

易方达亚洲精选股票型证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一二年八月二十四日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 17 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 2012 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.....	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1	资产负债表.....	15
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	33
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	33
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动.....	39
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42
7.7	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.....	42
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细...	42

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细...	42
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	43
7.11	投资组合报告附注.....	43
8	基金份额持有人信息.....	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
9	开放式基金份额变动.....	44
10	重大事件揭示.....	44
10.1	基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4	基金投资策略的改变.....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8	其他重大事件.....	49
11	备查文件目录.....	51
11.1	备查文件目录.....	51
11.2	存放地点.....	51
11.3	查阅方式.....	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达亚洲精选股票型证券投资基金
基金简称	易方达亚洲精选股票（QDII）
基金主代码	118001
交易代码	118001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月21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
报告期末基金份额总额	122,396,293.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚洲企业，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将基于对全球及亚洲宏观经济，各类资产的风险与收益水平的综合分析与判断在不同区域和行业间进行积极的资产配置。在构建投资组合方面，本基金坚持价值投资的理念，以自下而上的基本面分析、深入的公司研究、对股票价值的评估作为股票投资的根本依据，辅以自上而下的宏观经济分析、国别/地区因素分析、行业分析，争取获得超越比较基准的回报。固定收益品种与货币市场工具的投资将主要用于回避投资风险、取得稳定回报，同时，保持必要的灵活性，及时把握重大的投资机会。
业绩比较基准	MSCI AC 亚洲除日本指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	赵会军
	联系电话	020—38797888	010—66105799
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020—38799488	010—66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广州市体育西路 189 号城建 大厦 25、26、27、28 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		叶俊英	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	无	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 号渣打银行大厦 32 楼
办公地址		无	香港九龙观塘光观塘路三百八十八号渣打中心 15 楼
邮政编码		无	无

2.5 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	http://www.efunds.com.cn
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

2.6 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,283,882.42
本期利润	-234,293.79
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	-0.23%
本期基金份额净值增长率	-0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-28,221,274.59
期末可供分配基金份额利润	-0.2306
期末基金资产净值	94,175,018.60
期末基金份额净值	0.769
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-23.10%

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	2.95%	1.44%	2.26%	1.40%	0.69%	0.04%
过去三个月	-6.45%	1.32%	-7.04%	1.21%	0.59%	0.11%
过去六个月	-0.39%	1.18%	5.39%	1.11%	-5.78%	0.07%
过去一年	-28.47%	1.78%	-16.95%	1.54%	-11.52%	0.24%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起	-23.10%	1.38%	-8.70%	1.30%	-14.40%	0.08%

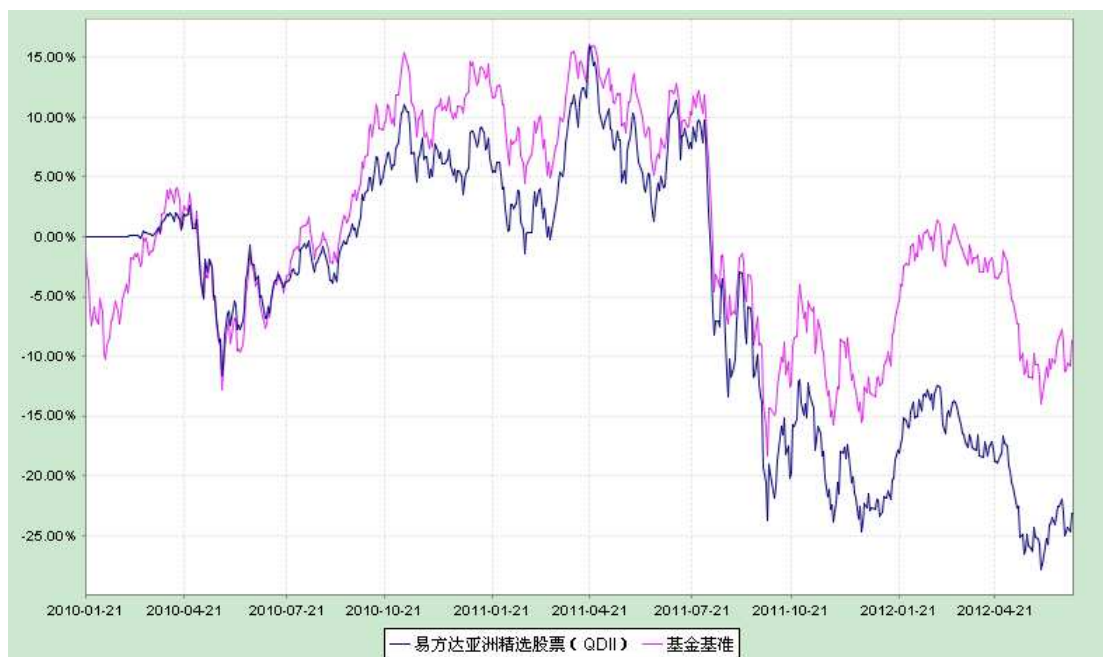
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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

