(上接B210版)

传真:0571-86800423
网址:www.5ifund.com
(116) 万银财富
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:商晓芳
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客服电话:400-808-0069
公司网站:http://www.wy-fund.com/
(117) 展恒基金
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:宋丽冉
联系电话:010-62020088
客户服务电话:400-888-6661
传真:010-62020355
网址:www.myfund.com
(118) 中期时代
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
电话:010-65807865
传真:010-65807864
客户服务电话:010-65087609
公司网站:www.cifcofund.com
(119) 众禄基金
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层IJ单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层IJ单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客户服务电话:4006-788-887
公司网站:www.zlfund.cn www.jjmmw.com
(二)基金注册登记机构
易方达基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人:叶俊英
电话:400 881 8088
传真:020-38799249
联系人:余贤高
(三)律师事务所和经办律师
律师事务所:北京市天元律师事务所
地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人:王立华
电话:010-88092188
传真:010-88092150
经办律师:朱小辉、陈华
联系人:王立华
(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(特殊普通合伙)
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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
首席合伙人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真电话:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称:易方达稳健收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:债券型基金

六、基金的投资目标

通过主要投资于债券品种,追求基金资产的长期稳健增值。

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、金融债、央行票据、企业债、可转换债券(含可分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购等固定收益品种,银行存款、股票,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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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为:债券等固定收益品种不低于基金资产的80%,其中,可转换债券不高于基金资产的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%。

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,进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、股票主动投资以及新股(含增发)申购之间的配置:1.主要基于对利率走势、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.基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等,预测新股申购的收益率以及风险;3.股票市场走势的预测;4.可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。

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、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、企业债以及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。

d.信用类债券投资

本基金投资于信用状况良好的信用类债券。在此基础上,分析各品种的信用溢价,选择信用风险较低和溢价较高的品种进行投资。

(2)投资品种的选择

在债券组合平均久期、期限结构、类属配置和信用风险管理的基础上,本基金对影响个别债券定价的主要因素,包括流动性、局部供求、信用风险、票息、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)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。为控制基金的波动性和流动性风险,本基金投资可转换债券的资产不超过基金资产的30%。

(4)资产支持证券投资

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。

3.股票投资策略

(1)新股(含增发)的投资策略

本基金通过对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力、利润成长性等因素的分析,参考同类公司的估值水平,进行公司股票的价值评估,从而判断一二级市场价差的大小,并根据新股的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和成长性的判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的时机卖出。

(2)股票二级市场的投资策略

在股票二级市场投资方面,本基金采取自下而上的投资策略,选择满足以下特征的公司进行投资:企业治理结构良好,管理层诚信尽职,重视股东利益,能根据市场环境的变化正确地制定和调整发展战略,经营管理能力能适应企业规模的需要;公司财务透明、清晰,资产质量及财务状况较好,拥有良好的历史盈利记录;企业的主营产品或服务具有良好的市场前景,企业在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的竞争优势。本基金将根据企业业绩的长期增长趋势以及同类企业的平均估值水平,应用本基金管理人设计的估值模型,选择价值被市场低估的企业进行投资。

九、基金的业绩比较基准

中债总指数(全价)

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告(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2014年4月23日复核了本投资组合报告。

本投资组合报告有关数据的期间为2013年10月1日至2013年12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	92,532,240.64	5.42
	其中:股票	92,532,240.64	5.42
2	固定收益投资	1,068,524,265.54	62.63
	其中:债券	1,068,524,265.54	62.63
	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	516,481,665.70	30.27
6	其他资产	28,537,726.74	1.67
7	合计	1,706,075,898.62	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	采矿业	-	-
C	制造业	65,141,929.86	5.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,746,000.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	7,760,049.80	0.68
K	房地产业	8,239,739.69	0.73
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	7,644,521.29	0.67
	合计	92,532,240.64	8.15

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

代码	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	600481	双良节能	1,124,465	12,830,145.65	1.13
2	600089	特变电工	938,700	10,062,864.00	0.89
3	600340	华夏幸福	407,303	8,239,739.69	0.73
4	000581	威孚高科	251,913	7,758,920.40	0.68
5	600805	悦达投资	696,857	7,644,521.29	0.67
6	600660	福耀玻璃	600,000	4,974,000.00	0.44
7	002035	华帝股份	406,151	4,967,226.73	0.44
8	601318	中国平安	111,600	4,657,068.00	0.41
9	600176	中国玻纤	586,341	4,438,601.37	0.39
10	300127	银河磁体	239,901	4,169,479.38	0.37

