易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金2010年年度报告摘要

2010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:交通银行股份有限公司
送出日期:二〇一一年三月三十日

§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3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达科汇灵活配置混合
基金主代码	110012
交易代码	110012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月9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	1,379,974,506.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值型股票和固定收益品种,追求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,进行战术性资产配置,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,追求更高收益,回避市场风险。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率X60%+中债总指数收益率X40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,理论上其风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市体育西路189号城建大厦28楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年	2008年10月9日(基金合同生效日)至2008年12月31日
本期已实现收益	151,308,709.19	377,495,185.47	1,858,246.18
本期利润	324,638,582.60	555,984,513.04	10,820,029.46
加权平均基金份额本期利润	0.2853	0.6591	0.0122
本期基金份额净值增长率	16.83%	73.39%	-0.65%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.5863	0.4455	0.0376
期末基金资产净值	2,471,163,491.91	1,155,469,191.18	759,785,061.10
期末基金份额净值	1.791	1.533	1.006

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人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.本基金已于2008年11月7日对原基金科汇退市时的基金份额进行了拆分,基金拆分比例为1:1.032996474。

4. 本基金合同于2008年10月9日生效,合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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
过去三个月	7.12%	1.46%	1.70%	1.08%	5.42%	0.38%
过去六个月	30.83%	1.30%	4.16%	0.94%	26.67%	0.36%
过去一年	16.83%	1.27%	-14.76%	0.98%	31.59%	0.29%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	101.26%	1.34%	18.44%	1.22%	82.82%	0.12%

3.2.2 自基金转型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

易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金
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
(2008年10月9日至2010年12月31日)

注:1.易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同中关于基金投资比例的约定:

1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

2)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;

3)股票资产占基金资产的30%—80%;

4)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不超过本基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

5)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;

6)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%;

7)基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;

8)权证投资比例遵照《关于股权分置改革中证券投资基金投资权证有关问题的通知》(证监基金字[2005]138号)及相关规定执行;

9)资产支持证券投资比例遵照《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》(证监基金字[2006]93号)及相关规定执行;

10)流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》(证监基金字[2006]141号)及相关规定执行;

11)法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时,本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

2.本基金由原基金科汇于2008年10月9日转型而来。

3.本基金自基金转型后至报告期末的基金份额净值增长率为101.26%,同期业绩比较基准收益率为18.44%。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金
自基金转型以来每年净值增长率与业绩比较基准收益率图

注:本基金合同生效日为2008年10月9日,2008年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 自基金转型以来基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	-
2009年	1.500	96,356,504.20	30,070,473.43	126,426,977.63	-
2008.10.9(基金转型日)-2008.12.31	-	-	-	-	-
合计	1.500	96,356,504.20	30,070,473.43	126,426,977.63	-

§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2010年12月31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、广东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2010年12月31日,易方达基金管理有限公司共管理1只封闭式基金、23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。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)及基金经理助理的简介

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		
吴欣荣	本基金的基金经理、易方达价值精选股票型基金的基金经理、研究部总经理	2010-01-01	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、基金科瑞基金经理。
冯波	本基金的基金经理、易方达行业领先企业股票型基金的基金经理	2010-01-01	-	9年	硕士研究生,历任广东发展银行行员,易方达基金管理有限公司市场拓展部研究员、市场拓展部副经理、市场部大区销售经理、北京分公司副总经理、研究部行业研究员、基金经理助理。

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。

3.根据2011年1月8日《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金经理变更公告》,自2011年1月10日起吴欣荣不再担任易方达科汇灵活配置混合型基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,无损害基金份额持有人利益的行为。本报告期曾出现2个交易日公募基金合计持有瑞贝卡超过总股本的10%的情况,后已及时调整至合规,除此以外,本基金在报告期内的运作符合法律法规和基金合同的规定。

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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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

