
负债和所有者权益	**本期末 2013年6月30日**	**上年度末 2012年12月31日**
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	135,722,119.99	72,138,806.32
应付赎回款	184,012,113.21	17,954,768.37
应付管理人报酬	15,996,677.41	17,475,936.28
应付托管费	2,666,112.90	2,912,656.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,999,303.42	3,921,883.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,229,096.27	702,126.67
负债合计	341,625,423.20	115,106,176.70
所有者权益：		
实收基金	24,899,937,826.69	26,918,887,679.78
未分配利润	-9,528,537,213.09	-7,756,272,051.35
所有者权益合计	15,371,400,613.60	19,162,615,628.43
负债和所有者权益总计	15,713,026,036.80	19,277,721,805.13

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.6173元，基金份额总额24,899,937,826.69份。

6.2 利润表

会计主体：易方达50指数证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-2,115,307,872.63	1,402,305,245.25
1.利息收入	14,602,334.64	23,600,306.37
其中：存款利息收入	896,986.05	601,372.73
债券利息收入	13,694,422.70	22,773,389.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,925.89	225,543.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	60,387,952.35	-598,950,990.08
其中：股票投资收益	-207,551,755.49	-895,437,320.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-636,104.55	-1,647,090.17
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	268,575,812.39	298,133,420.53
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-2,193,499,798.95	1,974,682,121.80
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	3,201,639.33	2,973,807.16
减：二、费用	134,669,542.61	155,927,512.73
1. 管理人报酬	105,534,187.66	123,155,830.85
2. 托管费	17,589,031.26	20,525,971.76
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,303,177.54	11,475,058.38
5. 利息支出	-	538,778.38
其中：卖出回购金融资产支出	-	538,778.38
6. 其他费用	243,146.15	231,873.36
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-2,249,977,415.24	1,246,377,732.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-2,249,977,415.24	1,246,377,732.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达50指数证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,918,887,679.78	-7,756,272,051.35	19,162,615,628.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,249,977,415.24	-2,249,977,415.24
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）	-2,018,949,853.09	477,712,253.50	-1,541,237,599.59
其中：1.基金申购款	3,758,650,371.96	-1,163,575,291.12	2,595,075,080.84
2.基金赎回款	-5,777,600,225.05	1,641,287,544.62	-4,136,312,680.43
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）	24,899,937,826.69	-9,528,537,213.09	15,371,400,613.60
项目	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日**		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	31,318,749,230.28	-11,884,985,651.67	19,433,763,578.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,246,377,732.52	1,246,377,732.52
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）	-2,987,102,505.41	925,055,883.75	-2,062,046,621.66
其中：1.基金申购款	2,837,182,772.81	-922,557,454.49	1,914,625,318.32
2.基金赎回款	-5,824,285,278.22	1,847,613,338.24	-3,976,671,939.98
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）	28,331,646,724.87	-9,713,552,035.40	18,618,094,689.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：叶俊英，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达50指数证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监基金字[2004]13号文《关于同意易方达50指数证券投资基金设立的批复》的批准，由易方达基金管理有限公司作为基金发起人，向社会公开发行募集并于2004年3月22日正式成立，首次设立募集规模为5,048,902,330.26份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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于2013年6月30日的财务状况以及2013年半年度的经营成果和净值变动情况。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")	基金管理人股东、基金销售机构
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,790,384,343.74	26.01%	2,496,302,434.87	36.73%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	41,808,920.10	100.00%	78,993,653.20	100.00%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,626,104.62	25.96%	943,073.90	47.20%
关联方名称	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日**			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	2,114,387.05	36.47%	922,459.72	24.51%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	105,534,187.66	123,155,830.85
其中：支付销售机构的客户维护费	20,275,590.60	20,626,346.27

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.2%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,589,031.26	20,525,971.76

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日**					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	38,986,476.17	-	-	-	50,000,000.00	42,866.23

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	605,009,506.23	605,009,506.23
期间申购/买入总份额	-	-
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	605,009,506.23	605,009,506.23
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.43%	2.14%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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
易方达教育基金会	39,329,962.07	0.16%	-	-

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
交通银行	702,935,065.37	830,593.94	209,193,638.94	545,745.91

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.2 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
600547	山东黄金	2013-04-03	重大事项	24.30	2013-07-01	28.77	8,134,046	320,930,677.50	197,657,317.80	-
601989	中国重工	2013-05-17	重大事项	4.52	-	-	9,609,366	68,214,806.02	43,434,334.32	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为13,973,053,277.38元，属于第二层级的余额为938,546,652.12元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级18,032,432,953.76元，第二层级837,921,000.00元，无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

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

(iv)第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金本报告期初未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012年期初：同)；本基金本期净转入/(转出)第三层级0.00元(2012年度：无)。

(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	14,033,612,401.00	89.31
	其中：股票	14,033,612,401.00	89.31
2	固定收益投资	877,987,528.50	5.59
	其中：债券	877,987,528.50	5.59
	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	708,006,501.54	4.51
6	其他各项资产	93,419,605.76	0.59
7	合计	15,713,026,036.80	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,215,056,324.50	7.90
C	制造业	2,510,577,816.19	16.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	475,143,145.23	3.09
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	237,908,232.54	1.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	180,119,668.56	1.17
J	金融业	7,961,644,654.40	51.80
K	房地产业	399,020,818.42	2.60
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	160,853,130.72	1.05
	合计	13,140,323,790.56	85.49