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	189,170,000.00	16.65
	其中:政策性金融债	99,020,000.00	8.72
4	企业债券	446,769,286.02	39.33
5	企业短期融资券	229,934,000.00	20.24
6	中期票据	66,852,000.00	5.89
7	可转债	135,798,979.52	11.96
8	其他	-	-
9	合计	1,068,524,265.54	94.07

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	041355001	13苏交通CP001	500,000	50,440,000.00	4.44
2	1280138	12许昌投资债	500,000	50,380,000.00	4.44
3	041359008	13北车CP001	500,000	50,165,000.00	4.42
4	071326001	13兴业证券CP001	500,000	50,090,000.00	4.41
5	041360062	13陕有色CP001	500,000	49,725,000.00	4.38

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.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。
10.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)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	211,051.18
2	应收证券清算款	1,796,619.22
3	应收股利	-
4	应收利息	26,125,521.07
5	应收申购款	401,551.07
6	其他应收款	2,984.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,537,726.74

(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	113002	工行转债	28,113,476.50	2.48
2	110015	石化转债	26,080,960.00	2.30
3	110016	川投转债	16,254,997.60	1.43
4	113003	重工转债	11,653,000.00	1.03
5	110020	南山转债	10,434,385.00	0.92
6	110017	中海转债	10,077,931.80	0.89
7	110018	国电转债	7,742,439.00	0.68
8	110023	民生转债	7,157,699.50	0.63
9	127001	海直转债	1,337,200.40	0.12

(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。

十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自转型后的2008年1月29日《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》生效以来(截至2013年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

1. 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
自稳健收益基金合同生效日至2008年12月31日	8.09%	0.12%	9.87%	0.22%	-1.78%	-0.10%
2009年1月1日至2009年12月31日	4.58%	0.25%	-4.44%	0.11%	9.02%	0.14%
2010年1月1日至2010年12月31日	8.59%	0.32%	-0.87%	0.10%	9.46%	0.22%
2011年1月1日至2011年12月31日	-4.19%	0.30%	2.52%	0.11%	-6.71%	0.19%
2012年1月1日至2012年12月31日	13.64%	0.31%	-0.67%	0.07%	14.31%	0.24%
2013年1月1日至2013年12月31日	0.42%	0.32%	-5.28%	0.11%	5.70%	0.21%
自稳健收益基金合同生效日至2013年12月31日	34.22%	0.28%	0.39%	0.13%	33.83%	0.15%

2. 稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
自稳健收益基金合同生效日至2008年12月31日	8.40%	0.12%	9.87%	0.22%	-1.47%	-0.10%
2009年1月1日至2009年12月31日	4.90%	0.25%	-4.44%	0.11%	9.34%	0.14%
2010年1月1日至2010年12月31日	8.92%	0.32%	-0.87%	0.10%	9.79%	0.22%
2011年1月1日至2011年12月31日	-3.91%	0.30%	2.52%	0.11%	-6.43%	0.19%
2012年1月1日至2012年12月31日	13.93%	0.31%	-0.67%	0.07%	14.60%	0.24%
2013年1月1日至2013年12月31日	0.84%	0.32%	-5.28%	0.11%	6.12%	0.21%
自稳健收益基金合同生效日至2013年12月31日	36.72%	0.28%	0.39%	0.13%	36.33%	0.15%

注:易方达稳健收益债券型证券投资基金由易方达月月收益中短期债券投资基金转型而成。《易方达月月收益中短期债券投资基金基金合同》生效日为2005年9月19日,自月月收益基金合同生效至2008年1月28日期间的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

1. 月月收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
自月月收益基金合同生效日至2005年12月31日	0.5710%	0.0065%	0.6150%	-	-0.0440%	0.0065%
2006年1月1日至2006年12月31日	1.4389%	0.0116%	2.2665%	0.0004%	-0.8276%	0.0112%
2007年1月1日至2007年12月31日	2.3181%	0.0200%	3.2952%	0.0021%	-0.9771%	0.0179%
2008年1月1日至2008年1月28日	0.19%	0.01%	0.34%	0.00%	-0.15%	0.01%
自月月收益基金合同生效至2008年1月28日	4.58%	0.02%	6.52%	0.00%	-1.94%	0.02%