2010年是经济危机后复苏的第二年,A股市场随着经济形势的变化而跌荡起伏,经济增长、通货膨胀和结构调整三者成为影响市场的主要因素。年初至6月初,经济的主要矛盾体现在经济增长过快,政策紧缩和经济结构转型成为主要方向。A股市场大幅下跌,地产、煤炭、银行等周期性股票跌幅较大,商业、医药、食品饮料等非周期行业表现突出。6月份至9月底,随着经济数据下滑,政策对经济增长关注增加,市场强劲反弹。成长性较高的中小盘股票表现较好,如新兴细分行业的园林、建筑装饰、家纺等表现强劲,IT、医药、食品饮料等行业也表现较好。四季度以后,通货膨胀成为经济主要矛盾,通胀受益板块如有色、农业、煤炭等大幅上涨,而医药、商业、地产、银行表现较弱。

2010年本基金在资产配置上相对灵活,债券方面主要配置企业债,同时保持较大比例现金参与新股申购。股票方面,在行业配置上以非周期性行业和高成长的新兴细分行业为主。个股选择上坚持投资具有安全边际的成长性股票,加强了对新兴细分行业(如园林、建筑装饰、家纺等)的研究,并进行重点配置,取得了较好的效果。

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1.791元,本报告期份额净值增长率为16.83%,同期业绩比较基准收益率为-14.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年,处理好稳定经济增长、调整经济结构、管理通货膨胀预期的关系仍将是政府工作主要目标,这三个目标中任何一个发生重大变化都将对我国经济运行、政策制定和市场预期产生重大影响。目前全球经济仍将处于弱复苏的状态,而影响中国经济的内外部因素不确定性正在加大。2011年我们将重点关注以下因素:一是通货膨胀率的走势。目前通胀水平在4%-5%之间,这一位置处于政策的临界点,高于或低于这一水平,均将带来对政策预期的变化;二是发达国家经济复苏的状况。经过两年多的调整,发达国家经济复苏水平有可能在2011年取得超预期进展,这将对全球大宗商品价格、贸易状况、发展中国家经济增长与汇率政策等产生重大影响。除此这外,中国的利率政策、汇率政策、房地产政策以及"十二五"相关政策都将对经济产生较大的影响。从中期来看,我们对中国经济充满信心。

随着通胀压力的加大以及货币政策回归正常化,A股市场流动性偏紧将持续较长时间,估值水平将受到压制,市场变化将更加复杂。2011年,本基金将保持相对灵活的资产配置。股票方面,行业配置适度均衡,并重点关注以下行业和公司的投资机会:(1)高端装备制造业、节能环保行业、新能源行业等政府鼓励的行业;(2)反映现阶段中国经济增长特征的新兴细分行业;(3)周期性行业可能存在的系统性机会;(4)具有安全边际前提下,超预期成长的公司;(5)明显受益于"十二五"规划的行业。债券方面,关注通胀背景下、利率持续上升过程中存在的投资机会,同时关注可转债市场的投资机会。

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

根据相关法律法规及《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金合同》,本基金本报告期应分配利润80,907,287.31元;本报告期内未进行利润分配;本报告期应分配尚未实施的利润为80,907,287.31元。本基金已于2011年2月15日进行了收益分配,每10份基金份额派0.70元。

§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

2010年度,基金托管人在易方达科汇灵活配置混合型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

2010年度,易方达基金管理有限公司在易方达科汇灵活配置混合型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,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2010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科汇灵活配置混合型证券投资基金的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 审计报告

安永华明会计师事务所审计了2010年12月31日的资产负债表、2010年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:		
银行存款	166,606,115.05	236,581,964.75
结算备付金	5,146,045.40	2,713,121.81
存出保证金	1,444,035.78	1,369,093.24
交易性金融资产	2,292,098,089.13	929,008,395.82
其中:股票投资	1,928,494,217.68	918,548,270.82
基金投资	-	-
债券投资	363,603,871.45	10,460,125.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	17,050,000.00	2,663,608.33
应收利息	3,937,141.48	138,044.75
应收股利	-	-
应收申购款	7,539,016.08	18,260,425.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,493,820,442.92	1,190,734,654.62
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
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	1,628,546.56	489,691.82
应付赎回款	11,789,723.99	29,595,647.41
应付管理人报酬	3,086,099.59	1,429,510.89
应付托管费	514,349.92	238,251.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,941,251.58	1,521,908.31
应交税费	865,356.17	865,356.17
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,831,623.20	1,125,097.06
负债合计	22,656,951.01	35,265,463.44
所有者权益:		
实收基金	1,336,015,295.73	729,751,001.96
未分配利润	1,135,148,196.18	425,718,189.22
所有者权益合计	2,471,163,491.91	1,155,469,191.18
负债和所有者权益总计	2,493,820,442.92	1,190,734,654.62

