易方达安心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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	易方达安心回报债券	
基金主代码	110027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月21日	
报告期末基金份额总额	1,166,913,733.57份	
投资目标	本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率,主要面向以储蓄存款为主要投资工具的中小投资者,追求基金资产的长期、持续、稳定增值,努力为投资者实现有吸引力的回报,为投资者提供养老投资的工具。	
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略,通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种的战略及战术资产配置,在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上,提高基金的收益水平。 具体来看,本基金主要通过研究各类资产在较长时期的收益与风险水平特征,及各类资产收益与风险间的相关关系,对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析,在本基金合同约定范围内制定合理的战略资产配置计划。 固定收益品种投资方面,本基金将经济分为衰退、萧条、复苏、繁荣四个阶段,并在各个阶段通过投资不同的固定收益类属资产,以获得超越长期平均通胀水平的回报。 权益类品种投资方面,本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略,严格管理权益类品种的投资比例以及净值的波动幅度。	
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)+1.0%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,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	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
下属两级基金的交易代码	110027	110028
报告期末下属两级基金的份额总额	341,575,699.92份	825,338,033.65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)	
	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
1.本期已实现收益	-3,101,058.09	-9,192,401.80
2.本期利润	-7,297,585.79	-20,242,628.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0178	-0.0187
4.期末基金资产净值	334,974,777.47	808,418,869.23
5.期末基金份额净值	0.981	0.980

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

1、易方达安心回报债券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	-2.00%	0.18%	1.45%	0.01%	-3.45%	0.17%

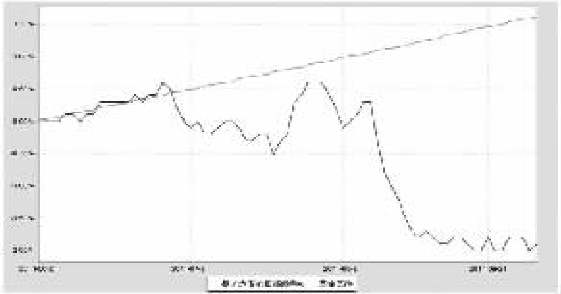
2、易方达安心回报债券B:

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	-2.10%	0.17%	1.45%	0.01%	-3.55%	0.16%

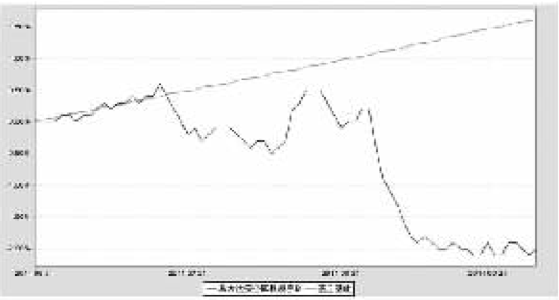
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达安心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
(2011年6月21日至2011年9月30日)

1.易方达安心回报债券A:



2.易方达安心回报债券B:



注:1.本基金合同于2011年6月21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)固定收益类品种的比例不低于基金资产的80%。

(2)权益类品种的比例不高于基金资产的20%。

(3)持有一家上市公司的股票,其市值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,不得超过该证券的10%。

(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%,本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期。

(6)本基金在任何交易日买入权证的总金额,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%,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%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定。

(7)本基金持有现金以及到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(8)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%。

(9)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%。

(10)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%。

(11)本基金管理人管理的全部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%。

(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

(13)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(14)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

3. 本基金的建仓期为六个月,本报告期本基金处于建仓期内。

4. 自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为-1.90%,同期业绩比较基准收益率为1.61%;B类基金份额净值增长率为-2.00%,同期业绩比较基准收益率为1.61%。

§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、易方达增强回报债券型基金的基金经理、固定收益部总经理	2011-6-21	-	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。

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,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逐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,本基金谨慎参与股票二级市场,继续保持较低的可转换债券仓位,基本回避新股申购,相对较好地回避了三季度股票市场和转债市场的调整行情。

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0.981元,本报告期份额净值增长率为-2.00%;本基金B类基金份额净值为0.980元,本报告期份额净值增长率为-2.10%,同期业绩比较基准收益率为1.45%。

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。对于股票市场,本基金将结合估值水平、政策动向等因素积极把握波段操作的机会。