(2010 年 1 月 21 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：1. 基金合同中关于基金投资比例的约定：

(1) 本基金主要投资于在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外），对以上两类企业的投资合计不低于股票资产的 80%；其他不高于 20% 的股票资产可以根据投资策略投资于超出前述投资范围的其他市场的企业。上述亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业。

(2) 本基金投资于股票及其他权益类证券占基金资产的比例不低于 60%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%。

(3) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(4) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

(5) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

(6) 同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

(7) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(8) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。但持有货币市场

基金可以不受上述限制。

(9) 同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

在基金合同生效 6 个月后，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓，以符合投资比例限制要求。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个工作日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 30 个工作日延长到 3 个月。

法律法规或中国有关监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，履行适当程序后，基金可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整上述限制。

2. 本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

3. 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-23.10%，同期业绩比较基准收益率为-8.70%。

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 2012 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 2012 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、33 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

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。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		
Guan Yu (管宇)	本基金的基金经理、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2012-01-01	-	5年	硕士研究生，曾任道富环球资产管理公司(SSgA)数量分析师，易方达基金管理有限公司海外投资经理。
张小刚	本基金的基金经理、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）的基金经理（自2011年5月6日至2012年5月17日）、易方达	2010-01-21	2012-05-18	13年	硕士研究生，曾任四通投资管理有限公司研究员，河北证券资产管理部投资经理，Atticus Capital, LLP 大中华区域研究员，Digital Century Capital, LLP 通讯行业研究员，Pacific Investment Management

	资产管理（香港）有限公司 基金经理				Company 投资经理，香港企荣财务有限公司投资基金经理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、海外市场股票研究员。
李弋	本基金的基金经理、基金投资部副总经理	2010-01-21	2012-01-13	12年	硕士研究生，曾任TCL公司材料及工程部质量控制主任，深圳市社保局投资分析员，ALLIED BUSINESS INTELLIGENCE 公司市场研究分析员，花旗集团资产管理公司（CGAM）股票研究员，日兴全球资产管理（美国）公司副总裁、基金经理、研究员，美国纽约人寿保险公司人寿及年金业务（L&A）首席投资官办公室投资分析师。

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，Guan Yu（管宇）的“任职日期”为公告确定的聘任日期，张小刚、李弋的“任职日期”为基金合同生效之日。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、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。本基金管理人制定了相应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，根据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年亚洲区股票市场经历了先冲高后回落的震荡。欧央行于去年年底推出的长期再融资计划缓解了欧洲银行体系流动性紧缩的局面。投资者的风险偏好回升并带动资金从 1 月中旬开始持续流入新兴经济体，推动亚洲区股票市场走出一轮以估值修复为主线的上涨。随着希腊国内政局在第 2 季度出现反复，欧洲债务危机再度恶化并向更大的经济体传导。西班牙国债收益率开始攀升，其银行体系稳定性持续地恶化，而欧盟方面未能做好大规模救助的准备。受此不明朗因素的影响，投资者避险情绪急剧上升，亚洲区股票市场普遍下跌。其中韩国、中国和香港等国家/地区的指数回跌到年初的水平。

