(上接C205版)
客户服务电话:4008096096
传真:023-63786311
网址:www.swsc.com.cn
(78)新时代证券
注册地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
办公地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
法定代表人:马金声
联系人:孙恺
联系电话:010-83561149
客户服务电话:400-698-9898
开放式基金业务传真:010-83561094
网址:www.xsdzq.cn
(79)华福证券
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
客户服务电话:0591-96326
传真:0591-87383610
网址:www.hfzq.com.cn
(80)红塔证券
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
网址:www.hongtastock.com
(81)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
(82)东兴证券
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤漫川
联系电话:010-66555316
客户服务电话:400-8888-993
传真:010-66555246
网址:www.dxzq.net.cn
(83)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
(84)瑞银证券
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:刘弘
联系人:邱培玲
联系电话:010-58328366
客户服务电话:400-887-8827
传真:010-59228748
网址:www.ubssecurities.com
(85)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:吴永良
联系人:李珍
客户服务电话:4001022011
网址:www.zszq.com.cn
(86)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
(87)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
(88)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:陶颖
联系电话:010-58568040
客户服务电话:010-58568118
传真:010-58568062
网址:www.hrsec.com.cn
(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:400 881 8088
传真:020-38799249
联系人:余贤高
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市天元律师事务所
住所: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
联系电话:(010)88092188
传真:(010)88092150
联系人:杨科
经办律师:陈华、杨科
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称: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
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:吴冠雄
电话:010-88092188
传真:010-88092150
经办律师:朱小辉、陈华
联系人:杨科
(四)会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所:安永华明会计师事务所
注册地址:中国北京市东城区东长安街1 号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼)16 层
法定代表人:葛明
电话:010-58153000
传真:010-85188298
经办注册会计师:李地、周刚
联系人:许建辉

四、基金的名称

本基金名称:易方达策略成长证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金通过投资兼具较高内在价值和良好成长性的股票,积极把握股票市场波动所带来的获利机会,努力为基金份额持有人追求较高的中长期资本增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金股票部分主要投资于具有较高内在价值及良好成长性的上市公司股票,投资于这类股票的资产不低于基金股票投资的80%。

八、基金的投资策略

本基金为主动型股票基金,主要投资于国内A股市场上兼具较高内在价值及良好成长性的股票。通过发挥基金管理人的研究优势,将稳健、系统的选股方法与主动、灵活的投资操作风格相结合,在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司成长发展的波动性的基础上,积极把握"价值区域"内股票价格和价值波动对比中的投资机会,为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值和一定的当期收益。

①资产配置策略

本基金采取相对稳定的资产配置策略,一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。只有当基金管理人通过研究发现市场的主导因素(宏观面、政策面和资金面等)发生实质性变化时,才会对资产配置比例进行较大幅度的主动调整。

本基金股票投资比例最高可达95%。

②股票投资策略

本基金为主动型股票基金,股票投资的总体原则是在价值区域内把握波动机会,在波动中实现研究的"溢价"。基金管理人以专业的研究力量为依托,将稳健、系统的选股方法与积极、主动的投资操作风格有机结合,首先筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,即确定投资的"价值区域";其次在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性以及上市公司成长发展的波动性的基础上,通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握"价值区域"内股票价格和价值波动对比中的投资机会,适时实现投资收益。

① 股票的选择

本基金采用定量与定性相结合的系统方法选择股票,筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,即处于本基金管理人所认为的"价值区域"中的股票。

首先,本基金以价值成长比率(PEG)为主要参考指标对进入本公司"股票投资一般备选库"中的股票进行定量分析,对股票的市盈率与成长性进行综合权衡评估;

其次,基金管理人将根据对上市公司基本面的深度研究和对市场趋势的具体把握,从公司基本面、股票流动性、股票相对价值等方面,结合定量分析的结果对"股票投资一般备选库"中的股票作进一步的定性评估,作为基金管理人构建组合的主要参考依据。

对于基金管理人基于基本面研究有充分理由认为其具有一定投资价值、符合本基金投资理念的上市公司,虽因其预期每股收益或净利润增长率为负不能进行PEG定量评估,基金管理人仍可将其选入投资组合,但其占基金股票资产的比重不应超过20%。

②股票的投资操作

本基金强调策略地持有股票,而不片面强调中长线静态持有。基金管理人根据对上市公司成长率动态变化的分析预测,兼顾考虑当时的市场趋势和个股的投资机会,通过对股票价格与价值相对波动和偏离程度的分析来掌握买卖时机,在股价的波动中适时实现收益。

