易方达增强回报债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达增强回报债券	
基金主代码	110017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年3月19日	
报告期末基金份额总额	3,014,937,938份	
投资目标	通过主要投资于债券品种,力争为基金持有人创造较高的当期收益和总回报,实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在非信用类固定收益品种(国债、央行票据等)、信用类固定收益品种(含可转换债券)、新股(含增发)申购及套利性股票投资之间的配置:1)基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析,预测固定收益品种的投资收益和风险;2)对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析,考察其对固定收益市场信用利差的影响;3)基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析,预测新股申购的收益率以及风险;4)套利性投资机会的投资期间及预期收益率;5)股票市场走势的预测;6)可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。	
业绩比较基准	中债总指数(全价)	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险的品种,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
下属两级基金的交易代码	110017	110018
报告期末下属两级基金的份额总额	2,094,679,249.77份	920,258,688.23份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)	
	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
1.本期已实现收益	-22,768,780.72	-11,175,079.38
2.本期利润	-72,868,790.19	-29,837,556.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0311	-0.0301
4.期末基金资产净值	2,209,583,933.70	963,599,729.18
5.期末基金份额净值	1.055	1.047

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、易方达增强回报债券A:

阶段	净值增长率①	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	-2.94%	0.36%	-0.26%	0.13%	-2.68%	0.23%

2、易方达增强回报债券B:

阶段	净值增长率①	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	-3.15%	0.36%	-0.26%	0.13%	-2.89%	0.23%

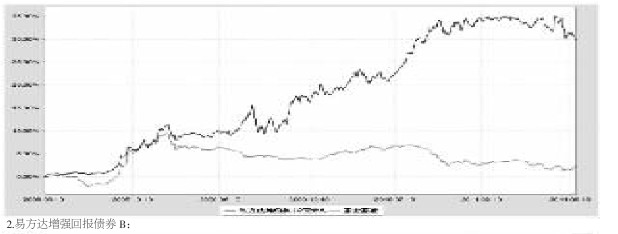
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达增强回报债券型证券投资基金

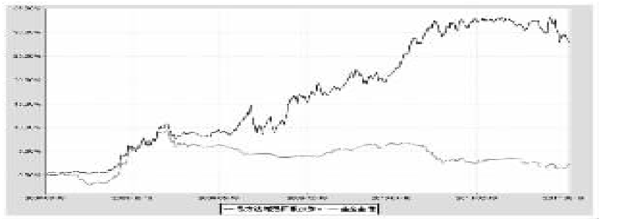
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年3月19日至2011年9月30日)

1.易方达增强回报债券A:



2.易方达增强回报债券B:



注:1. 基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)债券等固定收益资产的比例不低于基金资产的80%,其中,公司债、企业债、短期融资券、金融债等信用品种不低于固定收益类投资总额的50%,且可转换债券不高于基金资产净值的30%;股票等权益类品种不高于基金资产的20%;基金保留的现金以及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%;

(2)本基金投资于同一公司发行的股票不得超过基金资产净值的10%;

(3)本基金投资于同一公司发行的债券不得超过基金资产净值的10%;

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

(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(6)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%。;本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(7)本基金在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(8)本基金参与股票发行申购,所申报的金额不超过本基金的总资产,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;

(9)中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制;

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整;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个交易日内增加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,基金管理人履行相关程序后可将调整时限从10个交易日延长到3个月。法律法规如有变更,从其变更。

2. 本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3. 自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为30.05%,同期业绩比较基准收益率为2.39%;B类基金份额净值增长率为27.99%,同期业绩比较基准收益率为2.39%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟鸣远	本基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型基金的基金经理、易方达安心回报债券型基金的基金经理、固定收益部总经理	2008-3-19	-	11年	硕士研究生,曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员,联合证券有限责任公司固定收益部投资经理,泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员,新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理,易方达基金管理有限公司固定收益部经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理。
王晓晨	本基金的基金经理	2011-8-15	-	8年	学士本科,曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管。

