易方达岁丰添利债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

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

二〇一二年六月

重要提示

本基金根据2010年10月11日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]1358号)和2010年10月21日《关于易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2010]630号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2010年11月9日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金主要投资于固定收益品种并参与新股申购(含增发),投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,投资本基金可能遇到的风险包括:利率风险,本基金持有的信用类固定收益品种连约带来的信用风险,新股发行数量减少及新股申购收益率降低带来的风险,债券投资和新股申购出现亏损的风险,等等;基金运作风险,包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,等等。此外,本基金以1元初始面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破1元初始面值的风险。

基金不同于银行储蓄与债券,基金投资者有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

投资有风险,投资者投资本基金时应认真阅读本招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2012年5月9日,有关财务数据截止日为2012年3月31日,净值表现截止日为2011年12月31日。(本报告中财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

1.基金管理人:易方达基金管理有限公司

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

办公地址:广州市体育西路189号城建大厦25-28楼

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会,证监基金字[2001]4号

法定代表人:叶俊英

设立日期:2001年4月17日

组织形式:有限责任公司

注册资本:12,000万元人民币

存续期限:持续经营

联系人:陈晓梅

联系电话:400 881 8088

2.股权结构:

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总 计	100%

(二)主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

叶俊英先生,经济学博士,董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长,广东省烟草专卖局专卖办公室干部,广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁,易方达基金管理有限公司董事兼总裁、副董事长兼总裁。现任易方达基金管理有限公司董事长。

李建勇先生,经济学博士,董事。曾任广东省广晟资产经营有限公司副总经理。

杨方先生,EMBA,董事,曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理,佛山顺德百年科技有限公司行政总监,美的空调深圳营销中心区域经理,佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理,长虹空调广州营销中心营销总监,广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事、首席战略官。

刘晓艳女士,经济学博士,董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理,基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理,易方达基金管理有限公司督察员兼监察部总经理、总裁助理兼市场部总经理、公司副总裁,常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司董事、总裁,兼任易方达资产管理(香港)有限公司董事长。

谢石松先生,法学博士,独立董事。现任中山大学法学院教授、国际法研究所所长。兼任中国国际私法学会副会长,武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授,中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会成员,上海、广州、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员。

王化成先生,经济学博士,独立董事。曾任中国人民大学商学院助教、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授,博士生导师。

何小锋先生,经济学硕士,独立董事。曾任广东省副关市教育局干部,中共广东省副关市委宣传部干部,北京大学经济学院讲师、副教授、金融系主任兼教授及博士生导师。现任北京大学经济学院教授、博士生导师。

陈国祥先生,经济学硕士,监事会主席,曾任交通银行广州分行江南西营业部经理,广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理,易方达基金管理有限公司总裁助理兼市场拓展部总经理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李魁金先生,经济学硕士,监事,曾任华侨师范大学外语系党总支书记、中国证监会广州证管办处长。现任广州国际控股集团有限公司副总经理、广州市广永国有资产经营有限公司党支部书记、董事长兼总裁,万联证券有限责任公司董事长(兼)、广州银行副董事长(兼)。

廖智先生,经济学硕士,监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管,易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理,易方达基金管理有限公司人力资源部副总经理。现任易方达基金管理有限公司市场部总经理。

张优浩先生,MBA,常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理,广东证券公司发行上市部经理,深圳证券业务部总经理,基金部总经理,易方达基金管理有限公司董事兼副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁,兼任易方达资产管理(香港)有限公司董事。

肖坚先生,经济学硕士,副总裁,曾任广东粤财信托投资公司职员,香港安联投资有限公司财务部经理,粤信(香港)投资有限公司业务部副经理,广东粤财信托投资公司基金部经理,易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理、研究部总经理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼专户投资总监、专户首席投资官,基金科基金经理、易方达策略成长基金基金经理、易方达策略成长二号混合型基金基金经理、投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

陈志民先生,法学硕士,公共管理硕士,副总裁。曾任厦门国际信托投资公司信托部经理助理,南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资部副总经理(住管研究),易方达基金管理有限公司基金投资部副总经理、机构理财部总经理、基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资总监及基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资总监、基金首席投资官、基金科翔基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理,易方达积极成长基金基金经理,机构理财部投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