同时,本基金采取积极主动的行业优化配置和轮换策略。基金管理人主要根据对行业基本面和景气周期的分析预测,兼顾考虑行业内上市公司的代表性和基本面,确定基金在一定时期重点投资的行业。在此基础上,通过动态分析行业增长率和行业市盈率变动的偏离水平、不同行业的相对价值对比以及行业景气周期的变化等因素,适时在不同行业之间进行轮换。

按照上述投资策略,在一定时期本基金的股票投资组合有可能出现相对集中于个别行业/板块或个股的情形,以努力捕捉由于总体或特定的经济、社会、政策以及科技等方面的进步、变化所带来的投资机会。

③债券投资策略

在债券投资方面,本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、不同品种流动性的高低等因素,构造债券组合。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,发现套利机会,并综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例。

④其它投资策略

本基金将审慎投资于中国证监会批准的其它金融工具,以减少基金资产的风险并提高基金的收益。

九、基金的业绩比较基准

上证A指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%

十、基金的风险收益特征

本基金为中等风险水平的证券投资基金,基金力争通过主动投资获取较高的资本增值和一定的当期收益。

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1月10日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告有关数据的期间为2011年7月1日至2011年9月30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	2,970,284,108.53	70.32
	其中:股票	2,970,284,108.53	70.32
2	固定收益投资	465,218,000.00	11.01
	其中:债券	465,218,000.00	11.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	408,500,932.75	9.67
	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	340,831,088.60	8.07
6	其他各项资产	39,095,688.58	0.93
7	合计	4,223,929,818.46	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	59,893,565.00	1.42
B	采掘业	171,988,000.00	4.09
C	制造业	1,244,850,547.83	29.58
C0	食品、饮料	241,329,684.69	5.73
C1	纺织、服装、皮毛	46,633,665.00	1.11
C2	木材、家具	2,843,500.00	0.07
C3	造纸、印刷	19,373,400.00	0.46
C4	石油、化学、塑胶、塑料	42,516,535.60	1.01
C5	电子	4,346,621.80	0.10
C6	金属、非金属	86,804,742.98	2.06
C7	机械、设备、仪表	486,155,119.75	11.55
C8	医药、生物制品	314,847,278.01	7.48
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	64,281,582.18	1.53
E	建筑业	10,111,645.14	0.24
F	交通运输、仓储业	54,569,383.68	1.30
G	信息技术业	189,252,583.40	4.50
H	批发和零售贸易	517,253,580.22	12.29
I	金融、保险业	335,546,991.16	7.97
J	房地产业	148,242,567.44	3.52
K	社会服务业	174,293,662.48	4.14
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,970,284,108.53	70.59

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	000417	合肥百货	12,841,970	230,513,361.50	5.48
2	600546	山煤国际	6,200,000	171,988,000.00	4.09
3	000063	中兴通讯	9,000,000	170,100,000.00	4.04
4	000811	烟台冰轮	12,088,953	157,519,057.59	3.74
5	002277	友阿股份	7,999,971	157,279,429.86	3.74
6	600066	宇通客车	7,300,000	143,737,000.00	3.42
7	600223	鲁商置业	19,932,412	131,952,567.44	3.14
8	600015	华夏银行	12,999,748	131,427,452.28	3.12
9	600036	招商银行	8,875,373	98,161,625.38	2.33
10	002038	双鹭药业	2,675,550	86,554,042.50	2.06

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	49,440,000.00	1.17
2	央行票据	176,074,000.00	4.18
3	金融债券	140,074,000.00	3.33
	其中:政策性金融债	140,074,000.00	3.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,630,000.00	2.37
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	465,218,000.00	11.06

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	1001060	10央行票据60	1,700,000	166,260,000.00	3.95
2	1181287	11中电投CP02	1,000,000	99,630,000.00	2.37
3	110308	11进出08	600,000	59,754,000.00	1.42
4	110415	11农发15	500,000	50,410,000.00	1.20
5	110013	11附息国债13	500,000	49,440,000.00	1.17

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	1,961,899.00
2	应收证券清算款	29,831,549.60
3	应收股利	-
4	应收利息	3,937,102.71
5	应收申购款	3,365,137.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,095,688.58

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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2003年12月09日,基金合同生效以来(截至2011年6月30日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

