

# 易方达 50 指数证券投资基金 2011 年半年度报告

## 2011 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：二〇一一年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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 2011 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
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.....	38

---

7.9	投资组合报告附注.....	38
8	基金份额持有人信息.....	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	39
9	开放式基金份额变动.....	39
10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4	基金投资策略的改变.....	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	42
11	备查文件目录.....	43
11.1	备查文件目录.....	43
11.2	存放地点.....	43
11.3	查阅方式.....	43

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达50指数证券投资基金
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	31,013,670,688.04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	本基金为中等风险的证券投资基金，基金控制与基准的偏离风险，同时力争获得超越基准的收益。

### 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	张咏东
	联系电话	020-38799008	021-32169999

	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38799488	021-62701216
注册地址		广东省珠海市香洲区情侣路 428 号九洲港大厦 4001 室	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		广州市体育西路 189 号城建 大厦 25、26、27、28 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		510620	200120
法定代表人		梁棠	胡怀邦

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市体育西路 189 号城建大厦 28 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市体育西路 189 号城建大厦 25 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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-119,242,959.53
本期利润	59,705,586.15
加权平均基金份额本期利润	0.0019
本期加权平均净值利润率	0.24%
本期基金份额净值增长率	0.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-10,269,631,935.78
期末可供分配基金份额利润	-0.3311
期末基金资产净值	23,520,002,068.59
期末基金份额净值	0.7584
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）

基金份额累计净值增长率	128.78%
-------------	---------

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. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

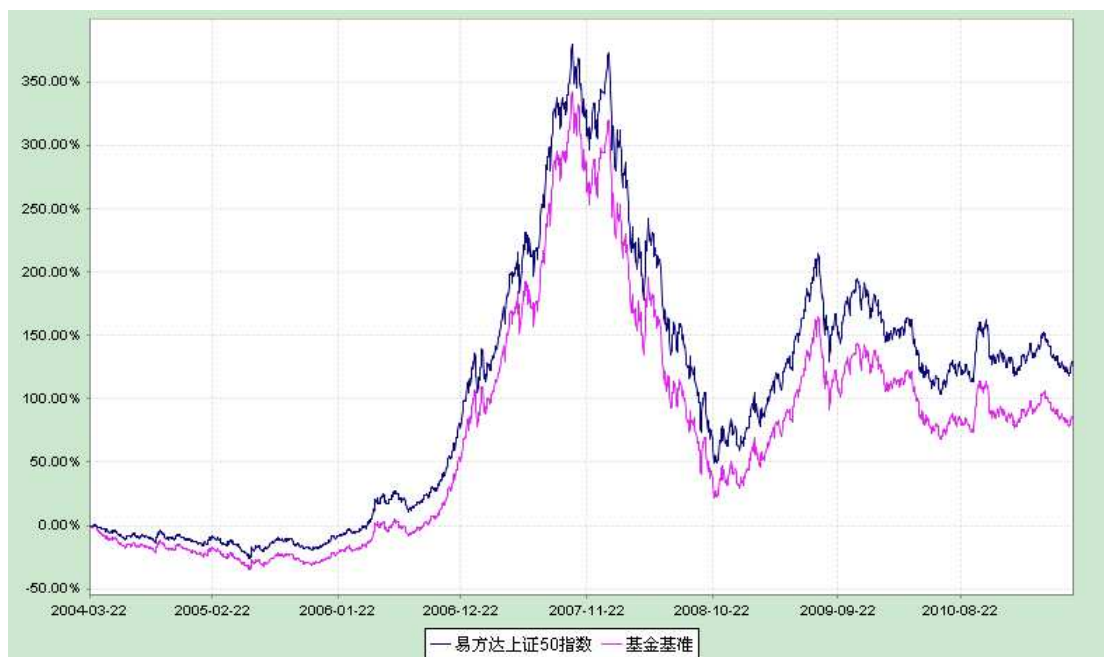
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.11%	1.12%	-1.05%	1.14%	1.16%	-0.02%
过去三个月	-4.46%	1.10%	-4.53%	1.11%	0.07%	-0.01%
过去六个月	0.15%	1.19%	0.61%	1.19%	-0.46%	0.00%
过去一年	11.15%	1.36%	9.36%	1.36%	1.79%	0.00%
过去三年	-7.06%	1.95%	-8.56%	2.04%	1.50%	-0.09%
自基金合同生效起至今	128.78%	1.79%	85.63%	1.92%	43.15%	-0.13%

