易方达中小板指数分级证券投资基金之易基稳健与易基进取基金份额上市交易公告书

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
登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:二〇一二年十月二十五日
公告日期:二〇一二年十月二十二日

一、重要声明与提示

易方达中小板指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之易基稳健与易基进取上市交易公告书(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)保证本公告书基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和深圳证券交易所对易方达中小板指数分级证券投资基金之易基稳健与易基进取上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请详细阅读刊登在中国证监会指定信息披露媒体以及本公司网站(www.efunds.com.cn)上的《易方达中小板指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

(一)基金名称:易方达中小板指数分级证券投资基金

基金简称:易基中小板份额;场内简称:易基中小;场内代码161118

基金简称:易基中小板A类份额;场内简称:易基稳健;场内代码150106

基金简称:易基中小板B类份额;场内简称:易基进取;场内代码150107

(二)本基金为设有7年分级运作期的开放式基金;分级运作期内,本基金采取分级方式进行运作,本基金的基金份额包括易方达中小板指数分级证券投资基金之基础份额(即“易基中小板份额”),易方达中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“易基中小板A类份额”)及易方达中小板指数分级证券投资基金之进取收益类份额(即“易基中小板B类份额”)。其中,易基中小板A类份额、易基中小板B类份额的基金份额比例始终保持1:1的比例不变。

分级运作期届满或提前结束后,本基金自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称将变更为“易方达中小板指数证券投资基金(LOF)”,基金份额仅包括易方达中小板指数证券投资基金之场内基金份额与场外基金份额(“易基中小板份额”)。

(三)基金类型

股票基金

(四)基金存续期限

不定期

(五)易基中小板份额的申购和赎回

投资者可通过场外或场内两种方式申购与赎回易基中小板份额。分级运作期内,易基中小板A类份额、易基中小板B类份额只上市交易,不单独接受申购和赎回;易基中小板份额只可申购和赎回,不上市交易。

易基中小板份额场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点(具体名单详见本上市交易公告书之“三、基金的募集与上市交易”或其他变更场外代销机构的公告);场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单详见深圳证券交易所网站)。

(六)基金份额的配对转换

份额配对转换是指本基金的易基中小板份额与易基中小板A类份额、易基中小板B类份额之间的配对转换,包括分拆和合并两方面。

分拆指基金份额持有人将其持有的每1份易基中小板份额的场内份额中请转换成1份易基中小板A类份额与1份易基中小板B类份额的行为。

合并指基金份额持有人将其持有的每1份易基中小板A类份额与1份易基中小板B类份额中请转换成2份易基中小板份额场内份额的行为。

(七)基金份额折算

1.定期份额折算

本基金每一分级运作周年(最后一个分级运作周年除外)进行一次定期份额折算。定期份额折算期间,本基金基金份额折算对象为定期份额折算基准日登记在册的易基中小板A类份额、易基中小板份额。定期份额折算前后,易基中小板A类份额与易基中小板B类份额的份额配比保持1:1的比例不变。

对于易基中小板A类份额期末的约定应得收益,即易基中小板A类份额每一分级运作周年的最后一个工作日基金份额参考净值超出1.0000元的部分,将折算为场内易基中小板份额并分配给易基中小板A类份额的份额持有人。易基中小板份额持有人持有的每2份易基中小板份额按1份易基中小板A类份额获得新增的易基中小板份额的分配。其中,持有场外易基中小板份额的基金份额持有人将按折进方式获得新增场外易基中小板份额的分配。持有场内易基中小板份额的基金份额持有人将按折进方式获得新增场内易基中小板份额的分配。经过上述份额折算,易基中小板A类份额的基金份额参考净值与易基中小板份额的基金份额净值将相应调整。

有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

2.不定期份额折算

分级运作期内,在定期份额折算之外,本基金还将在以下两种情况下进行不定期份额折算:①当易基中小板份额的基金份额净值大于或等于2.0000元时;②当易基中小板B类份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元时,不定期份额折算期间,本基金基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的易基中小板A类份额、易基中小板B类份额与易基中小板份额。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