欧洲债务危机的悬而不决在上半年明显拖累了全球实体经济的增长。与此同时，各国央行为预防经济的进一步下滑纷纷调整宏观政策以刺激经济。美联储公开市场委员会在 6 月 20 日议息会议后决定延长扭曲操作（OT）期限至今年年底。在会后的新闻发布会上，伯南克提前预警称，如果就业市场的表现不能改善，美联储将会扩大资产购买规模。此外，新兴市场国家也加入了刺激经济的行列。巴西央行也在 5 月 30 日的议息会议上下调其利率至 8.5%，创下自 1997 年以来的新低。中国从货币政策到信贷政策，“稳增长”的政策基调越来越明显。中国人民银行在一个月内接连作出降准、降息的举措，防止经济超预期下行。

由于亚洲区各经济体对于欧元区债务的风险敞口不大，欧债危机对于亚洲股市的影响主要通过流动性传导。当前亚洲地区主要股市的估值远低于历史平均水平，为长线投资提供了一定的安全边际。本基金投资组合的股票仓位在一季度初增加到九成左右，并在上半年基本保持了这个仓位水平。在行业配置方面，组合对于金融行业（以保险、房地产为主）作了一

定程度的超额配置，低配了原材料、日常消费品和信息技术行业，对于其他行业基本上保持均衡配置。整体而言，行业配置对于组合超额收益的影响不大。在国别配置上，投资组合超配了中国、韩国和香港等国家/地区，低配了印度和新加坡，没有配置台湾、印尼、泰国、马来西亚等国家/地区。组合上半年超配的国家/地区表现落后于亚洲其他市场。就个股选择而言，组合在香港和印度这两个市场获得正超额收益，但是在中国和韩国这两个超配的市场选股收益为负数。

4.5.2 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 0.769 元，本报告期份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准收益率为 5.39%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年下半年的亚洲股市，基金经理认为是机遇大于风险的投资环境。欧洲债务危机在下半年依然是影响股票市场的主要因素。欧元区各国维系货币联盟的努力一直没有中断，但是所提方案主要由各国首脑之间通过高度个人化的程序敲定，其进程不可预测。每次危机进入临界状态就会倒逼各方作出一些妥协和让步。目前各国围绕债务危机展开的政治博弈尚未结束。鉴于欧元区各国首脑已在某些重要领域（如对于西班牙银行业的援助计划）取得进展，全球通胀水平的持续回落也为美联储、欧央行和新兴市场国家央行推出更多的宽松政策提供了空间，基金经理对于欧元区债务危机在下半年出现一定程度的缓和持谨慎乐观态度。

目前投资者出于规避风险的考虑将大量资金配置在固定收益类资产，导致这类资产的收益屡创新低。相比而言，亚洲区股票市场的低估值凸显了其良好的投资价值。基金经理计划在下半年保持较高的股票仓位，同时增加对于印尼、泰国和马来西亚等国家的配置以加大多元化投资的力度，分散组合的风险。

4.7 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。

4.8 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

2012 年上半年，本基金托管人在对易方达亚洲精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012 年上半年，易方达亚洲精选股票型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达亚洲精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达亚洲精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	7,002,276.29	19,423,422.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	82,902,381.65	80,340,217.81
其中：股票投资		82,902,381.65	80,340,217.81
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		4,415,052.47	-
应收利息	6.4.7.5	337.68	310.52
应收股利		513,495.43	-
应收申购款		78,201.51	33,524.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		94,911,745.03	99,797,474.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		-	-
应付赎回款		413,156.18	339,630.75
应付管理人报酬		114,466.92	129,723.10
应付托管费		26,708.94	30,268.73

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	182,394.39	366,963.64
负债合计		736,726.43	866,586.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	122,396,293.19	128,102,134.81
未分配利润	6.4.7.10	-28,221,274.59	-29,171,246.08
所有者权益合计		94,175,018.60	98,930,888.73
负债和所有者权益总计		94,911,745.03	99,797,474.95

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.769 元，基金份额总额 122,396,293.19 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		1,200,999.81	5,711,815.88
1.利息收入		19,422.19	25,350.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,422.19	25,350.34
债券利息收入		-	-
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）		-1,932,856.23	2,650,082.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,389,838.40	1,414,607.68
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	8,437.92
股利收益	6.4.7.16	1,456,982.17	1,227,037.26