#### 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 2011 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 128.78%，同期业绩比较基准收益率为 85.63%。

## 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 2011 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 2011 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、26 只开放式基金，具体包括基金科瑞和易方达科讯股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达 50 指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金、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基金、易方达策略成长二号混合型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达增强回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深 300 指数基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金联接基金、易方达亚洲精选股票型基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达岁丰添利债券型基金、易方达医疗保健行业股票型基金、易方达黄金主题基金（LOF）、易方达安心回报债券型基金。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 交易型开放式指数基金联接基金的基金经理、指数与量化投资部副总经理	2007-02-10	-	8 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、易方达沪深 300 指数基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

### 4.3.3 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。

## 4.4 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

年初以来，投资、消费等主要经济增长数据逐渐呈现放缓趋势，经济领先指标 PMI 指数连续数月下滑。整体来看，去年下半年以来宏观经济紧缩政策对实体经济运行的影响正在逐步显现。与此同时，在趋势性和结构性因素的共同影响下，二季度通胀依然高位运行。持续偏紧的流动性环境以及投资者对经济增长、企业盈利波动的担忧对股票市场产生一定的抑制，市场整体呈现震荡走势，估值重心进一步回落。从结构上看，市场表现出较为明显的结构反转特征，去年涨幅明显落后的周期类行业及权重股成为一季度推动指数上涨主要因素，估值较高的中小盘个股在上半年面临了较大回调压力。上证指数上半年涨幅-1.64%，上证 50 指数同期涨幅 0.61%，作为增强型指数基金，50 指数基金上半年基金净值跟随基准指数

小幅上涨。

#### 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 0.7584 元，本报告期份额净值增长率为 0.15%，同期基准指数收益率为 0.61%，年化跟踪误差 1.46%，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

展望下半年，通胀在一定时间范围内仍是经济运行的主要矛盾，偏紧的政策面及外需放缓对国内经济增速以及通胀压力的滞后影响将会得到进一步体现。中期来看，中国经济发展正逐渐面临转型过程中新的矛盾和压力，但推动中国经济增长的基本面因素并未发生趋势性变化，我们对国内经济内生增长潜力依然维持相对乐观的判断，本轮调整后宏观经济将逐步进入增速更为平稳的阶段，市场的趋势和结构特征也将逐步反映政策、经济及企业基本面常态化的过程。50 指数基金将在控制基金相对基准指数的跟踪误差的前提下，根据对市场未来结构性变化的判断，对投资组合做适度的优化和调整，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。期望本基金为投资者分享中国证券市场大盘蓝筹股未来长期稳定的增长提供良好的投资机会。

#### 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**

2011 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**

2011 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**

2011 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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	863,291,452.51	238,992,411.04
结算备付金		4,366,196.11	9,508,367.36
存出保证金		1,973,069.42	679,987.27
交易性金融资产	6.4.7.2	22,700,207,644.56	24,224,398,602.51
其中：股票投资		22,143,387,644.56	23,158,300,602.51
基金投资		-	-
债券投资		556,820,000.00	1,066,098,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		18,860,437.00	59,557,973.48
应收利息	6.4.7.5	2,528,453.29	23,015,686.25
应收股利		69,051,476.33	-
应收申购款		9,583,700.67	91,050,088.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		23,669,862,429.89	24,647,203,116.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		99,665,476.92	118,369,434.33
应付赎回款		15,592,521.59	24,541,718.57
应付管理人报酬		23,003,031.48	25,291,510.99
应付托管费		3,833,838.57	4,215,251.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,678,744.30	8,784,661.89