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.791元,基金份额总额1,379,974,506.52份。

7.2 利润表

会计主体:易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	368,758,094.88	589,369,702.86
1.利息收入	6,783,729.16	4,111,299.54
其中:存款利息收入	2,033,827.43	1,572,517.35
债券利息收入	4,469,592.86	2,538,782.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	280,308.87	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	185,948,337.93	405,190,238.79
其中:股票投资收益	176,109,476.68	398,907,842.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,592,125.96	703,749.01
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	332,576.14
股利收益	7,246,735.29	5,246,071.15
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	173,329,873.41	178,489,327.57
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,696,154.38	1,578,836.96
减:二、费用	44,119,512.28	33,385,189.82
1.管理人报酬	27,162,062.48	16,101,109.15
2.托管费	4,527,010.47	2,683,518.20
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	11,692,772.64	14,126,909.71
5.利息支出	273,890.89	11,302.87
其中:卖出回购金融资产支出	273,890.89	11,302.87
6.其他费用	463,775.80	462,349.89
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	324,638,582.60	555,984,513.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	324,638,582.60	555,984,513.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	729,751,001.96	425,718,189.22	1,155,469,191.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	324,638,582.60	324,638,582.60
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)	606,264,293.77	384,791,424.36	991,055,718.13
其中:1.基金申购款	2,051,743,678.23	1,350,440,988.34	3,402,184,666.57
2.基金赎回款	-1,445,479,384.46	-965,649,563.98	-2,411,128,948.44
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)	1,336,015,295.73	1,135,148,196.18	2,471,163,491.91
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	731,387,087.05	28,397,974.05	759,785,061.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	555,984,513.04	555,984,513.04
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)	-1,636,085.09	-32,237,320.24	-33,873,405.33
其中:1.基金申购款	1,090,120,020.18	317,117,760.88	1,407,237,781.06
2.基金赎回款	-1,091,756,105.27	-349,355,081.12	-1,441,111,186.39
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)	-	-126,426,977.63	-126,426,977.63
五、期末所有者权益(基金净值)	729,751,001.96	425,718,189.22	1,155,469,191.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金(简称"本基金")由科汇证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1140号文《关于核准科汇证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》,科汇证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金,调整存续期限,终止上市交易,调整投资目标、范围和策略,修订基金合同,并更名为"易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金"。自2008年10月9日科汇证券投资基金在深圳证券交易所终止上市之日起,由《科汇证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为开放式基金,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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的有关规定,易方达基金管理有限公司于2008年11月7日对原基金科汇退市时的基金份额进行了份额拆分,拆分比例为1:1.032996474,并由注册登记机构进行了持有人份额的登记确认。

7.4.2 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>》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金于2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 关联方关系

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"广发证券")	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司(以下简称"粤财信托")	基金管理人股东
广东盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	103,149,249.48	1.31%	460,701,627.40	5.04%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31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	87,677.60	1.34%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	391,601.40	5.12%	-	-

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,162,062.48	16,101,109.15
其中:支付销售机构的客户维护费	2,252,837.07	597,120.88

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%/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首日起十五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,527,010.47	2,683,518.20

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月首日起十五个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	100,081,663.01	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	49,969,451.65	29,992,308.82	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	36,641,003.06	76,641,003.06
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	40,000,000.00
期末持有的基金份额	36,641,003.06	36,641,003.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.66%	4.86%

注:基金管理人上年度可比期间持有本基金份额变动相关的赎回费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	1,373,885.31	0.10%	1,373,885.31	0.18%

7.4.8.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	166,606,115.05	1,883,573.15	236,581,964.75	1,482,051.02

7.4.8.6 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 2010年1月1日至2010年12月31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	601126	四方股份	公开发行	26,982	620,586.00
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	002292	奥飞动漫	公开发行	8,816	202,062.72