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,049,588.63	3,802,849.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		60,298.25	-832,533.39
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,546.97	66,066.26
减：二、费用		1,435,293.60	2,995,926.17
1. 管理人报酬		762,065.10	1,192,445.21
2. 托管费		177,815.18	278,237.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	283,627.89	1,271,199.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	211,785.43	254,044.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-234,293.79	2,715,889.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-234,293.79	2,715,889.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	128,102,134.81	-29,171,246.08	98,930,888.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-234,293.79	-234,293.79
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）	-5,705,841.62	1,184,265.28	-4,521,576.34
其中：1. 基金申购款	4,251,587.21	-820,290.61	3,431,296.60
2. 基金赎回款	-9,957,428.83	2,004,555.89	-7,952,872.94
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)	122,396,293.19	-28,221,274.59	94,175,018.60
项目	上年度可比期间 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)	176,245,509.96	10,025,580.73	186,271,090.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,715,889.71	2,715,889.71
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)	-32,855,176.48	-1,996,616.17	-34,851,792.65
其中: 1. 基金申购款	37,731,952.24	3,657,980.91	41,389,933.15
2. 基金赎回款	-70,587,128.72	-5,654,597.08	-76,241,725.80
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)	143,390,333.48	10,744,854.27	154,135,187.75

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: 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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金(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”)证监许可[2008]1064 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2009]367 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的批复》核准,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2010 年 1 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 592,067,217.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 107,302.70 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为渣打银行（香港）有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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>》、《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制。

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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

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
----	-----

	2012 年 6 月 30 日
活期存款	7,002,276.29
定期存款	-
其他存款	-
合计	7,002,276.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		90,236,573.04	82,902,381.65	-7,334,191.39
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		90,236,573.04	82,902,381.65	-7,334,191.39

注：“股票”包括普通股和存托凭证等。

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 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	337.68
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

其他	-
合计	337.68

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	394.39
预提费用	182,000.00
合计	182,394.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,102,134.81	128,102,134.81
本期申购	4,251,587.21	4,251,587.21
本期赎回（以“-”号填列）	-9,957,428.83	-9,957,428.83
本期末	122,396,293.19	122,396,293.19

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	-16,435,040.84	-12,736,205.24	-29,171,246.08
本期利润	-3,283,882.42	3,049,588.63	-234,293.79
本期基金份额交易产生的变动数	866,761.22	317,504.06	1,184,265.28
其中：基金申购款	-636,850.23	-183,440.38	-820,290.61
基金赎回款	1,503,611.45	500,944.44	2,004,555.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,852,162.04	-9,369,112.55	-28,221,274.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	19,405.30
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	-
其他	16.89
合计	19,422.19

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	60,832,645.95
减：卖出股票成本总额	64,222,484.35
买卖股票差价收入	-3,389,838.40

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,456,982.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,456,982.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	3,049,588.63
——股票投资	3,049,588.63
——债券投资	-
——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	3,049,588.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	4,546.97
合计	4,546.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	283,627.89
银行间市场交易费用	-
合计	283,627.89

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	32,820.06
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	1,361.00
账户维护费	9,000.00
其他	19,424.43
合计	211,785.43

注：“其他”主要包含支付给交易所的结算服务费用和存托凭证托管机构的存托服务费用。

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。

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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国	基金托管人、基金销售机构

工商银行”)	
渣打银行(香港)有限公司(以下简称“渣打银行”)	境外资产托管人

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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	762,065.10	1,192,445.21
其中：支付销售机构的客户 维护费	116,450.07	206,803.46

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	177,815.18	278,237.17

注：本基金的托管费（包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.35%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国工商银行	1,536,846.89	17,685.21	2,830,726.56	20,798.43
渣打银行	5,465,429.40	1,720.09	14,576,803.83	3,257.91

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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（2012 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

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2012 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 2012 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。

本基金属股票基金，投资于股票及其他权益类证券占基金资产的比例不低于 60%，其中投资于在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外），合计不低于股票资产的 80%（亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业）。理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家 / 地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家 / 地区投资的风险。