注:1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期,钟鸣远的“任职日期”为基金合同生效之日,王晓晨的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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。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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年三季度,我国宏观经济各项指标在政策调控的影响下继续稳步回落,但通胀水平仍维持在高位并于7月份创下今年以来6.5%的新高。为稳定物价总水平,巩固宏观调控成果,央行继续执行名为“稳健”实则“从紧”的货币政策,7月份上调存贷款基准利率,8月份大幅扩大存款准备金征收范围,三季度国内货币供应量与贷款增速继续稳步回落。与此同时,三季度国际环境更加动荡不安:欧债危机升级,救助计划迟迟不能达成;美联储发布警告美国经济面临重大下行风险;全球资本市场、商品市场遭遇重大调整。

回顾三季度国内证券市场,债券市场包括可转债市场均延续了上半年的调整趋势,市场资金面在央行持续回笼基础货币的冲击下保持偏紧状态,短期利率好于年中水平但仍维持在高位。受此影响,债券市场收益率明显走高,短端上行幅度超过长端,收益率曲线呈现罕见的扁平化甚至倒挂现象。而近年来表现相对稳定的信用债在三季度更是遭遇了前所未有的负面冲击——城投债信用风波迭起、一级市场上扩容压力持续增大、长期机构投资者为回避信用风险与估值风险加速离场反过来对行情的下跌起到了推波助澜的作用,信用品种收益率全面超越历史最高水平。可转债市场方面,受股市低迷以及本身估值因素、流动性因素等综合影响,价格大幅下跌并向纯债价格靠拢,中信标普可转债指数三季度跌幅高达14.6%。

本报告期内,本基金相对准确把握宏观经济形势变化,基于对国内未来经济和通胀稳步回落的判断以及对信用品种违约风险、估值风险的担忧,本基金增持了利率品种和高等级短期融资券,谨慎配置中高等级公司债,回避低等级信用债。基于通胀压力短期内难以消除、政策紧缩将维持较长时期、权益类产品难寻较大系统性机会的判断,本基金降低了可转换债券仓位,谨慎参与新股申购并严格控制股票仓位,较好回避了三季度转债市场和股票市场的调整行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.055元,本报告期份额净值增长率为-2.94%,同期比较基准收益率为-0.26%;本基金B类基金份额净值为1.047元,本报告期份额净值增长率为-3.15%,同期业绩比较基准收益率为-0.26%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,随着通胀稳步回落,央行货币政策将进入一个相对稳定的观察期,债券市场可望走出阶段性的上涨行情。对于信用品种,在当前偏紧货币政策以及利率市场化逐步深化的过程中,企业融资需求以及改善负债结构的愿望越来越强烈,信用债市场仍面临较大压力。但对于中高等级信用债尤其是短期融资券,考虑持有期收益率已经具备配置价值。对于可转债,随着转债价格接近纯债,价格再度大幅下行的风险逐渐降低,可望出现波段操作的机会。

易方达增强回报基金下一阶段的操作将采取谨慎稳妥的投资策略,灵活调整组合久期,努力把握传统利率品种、高收益信用品种,以及可转换债券在不同市场环境下的阶段性机会,力争以理想的投资业绩回报基金持有人。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	318,007,688.57	7.52
	其中:股票	318,007,688.57	7.52
2	固定收益投资	3,820,118,951.74	90.37
	其中:债券	3,820,118,951.74	90.37
	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	27,427,893.35	0.65
6	其他各项资产	61,827,708.73	1.46
7	合计	4,227,382,242.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	118,810,433.60	3.74
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	23,304,000.00	0.73
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	23,737,500.00	0.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	6,764,367.90	0.21
C7	机械、设备、仪表	32,044,565.70	1.01
C8	医药、生物制品	32,960,000.00	1.04
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	10,423,367.22	0.33
I	金融、保险业	188,773,887.75	5.95
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	318,007,688.57	10.02

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601901	方正证券	28,997,525	188,773,887.75	5.95
2	600267	海正药业	1,000,000	32,960,000.00	1.04
3	601633	长城汽车	2,571,795	32,044,565.70	1.01
4	300198	纳川股份	1,125,000	23,737,500.00	0.75
5	002572	宁基股份	600,000	23,304,000.00	0.73
6	002563	森马服饰	206,526	10,423,367.22	0.33
7	601636	旗滨集团	711,290	6,764,367.90	0.21

