



信息披露

2014年1月21日 星期二
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B132

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年一月二十一日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告等，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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金获得回报。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资者应当认真阅读本报告中关于投资业绩表现的说明。
本报告所载数据截至2013年12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	易方达标普全球高端消费品指数增强(QFII)
基金代码	150802
交易代码	150802
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月4日
报告期末基金份额总额	63,574,268.46份
投资目标	本基金跟踪标普全球高端消费品指数，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以量化投资为主，并辅以有经验的主动管理。本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股及权重为基础，并适当增加基本面研究进行主动管理。在投资组合构建上，基金管理人运用量化模型对指数成份股进行筛选，力争将投资组合的年化跟踪误差控制在1%以内，从而力争实现基金资产净值长期稳定增值，并力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	标普全球高端消费品指数（税后净值，使用欧元，年复利）
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货币市场基金、债券基金和混合基金。本基金在控制跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。同时，本基金具有与业绩比较基准相似的风险水平。
风险收益特征	本基金主要投资于全球高端消费品基金，跟踪误差小，风险低，国际风险和商品风险是本基金特有的风险。
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	中文名称：香港中银国际(香港)有限公司 英文名称：Bank of China (Hong Kong) Limited

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期已实现收益	1,211,366.04
2.本期利润	5,931,440.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.1010
4.期末基金资产净值	90,223,806.30
5.期末基金份额净值	1.4151

注：1.本报告基金净值表现不包括持有人认购及交易基金的各项费用，计入费用后实现的收益水平可能低于所列数字。
2.本期本基金收益基金未实现收益，投资收益，其他收入（不含公允价值变动损益）和资产减值损失的金额。本期利润为本期基金收益加上本期公允价值变动收益。

5.4 投资组合报告

5.4.1 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.2 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

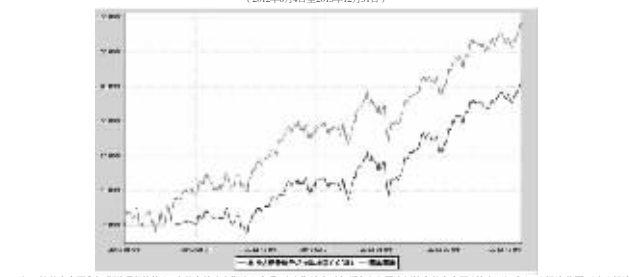


图1：本基金自合同生效以来的净值表现。本基金自合同生效以来，净值表现良好，净值稳步增长。图2：本基金自合同生效以来的净值表现。本基金自合同生效以来，净值表现良好，净值稳步增长。

5.4.3 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.4 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.5 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.6 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.7 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.8 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.9 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.10 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.11 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.12 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.13 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.14 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.15 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.16 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.17 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.18 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.19 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.20 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.21 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.22 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.23 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.24 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.25 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.26 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.27 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.28 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.29 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.30 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.4.31 报告期末基金资产组合情况

类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
权益投资	85,546,513.27	92.63
固定收益投资	83,479,147.41	96.53
其他投资	982,163.58	0.98
银行存款	1,216,269.02	1.32
其他资产	1,477,680.00	1.54
合计	92,015,782.27	100.00

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告等，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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金获得回报。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资者应当认真阅读本报告中关于投资业绩表现的说明。
本报告所载数据截至2013年12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	易方达标普全球高端消费品指数增强(QFII)
基金代码	150802
交易代码	150802
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月4日
报告期末基金份额总额	63,574,268.46份
投资目标	本基金跟踪标普全球高端消费品指数，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以量化投资为主，并辅以有经验的主动管理。本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股及权重为基础，并适当增加基本面研究进行主动管理。在投资组合构建上，基金管理人运用量化模型对指数成份股进行筛选，力争将投资组合的年化跟踪误差控制在1%以内，从而力争实现基金资产净值长期稳定增值，并力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	标普全球高端消费品指数（税后净值，使用欧元，年复利）
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货币市场基金、债券基金和混合基金。本基金在控制跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。同时，本基金具有与业绩比较基准相似的风险水平。
风险收益特征	本基金主要投资于全球高端消费品基金，跟踪误差小，风险低，国际风险和商品风险是本基金特有的风险。
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	中文名称：香港中银国际(香港)有限公司 英文名称：Bank of China (Hong Kong) Limited

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年10月1日至2013年12月31日)
1.本期已实现收益	1,211,366.04
2.本期利润	5,931,440.77
3.加权平均基金份额本期利润</	