易方达安心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、股票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	75,605,438.30	5.59
	其中:股票	75,605,438.30	5.59
2	固定收益投资	1,135,983,523.78	83.98
	其中:债券	1,135,983,523.78	83.98
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	67,900,221.85	5.02
	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	37,354,650.91	2.76
6	其他各项资产	35,759,742.65	2.64
7	合计	1,352,603,577.49	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	71,790,130.30	6.28
C0	食品、饮料	24,363,137.70	2.13
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	11,254,344.00	0.98
C5	电子	4,147,700.00	0.36
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	32,024,948.60	2.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,760.00	0.00
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,801,548.00	0.33
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
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	75,605,438.30	6.61

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	600887	伊利股份	1,331,319	24,363,137.70	2.13
2	002603	以岭药业	499,762	19,140,884.60	1.67
3	600267	海正药业	390,900	12,884,064.00	1.13
4	002326	永太科技	385,931	9,262,344.00	0.81
5	002528	英飞拓	190,000	4,147,700.00	0.36
6	002410	广联达	110,800	3,801,548.00	0.33
7	000731	四川美丰	300,000	1,992,000.00	0.17
8	002620	瑞和股份	500	13,760.00	0.00

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	100,801,079.88	8.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	520,249,000.00	45.50
	其中:政策性金融债	520,249,000.00	45.50
4	企业债券	313,702,433.40	27.44
5	企业短期融资券	189,321,000.00	16.56
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,910,010.50	1.04
8	其他	-	-
9	合计	1,135,983,523.78	99.35

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	110411	11农发11	1,200,000	120,600,000.00	10.55
2	110240	11国开40	1,000,000	99,690,000.00	8.72
3	110308	11进出08	1,000,000	99,590,000.00	8.71
4	110311	11进出11	700,000	70,105,000.00	6.13
5	110314	11进出14	600,000	60,504,000.00	5.29

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	375,000.00
2	应收证券清算款	23,938,955.74
3	应收股利	-
4	应收利息	11,285,402.01
5	应收申购款	160,384.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,759,742.65

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	110078	澄星转债	2,560,310.50	0.22

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情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
本报告期期初基金份额总额	476,546,478.86	1,313,683,053.68
本报告期基金总申购份额	2,462,135.66	5,024,272.85
减:本报告期基金总赎回份额	137,432,914.60	493,369,292.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	341,575,699.92	825,338,033.65

§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安心回报债券型证券投资基金募集的文件;
2.《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》;
3.《易方达安心回报债券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、营业执照;
6.基金托管人业务资格批件、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

易方达黄金主题证券投资基金(LOF)

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21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	易方达黄金主题(QDII-LOF-FOF)
基金主代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	1,150,803,944.08份
投资目标	本基金追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要通过对国际黄金价格中长期趋势的判断,深入研究黄金价格趋势、黄金采掘企业盈利和估值水平变化,以及考察其他品种的风险收益特征的基础上,进行黄金ETF、黄金股票类资产以及其他资产的比例配置。
业绩比较基准	以伦敦黄金市场下午定盘价计价的国际现货黄金(经汇率折算)。
风险收益特征	本基金的表现与黄金价格相关性较高,历史上黄金价格波幅较大,波动周期较长,预期收益可能长期超过或低于股票、债券等传统金融资产,因此本基金是预期收益与预期风险较高的基金品种。此外,本基金主要投资海外,存在汇率风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:无 中文名称:无
境外资产托管人	英文名称:The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited 中文名称:香港上海汇丰银行有限公司

§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	50,399,298.96
2.本期利润	32,401,174.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0168
4.期末基金资产净值	1,124,369,165.97
5.期末基金份额净值	0.977

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。

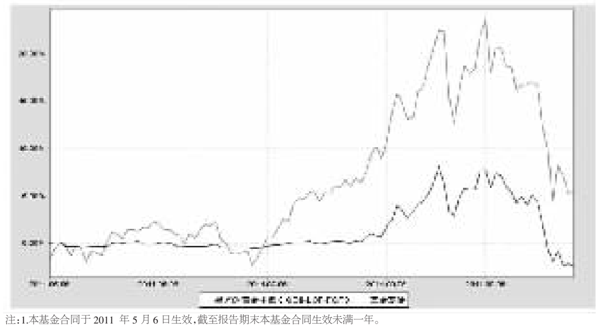
3.2 基金净值表现

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	-1.91%	0.95%	6.26%	1.85%	-8.17%	-0.90%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达黄金主题证券投资基金(LOF)
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5月6日至2011年9月30日)



注:1.本基金合同于2011年5月6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)投资于基金的资产合计不低于本基金基金资产净值的60%,投资于基金的资产中不低于80%投资于黄金基金。

(2)现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于本基金基金资产净值的5%。

(3)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)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)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市值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市值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)基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的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)每只境外基金投资比例不超过基金中基金资产净值的20%。如投资境外伞型基金,该伞型基金应当视为一只基金。