注:本基金本报告期末仅持有以上股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	375,861,742.19	11.84
2	央行票据	144,890,000.00	4.57
3	金融债券	1,188,804,000.00	37.46
	其中:政策性金融债	1,188,804,000.00	37.46
4	企业债券	1,470,070,400.75	46.33
5	企业短期融资券	258,614,000.00	8.15
6	中期票据	-	-
7	可转债	381,878,808.80	12.03
8	其他	-	-
9	合计	3,820,118,951.74	120.39

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110248	11国开48	3,100,000	310,186,000.00	9.78
2	110225	11国开25	1,900,000	186,333,000.00	5.87
3	110013	国投转债	1,620,000	150,530,400.00	4.74
4	110310	11进出10	1,500,000	149,400,000.00	4.71
5	110016	川投转债	1,411,150	124,858,552.00	3.93

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	914,554.25
2	应收证券清算款	5,112,976.89
3	应收股利	-
4	应收利息	50,949,976.60
5	应收申购款	4,850,200.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,827,708.73

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110013	国投转债	150,530,400.00	4.74
2	110016	川投转债	124,858,552.00	3.93
3	113001	中行转债	11,684,025.90	0.37
4	110011	歌华转债	8,575,730.10	0.27

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601633	长城汽车	32,044,565.70	1.01	新股流通受限
2	601636	旗滨集团	6,764,367.90	0.21	新股流通受限
3	601901	方正证券	188,773,887.75	5.95	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
本报告期期初基金份额总额	2,627,919,491.83	1,078,830,452.22
本报告期基金总申购份额	212,611,099.52	267,819,134.91
减:本报告期基金总赎回份额	745,851,341.58	426,390,898.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,094,679,249.77	920,258,688.23

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准易方达增强回报债券型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达增强回报债券型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.《易方达增强回报债券型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。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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
二〇一一年十月二十五日

易方达医疗保健行业股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达医疗保健行业股票
基金主代码	110023
交易代码	110023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
报告期末基金份额总额	3,647,142,421.08份
投资目标	主要投资医疗保健行业股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据对医疗保健行业各子行业的综合分析,从中选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资,在努力控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为主动股票基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种,理论上其风险收益水平高于混合基金和债券基金。同时,本基金为行业基金,在享受医疗保健行业收益的同时,也必须承担单一行业带来的风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-16,261,593.72
2.本期利润	-254,403,350.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0701
4.期末基金资产净值	3,275,207,752.84
5.期末基金份额净值	0.898

注:1.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;

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

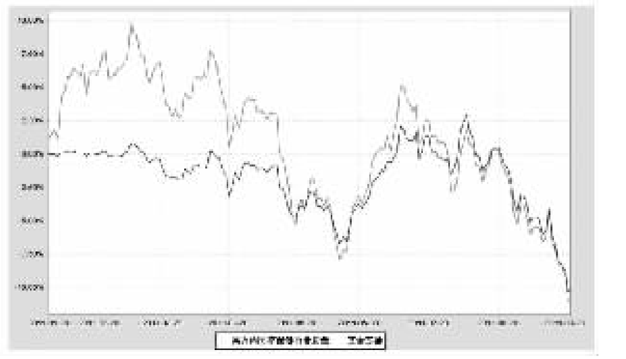
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.85%	0.87%	-8.46%	1.12%	1.61%	-0.25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达医疗保健行业股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年1月28日至2011年9月30日)



注:1.本基金合同于2011年1月28日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)股票资产占基金资产净值的比例为60%—95%;

(2)现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(3)本基金投资于上海申银万国证券研究所有限公司界定的医药生物行业股票的比例不低于股票资产的85%,如因基金管理人界定医疗保健行业的方法调整或者上市公司经营发生变化等,本基金持有申万研究界定的医药生物行业股票的比例低于股票资产的85%,本基金应在三十个交易日之内进行调整;

(4)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%;

(5)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%;

(6)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,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;

(7)进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(8)本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%;

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%;基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的20%;

(10)在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

(11)法律法规和基金合同规定的其他投资比例限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

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,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

3. 本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.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-10.20%,同期业绩比较基准收益率为-11.00%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李文健	本基金的基金经理、行业研究员	2011-1-28	-	11年	硕士研究生,曾任汇凯集团综合管理部业务主管、国泰君安证券股份有限公司研究所研究员、华林证券有限责任公司研究所研究员、鹏华基金管理有限公司研究部研究员。