张南女士,经济学博士,督察长,曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长,易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、督察长兼监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

2.基金经理

钟鸣远先生,经济学硕士,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总经理助理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理,易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理(自2008年3月19日起),易方达岁丰添利债券型基金基金经理(自2010年11月9日起),易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理(自2011年6月21日起)。

3.境内投资决策委员会成员

本公司境内投资决策委员会成员包括:刘晓艳女士、肖坚先生、陈志民先生、马骏先生、刘霞先生。

刘晓艳女士,同上。

肖坚先生,同上。

陈志民先生,同上。

马骏先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),曾任君安证券有限公司营业部职员,深圳众大投资有限公司投资部副总经理,广发证券有限责任公司研究员,易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、固定收益投资总监、总裁助理、基金科讯基金经理,易方达50指数基金基金经理,易方达深证100ETF基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益首席投资官兼任易方达资产管理(香港)有限公司人民币合格境外投资者(RQFII)业务负责人。

刘霞先生,理学硕士,曾任D.E.Shaw&Co机构部副总裁,加拿大皇家银行多类年证券公司(RBC Dominion Securities股权衍生产品部副总裁,HorizonLive.com高级副总裁,美国银行证券公司(Banc of America Securities机构部总监,Sagamore Hill Capital Management高级量化策略师,瑞银投资银行(UBS Investment Bank)启营部执行董事兼任交易员,布莱文霍华德美国资产管理公司(Brevan Howard Asset Management)量化投资总监兼任交易员,北京红色天时金融科技有限公司(The Red Capital, LLC)执行合伙人,易方达基金管理有限公司指数与量化投资部投资经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

变更注册登记日期:2004年8月26日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒百贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:肖 钢

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号

托管及投资者服务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:唐州徽

电话:010 66594855

传真:010 66594942

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构:易方达基金管理有限公司

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

办公地址:广州市体育西路189号城建大厦25-28楼

法定代表人:叶俊英

电话:020-85102506

传真:400 881 8099

联系人:温海萍

网址:www.efunds.com.cn

直销机构网点信息:

①)易方达基金管理有限公司广州直销中心

办公地址:广州市体育西路189号城建大厦26楼

电话:020-85102506

传真:400 881 8099

联系人:温海萍

②)易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址:北京市西城区金融街20号B座8层

电话:010-63213377

传真:400 881 8099

联系人:魏巍

③)易方达基金管理有限公司上海直销中心

办公地址:上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室

电话:021-50476668

传真:400 881 8099

联系人:王璐

④)易方达基金管理有限公司网上交易系统

网址:www.efunds.com.cn

2.场内代销机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。

3.场外代销机构(以下排序不分先后)

①)中国银行

住所:北京市复兴门内大街1号

办公地址:北京市复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

联系人:侯燕鹏

客户服务电话:95566

传真:010-66594465

网址:www.boc.cn

②)中国工商银行

注册地址:北京西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

联系人:王玛山

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

③)中国建设银行

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

联系人:王嘉明

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

④)中国农业银行

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:蒋超良

联系人:滕涛

客户服务电话:95599

开放式基金业务传真:010-85109219

网址:www.abchina.com

⑤)交通银行

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

联系人:曹榕

联系电话:021-58781234

客户服务电话:95559

传真:021-58408483

网址:www.bankcomm.com

⑥)深圳发展银行

注册地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:肖遂宁

联系人:张青

联系电话:0755-82088888

客户服务电话:95501

网址:www.sdb.com.cn

⑦)民生银行

注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

联系人:董云巍

联系电话:010-57092615

客户服务电话:95568

传真:010-57092611

网址:www.cmbc.com.cn

⑧)浦发银行

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉晓辉

联系人:高天、于慧

联系电话:021-61618888

客户服务电话:95528

传真:021-63604199

网址:www.spdb.com.cn

⑨)北京银行

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:闫冰竹

联系人:王曦

客户服务电话:95526

传真:010-66226045

网址:www.bankofbeijing.com.cn

⑩)中国光大银行

注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址:北京市西城区太平桥大街25号金融街F3大厦(中国光大中心)