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,086,748.44	1,437,424.87
负债合计		149,860,361.30	182,640,002.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	31,013,670,688.04	32,304,880,841.46
未分配利润	6.4.7.10	-7,493,668,619.45	-7,840,317,727.24
所有者权益合计		23,520,002,068.59	24,464,563,114.22
负债和所有者权益总计		23,669,862,429.89	24,647,203,116.69

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7584 元，基金份额总额 31,013,670,688.04 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>249,830,898.04</b>	<b>-7,353,030,226.07</b>
1.利息收入		16,655,646.27	10,356,931.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,498,488.05	1,375,470.08
债券利息收入		15,157,158.22	8,981,461.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		49,396,810.50	-269,559,224.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-260,541,699.80	-421,709,263.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,058,901.35	-41,300.00
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	304,879,608.95	152,191,338.77
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	178,948,545.68	-7,098,108,146.56
4.汇兑收益（损失以“-”号		-	-

填列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	4,829,895.59	4,280,213.48
<b>减: 二、费用</b>		<b>190,125,311.89</b>	<b>180,976,182.88</b>
1. 管理人报酬		147,900,250.63	141,851,971.34
2. 托管费		24,650,041.77	23,641,995.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	16,986,197.27	15,248,496.35
5. 利息支出		351,450.61	-
其中: 卖出回购金融资产支出		351,450.61	-
6. 其他费用	6.4.7.19	237,371.61	233,719.99
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>59,705,586.15</b>	<b>-7,534,006,408.95</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>59,705,586.15</b>	<b>-7,534,006,408.95</b>

### 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: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	32,304,880,841.46	-7,840,317,727.24	24,464,563,114.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	59,705,586.15	59,705,586.15
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)	-1,291,210,153.42	286,943,521.64	-1,004,266,631.78
其中: 1. 基金申购款	5,386,374,598.87	-1,152,288,870.64	4,234,085,728.23
2. 基金赎回款	-6,677,584,752.29	1,439,232,392.28	-5,238,352,360.01
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)	31,013,670,688.04	-7,493,668,619.45	23,520,002,068.59

项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	28,052,089,828.56	-1,768,436,204.67	26,283,653,623.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,534,006,408.95	-7,534,006,408.95
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）	3,511,263,164.01	-723,688,573.03	2,787,574,590.98
其中：1. 基金申购款	8,784,476,114.56	-1,666,853,061.24	7,117,623,053.32
2. 基金赎回款	-5,273,212,950.55	943,164,488.21	-4,330,048,462.34
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）	31,563,352,992.57	-10,026,131,186.65	21,537,221,805.92

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：

基金管理公司负责人：梁棠，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（统称“企业会计准则”），中国证券业协会制定的《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编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的《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〉》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

#### **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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日	
	活期存款	863,291,452.51
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	863,291,452.51	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,203,598,183.02	22,143,387,644.56	-3,060,210,538.46
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	557,551,896.39	556,820,000.00

	合计	557,551,896.39	556,820,000.00	-731,896.39
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	25,761,150,079.41	22,700,207,644.56	-3,060,942,434.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	144,066.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,768.32
应收债券利息	2,382,576.71
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	42.12
合计	2,528,453.29

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,668,339.22
银行间市场应付交易费用	10,405.08
合计	4,678,744.30

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	2,623,517.77
预提费用	213,230.67
合计	3,086,748.44

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,304,880,841.46	32,304,880,841.46
本期申购	5,386,374,598.87	5,386,374,598.87
本期赎回（以“-”号填列）	-6,677,584,752.29	-6,677,584,752.29
本期末	31,013,670,688.04	31,013,670,688.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,580,908,394.57	2,740,590,667.33	-7,840,317,727.24
本期利润	-119,242,959.53	178,948,545.68	59,705,586.15
本期基金份额交易产生的变动数	430,519,418.32	-143,575,896.68	286,943,521.64
其中：基金申购款	-1,783,974,274.58	631,685,403.94	-1,152,288,870.64
基金赎回款	2,214,493,692.90	-775,261,300.62	1,439,232,392.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,269,631,935.78	2,775,963,316.33	-7,493,668,619.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,346,099.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	71,041.80
其他	81,347.06
合计	1,498,488.05