(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%。

(10)为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

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。

如法律法规或中国有关监管部门取消上述限制,本基金将不受上述限制。《中华人民共和国证券投资基金法》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,基金可依据届时有效的法律法规适时合理地调整上述限制。

3.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

4.本基金的建仓期为六个月,本报告期本基金处于建仓期内。

5.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-2.30%,同期业绩比较基准收益率为5.40%。

§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		
张小刚	本基金的基金经理、易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理	2011-5-6	-	12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 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。

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 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.4.1 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,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 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。

4.4.3 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2008年金融危机期间,美国银行体系信贷收缩成功被美联储第一次量化宽松扩张作用抵消,黄金从1000美元/盎司上涨到1100美元左右;第二次量化宽松,黄金在13个月内从1100美元上涨到1500美元左右。今年6月底二次量化宽松结束时,高失业率和欧洲债务危机使市场产生惯性思维,对美联储第三次量化宽松和欧洲央行政策预期更加高涨,黄金在一个半月的时间内从1500美元上涨到1900美元左右。随着美联储量化宽松政策大大低于市场预期,欧洲央行也无意在短期有实质性的扩张性政策,市场大失所望,黄金在9月迅速从1900美元下跌到1600美元左右。

易方达黄金主题基金今年5月份成立时,黄金在1500美元/盎司左右震荡。我们预计美欧经济将再次进入调整通道,而且预计第三次量化宽松不会很快推出,即使推出也对市场影响有限,这些因素都会对黄金价格形成压力。因此我们一直保持谨慎建仓节奏。在黄金价格如过山车的行情中虽然减少了基金净值波动,保留充足弹药,但错过一些交易性机会。

除了基本面因素外,一些短期技术因素加剧黄金价格调整。9月23日全球主要期货交易所提高了黄金交易保证金比例,导致部分强制平仓行为。同时很多对冲基金由于在其它资产如石油,铜和股票上大幅亏损,通过抛售获利的黄金来控制风险。同时,一个特殊因素会持续支持黄金价格,即主要发展中国家央行都在买入黄金,以便在未来货币体系重构的过程中取得主动地位,对黄金价格有强烈支持作用。

欧美央行的政策效果如当初预料中令市场失望,一方面是迫于政治压力,一方面是可用工具非常有限。市场和政府都意识到如果不修复消费者资产负债表,不修复希腊等政府的资产负债表,单独使用货币政策对经济的刺激作用非常有限。短期内全球经济面对的是发达国家消费者和政府都在缩减开支的现状,消费不足是发达经济体面临的挑战。从中长期来看,发达国家经济最终会恢复增长,在宽松的货币环境下,通胀最终将会抬头。适度配置黄金资产来保持购买力对投资者来讲非常重要。总的来讲,短期我们还会保持谨慎操作,但会积极把握黄金调整的机会增加仓位。

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0.977元,本报告期份额净值增长率为-1.91%,同期业绩比较基准收益率为6.26%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	31,102,305.11	2.61
	其中:普通股	22,438,034.45	1.89
	存托凭证	8,664,270.66	0.73
2	基金投资	678,311,032.02	56.99
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	1,737,548.30	0.15
	其中:远期	1,737,548.30	0.15
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	75,200,232.80	6.32
	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	382,856,455.68	32.17
8	其他各项资产	20,996,161.16	1.76
9	合计	1,190,203,735.07	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	26,581,212.18	2.36
香港	4,521,092.93	0.40
合计	31,102,305.11	2.77

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。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	31,102,305.11	2.77
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	31,102,305.11	2.77

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称(英文)	公司名称(中文)	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ABX US	BARRICK GOLD CORP	-	纽约证券交易所	美国	35,000	10,375,962.98	0.92
2	GG US	GOLDCORP INC	-	纽约证券交易所	美国	26,000	7,540,978.54	0.67
3	AU US	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	-	纽约证券交易所	美国	20,000	5,256,773.28	0.47
4	GFI US	GOLD FIELDS LTD	-	纽约证券交易所	美国	35,000	3,407,497.38	0.30
5	1818 HK	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	招金矿业股份有限公司	香港证券交易所	香港	235,000	2,491,016.45	0.22
6	2099 HK	CHINA GOLD INTERNATIONAL RESOURCES CORP LTD	中国黄金国际资源有限公司	香港证券交易所	香港	115,800	2,030,076.48	0.18