法定代表人:唐双宁

联系人:薛军丽

联系电话:010-63636150

客户服务电话:95595

传真:010-68560661

网址:www.cebbank.com

⑪)东莞银行

注册地址:东莞市运河东一路193号

办公地址:东莞市运河东一路193号

法定代表人:廖玉林

联系人:巫迪峰

联系电话:0769-22100193

客户服务电话:0769-96228

网址:www.dongguanbank.cn

⑫)江苏银行

注册地址:南京市洪武北路55号

法定代表人:黄志伟

联系人:田春慧、法晓宇

联系电话:025-58587018.025-58587036

客户服务电话:96098.40086-96098

传真:025-58587039

网址:www.jsbchina.cn

⑬)广州银行

注册地址:广州市广州大道北195号

办公地址:广州市广州大道北195号

法定代表人:姚建军

客户服务电话:广州:96699;全国:4008996699

网址:www.gzcb.com.cn

⑭)广发证券

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:林治海

联系人:黄岚

客户服务电话:95575

开放式基金业务传真:020-87555305

网址:www.gf.com.cn

⑮)申银万国证券

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

联系人:曹晔

联系电话:021-54033888

客户服务电话:95523.4008895523

传真:021-54038844

网址:www.sywg.com

⑯)招商证券

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:林生迎

联系电话:0755-82943666

客户服务电话:95565、400-8888-111

传真:0755-82943636

网址:www.newone.com.cn

⑰)华泰证券

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

联系人:程涛峰

开放式基金咨询电话:95597

开放式基金业务传真:025-51863323

网址:www.htsc.com.cn

⑱)海通证券

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

联系人:金芸、李笑鸣

联系电话:021-23219000

客户服务电话:95553.400-8888-001

传真:021-23219100

网址:www.htsec.com

⑲)长江证券

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

联系人:李良

联系电话:027-65799999

客户服务电话:95579.4008-888-999

传真:027-85481900

网址:www.95579.com

⑳)长城证券

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:黄耀华

联系人:匡婷

联系电话:0755-83516289

客户服务电话:0755-33680000.400-6666-888

传真:0755-83515567

网址:www.cgws.com

㉑)平安证券

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人:杨宇翔

联系人:郑舒丽

联系电话:400-881-6168

开放式基金业务传真:0755-82400862

网址:www.pingan.com

㉒)湘财证券

注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层

法定代表人:林俊波

联系人:钟康莉

联系电话:021-68634518

开放式基金咨询电话:400-888-1551

开放式基金业务传真:021-68865680

网址:www.xcsc.com

㉓)西部证券

注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武

联系人:冯萍

联系电话:029-87416787

客户服务电话:029-95582

传真:029-87417012

网址:www.westsecu.com.cn

㉔)华安证券

注册地址:安徽省合肥市长江中路357号

办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座

法定代表人:李工

联系人:甘霖

联系电话:0551-5161666

客户服务电话:96518.400-80-96518

开放式基金业务传真:0551-5161672

网址:www.hazq.com

㉕)山西证券

办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:侯魏

联系人:郭荷

联系电话:0351-8686659

客户服务电话:95573或400-666-1618

传真:0351-8686619

网址:www.i618.com.cn

㉖)财通证券

注册地址:杭州市解放路111号金钱大厦

办公地址:杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人:沈继宁

联系人:乔骏

联系电话:0571-87925129

客户服务电话:0571-96336(上海地区:962336)

网址:www.ctsec.com

㉗)万联证券

注册地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人:张建军

联系人:罗创斌

联系电话:020-37865070

客户服务电话:400-8888-133

开放式基金业务传真:020-22373718-1013

网址:www.wanlong.com.cn

㉘)中信证券(浙江)