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	5,810,373,217.08
减：卖出股票成本总额	6,070,914,916.88
买卖股票差价收入	-260,541,699.80

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,453,069,413.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,396,437,854.20
减：应收利息总额	51,572,658.15
债券投资收益	5,058,901.35

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	304,879,608.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	304,879,608.95

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	178,948,545.68
——股票投资	175,483,542.07
——债券投资	3,465,003.61
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	178,948,545.68

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日

基金赎回费收入	4,828,447.88
印花税手续费返还	1,447.71
合计	4,829,895.59

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	16,967,897.27
银行间市场交易费用	18,300.00
合计	16,986,197.27

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	148,765.71
银行间帐户维护费	9,000.00
银行费用	15,140.94
合计	237,371.61

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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。

注：根据 2011 年 4 月 9 日《易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告》，基金管理人股东广东盈峰投资控股集团有限公司已更名为“盈峰投资控股集团有限公司”，基金管理人已完成股东更名事项的工商变更登记。

**6.4.9.2 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	基金管理人股东、基金销售机构

券”)

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	4,614,635,841.26	43.16%	4,159,107,962.24	38.81%

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	3,880,732.90	42.90%	1,258,027.98	26.95%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	3,514,663.96	38.67%	2,548,771.27	53.63%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	147,900,250.63	141,851,971.34

其中：支付销售机构的客户维护费	23,530,740.42	26,033,147.29
-----------------	---------------	---------------

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：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,650,041.77	23,641,995.20

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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
期初持有的基金份额	605,009,506.23	65,428,663.88
期间申购/买入总份额	-	539,580,842.35
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	1.95%	1.92%

注：基金管理人 2010 年度持有本基金份额变动相关的申购费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

##### 6.4.10.4.2 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



无。

#### 6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	863,291,452.51	1,346,099.19	233,260,228.63	1,027,999.10

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券	002345	潮宏基	公开发行	500	16,500.00

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位： 股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600104	上海汽车	2010-12-15	2011-12-12	非公开发行流通受	13.87	16.53	5,105,702	70,816,086.74	84,397,254.06	-

				限						
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--	--

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期。

#### 6.4.12.2 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
601998	中信银行	2011-06-29	配股停牌	4.75	2011-07-07	4.59	29,845,129	168,867,753.47	141,764,362.75	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金是增强指数型股票基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金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。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公

司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2010 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	559,202,576.71	1,089,071,679.46
合计	559,202,576.71	1,089,071,679.46

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素

的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	863,291,452.51	-	-	-	863,291,452.51
结算备付金	4,366,196.11	-	-	-	4,366,196.11
存出保证金	103,913.63	-	-	1,869,155.79	1,973,069.42
交易性金融资产	556,820,000.00	-	-	22,143,387,644.56	22,700,207,644.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	18,860,437.00	18,860,437.00
应收利息	-	-	-	2,528,453.29	2,528,453.29
应收股利	-	-	-	69,051,476.33	69,051,476.33
应收申购款	6,608,961.44	-	-	2,974,739.23	9,583,700.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,431,190,523.69	-	-	22,238,671,906.20	23,669,862,429.89
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	-	-	-	99,665,476.92	99,665,476.92
应付赎回款	-	-	-	15,592,521.59	15,592,521.59
应付管理人报酬	-	-	-	23,003,031.48	23,003,031.48

应付托管费	-	-	-	3,833,838.57	3,833,838.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,678,744.30	4,678,744.30
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,086,748.44	3,086,748.44
负债总计	-	-	-	149,860,361.30	149,860,361.30
利率敏感度缺口	1,431,190,523.69	-	-	22,088,811,544.90	23,520,002,068.59
上年度末2010年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	238,992,411.04	-	-	-	238,992,411.04
结算备付金	9,508,367.36	-	-	-	9,508,367.36
存出保证金	103,913.63	-	-	576,073.64	679,987.27
交易性金融资产	1,066,098,000.00	-	-	23,158,300,602.51	24,224,398,602.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	59,557,973.48	59,557,973.48
应收利息	-	-	-	23,015,686.25	23,015,686.25
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	10,821,334.51	-	-	80,228,754.27	91,050,088.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,325,524,026.54	-	-	23,321,679,090.15	24,647,203,116.69
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	-	-	-	118,369,434.33	118,369,434.33
应付赎回款	-	-	-	24,541,718.57	24,541,718.57
应付管理人报酬	-	-	-	25,291,510.99	25,291,510.99
应付托管费	-	-	-	4,215,251.82	4,215,251.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	8,784,661.89	8,784,661.89
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,437,424.87	1,437,424.87
负债总计	-	-	-	182,640,002.47	182,640,002.47
利率敏感度缺口	1,325,524,026.54	-	-	23,139,039,087.68	24,464,563,114.22

