

<p>4.1 本基金投资的指数成份股及备选股的比例不低于基金资产净值的95%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p> <p>4.2 本基金在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%，在全国银行间同业拆借市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的10%。</p> <p>4.3 本基金资产投资于同一发行主体，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买入股票公司可发行总量的10%。</p> <p>4.4 本基金在任一交易日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%，在任一交易日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券为股票、债券（不含到期日在一年以内的国债回购）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等；本基金在任一交易日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内及月末，本基金持有的股指期货合约的价值不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的余额；本基金在任何交易日终买入股指期货的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的10%，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值和买入股指期货的总金额之和的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>4.5 相关法律法规及中国证监会规定的其它投资限制。</p> <p>4.6 本基金的投资组合将遵循上述比例限制，同时本基金又上述规定的其它投资限制。</p> <p>4.7 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无法控制的因素导致投资组合不符合上述约定的比例，在不影响投资组合的前提下，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到合规。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>4.8 本基金的投资组合为：建仓期结束后各项资产配置比例符合各合同合同约定。</p> <p>4.9 本基金自建仓期三个月末报告期末的基金份额净值配置率为21-96%，同期业绩比较基准收益率为-20.01%。</p>	<p>4.3 管理人应实时监控证券市场行情及行业走势的宏观背景</p> <p>下一阶段市场，宏观经济增长保持平稳持续发展，宏观经济政策短期的重点将由严格控制通胀水平逐步转移到稳定经济增长和民生保障上，中长期的重点仍将放在经济总量平稳持续发展的前提下，通过有力性和针对性宏观调控政策，近期外贸也将出现了一些积极和亮点，通胀控制权逐步向央行转移，通胀压力逐步得到较大缓解，同时美国通胀水平表现相对较为平稳，鉴于内外需结构的调整，以及国内通胀压力的缓解和通胀的平稳增长，本基金对当前经济中长期的前景持相对乐观的判断。创业板指数发行或分布主要集中在新兴产业，新兴产业包括生物医药、节能环保、新材料、新能源、电子信息等，从其所处行业的平均市盈率较主板大值普遍偏高，但鉴于中国当前经济结构转型的大背景和相关产业的发展前景，创业板指数中长期的投资价值依然明显。</p> <p>作为创业板指数的核心成份股，创业板ETF将跟踪指数的成份股投资思路，以严格控制基金目标指数的跟踪偏离度为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。同时创业板ETF为投资者进一步分享中国经济的未来中长期成长性提供好的投资机会。</p> <p>§ 5 投资组合信息</p> <table> <tr> <th>序号</th><th>项目</th><th>金额(元)</th><th>占基金总资产的比例(%)</th></tr> <tr> <td>1</td><td>权益投资</td><td>456,142,737.76</td><td>97.97</td></tr> <tr> <td></td><td>其中：股票</td><td>456,142,737.76</td><td>97.97</td></tr> <tr> <td>2</td><td>固定收益投资</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td></td><td>其中：债券</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td></td><td>资产支持证券</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>3</td><td>金融衍生品投资</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>4</td><td>买入返售金融资产</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td></td><td>其中：买断式回购的买入返售金融资产</td><td></td><td></td></tr> </table>	序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	1	权益投资	456,142,737.76	97.97		其中：股票	456,142,737.76	97.97	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				其中：买断式回购的买入返售金融资产		
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)																																		
1	权益投资	456,142,737.76	97.97																																		
	其中：股票	456,142,737.76	97.97																																		
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																																				
	其中：买断式回购的买入返售金融资产																																				

王建军	2011-9-20	-	5年	用、易方达沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经	5	银行存款和结算备付金合计	8,528,283.28	1.83
				理	6	其他各项资产	912,773.28	0.20
				易方达沪深100交易型开放式指数基金联接基金的基金经	7	合计	465,583,796.24	100.00
				理	注：2. 其中的股票投资项可含可替代权证估值增值，而2.2中的合计项不可含可替代权证估值增值。			
				5.2 报告期内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	7,310,245.52	1.58	
				B	采掘业	7,138,925.48	0.76	
				C	制造业	254,738,092.86	55.20	
				C0	食品、饮料	12,522,482.76	2.71	
				C1	纺织、服装、皮毛	-	-	
				C2	木材、家具	-	-	
				C3	造纸、印刷	6,606,790.71	1.43	
				C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,184,831.06	4.37	
				C5	电子	56,009,715.08	12.14	
				C6	金属、非金属	10,811,268.51	3.90	
				C7	机械、设备、仪表	105,283,165.64	22.81	
				C8	医药、生物制品	36,129,839.70	7.83	
				C9	其他制造业	-	-	
				D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-	