注:1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日,“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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。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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年三季度,医药板块跟随大盘下跌。申万生物医药指数下降了10.51%,同期沪深300指数下降了15.21%。整个三季度医药板块的走势可以划分为两个阶段:

1)7月前半个月,医药股出现了一波较大幅度的上涨,医药指数上涨了10.2%。这既是对二季度医药股大幅下跌的纠正,也是对下半年医药行业利润总额增速回升的预期,部分优质公司良好的中报业绩也起到推波助澜的作用。

2)7月15日至9月底,在国内外多重利空因素的作用下,A股市场呈现大幅下跌,沪深300指数跌幅近20%。医药板块跟随大盘下跌,并没有表现出如前两年般的抗跌性。究其原因:一方面,1-6、1-7月医药行业利润总额增速的回升并不明显;另一方面,相对全市场估值水平,整个板块的估值溢价率仍较高。

由于上半年医药板块跌幅较大,三季度伊始,本基金加快了建仓步伐。至8月初,仓位接近80%。随后大盘出现系统性风险,但考虑到医药行业的增速有望在下半年回升,高估值也有望在跨年度切换后得到化解,因此没有主动减仓,维持80%的仓位至季度末。

个股配置方面做了部分调整,但仍偏重于产业基础良好、增长稳定、估值水平适中的公司,以及未来两三年业绩有望大幅增长的成长性企业。

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0.898元,本报告期份额净值增长率为-6.85%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对医药板块在四季度的表现持相对乐观的态度,主要是基于以下的判断:

1)1-7月医药行业的销售收入增速达到30%的较高水平,说明医药的消费需求旺盛。在政府持续紧缩的宏观调控下,四季度CPI有望逐步回落,压制利润增长的高成本因素也将逐步缓解,医药行业利润总额的增速预期得以回升。

2)经过近一年的调整,目前医药板块2011年动态PE为25倍左右,处于历史上较低的水平。作为稳定增长的行业,第四季度往往是医药行业估值跨年度切换的时间点,展望2012年,目前的估值水平则更低。

3)行业政策层面,相比药品价格,药品质量越来越得到政府的重视,政府将逐步引导各省招标从单纯的“唯低价是取”向“质量优先、价格合理”转变,这将有利于以上市公司为代表的品质优秀的大型企业,行业集中度将逐步提高。

因此,本基金在第四季度仍保持较高的仓位,重点仍为直接受益于医改的高端处方药企业、受益于基层医疗建设和新GMP实施的医疗器械类企业、受益于消费升级的品牌OTC企业以及受益于国际产业转移的特色原料药企业。

本基金长期看好医疗保健行业的投资价值,将坚持价值投资的理念,努力抓住医疗改革、人口老龄化、产业升级、产业整合等主题带来的投资机会,寻找持续成长性好、竞争优势显著、定价相对合理的投资品种,提高投资操作的效率,争取为投资者取得良好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,643,237,292.94	80.31
	其中:股票	2,643,237,292.94	80.31
2	固定收益投资	328,721,000.00	9.99
	其中:债券	328,721,000.00	9.99
	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	300,315,959.20	9.12
6	其他各项资产	18,943,964.05	0.58
7	合计	3,291,218,216.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,359,782,471.42	72.05
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	-	-
C7	机械、设备、仪表	121,819,076.59	3.72
C8	医药、生物制品	2,237,963,394.83	68.33
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	253,282,260.72	7.73
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	30,172,560.80	0.92
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,643,237,292.94	80.70

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002038	双鹭药业	5,453,607	176,424,186.45	5.39
2	000423	东阿阿胶	4,227,532	175,400,302.68	5.36
3	000538	云南白药	3,011,381	170,143,026.50	5.19
4	000963	华东医药	6,452,684	162,994,797.84	4.98
5	600267	海正药业	4,804,243	158,347,849.28	4.83
6	600521	华海药业	10,064,876	139,499,181.36	4.26
7	600535	天士力	3,127,342	124,030,383.72	3.79
8	600276	恒瑞医药	4,228,949	122,893,257.94	3.75
9	600518	康美药业	8,649,474	122,390,057.10	3.74
10	000028	一致药业	3,279,016	81,581,918.08	2.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	328,721,000.00	10.04
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	328,721,000.00	10.04