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	623,531.82	417,728.54
	2. 市场利率上升25个基点	-620,941.32	-417,163.53

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	22,143,387,644.56	94.15	23,158,300,602.51	94.66
交易性金融资产-债券投资	556,820,000.00	2.37	1,066,098,000.00	4.36
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,700,207,644.56	96.51	24,224,398,602.51	99.02

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升5%	1,107,086,497.37	1,149,834,466.37
	2. 业绩比较基准下降5%	-1,107,086,497.37	-1,149,834,466.37

**6.4.14 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

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)。

于 2011 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 21,917,226,027.75 元,第二层级的余额为 782,981,616.81 元,无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日:第一层级的余额为 23,087,280,287.69 元,第二层级的余额为 1,137,118,314.82 元,无属于第三层级的余额)。

(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	22,143,387,644.56	93.55
	其中:股票	22,143,387,644.56	93.55
2	固定收益投资	556,820,000.00	2.35
	其中:债券	556,820,000.00	2.35
	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	867,657,648.62	3.67
6	其他各项资产	101,997,136.71	0.43
7	合计	23,669,862,429.89	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	采掘业	3,559,362,382.70	15.13
C	制造业	3,063,206,654.65	13.02
C0	食品、饮料	739,780,382.33	3.15



C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,283,886,970.62	5.46
C7	机械、设备、仪表	1,039,539,301.70	4.42
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	274,622,007.24	1.17
E	建筑业	546,496,854.27	2.32
F	交通运输、仓储业	826,641,262.40	3.51
G	信息技术业	455,393,835.75	1.94
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	11,871,647,973.82	50.47
J	房地产业	618,641,613.56	2.63
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	21,216,012,584.39	90.20

## 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	24,639,384.00	0.10
B	采掘业	169,417,589.80	0.72
C	制造业	586,136,589.44	2.49
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	54,622,519.20	0.23
C7	机械、设备、仪表	482,434,491.34	2.05
C8	医药、生物制品	49,079,578.90	0.21
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-

H	批发和零售贸易	45,472,182.00	0.19
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	85,056,423.60	0.36
K	社会服务业	16,652,891.33	0.07
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	927,375,060.17	3.94

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 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所有股票投资明细

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	157,215,037	2,046,939,781.74	8.70
2	600000	浦发银行	197,695,834	1,945,327,006.56	8.27
3	601318	中国平安	31,899,970	1,539,811,551.90	6.55
4	601166	兴业银行	108,236,183	1,459,023,746.84	6.20
5	601088	中国神华	28,298,102	852,904,794.28	3.63
6	601398	工商银行	187,729,287	837,272,620.02	3.56
7	601601	中国太保	37,068,344	829,960,222.16	3.53
8	600519	贵州茅台	3,479,191	739,780,382.33	3.15
9	600016	民生银行	111,241,388	637,413,153.24	2.71
10	601699	潞安环能	19,015,606	623,902,032.86	2.65
11	600030	中信证券	41,113,123	537,759,648.84	2.29
12	600111	包钢稀土	7,070,538	505,048,529.34	2.15
13	601169	北京银行	48,737,651	485,914,380.47	2.07
14	601668	中国建筑	120,128,909	484,119,503.27	2.06
15	601939	建设银行	93,490,427	461,842,709.38	1.96
16	600050	中国联通	86,741,683	455,393,835.75	1.94
17	600547	山东黄金	10,022,246	449,397,510.64	1.91
18	600019	宝钢股份	63,275,729	381,552,645.87	1.62
19	600031	三一重工	21,093,093	380,519,397.72	1.62
20	601857	中国石油	32,482,052	353,729,546.28	1.50
21	600837	海通证券	37,794,116	340,902,926.32	1.45
22	600015	华夏银行	31,216,970	339,328,463.90	1.44
23	600104	上海汽车	18,223,467	330,224,170.16	1.40
24	600089	特变电工	25,409,253	328,795,733.82	1.40
25	600383	金地集团	49,732,628	318,786,145.48	1.36
26	600048	保利地产	27,284,392	299,855,468.08	1.27