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人:沈强

联系人:周妍

联系电话:0571-86078823

客户服务电话:96598

传真:0571-85783771

网址:www.bigsun.com.cn

㉙)金元证券

注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人:陆涛

联系人:马贤清

联系电话:0755-83025022

客户服务电话:400-888-228

传真:0755-83025625

网址:www.jyzq.cn

㉚)广州证券

注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼

办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

法定代表人:刘东

联系人:林洁茹

联系电话:020-88836999

客户服务电话:020-961303

传真:020-88836654

网址:www.gzs.com.cn

㉛)渤海证券

注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:杜庆平

联系人:王兆权

联系电话:022-28451861

客户服务电话:400-651-988

传真:022-28451892

网址:www.bhzq.com

㉜)东海证券

注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

法定代表人:朱科敏

联系人:李涛

联系电话:0519-88157761

客户服务电话:0519-88166222.021-52574550.0379-64902266

免费服务热线:400-888-8588

传真:0519-88157761

网址:www.longone.com.cn

㉝)齐鲁证券

注册地址:山东省济南市经七路86号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

联系电话:0531-68889155

客户服务电话:95538

传真:0531-68889752

网址:www.qlzq.com.cn

㉞)宏源证券

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

联系人:李巍

联系电话:010-88085858

客户服务电话:4008-000-562

传真:010-88085195

网址:www.hysec.com

㉟)中投证券

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人:龙增来

联系人:刘毅

联系电话:0755-82023442

客户服务电话:400-600-8008

传真:0755-82026539

网址:www.china-invs.cn

㊱)中航证券

注册地址:南昌市抚河北路291号

办公地址:南昌市抚河北路291号

法定代表人:杜航

联系人:戴蓝

联系电话:0791-6768681

客户服务电话:400-8866-567

传真:0791-6770178

网址:www.avicsec.com

㊲)信达证券

注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:高冠江

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

客户服务电话:400-800-8899

传真:010-63080978

网址:www.cindasc.com

㊳)华龙证券

注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦

法定代表人:李晓安

联系人:李昕田

联系电话:0931-4890208

客户服务电话:0931-4890100,4890619,4890618,4890208

传真:0931-4890118

网址:www.hlzqgs.com

㊴)中山证券

注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

法定代表人:吴水良

联系人:李珍

客户服务电话:4001022011

网址:www.zszq.com.cn

㊵)厦门证券

注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人:傅毅辉

联系人:卢金文

联系电话:0592-5161642

客户服务电话:0592-5163588

传真:0592-5161140

网址:www.xmzq.cn

㊶)江海证券

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:张宇宏

联系电话:0451-82336863

传真:0451-82287211

客户服务电话:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

㊷)华融证券

注册地址:北京市西城区金融大街8号

办公地址:北京市西城区金融大街8号A座三层、五层

法定代表人:丁之锁

联系人:陶昭

联系电话:010-58568040

客户服务电话:010-58568118

传真:010-58568062

网址:www.hrsec.com.cn

㊸)财富里昂证券

注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼

法定代表人:罗浩

电话:021-38784818

传真:021-68775878

联系人:倪丹

客户服务电话:68777877

公司网址:www.cf-cha.com

(二)基金登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区太平桥大街17号

办公地址:北京西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:010 59378839

传真:010 59378907

联系人:朱立元

(三)律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩阳

联系电话:021 31358666

传真:021 31358600

联系人:黎明

经办律师:邵红、黎明

(四)会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨经红

联系电话:021 23238888

传真:021 23238800

联系人:沈兆杰

经办会计师:薛菱、庄贤

四、基金的名称

本基金名称:易方达岁丰添利债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型、债券型基金。本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,封闭期间投资者不能申购、赎回本基金份额,但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。

六、基金的投资目标

本基金通过主要投资债券品种,力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种、股票、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的40%,权益类资产的比例不高于基金资产的20%。开放期内,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%。

本基金所指的信用债券为企业债、短期融资券、公司债、金融债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非由国家信用担保的固定收益证券品种。

八、基金的投资策略

1.资产配置策略

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和新股(含增发)申购之间的配置: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)基于对新股发行频率、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。

2.固定收益品种投资策略

①)固定收益品种的配置策略

a)平均久期配置

本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸政策和汇率政策等)进行分析,预测未来的利率趋势,判断债券市场对上述变量和政策的反应,并据此积极调整债券组合的平均久期,提高债券组合的总投资收益。

b)期限结构配置

本基金对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,选择确定期限结构配置策略,配置各期限固定收益品种的比例,以达到预期投资收益最大化的目的。

c)类属配置

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

②)单个债券的选择

在进行债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上,本基金对影响个别债券定价的主要因素,包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