3.到期份额折算

基金合同生效日第7个年度对应日,本基金分级运作期届满,届时本基金将进行分级运作期到期份额折算。到期份额折算期间,本基金基金份额折算对象为基金份额折算对象为全基金份额折算基准日登记在册的易基中小板A类份额、易基中小板B类份额与易基中小板份额。

在到期份额折算基准日日终,以份额折算前1.0000元的基金份额参考净值为基准,将易基中小板A类份额、易基中小板B类份额折算为易基中小板份额,并将折算前的易基中小板份额按折算后1.0000元的基金份额净值进行折算,折算完成后,本基金无需召开基金份额持有人大会,启动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“易方达中小板指数证券投资基金(LOF)”。

有关本基金到期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

(八)基金份额总额

截至2012年10月18日,本基金的基金份额总额为401,094,727.69份,其中,易基中小份额为250,315,214.69份,易基稳健份额为75,389,756份,易基进取份额为75,389,757份。

(九)基金份额参考净值

截至2012年10月18日,易基中小份额的基金份额净值为1.0057元,易基稳健份额的基金份额参考净值为1.0052元,易基进取份额的基金份额参考净值为1.0062元。

(十)本次上市交易的基金份额简称及其基金代码;易基稳健(基金代码:150106);易基进取(基金代码:150107)。

(十一)本次上市交易份额

截至2012年10月18日,易基稳健75,389,756份;易基进取75,389,757份。

(十二)上市交易的证券交易所

深圳证券交易所

(十三)上市交易日期

2012年10月25日

(十四)基金管理人

易方达基金管理有限公司

(十五)基金托管人

中国建设银行股份有限公司

(十六)上市推荐人

无

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前募集情况

1.本基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可[2012]680号文。

2.基金的运作方式:契约型开放式。本基金自基金合同生效后7年内(含7年)采取分级方式进行运作;7年分级运作期届满或提前结束,本基金将自动转换为上市开放式基金(LOF)。

3.基金合同期限:不定期。

4.发售日期:2012年8月20日至2012年9月14日。

5.发售价格:1.00元人民币。

6.发售方式:场内、场外认购。

7.发售机构:

(1)场内代销机构

场内代销机构是指具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单详见深圳证券交易所网站)

(2)场外销售机构

①直销机构:易方达基金管理有限公司

直销机构网点信息:

广州市珠海西路189号城建大厦26楼易方达基金管理有限公司广州直销中心;

北京市西城区金融大街20号B座8层易方达基金管理有限公司北京直销中心;

上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室易方达基金管理有限公司上海直销中心。

易方达基金管理有限公司网上交易系统:网址www.efunds.com.cn。

②代销机构

中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、广发证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、浙商证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司。

如变更场外销售机构,本公司将另行公告。

8.验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

9.募集资金总额及入账情况

本次募集的有效净认购金额为401,025,502.53元人民币,有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计69,225.16元人民币,有效认购户数为2,501户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本息合计募集基金份额总额为401,094,727.69份,已全部计入投资者账户,扣投资者所有。上述有效净认购金额已于2012年9月20日内划入本基金在基金托管人中国建设银行开立的基金托管专户。在基金募集期内,本公司基金从业人员未认购易方达中小板指数分级证券投资基金。

10.基金备案情况

本基金于2012年9月20日验资完毕,2012年9月20日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2012年9月20日获得书面确认。

11.基金的同生效日:2012年9月20日。

12.基金的同生效日的基金份额总额:401,094,727.69份。

(二)本基金上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2012]352号。

2.上市交易日期:2012年10月25日。

3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。

4.本次上市交易的基金份额场内简称及代码:易基稳健(150106)、易基进取(150107)。

5.本次上市交易份额:易基稳健75,389,756份、易基进取75,389,757份(截至2012年10月18日)。

6.基金净值的披露:基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产估值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。本基金上市交易后,基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深圳证券交易所,深圳证券交易所于下个工作日通过行情系统揭示。分级运作期内,通过深圳交易所行情系统揭示易基中小板份额的基金份额净值,以及易基中小板A类份额与易基中小板B类份额的基金份额参考净值;分级运作期届满或提前结束,本基金自动转换为上市开放式基金(LOF)后,通过深圳交易所行情系统揭示易基中小板份额的基金份额净值。