注：1. 此处的“有效日期”为基金合同生效之日起，截至“日期”为公告确定的解聘日期。	
2. 基金经理变更须经中国证监会核准并公告，变更事项按照基金合同的有关规定。	
4. 2 管理人对于报告期内基金投资运作情况的说明	
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、招募说明书等有关规定，恪尽职守，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，为基金份额持有人谋求最大利益。	
本基金管理人、在控制风险的前提下，在本基金份额持有人谋求最大利益、及本基金合同约定合法合规、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纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后分析评估监督机制，确保公平交易制度的有效执行。本基金管理人严格执行投资授权制度，严格实行投资决策委员会投资决策管理制度，并重视交易执行环节的公平交易管理，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。对于一级市场中申购或赎回基金份额、以及交易所公开竞价交易和公平交易制度总体执行情况报告期内，	
4.3.2 异常交易行为的说明	
本报告期内，本基金旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易金额占当日成交量的5%的有3次，均为ETF基金被动跟踪标的指数和其组合成分股的反向交易。	

[illegible]

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

The chart displays the historical performance of the fund relative to the Shanghai-Shenzhen 300 Index. The fund's NAV starts at approximately 1.00 in January 2011, rises to a peak of about 1.35 in May 2011, then falls to around 1.00 by July 2011. It reaches another peak of nearly 1.30 in November 2011 before dropping sharply to below 1.00 by January 2012. The benchmark index follows a similar trend but remains generally higher than the fund's NAV throughout the period.

[illegible][illegible][illegible]

易方达行业领先企业股票型证券投资基金

【2012】第一季度报告

易方达行业领先企业股票型证券投资基金

2012 年 1 季度 报告

7 基金财产参与股票投资中,本基金所申报的金额不得超过基金总资产,所申报的股票数量不得超过拟买入股票公司本次发行证券总量的总量;

8 相关法律法规及监管部门指定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制,本基金在不受上述限制的前提下,将按照法律法规或监管部门的要求履行适当程序后,本基金不受上述限制。

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因素导致投资组合不符合上述约定的比例,不视为违规,本基金将在交易日日终进行复核,并将符合上述要求的情形,按照法律法规的有关规定从其规定。

本基金建仓期为六个月,建仓期结束前各项资产配置比例符合基金合同的规定。

3.本基金自基金合同生效之日起至报告期末,基金净值增值率为 27.21%,同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

4.1 基金治理 基金治理小组介绍

姓名	职务	任本基金基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
冯波	本基金基金经理、易方达基金权益配置、固定收益基金经理	2010-1-1	-	11 年

冯波,硕士研究生,曾任广发证券股份有限公司、易方达基金管理有限公司市场部拓展部负责人、市场部拓展部副经理、市场部大区销售经理、北京分公司副经理、研究部行业研究员、基金基金经理。

注:1.基金的“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 管理人对于报告期内本基金遵守投资运作情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等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、取信于基金投资者为宗旨,本着诚信信用、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长期利益。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、交易流程,以及强化事后分析评估监督机制来确保公平交易制度的切实执行和落实。本基金管理人建立了严格的投资研究决策、投资组合管理流程和集中交易制度等,并严格执行对开出的公平交易制度,以时间优先、价格优先为原则执行所有的基金买卖;通过投资交易系统对基金的公平交易控制,以及可追溯的公平交易投资组合,对于一般市场中间市场外交易,按照公平交易原则完善了相关程序。在本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 3 笔,均为对基金合同和投资策略的贯彻和风险控制发生的反向交易。

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运作情况说明

报告期内,本基金投资策略和运作情况如下:

1. 股票:随着 CPI 持续下行,经济周期预期逐步明确,政策从紧偏向中性偏宽松, A 股市场前期看好明显上升,估值水平得到修复,市场出现底部反弹行情。上证指数收盘达 2478 点,涨幅 12.66%,但至 3 月中旬下旬,由于政策放宽松度低于预期,前期反弹行情,市场出现快速回落行情,上证指数收盘达 2292 点,涨幅为 2.88%,全市场板块快速轮动,早期看好的地产、化工、医药等行业,市场出现快速回落行情。