③)信用债券的投资策略

本基金对信用债券采取自上而下的投资策略。通过对宏观经济和企业财务状况进行分析,对债券的信用风险进行度量及定价,利用市场对信用利差定价的相对失衡,对溢价率较高的品种进行投资。

a)根据宏观经济环境及各行业的发展状况,决定各行业的配置比例;

b)研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、公司背景、盈利状况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息,分析企业的长期运作风险;

c)运用财务评分模型对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评分,度量发行人财务风险;

d)利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算债券发行人的违约率及违约损失率;

e)综合发行人各方面分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择溢价偏高的品种进行投资。

④)短期融资管理

本基金从以下三个方面来进行信用风险管理:1)进行独立的发行主体信用分析,不断在实践中完善分析方法和积累分析经验数据;2)严格遵守信用类债券的备选库制度,根据不同的信用风险等级,按照不同的投资管理流程和权限管理制度,对入库债券进行定期信用跟踪分析;3)采取分散化投资策略和集中度限制,严格控制组合整体的违约风险水平。

⑤)股票投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。本基金投资资产支持证券的比例不高于基金资产净值的20%。

3.可转换债券的投资策略

可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值,本基金管理人将对可转换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。

本基金管理人将对发行公司的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等,并参考同类公司的估值水平,判断可转换债券的股权投资价值;基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换债券的投资策略。

此外,本基金还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果、积极参与可转债新券的申购

本基金可参与一级市场新股申购或增发新股,还可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票、因投资可分离债券所形成的权证等资产。

本基金对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力、利润或长性性等因素进行分析,参考同类公司的估值水平,进行股票的价值评估,从而判断一二级市场价差的大小,并根据资金成本、新股约中签率及上市后股价涨幅的统计、股票锁定期间投资风险的判断,制定新股申购策略。在新发股票获准上市后,本基金管理人将根据对股票内在投资价值的判断,结合市场环境的分析,选择适当的时机卖出。对于分离交易的可转换公司债券,在认股权证上市后,本基金将根据权证估值模型的分析结果,在权证价值被高估时,选择适当的时机卖出。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率+1.2%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前2日在至少一种指定媒体上进行公告并报中国证监会备案。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上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。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2012年5月18日复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2012年1月1日至2012年3月31日。

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	110,466,701.48	3.02
	其中:股票	110,466,701.48	3.02
2	固定收益投资	3,434,147,617.18	93.90
	其中:债券	3,434,147,617.18	93.90
	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:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	28,340,220.81	0.77
6	其他各项资产	84,259,884.11	2.30
7	合计	3,657,214,423.58	100.00

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	73,897,901.48	2.74
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	73,897,901.48	2.74
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,568,800.00	1.36
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
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	110,466,701.48	4.10

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	002663	普邦园林	790,000	31,181,300.00	1.16
2	000651	格力电器	1,500,000	30,495,000.00	1.13
3	002662	京威股份	1,000,000	17,480,000.00	0.65
4	002667	鞍重股份	680,000	15,538,000.00	0.58
5	601633	长城汽车	771,538	10,384,901.48	0.38
6	002620	瑞和股份	250,000	5,387,500.00	0.20

注:本基金本报告期末仅持有以上股票。

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	30,531,000.00	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,260,000.00	1.83
	其中:政策性金融债	49,260,000.00	1.83
4	企业债券	2,722,786,914.11	100.94
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	215,340,000.00	7.98
7	可转债	416,229,703.07	15.43
8	其他	-	-
9	合计	3,434,147,617.18	127.31

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	112055	11诺工01	2,000,000	204,800,000.00	7.59
2	113002	工行转债	1,300,000	140,751,000.00	5.22
3	122108	11新天01	1,000,000	100,000,000.00	3.71
	122129	12海纺债	1,000,000	100,000,000.00	3.71
5	1180194	11京国资02	1,000,000	99,840,000.00	3.70

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。

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。

8.投资组合报告附注

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