7.未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统在深圳证券交易所上市交易。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2012年10月18日,本基金份额持有人户数为2502户,平均每户持有的基金份额为160,309.64份。其中,场内易基中小份额持有户数为3户,平均每户持有的易基中小基金份额为1.00份。易基稳健份额持有人户数为880户,平均每户持有的易基稳健基金份额为85,670.18份。易基进取份额持有人户数为880户,平均每户持有的易基进取份额为85,670.18份。

(二)持有人结构

截至2012年10月18日,机构投资者持有的场内易基中小基金份额为1份,占场内易基中小基金份额比例为33.34%;个人投资者持有的场内易基中小基金份额为2份,占场内易基中小基金份额比例为66.66%。

截至2012年10月18日,机构投资者持有的本次上市交易的易基稳健基金份额为40,758,713份,占本次易基稳健上市交易基金份额比例为54.06%;个人投资者持有的本次上市交易的易基稳健基金份额为34,631,043份,占本次易基稳健上市交易基金份额比例为45.94%。

截至2012年10月18日,机构投资者持有的本次上市交易的易基进取基金份额为40,758,715份,占本次易基进取上市交易基金份额比例为54.06%;个人投资者持有的本次上市交易的易基进取基金份额为34,631,042份,占本次易基进取上市交易基金份额比例为45.94%。

(三)前十名场内基金份额持有人的情况:

截至2012年10月18日,易基中小前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有场内易基中小基金份额(份)	占场内易基中小份额比例(%)
1	中信证券投资有限公司	1	33.34
2	陈小青	1	33.33
3	陈伟光	1	33.33
4			
5			
6			
7			
8			
9			
10			
合计		3	100

截至2012年10月18日,易基稳健前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有易基稳健基金份额(份)	占易基稳健份额比例(%)
1	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	10,000,583	13.27
2	中信证券投资有限公司	7,499,837	9.95
3	红塔证券股份有限公司	5,000,146	6.63
4	浙商证券-农行-浙商汇金1号集合资产管理计划	5,000,145	6.63
5	中信证券股份有限公司	4,000,233	5.31
6	兴业证券股份有限公司	4,000,117	5.31
7	上海证券有限责任公司	4,000,116	5.31
8	杨聪菊	1,236,036	1.64
9	浙江浙南茶叶市场有限公司	1,150,034	1.53
10	任汉杰	994,028	1.32
合计		42,881,275	56.88

截至2012年10月18日,易基进取前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有易基进取基金份额(份)	占易基进取份额比例(%)
1	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	10,000,583	13.27
2	中信证券投资有限公司	7,499,837	9.95
3	浙商证券-农行-浙商汇金1号集合资产管理计划	5,000,146	6.63
4	红塔证券股份有限公司	5,000,145	6.63
5	中信证券股份有限公司	4,000,233	5.31
6	上海证券有限责任公司	4,000,117	5.31
7	兴业证券股份有限公司	4,000,116	5.31
8	杨聪菊	1,236,036	1.64
9	浙江浙南茶叶市场有限公司	1,150,033	1.53
10	任汉杰	994,029	1.32
合计		42,881,275	56.88

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1.名称:易方达基金管理有限公司

2.法定代表人:叶俊英

3.总裁:刘晓艳

4.注册资本:壹亿贰仟万元人民币

5.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

6.设立批准文号:证监基金字[2001]4号

7.工商登记注册的法人营业执照文号:440000000002868

8.经营范围:基金募集、基金销售;资产管理;经中国证监会批准的其他业务。

9.股权结构:广东粤财信托有限公司,持有股份25%;盈峰投资控股集团有限公司,持有股份25%;广东省广晟资产经营有限公司,持有股份16.67%;广州市广水国有资产经营有限公司,持有股份8.33%。

10.内部组织结构及职能:

目成立以来,公司不断致力于健全公司治理结构,严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求,建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构,保持公司规范运作,维护基金份额持有人的利益。