2. 固定收益:报告期内,本基金主要投资于国债、金融债、企业债、公司债、可转债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业拆借、货币市场基金等固定收益类资产。报告期内,本基金固定收益类资产的投资策略和运作情况如下:

3. 基金财产参与股票投资中,本基金所申报的金额不得超过基金总资产,所申报的股票数量不得超过拟买入股票公司本次发行证券总量的总量;

4. 相关法律法规及监管部门指定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制,本基金在不受上述限制的前提下,将按照法律法规或监管部门的要求履行适当程序后,本基金不受上述限制。

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因素导致投资组合不符合上述约定的比例,不视为违规,本基金将在交易日日终进行复核,并将符合上述要求的情形,按照法律法规的有关规定从其规定。

本基金建仓期为六个月,建仓期结束前各项资产配置比例符合基金合同的规定。

3.本基金自基金合同生效之日起至报告期末,基金净值增值率为 27.21%,同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

5.1 报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	912,506,619.94	79.67
2	其中:股票	912,506,619.94	79.67
3	固定收益投资	80,472,000.00	7.03
4	其中:债券	80,472,000.00	7.03
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	147,739,615.20	12.90
10	其他各项资产	4,674,430.35	0.41
11	合计	1,145,392,665.49	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	采矿业	76,170,996.30	6.70
C	制造业	601,724,013.03	52.61
C0	食品饮料	221,649,489.59	19.49
C1	纺织服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	4,223,576.00	0.37
C3	医药、生物制品	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,347,201.66	1.00
C5	电子	27,125,206.08	2.38
C6	金属、非金属	78,220,622.05	6.88
C7	机械、设备、仪表	171,376,430.90	15.07
C8	医药、生物制品	87,781,504.55	7.72
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	148,121,024.57	13.02
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	43,281,864.57	3.81
H	批发和零售业	90,307,628.73	2.69
I	金融、保险业	4,822,500.00	0.42

易方达基金管理有限公司股票型证券投资基金

2012 第 三 季 度 报 告

§1 基金财产参与证券发行申购、本基金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

§1 相关法规及证监会部门规定的其它投资限制

根据法律法规及《基金合同》的相关规定，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因素导致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 个工作日内进行内部调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2. 在本报告期内为一个月，本基金期末按各项资产配置比例符合基金合同的约定。

3. 本基金各基金份额有效申购报告期末的基金份额净值增长率为 7.21%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 顾国建(小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限 任职日期-解任日期	证券从业年限	说明
冯波	本基金的基金经理 南方基金权益配置 组合基金的基金经理	2010-1-1 - 至今	11 年	硕士研究生，曾任广东发展银行行员，南方达金资产管理股份有限公司市场部拓展部研究员、市场部拓展部副经理、市场部大客户销售部经理，北京分公司总经理助理，研究部行业研究员，基金交易助理。

注：1.上述表的“任职日期”和“解任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。
2.在报告期内无变更基金经理人，基金经理人未发生变更管理行为的相应说明。

4.2 管理人对本报告期内遵守诚信情况的说明

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约定，以取信于市场，维护社会公共利益为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期利益。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 公平交易的实际情况说明

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、交易流程，以及系统化事后分析评估监督机制来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人建立了严格的投资管理控制制度，投资决策及管理控制和相关信息均纳入公平交易的监控系统之中，由系统统一监控执行。同时，本基金还通过公平交易系统的实时监控，对异常交易行为进行及时识别和反馈，对于一切可能影响公平对待的投资交易行为，对于一级市场中所有场外交易，按照公开竞价原则完善了分散分配机制。本报告期内，公平交易系统总体执行情况良好。

4.3.2 公平交易的专项测试

本报告期内，公平交易系统中参与的交易所公开竞价交易中，同日同向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易共有 3 笔，均为 ETF 基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内本基金有无可能导致不公平定价和利益输送的异常情况

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

季初，继 2012 年 8 月央行上调存款准备金率后，政策从紧偏向中性偏谨慎，A 股市场继续明显上行，估值水平得到修复，市场走出连续反弹行情，上证指数结束 2478 点，涨幅仅 12.66%，但至月中下旬，由于政策效应低于预期，股指仍持续下行，市场出现快速回调，月末上证指数收于 2262 点，涨幅仅为 2.88%，全季从宏观背景看，早期房地产、煤炭、有色、家电、汽车等行业表现较好，大幅超涨后市，后端的消费品、食品饮料、医药等行业表现疲弱。

