

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:二〇一三年八月二十八日

■ 重要提示
基金管理人的董事会、董事声明本基金报告期所载的信息不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担责任;基金的法律意见书由本年度报告经三分之二以上独立董事签章并由董事长签署。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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,投资者欲了解详细内容,请阅读半年度报告正文。
本报告期中财务数据未经审计。
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:易方达中小板指数分级证券投资基金
基金主代码:161118
交易代码:161118
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
报告期基金份额总额:78,781,597.76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:18,138,082.76份 30,321,737.00份 30,321,738.00份

2.2 基金产品说明

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,追求超越偏股型指数的跟踪误差最小化。

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相应调整,以实现对业绩比较基准的紧密跟踪,追求超越偏股型指数的跟踪误差最小化。

本基金的业绩比较基准:95%×恒生指数存托凭证+5%×人民币存托凭证。

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指

标的指数的指数组合,并以标的指数所代表的股票市场的

风险作为基金的风险特征。

本基金为中小板指数分级A份额具有低预期风险,其高预期

风险,相对高预期风险、相对预期收益风险,相对高预期收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

名称:张南
姓名:田青
信息披露负责人:020-38797888 010-67595096
电子邮箱:efunds.com.cn
客户服务电话:400 881 8088 010-67595096
传真:020-38799488 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互连

http://www.efunds.com.cn
联网网址

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 主要财务数据和财务指标

金额单位:人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应收赎回款 0.00 0.00

应收申购款 992,063.49 0.00

应付赎回款 0.00 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应收赎回款 0.00 0.00

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

衍生金融资产 78,160,606.05 230,734,554.91

应收利息 0.00 0.00

应收股利 3,506,408.78 0.00

应收申购款 1,378.90 3,03.32

应付赎回款 992,063.49 0.00

应付申购款 85,333,487.99 250,957,771.45

负债和所有者权益 85,333,487.99 250,957,771.45

本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日

货币基金 6,936,889.89 14,319,869.21

银行存款 185,493.30 1,400,555.89

存出保证金 49,119.85 81.85

交易性金融资产 7