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
基金合同生效至2003年12月31日	4.20%	0.85%	3.60%	0.82%	0.60%	0.03%
2004年1月1日至2004年12月31日	6.12%	1.05%	-12.37%	0.99%	18.49%	0.06%
2005年1月1日至2005年12月31日	13.41%	1.02%	-2.64%	1.03%	16.05%	-0.01%
2006年1月1日至2006年12月31日	151.6%	1.56%	98.46%	1.01%	53.14%	0.55%
2007年1月1日至2007年12月31日	133.88%	2.01%	71.99%	1.65%	61.89%	0.36%
2008年1月1日至2008年12月31日	-48.17%	2.11%	-46.68%	2.14%	-1.49%	-0.03%
2009年1月1日至2009年12月31日	62.06%	1.76%	60.07%	1.42%	1.99%	0.34%
2010年1月1日至2010年12月31日	-3.99%	1.40%	-10.05%	1.06%	6.06%	0.34%
2011年1月1日至2011年6月30日	-7.18%	1.16%	-0.74%	0.81%	-6.44%	0.35%
基金合同生效至2011年6月30日	452.39%	1.59%	77.08%	1.37%	375.31%	0.22%

十三、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基金信息披露费用;

④基金份额持有人大会费用;

⑤与基金相关的会计师费和律师费;

⑥证券交易费;

⑦按照国家有关规定可以列入的其他费用;

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

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数;H为每日应支付的基金管理费;E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金托管人复核后于次月的前两个工作日内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

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计算。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数;H为每日应计提的基金托管费;E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人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月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

③上述1款中④至⑦项费用由基金托管人根据其他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因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4. 基金管理人和基金托管人可磋商的情调低基金管理费和基金托管费,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. 本基金申购费率如下表所示。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

申购金额(含申购费)	申购费率
M≥1000万	按笔收取,1000元/笔
500万≤M<1000万	0.3%
100万≤M<500万	1.2%
M<100万	1.5%

基金的申购费由申购人承担,不计入基金财产。

2. 本基金的赎回费率根据持有期限的不同分为三档。持有期限的起始日为基金权益登记日。

持有期限(天)	赎回费率
0-364	0.50%
365-729	0.25%
730及以上	0.00%

基金的赎回费由赎回人承担,赎回费的25%归入基金财产,余额为注册登记费和其他手续费。

3. 转换费率

目前,基金管理人已开通了本基金与易方达平稳增长基金、易方达50指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金、易方达价值精选股票型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达科讯股票型基金、易方达增强回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深300指数基金、易方达深证100ETF联接基金、易方达上证中盘ETF联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达医疗保健行业股票型基金、易方达安心回报债券型基金、易方达资源行业股票型基金和易方达创业板ETF联接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,其中转出基金赎回费用的25%的部分归入基金财产(对于持有期限少于30日的易方达安心回报债券型基金A类/B类基金份额所收取的赎回费,全额计入基金财产),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。代销机构可对每笔转换申请向投资者收取不高于10元的业务代理费,具体收费标准以各代销机构的规定为准。

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3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

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

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《易方达策略成长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2011年8月2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"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人基本情况、主要人员情况部分的内容。
2. 在"四、基金托管人"部分,根据最新资料进行了更新。
3. 在"五、相关服务机构"部分,根据相关公告的内容,增加了4个代销机构:东莞农村商业银行、广州银行、江海证券和华融证券;因华泰证券已吸收合并华泰联合证券的经纪业务,删除了华泰联合证券;根据最新资料更新了基金份额发售机构信息、经办注册会计师信息。
4. 在"九、基金份额的申购、赎回和转换"部分,更新了部分表述,并相应更新了"十三、基金的费用与税收"部分的表述。
5. 在"九、基金的投资"部分,更新了"七、投资程序"的部分内容,补充了本基金2011年第3季度投资组合报告的内容。
6. 在"九、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。
7. 在"二十、对基金份额持有人的服务"部分,更新了部分内容。
8. 在"二十一、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
2012年1月20日