公司下设二十四个部门:基金投资部、机构理财部、固定收益部、指数与量化投资部、研究部、投资发展部、集中交易室、投资风险管理部、养老金部、市场部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、南京分公司、系统研发部、技术运营部、核算部、注册登记部、宣传策划部、综合管理部、人力资源部、监察部、北京代表处。

各部门的主要职责概述如下:

基金投资部负责公募基金资产的日常管理和运作。

机构理财部负责社保基金、企业年金和其他受托资产的投资管理工作。

固定收益部负责公司管理的固定收益资产的投资管理。

指数与量化投资部主要负责指数基金以及量化策略基金的投资管理及相关工作。

研究部的主要工作职责是对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种进行研究。

投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发;为市场营销工作提供专业支持。

集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作,保存交易记录,备份交易数据。

投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估,负责投资研究系统建设相关的工作,以及与投资研究跨部门流程相关的支持性工作。

养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。

市场部主要负责公司市场营销和销售支持工作,为渠道、机构客户、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持,研究和开发设计基金行业电子商务模式等。

宣传策划部负责制作宣传材料,传播公司信息,管理媒体关系,管理广告投放及维护公司网站等。

北京分公司负责组织实施以北京为中心的华北和西北地区的销售工作。

上海分公司负责组织实施以上海为中心的华东地区及西南、东北部分地区的销售工作。

广州分公司负责组织实施以广州为中心的华南地区的销售工作。

成都分公司负责组织实施以四川省为中心的销售工作。

南京分公司负责组织以江苏省为中心的销售工作。

系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试,以及上线运营后的应用支持工作。

技术运营部负责公司IT基础设施的规划与建设,公司日常运营的技术支持与服务,保障公司信息系统安全可靠高效运行。

核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作,负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作,以及各银行账户的管理工作。

注册登记部主要工作是进行开放式基金和特定多个客户资产管理计划的注册登记业务。

综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作,负责公司财务会计、行政保卫和文书档案等工作。

人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施,具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。

监察部独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督,协助并督促各部门履行内控职责,确保公司各项经营活动稳健合规,实现公司经营目标。

北京代表处负责与在京监管部门的日常联系工作。

11.人员情况

截止到2012年9月30日,本公司有员工389人,其中211人具有硕士学历,23人具有博士学历。90%的公司员工具有基金从业资格。

12.信息披露负责人:张南

电话:020-85102688

13.基金管理业务介绍

截至2012年9月30日,本公司旗下共管理37只开放式基金和1只封闭式基金,公募基金资产管理规模1496.07亿元。旗下管理的封闭式基金有利福证券投资基金。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、易方达沙尔思证券投资基金、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、易方达水利添利定期开放债券型证券投资基金、易方达量化行情股票型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金。

14.本基金基金经理

王建军先生,经济学博士。曾任江浙富基金管理有限公司数量分析师、易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理。现任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理(自2010年9月27日起)、易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金基金经理(自2010年9月27日起)、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2011年9月20日起)、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2011年9月20日起)、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理(自2012年9月20日起)。

(二)基金托管人

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称“中国建设银行”)

住所: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

法定代表人:王洪章

成立日期:2004年9月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟柒佰柒拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]12号

存续期间:持续经营

联系人:尹 东

联系电话:010-6759 5003

2.主要人员情况

杨新丰,投资托管服务部副总经理(主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和基金管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室、长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日,中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2011年,中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《证券时报》评为2011年度“中国最佳托管银行”;并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。

(三)基金验资机构

会计师事务所:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

主要经营场所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人:Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话:(010)58153000

传真:(010)85188298

经办注册会计师:昌华、王华

联系人:许建辉

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

易方达中小板指数分级证券投资基金2012年10月18日资产负债表如下:

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资 产:	本期末(2012年10月18日)
银行存款	30,494,037.53
结算备付金	4,411,704.13
存出保证金	815.85
交易性金融资产	87,455,311.02
其中:股票投资	87,455,311.02
债券投资	-
基金投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	290,000,000.00
应收证券清算款	18,986.64
应收利息	65,195.10
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	412,446,050.27
负债和所有者权益	**本期末(2012年10月18日)(2010年9月21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	8,728,226.37
应付赎回款	-
应付管理人报酬	197,719.78
应付托管费	43,498.34
应付销售服务费	-
应付交易费用	50,591.48
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	42,241.92
负债合计	9,062,277.89
所有者权益:	
实收基金	401,094,727.69
未分配利润	2,289,044.69
所有者权益合计	403,383,772.38
负债和所有者权益总计	412,446,050.27

八、基金投资组合

截至2012年10月18日,易方达中小板指数分级证券投资基金的投资组合如下:

(一)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	87,455,311.02	21.20
	其中:股票	87,455,311.02	21.20
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	290,000,000.00	70.31
	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	34,905,741.66	8.46
6	其他各项资产	84,997.59	0.02
7	合计	412,446,050.27	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1.指数投资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	1,435,113.00	0.36
B	采掘业	5,264,325.00	1.31
C	制造业	56,431,230.88	13.99
C0	食品、饮料	9,002,557.33	2.23
C1	纺织、服装、皮毛	4,955,931.90	1.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	443,452.00	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,301,531.99	1.81
C5	电子	7,960,775.44	1.97
C6	金属、非金属	1,898,178.00	0.47
C7	机械、设备、仪表	11,835,344.00	2.93
C8	医药、生物制品	12,430,942.22	3.08
C99	其他制造业	602,518.00	0.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	178,704.00	0.04
E	建筑业	1,849,861.00	0.46
F	交通运输、仓储业	193,366.00	0.05
G	信息技术业	5,438,441.66	1.35
H	批发和零售贸易	14,056,829.48	3.48
I	金融、保险业	1,074,130.00	0.27
J	房地产业	812,294.00	0.2
K	社会服务业	721,016.00	0.18
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	87,455,311.02	21.68

2.积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金于2012年10月18日未持有积极投资股票。

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票明细

1.期末指数投资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	002024	苏宁电器	1,660,916	11,759,285.28	2.92
2	002422	科伦药业	123,833	6,625,065.50	1.64
3	002304	洋河股份	48,185	6,167,680.00	1.53
4	002008	大族激光	566,100	5,072,256.00	1.26
5	002029	七匹狼	199,389	4,406,496.90	1.09
6	002128	露天煤业	237,700	3,137,640.00	0.78
7	002007	华兰生物	116,996	2,991,587.72	0.74
8	002230	科大讯飞	97,014	2,880,345.66	0.71
9	002385	大北农	132,039	2,834,877.33	0.70
10	002037	久联发展	110,700	2,506,248.00	0.62

2.期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金于2012年10月18日未持有积极投资股票。

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于2012年10月18日未持有债券。

(五)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

本基金于2012年10月18日未持有资产支持证券。

(六)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

本基金于2012年10月18日未持有权证。

(七)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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

3.其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	815.85
2	应收证券清算款	18,986.64
3	应收股利	-
4	应收利息	65,195.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,997.59

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2012年10月18日未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末股票投资中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资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	002304	洋河股份	6,167,680.00	1.53	重大事项停牌

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2012年10月18日未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整地及时披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

(一)中国证监会核准易方达中小板指数分级证券投资基金募集的文件;

(二)《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》;

(三)《易方达中小板指数分级证券投资基金招募说明书》;

(四)《易方达中小板指数分级证券投资基金托管协议》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件和营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点:基金管理人、基金托管人处。

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。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

易方达基金管理有限公司
二〇一二年十月二十二日

附件:基金合同内容摘要

(一)基金管理人的权利、义务

1.基金管理人的权利

①自本基金合同生效日起,依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产;

②依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

③收售基金份额;

④依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

⑤在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则,在法律法规和基金合同规定的范围内决定和调整基金的赎调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

⑥根据基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

⑦在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

⑧法律法规允许的前提下,为了更好地实现基金流动性的要求,决定是否暂停接受基金的申购、赎回申请;

⑨自行担任或选择、更换基金登记结算代理机构,获取基金份额持有人名册,并