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
002092	中泰化学	2010-04-19	2011-04-20	非公开发行流通受限	16.33	13.40	1,050,000	11,431,000.00	14,070,000.00	-
002164	东力传动	2010-08-20	2011-08-23	非公开发行流通受限	12.80	15.06	1,000,000	12,800,000.00	15,060,000.00	-
300125	易世达	2010-09-27	2011-01-13	新股流通受限	55.00	83.49	37,672	2,071,960.00	3,145,235.28	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股流通受限	23.00	31.11	26,982	620,586.00	839,410.02	-

注:(1)新疆中泰化学(集团)股份有限公司于2010年9月20日(流通受限期内)每10股派发人民币现金红利1.3元(含税),同时以资本公积金向全体股东每10股转增5股。

(2)以上"可流通日"中,部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31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。

7.4.10 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2010年12月31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1,945,387,089.13元,第二层级的余额为346,711,000.00元,无属于第三层级的余额(2009年12月31日:第一层级的余额为916,968,395.82元,第二层级的余额为12,040,000.00元,无属于第三层级的余额)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009年度:同)。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级,并于限售期满后从第二层级转入第一层级(2009年度:同)。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,928,494,217.68	77.33
	其中:股票	1,928,494,217.68	77.33
2	固定收益投资	363,603,871.45	14.58
	其中:债券	363,603,871.45	14.58
	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	171,752,160.45	6.89
6	其他各项资产	29,970,193.34	1.20
7	合计	2,493,820,442.92	100.00

8.2 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	8,529,000.00	0.35
B	采掘业	126,167,400.56	5.11
C	制造业	906,783,083.90	36.69
C0	食品、饮料	120,910,970.03	4.89
C1	纺织、服装、皮毛	7,895,946.52	0.32
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	205,374,778.30	8.31
C5	电子	29,160,623.33	1.18
C6	金属、非金属	153,925,921.84	6.23
C7	机械、设备、仪表	221,420,610.44	8.96
C8	医药、生物制品	121,654,830.52	4.92
C99	其他制造业	46,439,402.92	1.88
D	电力、煤气及水的生产和供应业	57,681,801.32	2.33
E	建筑业	283,618,595.98	11.48
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	120,316,084.55	4.87
H	批发和零售贸易	192,272,092.80	7.78
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	139,055,305.89	5.63
K	社会服务业	38,797,999.88	1.57
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	55,272,852.80	2.24
	合计	1,928,494,217.68	78.04

8.3 期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

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	002310	东方园林	1,584,762	218,681,308.38	8.85
2	000063	中兴通讯	2,473,448	67,525,130.40	2.73
3	600546	山煤国际	1,947,913	67,397,789.80	2.73
4	600888	新疆众和	2,619,746	63,004,891.30	2.55
5	002384	东山精密	839,466	62,699,715.54	2.54
6	000581	威孚高科	1,578,312	58,634,290.80	2.37
7	600199	金种子酒	2,774,586	57,905,609.82	2.34
8	600098	广州控股	6,899,737	57,681,801.32	2.33
9	600582	天地科技	2,179,560	56,646,764.40	2.29
10	002344	海宁皮城	943,310	51,768,852.80	2.09