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同责任（本基金为进行避险和组合的有效管理可以投资衍生品），或者基金所投资证券之发行人出现违约（包括国家信用风险）、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投资备选库制度和交易对手备选库制度及分散化投资方式防范信用风险。本期末本基金没有进行衍生品投资和债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金在短时间内购买以及售出金融工具，成交价格较远地偏离了真实价值。当某国 / 地区的资本市场规模较小，金融市场不发达，某金融品种流通市值较低，参与机构数量较少，成交不活跃，以及基金需要在短时间内进行大量交易时，有可能发生流动性风险，导致基金难以快速建仓，或在出现大额赎回时，被迫在不利价格大量抛售证券，使基金净值遭受不利影响。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，主要投资的交易所流动性较好，因此本基金面临的流动性风险较小。

6.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的涨跌。

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 2012 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	7,002,276.29	-	-	-	7,002,276.29
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	82,902,381.65	82,902,381.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,415,052.47	4,415,052.47
应收利息	-	-	-	337.68	337.68
应收股利	-	-	-	513,495.43	513,495.43
应收申购款	26,734.36	-	-	51,467.15	78,201.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,029,010.65	-	-	87,882,734.38	94,911,745.03
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	413,156.18	413,156.18
应付管理人报酬	-	-	-	114,466.92	114,466.92

应付托管费	-	-	-	26,708.94	26,708.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	182,394.39	182,394.39
负债总计	-	-	-	736,726.43	736,726.43
利率敏感度缺口	7,029,010.65	-	-	87,146,007.95	94,175,018.60
上年度末2011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	19,423,422.41	-	-	-	19,423,422.41
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	80,340,217.81	80,340,217.81
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	-	-	-	310.52	310.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	5,882.46	-	-	27,641.75	33,524.21
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,429,304.87	-	-	80,368,170.08	99,797,474.95
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	339,630.75	339,630.75
应付管理人报酬	-	-	-	129,723.10	129,723.10
应付托管费	-	-	-	30,268.73	30,268.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	366,963.64	366,963.64
负债总计	-	-	-	866,586.22	866,586.22
利率敏感度缺口	19,429,304.87	-	-	79,501,583.86	98,930,888.73

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

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价				

的资产				
银行存款	3,152,667.85	2,313,653.00	38.01	5,466,358.86
交易性金融资产	4,552,783.19	49,461,942.92	28,887,655.54	82,902,381.65
应收利息	-	-	0.02	0.02
应收股利	-	513,495.43	-	513,495.43
应收证券清算款	-	4,415,052.47	-	4,415,052.47
资产合计	7,705,451.04	56,704,143.82	28,887,693.57	93,297,288.43
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	7,705,451.04	56,704,143.82	28,887,693.57	93,297,288.43
项目	上年度末 2011年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	9,429,068.50	8,958,221.58	278.21	18,387,568.29
交易性金融资产	-	39,783,643.24	40,556,574.57	80,340,217.81
应收利息	-	-	33.68	33.68
资产合计	9,429,068.50	48,741,864.82	40,556,886.46	98,727,819.78
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	9,429,068.50	48,741,864.82	40,556,886.46	98,727,819.78

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币 平均升值5%	-4,664,864.42	-4,936,390.99
	假设人民币对一揽子货币 平均贬值5%	4,664,864.42	4,936,390.99

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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	82,902,381.65	88.03	80,340,217.81	81.21
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	82,902,381.65	88.03	80,340,217.81	81.21

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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日

1. 业绩比较基准上升5%	4,697,119.37	4,738,639.94
2. 业绩比较基准下降5%	-4,697,119.37	-4,738,639.94

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

(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) 各层次金融工具公允价值

于 2012 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 82,902,381.65 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 80,340,217.81 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(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	82,902,381.65	87.35
	其中：普通股	78,349,598.46	82.55
	存托凭证	4,552,783.19	4.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,002,276.29	7.38
8	其他各项资产	5,007,087.09	5.28
9	合计	94,911,745.03	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	49,461,942.92	52.52
韩国	28,166,692.83	29.91
美国	4,552,783.19	4.83
新加坡	720,962.71	0.77
合计	82,902,381.65	88.03

注：1. 国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2. ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	7,247,422.21	7.70
材料	5,024,541.39	5.34
工业	8,766,474.86	9.31
非必需消费品	5,169,776.91	5.49
必需消费品	720,962.71	0.77
保健	1,071,691.06	1.14
金融	31,340,452.85	33.28
信息技术	10,987,366.22	11.67