季初在资产配置上，本基金季初大幅提升了股票仓位，降低了现金和债券仓位，加大了对家电、汽车、煤炭、白酒等行业配置，降低了百货、医药等行业配置，个别方面，适度加大了部分估值水平较高的中小盘股票的配置，减持了部分估值水平偏低且成长性一般的中大盘股。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截至报告期末，本基金份额净值为 1.009 元，本报告期份额净值增长率为 7.01%，同期业绩比较基准收益率为 3.67%。

未来较长的一段时间内，宏观经济难以系统性好转，经济将处于下滑的大背景下，结构调整将成为经济运行中的重点，同时在对利率走势的判断上，我们认为政策的大幅放松已经出现，更可能出现的情况是，政策的对冲性使得经济周期的波动性增强，因此，经济周期可能处于一个震荡中长期的阶段，经济成长性的不确定性，或者说不确定性，将是未来观察市场的重要能力，政策支持是前提性条件。从外部市场环境看，欧债危机仍未见底趋缓，美国经济复苏速度超预期，全球流动性正在被暖化甚至过剩，我国经济和海外市场有所分化。

本基金认为，当前市场的核心特征是：一方面，流动性宽松使资金成本盈利长期化，压制了估值水平；另一方面，流动性的相对改善和本市场的持续扩容下估值依然一分出，证券市场在持续的国际化进程中也有估值较高的中小盘股票产生压力。展望未来，我们认为股票市场仍将持续上升态势之一方面，基本面支撑持续下降，估值溢价增加，二是流动性宽松，经济保持温和回升的可能性较大，一方面，资本市场估值提升能力和对中长期增长的预期也随着市场的上升而提高。

2012 年三季度，本基金将以控制回撤稳定收益为主，主要投资蓝筹股，股票仓位保持在高位，关注以行业和个股的估值为基础，综合结合国际国内经济走向的行业，食品农产品、医药消费等。一是短期行业性的波段投资机会，二是受益于快速增长成长阶段的行业，如装备、国防、民航、工业设备等产业链；四是行业增速放缓但集中度持续提升的行业。

§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	912,506,619.94	79.67
	其中：股票	912,506,619.94	79.67
2	固定收益投资	80,472,000.00	7.03
	其中：债券	80,472,000.00	7.03
3	货币支持证券	-	-
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	147,739,615.20	12.90
6	其他各项资产	4,674,430.35	0.41
7	合计	1,145,392,665.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的基金投资组合

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	76,170,996.30	6.70
C	制造业	721,724,033.03	52.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,649,489.59	5.49
E	建筑业	-	-
F	房地产业	4,223,576.00	0.37
G	商业、贸易	-	-
H	信息技术、电子、塑胶、塑料	11,347,201.66	1.00
I	金融业、保险业	227,125,006.08	2.38
O	金属、非金属、陶瓷、玻璃、建材	78,220,624.25	6.88
J	机械、设备、仪表	17,376,430.90	1.57
K	化学、生物制品	87,781,504.55	7.77
L	其他制造业	-	-
M	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
N	铁路运输业	148,121,024.57	13.02
P	交通运输、仓储业	-	-
Q	信息技术业	43,281,864.57	3.81
H	批发和零售贸易	30,577,628.73	2.69
I	金融、保险	4,822,500.00	0.42
J	房地产业	7,808,572.74	0.69
K	卫生服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	餐饮业	-	-
	合计	912,506,619.94	80.22

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	764,915	69,469,580.00	6.11
2	000688	神州泰岳	1,432,642	56,001,975.78	4.92
3	000088	招商局 A	3,744,095	55,974,220.25	4.92
4	600199	金种子酒	2,602,436	50,214,866.16	4.46
5	601699	潞安环能	2,070,930	52,706,344.00	4.59
6	002373	星源股份	1,285,825	37,276,066.75	3.28
7	600887	伊力股份	1,634,852	36,032,138.08	3.17
8	000651	格力电器	1,725,401	35,977,022.73	3.28
9	000085	五粮液	1,001,284	32,882,166.56	2.89
10	600406	国电南瑞	833,496	26,313,468.72	2.31