(上接C207版)
(59)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
(60)东兴证券
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤漫川
联系电话:010-66555316
客户服务电话:400-8888-993
传真:010-66555246
网址:www.dxzq.net.cn
(61)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
(62)瑞银证券
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:刘弘
联系人:邱培玲
联系电话:010-58328366
客户服务电话:400-887-8827
传真:010-59228748
网址:www.ubssecurities.com
(63)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:吴永良
联系人:李珍
客户服务电话:4001022011
网址:www.zszq.com.cn
(64)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
(65)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
(66)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:陶颖
联系电话:010-58568040
客户服务电话:010-58568118
传真:010-58568062
网址:www.hrsec.com.cn
(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:400 881 8088
传真:020-38799249
联系人:余贤高
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市天元律师事务所
住所: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
联系电话:(010)88092188
传真:(010)88092150
联系人:杨科
经办律师:陈华、杨科
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称: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、庄贤

四、基金的名称

本基金名称:易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括深证100ETF、深证100价格指数成份股及备选成份股、新股(一级市场初次发行和增发)、货币市场工具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。

正常情况下,本基金资产中投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如果法律法规允许,本基金指数化投资(指对深证100ETF、深证100价格指数成份股及备选成份股的投资)的比例可以提高到基金资产净值的100%,同时业绩比较基准进行相应变更,该事项无须经基金份额持有人大会同意。

八、基金的投资策略

本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争最终将年化跟踪误差控制在4%以内。

在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。

待指数衍生金融产品推出以后,本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:深证100价格指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%。

如果深证100ETF变更业绩比较基准、或深证100价格指数编制单位变更或停止深证100 价格指数的编制及发布、或深证100价格指数由其他指数替代、或深证100价格指数编制方法发生重大变更导致该指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行必要手续后,调整业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为深证100ETF的联接基金,主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。理论上本基金预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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1月10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2011年7月1日至2011年9月30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	159,671,802.82	1.82
	其中:股票	159,671,802.82	1.82
2	基金投资	8,066,286,464.50	92.00
3	固定收益投资	421,892,872.80	4.81
	其中:债券	421,892,872.80	4.81
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	96,868,194.25	1.10
7	其他各项资产	22,900,757.41	0.26
8	合计	8,767,620,091.78	100.00

2. 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	8,066,286,464.50	92.08

3. 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	764,400.00	0.01
B	采掘业	13,570,757.36	0.15
C	制造业	93,309,944.27	1.07
C0	食品、饮料	21,322,636.80	0.24
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	6,336,387.44	0.07
C5	电子	3,048,934.64	0.03
C6	金属、非金属	19,111,631.93	0.22
C7	机械、设备、仪表	31,874,553.08	0.36
C8	医药、生物制品	10,482,561.90	0.12
C99	其他制造业	1,133,238.48	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,347,541.23	0.02
E	建筑业	719,076.00	0.01
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,514,099.53	0.05
H	批发和零售贸易	6,514,695.78	0.07
I	金融、保险业	13,333,398.66	0.15
J	房地产业	12,839,517.83	0.15
K	社会服务业	1,886,340.78	0.02
L	传播与文化产业	5,190,920.18	0.06
M	综合类	5,681,111.20	0.06
	合计	159,671,802.82	1.82

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	000858	五粮液	214,884	7,800,289.20	0.09
2	000002	万科A	1,015,821	7,354,544.04	0.08
3	000895	双汇发展	113,043	7,347,795.00	0.08
4	002024	苏宁电器	512,158	5,331,564.78	0.06
5	000157	中联重科	527,358	5,015,174.58	0.06
6	000001	深发展A	306,605	4,917,944.20	0.06
7	000651	格力电器	239,652	4,790,643.48	0.05
8	000063	中兴通讯	214,272	4,049,740.80	0.05
9	000983	西山煤电	181,266	3,862,778.46	0.04
10	000527	美的电器	215,400	3,174,996.00	0.04

5. 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	201,958,872.80	2.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	219,934,000.00	2.51
	其中:政策性金融债	219,934,000.00	2.51
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	421,892,872.80	4.82

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

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	110414	11农发14	2,200,000	219,934,000.00	2.51
2	010112	21国债(2)	2,015,960	201,958,872.80	2.31

注:本基金本报告期末仅持有以上债券。

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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 投资组合报告附注

①根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月28日发布的《关于收到中国证监会<行政处罚决定书>的公告》,宜宾五粮液股份有限公司因信息披露等问题,受到中国证监会的行政处罚。

本基金是深证100ETF的联接基金,本基金股票投资部分对五粮液基本维持了标准配置比例。

除五粮液外,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	4,250,000.00
2	应收证券清算款	1,663,976.55
3	应收股利	-
4	应收利息	6,775,177.14
5	应收申购款	10,172,113.72
6	其他应收款	39,490.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,900,757.41

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的情况。

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