电信服务	7,205,703.96	7.65
公用事业	5,367,989.48	5.70
合计	82,902,381.65	88.03

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	700	4,642,548.93	4.93
2	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港证券交易所	香港	300,000	3,536,424.36	3.76
3	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	香港	600,000	3,360,336.84	3.57
4	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	-	000660 KS	韩国证券交易所	韩国	20,000	2,634,109.48	2.80
5	KOREAN AIR LINES CO LTD	-	003490 KS	韩国证券交易所	韩国	9,000	2,499,919.00	2.65
6	CHINA MOBILE LIMITED	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	香港	36,000	2,487,236.22	2.64
7	LENOVO GROUP LIMITED	联想集团有限公司	992 HK	香港证券交易所	香港	460,000	2,452,507.85	2.60
8	LG UPLUS CORP	-	032640 KS	韩国证券	韩国	80,000	2,447,457.70	2.60

				交 易 所				
9	CHINA LIFE INSURANCE CO LIMITED	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	150,000	2,440,768.68	2.59
10	CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) COMPANY LTD	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	2601 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	120,000	2,435,877.36	2.59
11	HYUNDAI MOBIS	-	012330 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	1,500	2,273,783.18	2.41
12	CNOOC LIMITED	中国海洋石油有限公司	883 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	180,000	2,259,789.84	2.40
13	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORPORATION (SINOPEC)	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	380,000	2,131,311.17	2.26
14	CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	重庆农村商业银行股份有限公司	3618 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	800,000	2,028,267.36	2.15
15	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	-	000210 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	4,000	1,992,424.95	2.12
16	NEW WORLD DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	新世界发展有限公司	17 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	262,947	1,931,380.48	2.05
17	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LIMITED	中国忠旺控股有限公司	1333 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	800,000	1,930,440.96	2.05
18	HYUNDAI MOTOR COMPANY	-	005380 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	1,500	1,925,881.93	2.05

				交 易 所				
19	PETROCHINA COMPANY LIMITED	中国石 油天然 气股份 有限公 司	857 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	230,000	1,865,630.97	1.98
20	GUANGDONG INVESTMENT LIMITED	粤海投 资有限 公司	270 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	400,000	1,819,571.04	1.93
21	CHEUNG KONG (HOLDINGS) LIMITED	长江实 业（集 团）有 限公司	1 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	23,000	1,773,755.68	1.88
22	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	新鸿基 地产发 展有限 公司	16 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	23,000	1,709,067.97	1.81
23	STERLITE INDUSTRIES (INDIA) LTD	-	SLT US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	30,000	1,438,282.26	1.53
24	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION (KEPCO)	-	015760 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	10,000	1,416,455.10	1.50
25	PICC PROPERTY & CASUALTY COMPANY LIMITED	中国人 民财产 保险股 份有限 公司	2328 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	200,000	1,413,591.48	1.50
26	CHINA TELECOM CORPORATION LIMITED	中国电 信股份 有限公 司	728 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	500,000	1,373,645.70	1.46
27	SWIRE PACIFIC LIMITED	太古股 份有限 公司	19 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	18,000	1,316,254.21	1.40
28	WHEELOCK & COMPANY LIMITED	会德丰 有限公 司	20 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	54,000	1,285,438.90	1.36

				所				
29	ICICI BANK LIMITED	-	IBN US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,900	1,209,441.05	1.28
30	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS COMPANY LIMITED	华润电 力控股 有限公 司	836 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	88,000	1,140,655.82	1.21
31	WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	-	053000 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	16,000	1,100,030.63	1.17
32	WUXI PHARMATECH CAYMAN INC.	-	WX US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	12,000	1,071,691.06	1.14
33	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	交通银 行股份 有限公 司	3328 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	248,000	1,049,285.97	1.11
34	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORPORATION LTD	中国铁 建股份 有限公 司	1186 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	200,000	1,045,112.04	1.11
35	HANG SENG BANK LIMITED	恒生银 行有限 公司	11 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	12,000	1,036,959.84	1.10
36	DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION COMPANY LIMITED	大唐国 际发电 股份有 限公司	991 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	400,000	991,307.52	1.05
37	SK INNOVATION CO LTD	-	096770 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	1,300	990,690.23	1.05
38	KOREA EXCHANGE BANK	-	004940 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	22,000	990,138.01	1.05
39	DONGFENG MOTOR	东风汽	489	香 港	香港	100,000	970,111.80	1.03

