

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

2013 年度报告摘要

公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,上述公平交易制度和操作方法总体执行情况良好。公司风险管理部与运营部合作,利用统计分析的方法工具,按照不同的时间窗口(包括当日、3日内、5日内),对我们旗下所有投资组合2013年度的期间交易交易情况进行了分析,包括旗下各类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四类业务)的期间交易价差、各组合与同类资产其他所有组合之间、同类型资产组合之间、同类型资产组合与不同资产组合之间的期间交易价差,并分别就公平交易制度的执行情况进行了分析,未发现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发生本基金可能導致不公平交易和利益輸送的异常交易。

报告期内,本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超过该证券当日成交量的9%的交易共有17次,其中16次为因该证券当日成交量较小,全年规模以上行业市值占比超7%,与COPX走势同步,且因该资产“投资价值”增长10.6%,溢价回落,消费增长基本平稳,在中央银行行约的驱动下,高端消费下降,房地产、汽车等耐用消费品增长较快。货币政策持续宽松,全年新增信贷9.7万亿,社会融资规模1.37万亿,使得市场9.7%,较11月明显回落,银监会出台清理“影子银行”的严厉政策,加上利率市场化进程的加快,使得信用无风险利率持续处于高位。A股市场在经济回落、货币政策宽松的环境下,震荡下跌,上证指数全年下跌6.75%,板块间分化加剧,智能手机、移动互联网的快速兴起,开始对经济生活产生重大影响,受益于移动互联网技术服务的相关行业如移动设备、游戏、视频、轻工等行业在报告期内出现高速增长。医药生物、大众消费、家用电器等稳增长行业也有不俗表现,环保、自贸区概念等出现主题投资机会。传统周期类行业全面下挫,金融、地产、有色、煤炭、建材等行业跌幅普遍超过10%以上。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

2013年中国国内生产总值GDP增长7.7%,连续三年下降。上半年经济回落较快,二季度GDP增速一度回落至7.4%,下半年政府“稳增长”下,下调调控力度逐渐明晰,经济企稳出现了复苏态势。全年规模以上工业增加值同比增长7.8%,与COPX走势同步,且因该资产“投资价值”增长10.6%,溢价回落,消费增长基本平稳,在中央银行行约的驱动下,高端消费下降,房地产、汽车等耐用消费品增长较快。货币政策持续宽松,全年新增信贷9.7万亿,社会融资规模1.37万亿,使得市场9.7%,较11月明显回落,银监会出台清理“影子银行”的严厉政策,加上利率市场化进程的加快,使得信用无风险利率持续处于高位。A股市场在经济回落、货币政策宽松的环境下,震荡下跌,上证指数全年下跌6.75%,板块间分化加剧,智能手机、移动互联网的快速兴起,开始对经济生活产生重大影响,受益于移动互联网技术服务的相关行业如移动设备、游戏、视频、轻工等行业在报告期内出现高速增长。医药生物、大众消费、家用电器等稳增长行业也有不俗表现,环保、自贸区概念等出现主题投资机会。传统周期类行业全面下挫,金融、地产、有色、煤炭、建材等行业跌幅普遍超过10%以上。

4.5 报告期内基金投资组合的行业分布

本基金的投资组合中,行业分布与沪深300指数和行业权重基本一致。

4.6 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.7 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.8 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.9 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.10 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.11 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.12 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.13 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.14 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.15 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.16 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.17 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.18 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.19 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.20 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.21 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.22 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.23 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.24 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.25 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.26 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.27 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.28 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

4.29 报告期内基金投资组合的行业分布

截至报告期末,本基金份额净值为2.3424元,本报告期份额净值增长率为3.76%,同期业绩比较基准收益率为3.03%,年化跟踪误差0.53%,在合同规定的目标跟踪范围之内。

交易型开放式指数证券投资基金合同》公开募集。经中国证监会备案,《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2010年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,752,478.06份基金份额,其中认购基金份额折合4,000份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期不限。本基金基金管理人易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与上证中盘指数进行对比,根据《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,易方达基金管理有限公司确定2010年3月28日为本基金的首个估值日。当日上证中盘指数收盘值为2706.88点,本基金资产净值为2,562.624,152.24元,折算前基金份额总额为2,752,478.06份,折算前基金份额净值为0.931元。根据基金估值计算公式,基金份额折算比例为0.3439471,折算后基金份额总额为6,485,089.6份,折算后基金份额净值为2.707元。易方达基金管理有限公司已根据上述计算结果,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2010年5月31日进行了变更登记。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则——基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释和其他相关规定以下合称“企业会计准则”、中国证监会颁布的证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《信息披露内容和格式要求》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他相关规定的说明