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网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000063	中兴通讯	95,385,920.73	8.26
2	002310	东方园林	89,181,102.80	7.72
3	601601	中国太保	77,140,861.15	6.68
4	600546	山煤国际	74,952,256.40	6.49
5	000568	泸州老窖	70,739,003.12	6.12
6	600000	浦发银行	68,792,412.78	5.95
7	601318	中国平安	65,572,998.17	5.68
8	000422	湖北宜化	62,539,623.52	5.41
9	601998	中信银行	61,261,080.79	5.30
10	601018	宁波港	59,025,922.40	5.11
11	600888	新疆众和	58,195,487.22	5.04
12	600582	天地科技	57,749,884.61	5.00
13	600309	烟台万华	55,363,624.78	4.79
14	000762	西藏矿业	55,192,603.76	4.78
15	600098	广州控股	54,316,822.69	4.70
16	600199	金种子酒	54,146,311.96	4.69
17	002384	东山精密	54,125,267.19	4.68
18	000401	冀东水泥	51,791,023.98	4.48
19	601699	潞安环能	50,418,713.28	4.36
20	002344	海宁皮城	50,112,237.64	4.34
21	000061	农产品	49,282,118.83	4.27
22	000983	西山煤电	48,712,565.61	4.22
23	300055	万邦达	47,935,192.66	4.15
24	601288	农业银行	47,788,339.77	4.14
25	600383	金地集团	46,613,426.20	4.03
26	002164	东力传动	45,905,878.31	3.97
27	000792	盐湖钾肥	45,242,752.24	3.92
28	002045	广州国光	44,997,056.98	3.89
29	002038	双鹭药业	43,212,244.83	3.74
30	000002	万科A	42,953,915.57	3.72
31	002427	尤夫股份	36,206,427.95	3.13
32	002142	宁波银行	35,949,556.51	3.11
33	000417	合肥百货	35,450,431.34	3.07
34	000926	福星股份	34,997,106.50	3.03
35	000024	招商地产	32,982,384.42	2.85
36	600331	宏达股份	32,911,630.03	2.85
37	000729	燕京啤酒	32,691,751.09	2.83
38	000581	威孚高科	31,732,765.81	2.75
39	600141	兴发集团	31,348,628.34	2.71
40	000338	潍柴动力	31,342,423.50	2.71
41	002146	荣盛发展	31,140,352.50	2.70
42	600068	葛洲坝	30,752,731.45	2.66
43	002367	康力电梯	30,722,590.66	2.66
44	600729	重庆百货	30,261,970.59	2.62
45	600535	天士力	28,817,516.45	2.49
46	600592	龙溪股份	28,174,286.60	2.44
47	002230	科大讯飞	27,822,723.70	2.41
48	002080	中材科技	27,755,101.10	2.40
49	002290	禾盛新材	27,625,650.50	2.39
50	601888	中国国旅	27,592,877.96	2.39
51	002091	江苏国泰	27,202,116.49	2.35
52	000800	一汽轿车	27,147,379.72	2.35
53	002003	伟星股份	27,005,893.64	2.34
54	002322	理工监测	26,941,285.52	2.33
55	600289	亿阳信通	26,723,846.80	2.31
56	600221	海南航空	25,776,470.03	2.23
57	002250	联化科技	25,699,557.57	2.22
58	002004	华邦制药	25,506,434.36	2.21
59	600029	南方航空	25,440,833.84	2.20
60	600694	大商股份	25,065,744.90	2.17
61	000858	五粮液	23,970,784.29	2.07
62	000528	柳工	23,761,470.12	2.06
63	600115	东方航空	23,380,960.27	2.02
64	002277	友阿股份	23,266,646.35	2.01