27	600362	江西铜业	8,162,781	289,288,958.64	1.23
28	601111	中国国航	29,540,109	283,289,645.31	1.20
29	600028	中国石化	34,343,826	282,649,687.98	1.20
30	600900	长江电力	38,089,044	274,622,007.24	1.17
31	601919	中国远洋	32,812,235	272,013,428.15	1.16
32	601168	西部矿业	18,349,032	271,932,654.24	1.16
33	601006	大秦铁路	33,130,426	271,338,188.94	1.15
34	600348	阳泉煤业	11,049,612	266,737,633.68	1.13
35	601958	金钼股份	7,523,953	144,836,095.25	0.62
36	601998	中信银行	29,845,129	141,764,362.75	0.60
37	601688	华泰证券	11,307,423	139,646,674.05	0.59
38	601898	中煤能源	12,868,940	128,689,400.00	0.55
39	601899	紫金矿业	17,687,507	128,057,550.68	0.54
40	601600	中国铝业	9,808,977	107,996,836.77	0.46
41	601818	光大银行	19,286,571	64,610,012.85	0.27
42	601288	农业银行	22,903,826	64,130,712.80	0.27
43	600489	中金黄金	2,071,289	56,525,476.81	0.24
44	601390	中国中铁	14,000,000	55,860,000.00	0.24
45	601618	中国中冶	1,654,150	6,517,351.00	0.03

## 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所有股票投资明细

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	9,153,607	215,109,764.50	0.91
2	600497	驰宏锌锗	7,363,156	162,357,589.80	0.69
3	600066	宇通客车	5,638,652	130,478,407.28	0.55
4	000024	招商地产	4,647,892	85,056,423.60	0.36
5	601989	中国重工	4,999,725	68,946,207.75	0.29
6	600585	海螺水泥	1,967,670	54,622,519.20	0.23
7	002004	华邦制药	1,088,239	49,079,578.90	0.21
8	600739	辽宁成大	1,635,690	45,472,182.00	0.19
9	601766	中国南车	4,999,918	35,599,416.16	0.15
10	601118	海南橡胶	1,999,950	24,639,384.00	0.10
11	000528	柳工	749,973	16,971,888.99	0.07
12	600754	锦江股份	956,513	16,652,891.33	0.07
13	600366	宁波韵升	978,851	15,328,806.66	0.07
14	600188	兖州煤业	200,000	7,060,000.00	0.03

#### 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	601939	建设银行	505,351,578.82	2.07
2	601601	中国太保	434,472,677.36	1.78
3	601958	金铂股份	400,783,147.79	1.64
4	600031	三一重工	392,735,046.02	1.61
5	600111	包钢稀土	242,795,127.67	0.99
6	600837	海通证券	221,972,363.63	0.91
7	601111	中国国航	221,706,890.72	0.91
8	600050	中国联通	206,383,367.47	0.84
9	600015	华夏银行	199,013,147.67	0.81
10	601699	潞安环能	193,311,280.83	0.79
11	600497	驰宏锌锗	192,305,170.67	0.79
12	601998	中信银行	165,840,523.10	0.68
13	601688	华泰证券	161,913,710.69	0.66
14	601668	中国建筑	155,737,122.00	0.64
15	600066	宇通客车	149,688,698.94	0.61
16	000157	中联重科	114,148,849.36	0.47
17	600048	保利地产	112,620,890.92	0.46
18	600016	民生银行	106,372,430.00	0.43
19	601318	中国平安	78,658,799.67	0.32
20	601088	中国神华	75,104,903.36	0.31