5.4	报告期末按债券品种分类的债券投资组合	
5.5	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	
5.7	本基金本报告期末未持有债券	
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十名资产支持证券投资明细	
5.9	本基金本报告期末未持有资产支持证券	
5.10	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	
5.11	本基金本报告期末未持有权证	
5.12	证券投资组合附注	
5.13	本基金投资的前十名股票的发行主体本期没有出现在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	
5.14	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	
5.15	其他各项资产构成	

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	911,213.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,560.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	912,773.28

5.8.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.8.5	本基金本报告期末持有处于转股期但可转换债券

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	300146	汤臣倍健	12,522,482.76	2.71	重大事项停牌

§ 6 开放式基金估值变动

	单位:份
本报告期初基金份额总额	539,454,936
本报告期基金总申购份额	2,684,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	2,546,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	677,454,936

§ 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创业板交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2. 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

3. 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议；

4. 基金管理人业务资格批准和营业执照；

5. 基金托管人业务资格批准和营业执照。

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

二〇一二年四月二十四日

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	300070	银泰黄金	1,420	53,818.00	0.03
2	300027	华联兄弟	3,337	46,050.60	0.02
3	300024	机器人	2,150	36,722.00	0.02
4	300077	国民技术	1,400	34,230.00	0.02
5	300079	数码视讯	1,300	33,826.00	0.02
6	300146	汤臣倍健	600	33,822.00	0.02
7	300039	上海凯宝	1,500	29,565.00	0.02
8	300104	东瑞股份	800	28,640.00	0.02
9	300124	汇川技术	700	27,978.00	0.01
10	300142	沃森生物	600	27,405.00	0.01

5.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未有债券。

5.2 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有债券。

5.3 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有资产支持证券。

5.4 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有权证。

5.5 投资组合报告附注

5.5.1 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。

5.5.2 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。

5.5.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,233.87
5	应收申购款	2,982,729.60
6	其他应收款	0.15840

6	其他应收款		9,158.40
7	待摊费用		-
8	其他		-
9	合计		3,495,121.87

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券余额
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末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	300146	汤臣倍健	33,822.00	0.02	重大事项停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额	205,795,630.26
本报告期基金总申购份额	63,010,136.20
减:本报告期基金总赎回份额	51,427,693.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	217,378,072.52

6.7 基金资产净值

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2. 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同；

3. 韩达基金管理有限公司开放式基金业务规则；

4. 易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议；

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内免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一二年四月二十四日

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	--	--	--
2	央行票据	--	--	--
3	金融债券	80,472,000.00	7.07	
	其中:政策性金融债	80,472,000.00	7.07	
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	80,472,000.00	7.07	

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	070211	07国开11	500,000	50,265,000.00	4.42
2	070219	07国开19	300,000	30,267,000.00	2.66

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

本基金本报告期末没有资产支持证券。

5.7 报告期内本基金公允价值基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末无持仓。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 原基金管理人投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在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,或存在其他影响证券价格的负面情况。

根据宜信五粮微贷(有限合伙)2014年5月28日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会行政处罚决定书的公告》,宜信五粮微贷(有限合伙)因“违规披露、提供虚假信息”被中国证监会处以警告,并处以30万元罚款。

根据宜信五粮微贷(有限合伙)的公开正常经营,公司对投资该证券没有造成实质影响,故进行投资。本基金投资宜信五粮的决策符合公司投资政策及风险控制规定。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,无股票具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	479,130.26
2	应收证券清算款	3,797,225.79
3	应收股利	-
4	应收利息	75,230.92
4.1	应收申购款	322,843.38
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
9	合计	4,674,430.35

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

本报告期初基金份额总额	1,158,503,397.60
本报告期基金总申购份额	30,435,663.29
减：本报告期基金总赎回份额	62,013,669.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,126,925,391.15

§ 7 备查文件目录

- 中国证监会核准基金管理人业绩证明证券投资基金募集的文件；
- 基金管理人业绩证明证券投资基金基金合同(附件)；
- 基金管理人业绩证明基金管理人开放式基金业务规则；
- 基金管理人业绩证明证券投资基金基金托管协议；
- 基金管理人业务资格批复和营业执照；
- 基金托管人业务资格批复和营业执照；
- 基金管理人、基金托管人处。
- 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一二年四月二十四日