2. 月月收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
自月月收益基金合同生效日至2005年12月31日	0.6413%	0.0069%	0.6150%	-	0.0263%	0.0069%
2006年1月1日至2006年12月31日	1.6923%	0.0118%	2.2665%	0.0004%	-0.5742%	0.0114%
2007年1月1日至2007年12月31日	1.8186%	0.0230%	2.2929%	0.0022%	-0.4743%	0.0208%
2008年1月1日至2008年1月28日	0.21%	0.01%	0.34%	0.00%	-0.13%	0.01%
自月月收益基金合同生效至2008年1月28日	4.42%	0.02%	5.52%	0.00%	-1.10%	0.02%

月月收益B级基金曾经出现份额为零的情况,月月收益B级基金的净值表现及业绩比较基准均采用月月收益B级基金份额存在期间的数据计算。

十三、基金的费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金销售服务费;
(4)基金合同生效后的信息披露费用;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费;
(7)证券交易费用;
(8)资金汇划费;
(9)按照国家有关规定和本基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.6%的管理费年费率来计算,具体计算方法如下:

每日应付的基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次日从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按该基金前一日资产净值乘以0.2%的托管费年费率来计算。计算方法如下:

每日应支付的基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次日从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)基金的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金管理人将通过定期的审计和监察稽核监督基金销售服务费的支出和使用情况,确保其用于约定的用途。在通常情况下,本基金A级基金份额的销售服务年费率为0.3%,B级基金份额不计提销售服务费。

A级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

每日应支付的A级基金销售服务费=前一日A级基金份额的基金资产净值×R÷当年天数

R为A级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次日从基金资产中一次性支付给基金销售机构。

(4)上述"1.基金费用的种类"中(4)至(8)项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

3.不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和托管费、销售服务费,经中国证监会核准后公告。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

(二)与基金销售有关的费用

1.基金申购费

(1)申购费率

本基金A级基金份额申购费率为零。

本基金对通过本公司直销中心申购的的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金(包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

通过基金管理人的直销中心申购本基金B级基金份额的特定投资群体申购费率为:

申购金额M(元)(含申购费)	申购费率
M<100万	0.08%
100万≤M<500万	0.03%
500万≤M<1000万	0.005%
1000万≤M	每笔1000元

其他投资者申购本基金B级基金份额的申购费率为:

申购金额M(元)(含申购费)	申购费率
M<100万	0.8%
100万≤M<500万	0.3%
500万≤M<1000万	0.05%
1000万≤M	每笔1000元

(2)申购费的收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下,如果投资者多次申购,申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

基金的申购费由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不计入基金财产。

(3)申购份额的计算

A级份额申购份额的计算:

申购份额=申购金额/T日基金份额净值

B级份额申购份额的计算:

申购费用=申购金额/(1+申购费率)×申购费率

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

申购份数保留至小数点后两位,小数点后两位以下舍去,舍去部分所代表的资产计入基金财产。

2.基金赎回费

(1)赎回费率

本基金A级/B级基金份额的赎回费率为:

持有时间(天)	A级/B级基金份额赎回费率
0-29	0.75%
30及以上	0%

(2)赎回费的收取和用途

本基金的赎回费由赎回人承担,对于持有期限少于30日的本基金A级/B级基金份额的赎回所收取的赎回费,全额计入基金财产。

(3)赎回金额的计算

赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回费用

赎回费用、赎回金额以人民币元为单位,四舍五入,保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益由基金财产所有。

3.基金转换费

目前,基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务,具体实施办法和转换费率详见相关公告。基金转换费用由投资者承担,基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成,其中赎回费按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费,转换费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位。

4.投资者通过本公司网上交易系统(www.efunds.com.cn)进行申购、赎回和转换的交易费率,请具体参照我公司网站上的相关说明。

5.基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更,基金管理人应最迟于新的费率实施前2个工作日在至少一种指定媒体公告。

6.基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定交易方式(如网上交易、电话交易、手机交易等)或特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回和转换费率。

十四、对招募说明书更新部分的说明

易方达月月收益中短期债券投资基金基金于2008年1月29日转型为易方达稳健收益债券型证券投资基金。本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2013年11月1日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在"二、释义"部分,更新了部分内容,并相应更新了相关部分的表述。
2.在"三、基金管理人"部分,更新了部分内容。
3.在"四、基金托管人"部分,根据最新资料进行了更新。
4.在"五、相关服务机构"部分,更新了基金份额发售机构的信息和会计师事务所信息。
5.在"七、基金份额的申购、赎回"部分,更新了部分内容
6.在"八、基金转换"部分,更新了部分内容。
7.在"十、基金的投资"部分,更新了"(七)投资决策"的部分内容,并补充了本基金2013年第4季度投资组合报告的内容。
8.在"十一、基金的业绩"部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。
9.在"十五、基金的费用与税收"部分,更新了部分内容。
10.在"二十四、其他应披露事项"部分,根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司
2014年4月30日