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1181287	11中电投CP02	1,500,000	149,445,000.00	4.56
2	1181149	11盘投CP01	600,000	59,724,000.00	1.82
3	1181289	11中电投CP03	500,000	49,815,000.00	1.52
4	1181132	11渝机电CP01	500,000	49,795,000.00	1.52
5	1181107	11酒钢CP01	200,000	19,942,000.00	0.61

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	266,660.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,819,324.63
5	应收申购款	13,857,978.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,943,964.05

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,380,179,208.91
本报告期基金总申购份额	819,846,377.07
减:本报告期基金总赎回份额	552,883,164.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,647,142,421.08

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达医疗保健行业股票型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达医疗保健行业股票型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.《易方达医疗保健行业股票型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。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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
二〇一一年十月二十五日

易方达中小盘股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中小盘股票
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月19日
报告期末基金份额总额	1,846,584,289.86份
投资目标	通过投资具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,力求在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	采取“自下而上”的策略,投资具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票,以谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	45%×天相中盘指数收益率+35%×天相小盘指数收益率+20%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是主动股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,理论上其风险收益水平高于混合型基金和债券基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-54,394,609.86
2.本期利润	-270,728,074.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1495
4.期末基金资产净值	2,926,502,365.96
5.期末基金份额净值	1.5848

注:1.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;

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

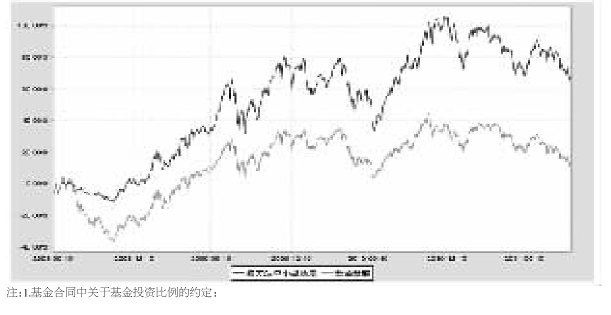
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.20%	1.20%	-12.21%	1.11%	4.01%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达中小盘股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年6月19日至2011年9月30日)



注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)股票资产占基金资产的60%—95%;债券、资产支持证券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及投资于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%。本基金投资中小盘股票的资产不低于股票资产的80%;

(2)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%;

(3)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%;

(4)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,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)法律法规和基金合同规定的其他限制。

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。法律法规另有规定时,从其规定。

2.本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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63.61%,同期业绩比较基准收益率为9.95%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何云峰	本基金的基金经理、易方达积极成长基金的基金经理、基金投资部总经理助理	2008-6-19	-	7年	博士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。

注:1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日,“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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。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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年3季度,A股市场延续2季度的下跌走势,且跌幅加剧。海外市场在欧债危机愈演愈烈和QE2结束后美国疲软经济数据的背景下大幅下挫,全球经济发展前景继2008年之后再次蒙上阴影。国内经济增长在持续的货币紧缩政策调控下增速下滑,企业盈利增长面临一定压力,但国内CPI数据的持续高涨使得紧缩压力不减,投资者开始担忧内外因素双重作用下国内经济的增长速度,市场参与热情下降,成交量急剧萎缩。本季上证综合指数下跌402.86点,跌幅达14.59%,从板块及个股走势上看,市场呈现普跌格局。上半年表现较好的水泥、化工等价格敏感板块大幅下跌;受紧缩政策影响较大的银行、地产、钢铁、机械、煤炭等周期类板块跌幅较大;估值较高的医药、新兴产业等中小市值板块个股大部分走势仍较差;而食品饮料、纺织服装、家纺等稳定增长板块受业绩超预期影响则表现较好。

由于对A股市场3季度走势判断过于乐观,尤其对欧债危机的演变始料未及,易方达中小盘基金保持了较高股票仓位,导致基金净值受损较大,值得反思。在操作上本基金仍然坚持自下而上重点选择基本面优良、业绩成长空间较大、估值相对合理的中小盘成长股作为构建组合的核心品种。在行业配置上,维持了受益于中长期产业结构调整和升级的机械、新材料等板块重点配置,逢低继续增持了部分跌幅较大、基本面优良的中小盘个股,对基本面优良、具备价格弹性的煤炭、化工等周期类板块也基本保持了配置,而对竞争力一般,估值较高的新兴产业板块个股适当进行了减持。从实际效果来看,表现一般,虽然股票结构尚可,但整体仓位偏重。