注:1.本基金本报告期末仅持有以上股票及存托凭证。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	远期交易	外汇远期(美元兑人民币)	373,746.00	0.03
2	远期交易	外汇远期(美元兑人民币)	363,521.00	0.03
3	远期交易	外汇远期(美元兑人民币)	363,234.00	0.03
4	远期交易	外汇远期(美元兑人民币)	337,204.50	0.03
5	远期交易	外汇远期(美元兑人民币)	299,842.80	0.03

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR Gold Trust	ETF(交易所交易基金)	Mutual Fund(共同基金)	World Gold Trust Services LLC/ USA	186,852,362.11	16.62
2	iShares Gold Trust	ETF(交易所交易基金)	Mutual Fund(共同基金)	BlackRock Fund Advisors	177,354,392.12	15.77
3	GBS Bullion Securities	ETC(交易所交易商品)	Mutual Fund(共同基金)	ETF Securities Management Co Ltd	150,115,447.80	13.35
4	ETFS Physical Gold	ETC(交易所交易商品)	Mutual Fund(共同基金)	ETF Securities Management Co Ltd	132,774,133.13	11.81
5	Market Vectors Gold Miners ETF	ETF(交易所交易基金)	Mutual Fund(共同基金)	Van Eck Associates Corp	31,214,696.86	2.78

注:本基金本报告期末仅持有以上基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	19,416,795.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,408.73
5	应收申购款	1,537,957.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,996,161.16

5.10.4 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。

5.10.5 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	2,657,035,909.18
本报告期基金总申购份额	51,031,090.07
减:本报告期基金总赎回份额	1,557,263,055.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,150,803,944.08

§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黄金主题证券投资基金(LOF)募集的文件;
2.《易方达黄金主题证券投资基金(LOF)基金合同》;
3.《易方达黄金主题证券投资基金(LOF)托管协议》;
4.基金管理人业务资格批件和营业执照;
5.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

易方达行业领先企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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	易方达行业领先股票
基金主代码	110015
交易代码	110015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月26日
报告期末基金份额总额	1,237,718,454.13份
投资目标	在优化行业资产配置的基础上,从行业领先企业中精选行业龙头与高成长企业进行投资,力求基金资产的长期增值。
投资策略	在行业配置的基础上,本基金将从各细分行业中选择行业领先企业,然后从行业领先企业中选择行业龙头企业和具有较高成长性的公司,构造股票组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
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高收益品种,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	中国工商银行股份有限公司

§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	-42,774,862.88
2.本期利润	-126,546,622.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1025
4.期末基金资产净值	1,417,421,981.49
5.期末基金份额净值	1.145

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。

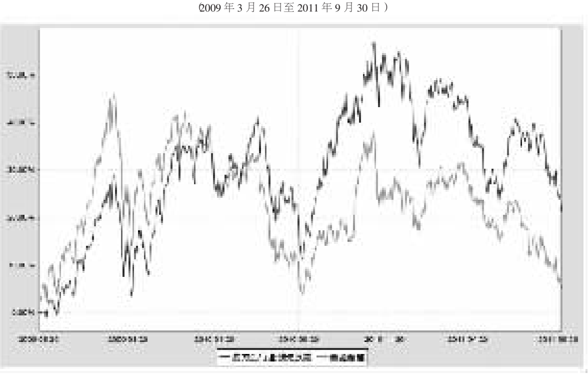
3.2 基金净值表现

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	-7.96%	1.16%	-12.21%	1.05%	4.25%	0.11%

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

易方达行业领先企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
(2009年3月26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%;本基金投资行业领先企业的资产不低于股票资产的80%;

(2)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%;

(3)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%;

(4)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,不超过该证券的10%;

(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(6)本基金在任何交易日买入权证的总金额,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%,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%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

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

(8)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

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21.66%,同期业绩比较基准收益率为5.23%。

§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		
冯波	本基金的基金经理、易方达科汇灵活配置混合型基金的基金经理	2010-1-1	-	10年	硕士研究生,曾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。

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

三季度,A股市场加速下跌,上证指数跌幅达14.59%,并创出2348点的年内新低。本季度行情可分为两个阶段:第一阶段从季初至8月中旬,市场以结构分化为主,由于投资者预期通胀见顶和政策放松,投资的风险偏好上升,上半年跌幅较大的消费医药类股票和中小盘成长股表现较好,而大盘股表现相对较弱;第二阶段从8月中旬到季末,由于欧美经济大幅低于预期,欧债危机恶化以及国内物价指数回落幅度低于预期、政策放松预期落空,投资者对经济中期前景变得悲观,风险偏好大幅下降,市场呈现普跌格局。