(上接B209版)

办公地址:浙江杭州西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心D区801室
法定代表人:陆彬彬
联系人:邓秀男
电话:0571-56028620
传真:0571-56899710
客户服务电话:4000680058
公司网站:http://www.jincheng-fund.com
92) 诺亚正行
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38600735
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com
93) 上海长量
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com
94) 深圳新兰德
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层
法定代表人:马令海
联系人:邓洁
电话:010-58321105
传真:010-58325282
客户服务电话:4008507771
公司网站: t.jrj.com
95) 数米基金
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
联系电话:021-60897840
客户服务电话:4000-766-123
传真:0571-26698533
网址:http://www.fund123.cn/
96) 天天基金
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998
客户服务电话:400-1818-188
传真:021-64385308
网址:www.1234567.com.cn
97) 同花顺
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:胡璇
联系电话:0571-88911818
客户服务电话:0571-88920897、4008-773-772
传真:0571-86800423
网址:www.5ifund.com
98) 万银财富
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:商晓芳
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客服电话:400-808-0069
公司网站:http://www.wy-fund.com/
99) 展恒基金
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:宋丽冉
联系电话:010-62020088
客户服务电话:400-888-6661
传真:010-62020355
网址:www.myfund.com
100) 众禄基金
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层IJ单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层IJ单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客户服务电话:4006-788-887
公司网站:www.zlfund.cn www.jjmmw.com
2.场内销售机构
深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站。
(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
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:(010) 5937 8839
传真:(010) 5937 8907
联系人:朱立元
(三)出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:上海通力律师事务所
地址:上海浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021) 3135 8666
传真:(021) 3135 8600
经办律师:吕红、安冬
联系人:安冬
(四)审计基金财产的会计师事务所
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、周刚
联系人:许建辉

四、基金的名称

本基金名称:易方达中小板指数分级证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式,股票基金

六、基金的投资目标

本基金采取指数化投资方式,以实现对业绩比较基准的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含一级市场初次发行及增发的新股,以及在创业板上市的股票)、权证等权益类品种、国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、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类品种(含货币市场工具)、股指期货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。

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。

基金的投资组合比例为:

股票资产占基金资产的比例为90%-95%。其中,本基金投资于中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的90%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金的投资比例范围为,股票资产占基金资产的比例为90%-95%。其中,本基金投资于中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的90%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素,确定股票、债券等资产的具体配置比例。

本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

2. 权益类品种投资策略

2.1 股票投资策略

本基金主要采取完全复制法进行投资,即按照中小板价格指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当以下情况发生时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪:

(1) 基金管理人预期指数成份股或权重发生变化;
(2) 由于市场因素影响,法律法规限制等原因,本基金无法根据指数构建组合;
(3) 基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

2.2 股票组合的动态调整

在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将对投资组合进行调整:

(1) 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时进行投资组合调整;
(2) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将根据指数成份股调整方案,判断指数成份股调整对投资组合的影响,在此基础上确定组合调整策略;
(3) 标的指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响,并据此确定相应的投资组合调整策略;
(4) 基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响,据此对投资组合进行相应调整。
(5) 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场情况,以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

2.3 权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

3. 股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,按照相关法律法规的有关规定,进行股指期货投资。具体而言,本基金将运用股指期货进行如下投资:

(1) 市场风险管理

为达到与业绩比较基准相同的市场暴露度,若本基金投资组合中股票组合的市场暴露度小于业绩比较基准的市场暴露,本基金可通过买入股指期货以实现与业绩比较基准相同的市场暴露度。

(2) 流动性风险管理

出现大量净申购或净赎回的情况时,本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。如出现大量净申购,本基金可买入复制比配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求,并在净申购资金到帐后逐步平仓;反之,如出现大量净赎回,本基金可卖空数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求,并在卖出股票的同时逐步平仓。此外,如预期出现大量净赎回,本基金可在逐步卖出股票的同时买入数量匹配的股指期货合约以维持目标市场暴露度,并在投资者赎回的同时逐步平仓。

九、基金的业绩比较基准

中小板价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%

十、基金的风险收益特征

本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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建设银行股