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。

8.4.2 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	000063	中兴通讯	96,651,767.29	8.36
2	601601	中国太保	78,719,666.11	6.81
3	600439	瑞贝卡	73,342,706.95	6.35
4	600348	国阳新能	70,962,277.90	6.14
5	002106	莱宝高科	70,573,378.67	6.11
6	600000	浦发银行	65,423,905.14	5.66
7	000422	湖北宜化	63,459,658.09	5.49
8	601318	中国平安	63,021,912.20	5.45
9	601998	中信银行	59,651,818.04	5.16
10	000513	丽珠集团	52,630,803.79	4.55
11	000417	合肥百货	52,613,747.28	4.55
12	601018	宁波港	50,627,362.48	4.38
13	000762	西藏矿业	50,350,265.06	4.36
14	600223	鲁商置业	49,510,088.33	4.28
15	601288	农业银行	47,900,479.72	4.15
16	000800	一汽轿车	47,343,026.68	4.10
17	002045	广州国光	46,567,642.57	4.03
18	000568	泸州老窖	46,093,725.90	3.99
19	600016	民生银行	46,073,245.43	3.99
20	000338	潍柴动力	43,051,709.64	3.73
21	000002	万科A	42,443,751.91	3.67
22	000983	西山煤电	41,313,896.89	3.58
23	002310	东方园林	39,902,486.01	3.45
24	600331	宏达股份	38,311,967.28	3.32
25	002080	中材科技	36,965,555.01	3.20
26	600546	山煤国际	36,813,030.02	3.19
27	002142	宁波银行	36,572,481.80	3.17
28	000401	冀东水泥	36,429,054.93	3.15
29	002038	双鹭药业	34,555,609.97	2.99
30	000533	万家乐	34,085,040.23	2.95
31	601888	中国国旅	33,625,332.27	2.91
32	600858	银座股份	32,816,949.32	2.84
33	002230	科大讯飞	32,458,648.08	2.81
34	002017	东信和平	32,226,720.06	2.79
35	002315	焦点科技	30,785,097.72	2.66
36	600029	南方航空	30,160,121.30	2.61
37	002367	康力电梯	29,463,592.18	2.55
38	600309	烟台万华	28,236,384.84	2.44
39	000024	招商地产	27,688,522.66	2.40
40	600267	海正药业	27,464,205.84	2.38
41	601001	大同煤业	27,399,889.53	2.37
42	000039	中集集团	27,331,755.51	2.37
43	600592	龙溪股份	26,981,349.93	2.34
44	600115	东方航空	26,901,186.30	2.33
45	600289	亿阳信通	25,440,498.04	2.20
46	600221	海南航空	25,049,296.22	2.17
47	600141	兴发集团	25,002,335.96	2.16
48	300055	万邦达	24,864,586.09	2.15
49	002252	上海莱士	24,104,056.15	2.09
50	600366	宁波韵升	23,988,259.46	2.08
51	300050	世纪鼎利	23,449,774.76	2.03
52	000858	五粮液	23,287,143.16	2.02
53	000528	柳工	23,264,607.83	2.01

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。

8.4.3 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	4,325,649,218.95
卖出股票收入(成交)总额	3,666,124,838.35

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。

8.5 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	97,820,000.00	3.96
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	7,957,227.60	0.32
5	企业短期融资券	219,761,000.00	8.89
6	可转债	38,065,643.85	1.54
7	其他	-	-
8	合计	363,603,871.45	14.71

8.6 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	1081212	10豫投资CP01	700,000	70,028,000.00	2.83
2	1081133	10昆自CP01	500,000	50,055,000.00	2.03
3	1001019	10央行票据19	500,000	48,915,000.00	1.98
4	1001021	10央行票据21	500,000	48,905,000.00	1.98
5	113002	工行转债	301,840	35,659,377.60	1.44

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	1,444,035.78
2	应收证券清算款	17,050,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,937,141.48
5	应收申购款	7,539,016.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,970,193.34

8.9.4 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。

8.9.5 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的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
75,725	18,223.50	700,151,483.00	50.74%	679,823,023.52	49.26%

注:持有人户数含未确权的原持有人户数

9.2 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	1,137,501.87	0.0824%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年10月9日)基金份额总额	800,000,000
本报告期期初基金份额总额	753,823,775.88
本报告期基金总申购份额	2,119,357,393.47
减:本报告期基金总赎回份额	1,493,206,662.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,379,974,506.52

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自转型以来连续3年聘请安永华明会计师事务所提供审计服务,本报告年度的审计费为130,000.00元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	2	1,814,472,915.91	23.05%	1,483,196.58	22.73%	-
安信证券	2	1,724,574,486.76	21.91%	1,422,398.69	21.80%	-
德邦证券	1	1,588,257,175.55	20.17%	1,350,015.89	20.69%	-
申银万国	1	923,724,476.72	11.73%	785,159.99	12.03%	-
中信证券	1	773,669,481.28	9.83%	628,612.69	9.63%	-
世纪证券	1	476,362,788.28	6.05%	387,047.12	5.93%	-
招商证券	1	468,732,867.36	5.95%	380,850.38	5.84%	-
广发证券	1	103,149,249.48	1.31%	87,677.60	1.34%	-

注:a)本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

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。

11.7.2 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
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	21,980,769.00	4.21%	300,000,000.00	100.00%	-	-
德邦证券	214,645,962.70	41.14%	-	-	-	-
申银万国	280,055,063.70	53.67%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	5,125,002.00	0.98%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一一年三月三十日