	GROUP COMPANY LIMITED	车集团 股份有 限公司	HK	证 券 交 易 所				
40	CHINA CITIC BANK CORPORATION LIMITED	中信银 行股份 有限公 司	998 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	300,000	966,035.70	1.03
41	LG DISPLAY CO LTD	-	034220 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	8,000	943,198.95	1.00
42	DGB FINANCIAL GROUP INC	-	139130 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	12,000	917,796.64	0.97
43	SK TELECOM CO LTD	-	017670 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	1,300	897,364.34	0.95
44	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL COMPANY LTD	中国建 材股份 有限公 司	3323 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	130,000	878,562.59	0.93
45	SK HOLDINGS CO LTD	-	003600 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	1,200	878,036.49	0.93
46	HANA FINANCIAL GROUP INC	-	086790 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	4,200	839,601.69	0.89
47	TATA MOTORS LIMITED	-	TTM US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,000	833,368.82	0.88
48	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	国泰航 空有限 公司	293 HK	香 港 证 券 交 易 所	香港	80,000	812,611.30	0.86
49	HANWHA CORPORATION	-	000880 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	5,000	777,255.58	0.83

50	WILMAR INTERNATIONAL LTD	-	WIL SP	新加坡证券交易所	新加坡	40,000	720,962.71	0.77
51	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	东方海外（国际）有限公司	316 HK	香港证券交易所	香港	23,000	705,002.26	0.75
52	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源控股有限公司	3800 HK	香港证券交易所	香港	230,000	315,001.01	0.33

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	3618 HK	2,926,121.72	2.96
2	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORPORATION (SINOPEC)	386 HK	2,732,248.27	2.76
3	TATA MOTORS LIMITED	TTM US	2,700,117.72	2.73
4	CNOOC LIMITED	883 HK	2,420,866.02	2.45
5	CHINA MOBILE LIMITED	941 HK	2,389,387.23	2.42
6	LENOVO GROUP LIMITED	992 HK	2,213,438.03	2.24
7	PETROCHINA COMPANY LIMITED	857 HK	2,136,452.04	2.16
8	CHINA	1333 HK	2,036,462.85	2.06

	ZHONGWANG HOLDINGS LIMITED			
9	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	1,950,493.16	1.97
10	CHEUNG KONG (HOLDINGS) LIMITED	1 HK	1,854,852.78	1.87
11	CHINA TELECOM CORPORATION LIMITED	728 HK	1,708,815.76	1.73
12	INFOSYS LIMITED	INFY US	1,706,506.60	1.72
13	STERLITE INDUSTRIES (INDIA) LTD	SLT US	1,635,360.38	1.65
14	NEW WORLD DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	17 HK	1,583,010.57	1.60
15	WIPRO LIMITED	WIT US	1,551,232.36	1.57
16	GUANGDONG INVESTMENT LIMITED	270 HK	1,516,313.80	1.53
17	ICICI BANK LIMITED	IBN US	1,400,344.37	1.42
18	SWIRE PACIFIC LIMITED	19 HK	1,312,823.85	1.33
19	GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDING LIMITED	493 HK	1,184,524.98	1.20
20	WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	053000 KS	1,183,716.74	1.20

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	AIA GROUP LTD	1299 HK	4,056,628.00	4.10
2	DONGFENG MOTOR GROUP COMPANY LIMITED	489 HK	3,547,062.09	3.59
3	DOOSAN INFRACORE CO LTD	042670 KS	3,380,934.50	3.42
4	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	1880 HK	2,950,677.81	2.98
5	SAMSUNG SDI CO LTD	006400 KS	2,903,864.80	2.94
6	TSINGTAO BREWERY COMPANY LIMITED	168 HK	2,727,110.92	2.76
7	SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	631 HK	2,668,092.82	2.70
8	HANKOOK TIRE CO LTD	000240 KS	2,594,372.02	2.62
9	PING AN INSURANCE (GROUP) COMPANY OF CHINA LIMITED	2318 HK	2,429,707.96	2.46
10	SANDS CHINA LTD	1928 HK	2,380,481.79	2.41
11	NCSoft CORPORATION	036570 KS	2,361,278.39	2.39
12	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED	1088 HK	2,191,228.13	2.21
13	CHINA RESOURCES	291 HK	2,189,268.44	2.21