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	601818	光大银行	698,011,169.68	2.85
2	600739	辽宁成大	637,135,563.38	2.60
3	601318	中国平安	535,876,739.13	2.19
4	000063	中兴通讯	442,859,482.57	1.81
5	601958	金铂股份	433,005,019.67	1.77
6	600016	民生银行	412,591,059.20	1.69
7	601166	兴业银行	332,048,812.11	1.36
8	601398	工商银行	259,312,241.27	1.06

9	601088	中国神华	240,011,197.56	0.98
10	000157	中联重科	122,044,070.60	0.50
11	601699	潞安环能	112,407,337.76	0.46
12	000651	格力电器	110,158,330.26	0.45
13	000024	招商地产	106,878,347.95	0.44
14	600900	长江电力	92,759,150.31	0.38
15	601898	中煤能源	82,648,828.15	0.34
16	600754	锦江股份	71,801,340.77	0.29
17	600031	三一重工	70,842,830.45	0.29
18	601628	中国人寿	70,825,339.97	0.29
19	601618	中国中冶	63,767,494.75	0.26
20	601600	中国铝业	62,045,898.88	0.25

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	4,880,518,416.86
卖出股票收入（成交）总额	5,810,373,217.08

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	297,730,000.00	1.27
3	金融债券	259,090,000.00	1.10
	其中：政策性金融债	259,090,000.00	1.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	556,820,000.00	2.37

#### 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	110308	11 进出 08	2,600,000	259,090,000.00	1.10
2	1101023	11 央行票据 23	2,000,000	198,500,000.00	0.84
3	1101029	11 央行票据 29	1,000,000	99,230,000.00	0.42

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	1,973,069.42
2	应收证券清算款	18,860,437.00
3	应收股利	69,051,476.33
4	应收利息	2,528,453.29
5	应收申购款	9,583,700.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,997,136.71

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5.1 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。

#### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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
1,329,626	23,325.11	7,410,622,498.75	23.89%	23,603,048,189.29	76.11%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	736,955.89	0.0024%

## 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	32,304,880,841.46
本报告期基金总申购份额	5,386,374,598.87
减：本报告期基金总赎回份额	6,677,584,752.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	31,013,670,688.04

## 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	
广发证券	3	4,614,635,841.26	43.16%	3,880,732.90	42.90%	-
齐鲁证券	1	1,258,474,036.02	11.77%	1,069,703.86	11.83%	-
中银国际	1	2,119,721,452.61	19.83%	1,801,762.88	19.92%	-
海通证券	1	780,071,775.64	7.30%	663,061.35	7.33%	-
申银万国	1	829,977,070.51	7.76%	705,476.48	7.80%	-
光大证券	1	564,679,013.52	5.28%	479,975.82	5.31%	-
国信证券	2	348,917,030.90	3.26%	296,577.77	3.28%	-
安信证券	1	133,002,637.88	1.24%	113,051.99	1.25%	-
渤海证券	1	41,412,775.60	0.39%	35,200.74	0.39%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-



国泰君安	1	-	-	-	-	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增申银万国证券股份有限公司一个交易单元。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	122,843,950.30	100.00%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上直销优惠申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-28
2	易方达基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-01
3	易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-09
4	易方达基金管理有限公司关于扩展网上交易定期定额业务申购周期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-28
5	易方达基金管理有限公司关于基金对账单服务形式调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-31
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-01
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行网上银行申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-01
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华夏银行为代销机构、在华夏银行推出定期定额申购业务及参加华夏银行网上银行与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-07
9	易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-09
10	易方达基金管理有限公司关于开通中国工商银行借记卡网上直销定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-26
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行网上银行申购费率	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-29

	优惠活动的公告		
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-29
13	关于暂停中国银行广东省分行银行卡基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-24
14	易方达基金管理有限公司关于开通基金手机交易和查询业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-07
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准易方达 50 指数证券投资基金设立的文件；
2. 《易方达 50 指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《易方达 50 指数证券投资基金托管协议》；
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。

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 11.3 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  
二〇一一年八月二十六日