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1.5848元,本报告期份额净值增长率为-8.20%,同期业绩比较基准收益率为-12.21%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年4季度,全球经济仍处于扑朔迷离中。海外经济在量化宽松的货币政策结束后走势如何?下一轮经济增长的驱动力是什么?欧债危机如何进一步演变?这些都充满着不确定性。而国内经济增长在全球经济增长放缓和国内持续货币紧缩政策调控下面临一定的压力,尤其是国内CPI数据的持续高涨使得政策短期操作空间较小,预计4季度CPI涨幅将呈现高位逐步回落,紧缩政策的实施力度将可能略有减弱。国内调控政策将不断在保持经济稳定较快增长、控制通胀压力和经济结构转型之间寻求平衡。

从估值角度看,随着市场的整体大幅回落,目前大部分板块个股已处于投资价值区间,但行业变化趋势差异较大,因此未来不同行业和个股基本面的差异将导致估值水平的持续较大分化。竞争力强、成长空间大的优质成长股预计将获得市场追捧。此外,机械和新材料产业面临较大的产业升级和进口替代空间,业绩和估值都有较大提升可能。

基于上述判断,预计2011年4季度市场将处于震荡格局。市场结构性分化将较为明显。医药、新兴产业板块个股继续需要时间消化其相对偏高的估值,受益于产业升级的机械、新材料、低碳新能源等板块依然可能受到市场的关注。另外,自下而上发掘基本面超预期的成长股也将获得较大超额回报。易方达中小盘基金将采取自下而上的投资策略,重点挖掘和投资质地优良、行业发展空间较大、管理层优秀、相对其它企业有明显竞争优势的中小盘公司。策略上仍将以业绩弹性和成长空间较大的中小盘优质个股作为构建组合的首选品种,提高操作效率,争取为投资者带来更为丰厚的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,625,648,030.08	89.42
	其中:股票	2,625,648,030.08	89.42
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	303,994,923.14	10.35
6	其他各项资产	6,713,827.03	0.23
7	合计	2,936,356,780.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	280,691,677.08	9.59
C	制造业	1,510,857,669.23	51.63
C0	食品、饮料	66,704,977.10	2.28
C1	纺织、服装、皮毛	139,659,332.90	4.77
C2	木材、家具	52,758,345.46	1.80
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	133,629,675.14	4.57
C5	电子	138,999,618.34	4.75
C6	金属、非金属	172,370,748.24	5.89
C7	机械、设备、仪表	686,538,944.20	23.46
C8	医药、生物制品	120,196,027.85	4.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	108,035,193.60	3.69
E	建筑业	238,742,677.14	8.16
F	交通运输、仓储业	24,802,111.08	0.85
G	信息技术业	240,525,631.03	8.22
H	批发和零售贸易	117,811,216.02	4.03
I	金融、保险业	11,060,000.00	0.38
J	房地产业	50,184,920.56	1.71
K	社会服务业	42,936,934.34	1.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,625,648,030.08	89.72

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600888	新疆众和	8,002,356	172,370,748.24	5.89
2	600406	国电南瑞	4,001,318	139,966,103.64	4.78
3	600089	特变电工	13,399,437	137,612,217.99	4.70
4	600582	天地科技	6,596,557	122,959,822.48	4.20
5	600366	宁波韵升	6,098,922	116,306,442.54	3.97
6	002325	洪涛股份	4,820,242	97,368,888.40	3.33
7	600592	龙溪股份	9,800,332	96,533,270.20	3.30
8	600098	广州控股	16,006,016	93,635,193.60	3.20
9	600546	山煤国际	3,099,541	85,981,267.34	2.94
10	002310	东方园林	819,945	73,385,077.50	2.51

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58,884.98
5	应收申购款	6,154,942.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,713,827.03

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,705,358,806.74
本报告期基金总申购份额	354,771,679.18
减:本报告期基金总赎回份额	213,546,196.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,846,584,289.86

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准易方达中小盘股票型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达中小盘股票型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达中小盘股票型证券投资基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

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。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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
二〇一一年十月二十五日