	ENTERPRISE LTD			
14	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	2,148,055.76	2.17
15	CHEIL INDUSTRIES INC	001300 KS	2,138,311.12	2.16
16	TATA MOTORS LIMITED	TTM US	1,975,864.17	2.00
17	INFOSYS LIMITED	INFY US	1,786,698.92	1.81
18	S-OIL CORPORATION	010950 KS	1,744,987.95	1.76
19	LG CHEM LTD	051910 KS	1,731,782.64	1.75
20	LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	010120 KS	1,632,177.13	1.65

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	63,714,021.82
卖出收入（成交）总额	60,832,645.95

注：“买入成本”或“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	4,415,052.47
3	应收股利	513,495.43
4	应收利息	337.68
5	应收申购款	78,201.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,007,087.09

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金可以将不高于 20% 的股票资产投资于除在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外）之外的其他企业，本报告期末该部分股票的投资比例为 0。

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	持有份额	占总份额

			例		比例
7,290	16,789.61	119.01	0.00%	122,396,174.18	100.00%

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	40,722.42	0.0333%

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（2010 年 1 月 21 日）基金份额总额	592,067,217.31
本报告期期初基金份额总额	128,102,134.81
本报告期基金总申购份额	4,251,587.21
减：本报告期基金总赎回份额	9,957,428.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	122,396,293.19

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

基金管理人于 2012 年 3 月 3 日发布了《易方达基金管理有限公司高管人员变更公告》，经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]266 号文核准批复，自 2012 年 3 月 1 日起基金管理人聘任肖坚先生、陈志民先生担任公司副总经理。

本报告期内本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	
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	27,051,825.02	21.72%	27,051.82	20.42%	—
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	26,286,813.08	21.11%	26,286.81	19.85%	—
Citigroup Global Markets Limited	1	18,480,362.87	14.84%	18,480.34	13.95%	—
Daishin Securities	1	17,664,753.35	14.18%	17,664.47	13.34%	—

(Asia) Ltd						
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	10,129,578.38	8.13%	17,608.78	13.30%	-
UBS Securities Asia Limited	1	9,139,006.23	7.34%	9,357.62	7.07%	-
Shin Han Investment Corp.	1	8,109,396.11	6.51%	8,109.21	6.12%	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	1	6,680,754.73	5.36%	6,680.66	5.04%	-
CLSA Limited	1	1,004,178.03	0.81%	1,205.02	0.91%	-
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	1	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	1	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	1	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Daewoo Securities	1	-	-	-	-	-
Woori Investment & Securities	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的

开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets	-	-	-	-	-	-	-	-

Limited								
Daishin Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Shin Han Investment Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daewoo Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Woori Investment &	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities								
------------	--	--	--	--	--	--	--	--

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	2012-01-05
2	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-14
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加财富里昂证券为代销机构及在财富里昂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	2012-01-19
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安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	2012-01-20
5	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年 3 月 1 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-27
6	易方达基金管理有限公司关于延长中国工商银行借记卡基金网上直销申购费率优惠期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-29
7	易方达基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-03
8	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年 4 月 6 日、4 月 9 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-29
9	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	2012-03-31
10	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年 4 月 11 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-06
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国泰君安证券自助式交易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	2012-04-09
12	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-16

	件的公告		
13	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农业银行网上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	2012-04-27
14	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吴证券网上交易系统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	2012-05-04
15	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-05-19
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在渤海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	2012-05-21
17	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年 5 月 28 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-05-23
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华融证券网上交易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	2012-05-29
19	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年 6 月 6 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-01
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信万通证券为代销机构及在中信万通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	2012-06-11
21	易方达基金管理有限公司关于开通机构投资者网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-11
22	易方达基金管理有限公司关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2012 年 7 月 2 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-27
23	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优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-29
24	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	2012-06-29

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的文件；
2. 中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的文件；
3. 《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 《易方达亚洲精选股票型证券投资基金托管协议》；
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
7. 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
二〇一二年八月二十四日