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	849,321,916.44	5.53
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	38,479,105.60	0.25
K	房地产业	5,487,588.40	0.04
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	893,288,610.44	5.81

7.3 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

7.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	114,357,537	1,326,547,429.20	8.63
2	600016	民生银行	148,381,301	1,271,627,749.57	8.27
3	601166	兴业银行	78,806,049	1,163,965,343.73	7.57
4	600519	贵州茅台	5,967,505	1,147,968,936.85	7.47
5	601318	中国平安	27,767,098	965,184,326.48	6.28
6	600000	浦发银行	77,174,050	639,001,134.00	4.16
7	601398	工商银行	128,556,568	516,797,403.36	3.36
8	600837	海通证券	49,860,388	467,690,439.44	3.04
9	601668	中国建筑	126,367,981	413,223,297.87	2.69
10	600048	保利地产	40,264,462	399,020,818.42	2.60

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网站的半年度报告正文。

7.3.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	9,397,019	235,489,296.14	1.53
2	000895	双汇发展	5,663,534	217,706,246.96	1.42
3	600518	康美药业	8,964,316	172,383,796.68	1.12
4	600600	青岛啤酒	3,456,673	131,284,440.54	0.85
5	600252	中恒集团	6,661,249	92,458,136.12	0.60

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网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	342,665,776.31	1.79
2	601166	兴业银行	273,612,256.03	1.43
3	600837	海通证券	236,433,538.63	1.23
4	601006	大秦铁路	191,851,861.07	1.00
5	000895	双汇发展	162,803,577.00	0.85
6	600518	康美药业	161,438,914.86	0.84
7	601688	华泰证券	160,381,763.70	0.84
8	600348	阳泉煤业	137,696,686.49	0.72
9	600600	青岛啤酒	124,276,605.28	0.65
10	600252	中恒集团	111,058,691.49	0.58
11	601318	中国平安	108,132,155.70	0.56
12	601669	中国水电	76,043,637.50	0.40
13	600030	中信证券	68,444,440.19	0.36
14	600104	上汽集团	63,667,504.63	0.33
15	600050	中国联通	63,267,557.56	0.33
16	601398	工商银行	61,331,447.18	0.32
17	600999	招商证券	45,285,743.39	0.24
18	600016	民生银行	41,400,449.05	0.22
19	601169	北京银行	36,246,224.51	0.19
20	601668	中国建筑	27,857,000.00	0.15

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	386,119,855.63	2.01
2	600016	民生银行	354,312,246.56	1.85
3	600111	包钢稀土	339,179,277.49	1.77
4	600015	华夏银行	318,606,518.17	1.66
5	601628	中国人寿	202,803,067.08	1.06
6	601601	中国太保	190,625,510.38	0.99
7	600000	浦发银行	153,311,140.05	0.80
8	601398	工商银行	149,679,153.17	0.78
9	600030	中信证券	146,065,138.84	0.76
10	601166	兴业银行	141,346,434.45	0.74
11	601668	中国建筑	128,430,435.49	0.67
12	601699	潞安环能	126,017,967.79	0.66
13	600549	厦门钨业	122,265,069.06	0.64
14	601901	方正证券	118,135,773.38	0.62
15	601318	中国平安	106,122,710.35	0.55
16	601899	紫金矿业	105,907,527.30	0.55
17	600123	兰花科创	91,240,234.79	0.48
18	601288	农业银行	88,677,197.79	0.46
19	601088	中国神华	85,662,721.00	0.45
20	000651	格力电器	84,474,378.24	0.44

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,646,192,314.77
卖出股票收入（成交）总额	4,238,090,156.85

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	697,455,000.00	4.54
	其中：政策性金融债	697,455,000.00	4.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	180,532,528.50	1.17
8	其他	-	-
9	合计	877,987,528.50	5.71

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120245	12国开45	3,000,000	298,410,000.00	1.94
2	120228	12国开28	2,000,000	199,900,000.00	1.30
3	110023	民生转债	1,315,830	136,780,528.50	0.89
4	120238	12国开38	1,000,000	99,660,000.00	0.65
5	120419	12农发19	500,000	49,760,000.00	0.32

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

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

7.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,262,495.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	69,174,632.03
4	应收利息	16,290,204.10
5	应收申购款	6,692,273.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,419,605.76

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	43,752,000.00	0.28

7.10.5.1 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。

7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,145,313	21,740.73	2,653,509,524.61	10.66%	22,246,428,302.08	89.34%

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	502,289.08	0.002%

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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年3月22日）基金份额总额	5,048,902,330.26
本报告期期初基金份额总额	26,918,887,679.78
本报告期基金总申购份额	3,758,650,371.96
减：本报告期基金总赎回份额	5,777,600,225.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,899,937,826.69

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	56,661,409.53	0.82%	51,584.18	0.82%	-
渤海证券	1	790,119,212.65	11.48%	719,324.33	11.48%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	1,095,475,261.78	15.91%	997,319.29	15.92%	-
广发证券	3	1,790,384,343.74	26.01%	1,626,104.62	25.96%	-
国都证券	1	222,385,398.28	3.23%	202,459.83	3.23%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	416,278,352.70	6.05%	378,978.85	6.05%	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	1,104,093,377.41	16.04%	1,005,167.21	16.05%	-
申银万国	1	321,819,317.87	4.67%	292,982.79	4.68%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	955,585,433.43	13.88%	869,961.21	13.89%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	131,480,364.23	1.91%	119,699.92	1.91%	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	41,808,920.10	100.00%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一三年八月二十八日