三季度,本基金主要以结构调整为主。行业配置上,加大了食品饮料、医药、装饰园林、精细化工等行业配置,降低了银行、地产、大宗化工品、有色等行业的比例。个股方面,加大了企业特点突出、业绩成长明确、估值水平合理的个股的投资比例。但是在三季度,欧美发达国家疲弱的经济状况和欧债危机的恶化程度,均严重超出我们的预期,导致我们在资产配置上出现偏差,股票仓位较高,基金净值跌幅较大。

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1.145元,本报告期份额净值增长率为-7.96%,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

未来一段时间,国内经济增长面临较多的不确定性因素。首先是经济的外部环境仍处于动荡之中。欧债危机是否对欧洲金融体系造成灾难性冲击,欧美经济是否再次衰退,各国政府能否合理应对财政危机等都存在较大的不确定性。国内经济方面,严厉的紧缩政策下,控制通货膨胀、保持经济合理增长和进行经济结构调整三者之间的矛盾也更加突出。但同时,经济增长的积极因素也较多。首先是全球新兴市场国家通胀水平普遍处于见顶回落过程中,国内CPI回落幅度虽然较缓,但趋势十分明确;其次大宗商品价格大幅下跌,有利于控制输入性通胀和降低企业成本;三是国内就业水平情况良好;四是发达国家的经济问题已暴露得比较充分,进一步恶化的可能性较小。因此我们对经济中期趋势的看法相对比较乐观。

展望后市,我们认为股票市场仍将处于振荡之中。一方面,内外部经济的不确定性将降低投资者的风险偏好,影响股票的估值水平;流动性紧张和股票市场持续扩容也对市场形成较大的制约因素。另一方面,通胀的持续回落将改善投资者的政策预期;极低的估值水平也会对市场形成支撑。

四季度,本基金在股票仓位上将更加灵活,重点关注全球经济企稳后可能存在的系统性投资机会。股票方面主要关注以下几点:一是符合我国经济结构调整方向的行业,如食品饮料、医药消费等;二是处于快速成长阶段的行业,如装饰、园林、煤机、精细化工、工业电容器产业链等;三是估值水平处于合理区间,经营特点突出、竞争力优势明显的成长性企业。

§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	1,222,548,703.66	85.98
	其中:股票	1,222,548,703.66	85.98
2	固定收益投资	32,259,963.60	2.27
	其中:债券	32,259,963.60	2.27
	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	164,278,829.43	11.55
6	其他各项资产	2,763,598.11	0.19
7	合计	1,421,851,094.80	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	160,931,325.14	11.35
C	制造业	662,406,698.91	46.73
C0	食品、饮料	100,079,802.22	7.06
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	10,296,829.60	0.73
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	80,788,301.23	5.70
C5	电子	71,835,352.74	5.07
C6	金属、非金属	90,193,412.10	6.36
C7	机械、设备、仪表	223,532,394.06	15.77
C8	医药、生物制品	82,772,606.96	5.84
C99	其他制造业	2,908,000.00	0.21
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,400,000.00	1.02
E	建筑业	182,798,368.74	12.90
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	77,847,086.40	5.49
H	批发和零售贸易	89,543,955.09	6.32
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	34,621,269.38	2.44
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,222,548,703.66	86.25

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	002310	东方园林	1,083,143	96,941,298.50	6.84
2	600888	新疆众和	3,769,095	81,186,306.30	5.73
3	600546	山煤国际	2,059,387	57,127,395.38	4.03
4	601699	潞安环能	1,770,900	51,692,571.00	3.65
5	600366	宁波韵升	2,488,834	47,462,064.38	3.35
6	600406	国电南瑞	1,308,496	45,771,190.08	3.23
7	600582	天地科技	2,320,342	43,251,174.88	3.05
8	000417	合肥百货	2,373,702	42,607,950.90	3.01
9	000581	威孚高科	1,120,137	36,538,868.94	2.58
10	600223	鲁商置业	5,229,799	34,621,269.38	2.44

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	32,259,963.60	2.28
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	32,259,963.60	2.28

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	010112	21国债⑿	322,020	32,259,963.60	2.28

注:本基金本报告期末仅持有以上债券。

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	884,865.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	929,890.76
5	应收申购款	948,841.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,763,598.11

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	1,179,401,236.43
本报告期基金总申购份额	122,722,644.27
减:本报告期基金总赎回份额	64,405,426.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,237,718,454.13

§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行业领先企业股票型证券投资基金募集的文件;
2.《易方达行业领先企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.《易方达行业领先企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