7.4.4 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.5 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.6 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.7 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.8 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.9 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.10 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.11 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.12 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.13 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.14 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.15 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.16 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.17 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.18 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.19 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.20 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.21 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.22 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.23 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.24 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.25 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.26 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.27 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.28 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.29 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.30 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.31 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.32 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.33 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.34 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.35 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.36 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.37 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.38 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.39 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.40 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.41 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.42 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.43 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.44 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.45 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.46 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.47 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.48 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.49 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.50 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.51 报告期内基金投资组合的行业分布

7.4.52 报告期内基金投资组合的行业分布

12月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	占基金资产净值比例(%)
1	600199	金发科技	5,185,634	21,468,524.76	3.02
2	600690	青岛啤酒	882,425	17,287,287.50	2.42
3	600000	长江电力	2,675,577	16,509,664.64	2.38
4	600089	特变电工	1,424,569	15,271,379.68	2.15
5	600535	天士力	334,942	14,565,662.38	2.02
6	600276	恒顺医药	367,658	13,963,650.84	1.96
7	600739	辽宁成大	737,620	12,937,854.80	1.82
8	600196	华鲁医药	617,650	12,099,763.50	1.70
9	600309	万华化学	584,354	12,066,327.80	1.70
10	600011	华能国际	2,270,285	11,887,237.30	1.61

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网站的年度报告全文。

13报告期内基金投资组合的重大变动

8.4.1 买入/卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	600315	东方明珠	16,442,011.90	1.37
2	600019	宝钢股份	11,425,296.33	0.95
3	600804	东方明珠	11,134,387.25	0.93
4	600832	东方明珠	9,332,399.23	0.78
5	600332	白云山	8,897,794.79	0.74
6	600352	浙江龙盛	8,608,001.03	0.73
7	600049	上海机场	7,764,158.41	0.65
8	600597	华鲁医药	7,734,148.68	0.65
9	600108	亚细亚	7,675,707.55	0.64
10	600886	国电电力	7,619,925.54	0.64
11	600808	中国铝业	7,237,796.49	0.60
12	600778	东方明珠	7,209,749.40	0.60
13	601069	中国核电	6,825,178.32	0.57
14	601088	中国能源	6,792,866.45	0.57
15	601088	中国能源	6,608,367.42	0.55
16	600008	首创股份	5,381,097.04	0.45
17	600062	华鲁医药	5,369,322.44	0.45
18	600448	阳澄湖	5,293,10.42	0.44
19	600406	中国铝业	5,006,347.35	0.42
20	600765	中航工业	4,938,466.73	0.41

注:买入/卖出金额按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不包括相关交易费用。

8.4.2 卖出/买入金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	600083	金发科技	21,435,068.01	1.79
2	600518	康美药业	20,796,949.09	1.74
3	600999	招商证券	16,985,585.55	1.42
4	600966	中国铝业	13,216,948.94	1.10
5	600237	百润股份	13,177,786.82	1.10
6	600804	东方明珠	10,211,083.07	0.85
7	601788	光大证券	9,985,733.63	0.83
8	601117	光大证券	9,715,128.15	0.81
9	600332	白云山	9,203,699.42	0.77
10	600049	上海机场	8,059,183.31	0.67
11	600642	首创股份	8,021,665.05	0.67
12	601018	亚细亚	6,277,792.44	0.52
13	601018	亚细亚	5,892,442.52	0.49
14	601088	中国能源	5,801,732.01	0.48
15	600568	贵州茅台	5,097,165.82	0.43
16	600839	四川长虹	4,671,308.74	0.39
17	601066	国电电力	4,439,347.76	0.37
18	601929	安邦保险	4,203,293.07	0.35
19	600135	东方航空	4,170,405.76	0.35
20	600873	恒顺医药	4,163,437.72	0.35

注:卖出/买入金额按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不包括相关交易费用。

8.4.3 买入/卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
318,296,963.73	299,527,963.38

注:买入/卖出股票成本“或”卖出股票收入“均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不包括相关交易费用。

8.4.3.2 买入/卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
318,296,963.73	299,527,963.38

注:买入/卖出股票成本“或”卖出股票收入“均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不包括相关交易费用。

8.4.3.2 买入/卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
318,296,963.73	299,527,963.38

注:买入/卖出股票成本“或”卖出股票收入“均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不包括相关交易费用。

8.4.3.2 买入/卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
318,296,963.73	299,527,963.38

注:买入/卖出股票成本“或”卖出股票收入“均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不包括相关交易费用。

8.4.3.2 买入/卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额</
--------------	----------------