易方达保证金收益货币市场基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达保证金货币
基金主代码	159001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月29日
报告期末基金份额总额	801,383,058份
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率,即活期存款基准利率×(1-利息税税率)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	易方达保证金货币A / 易方达保证金货币B
下属两级基金的交易代码	159001 / 159002
报告期末下属两级基金的份额总额	319,764,832份 / 481,618,226份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	易方达保证金货币A	易方达保证金货币B
1.本期已实现收益	3,737,808.48	9,295,071.66
2.本期利润	3,737,808.48	9,295,071.66
3.期末基金资产净值	319,764,832.00	481,618,226.00

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金收益分配是每月集中支付。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达保证金货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9794%	0.0013%	0.0894%	0.0000%	0.8900%	0.0013%

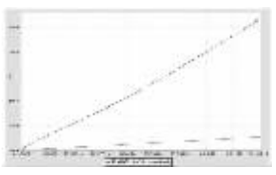
易方达保证金货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.1328%	0.0013%	0.0894%	0.0000%	1.0434%	0.0013%

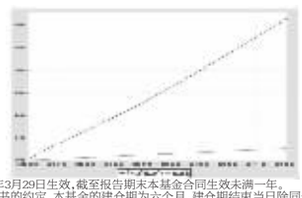
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达保证金收益货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年3月29日至2013年12月31日)

易方达保证金货币A



易方达保证金货币B



注:1.本基金合同于2013年3月29日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束当日除同一商业银行存款比例略高于合同规定的范围外,其他各项资产配置比例符合合同(第十部分(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。由于建仓期结束当日规模变动导致的同一商业银行存款比例被动超标,本基金已在法规规定的期限内调整完毕。

3.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为2.6873%,B类基金份额净值收益率为3.1580%,同期业绩比较基准收益率为0.2703%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓晨	本基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达投资管理(香港)有限公司基金经理	2013-4-22	-	10年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管。
石大怿	本基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达理财货币市场基金的基金经理	2013-4-22	-	4年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。

注:1.此处的"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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。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,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,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。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

本报告期内,公司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量超过该证券当日成交量的5%的交易共有12次,其中11次为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易,1次为不同基金经理管理的非指数基金间因投资策略不同而发生的反向交易,该次交易基金经理已提供决策依据,并履行了审批程序。

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季度上证指数下跌2.7%,创业板指数下跌4.6%。四季度制造业信心指数和发电量等经济指标显示经济景气度有所回落,同时资金市场偏紧、市场利率上行。在此宏观经济和资金市场背景下,四季度房地产、银行和资源等强周期行业出现较大幅度的下跌,防御类行业中大众消费品和医药也出现小幅回调,家电涨幅较大。

本基金在四季度仓位和行业配置保持稳定,组合构造以"大健康、大消费"为核心配置,主要集中在医药、大众消费品和家电等行业,主要的调整是将一些周期股换成成长股,同时根据医药行业政策变化对医药类个股重新梳理,整体组合的集中度继续提高,股票集中在管理优秀的个股上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.550元,本报告期份额净值增长率为-0.45%,同期业绩比较基准收益率为-1.88%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年一季度,政府推行的市场化改革和经济转型继续释放经济的内生增长动力,互联网技术的迅速发展催生更多新的商业模式,同时欧美经济持续复苏也营造更好的外部经济环境。 在经济保持稳健的增长背景下,也要看到国内产能过剩的局面还没有得到根本改观,经济依然处于去杠杆的进程。经济运行的这些特征决定了股票市场的结构分化将继续存在。从市场资金看,加强影子银行监管等措施将进一步使得实体经济资金市场偏紧,同时大量新股发行也将分流部分二级市场资金。

综上所述,我们对债券市场持中性的态度。本基金将继续保持组合较高的流动性,维持较高的债券和逆回购的配置比例,并在债券的配置中维持较低的剩余期限,在保证资产流动性的前提下提高组合收益。

基金管理人将坚持规范运作、审慎投资,勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

§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	固定收益投资	448,060,201.27	55.77
	其中:债券	448,060,201.27	55.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	225,500,287.75	28.07
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	112,773,183.79	14.04
4	其他资产	17,081,150.44	2.13
5	合计	803,414,823.25	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.75
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限未超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	60.85	0.02
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	3.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	17.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.89	-
4	90天(含)—180天	4.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	12.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.35	0.02

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	摊余成本(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	348,055,613.56	43.43
	其中:政策性金融债	348,055,613.56	43.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,004,587.71	12.48
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	448,060,201.27	55.91
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,192,783.05	4.89

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	1,700,000	169,470,205.96	21.15
2	130227	13国开27	1,000,000	99,528,849.10	12.42
3	041353018	13国投新集CP001	500,000	50,005,773.23	6.24
4	041354013	13洋河CP001	500,000	49,998,814.48	6.24
5	110212	11国开12	400,000	39,192,783.05	4.89
6	130248	13国开48	200,000	19,977,591.27	2.49
7	130218	13国开18	200,000	19,886,184.18	2.48

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1579%
报告期内偏离度的最低值	-0.1055%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0604%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	9,865,388.60
3	应收利息	7,215,761.84
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,081,150.44

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达保证金货币A	易方达保证金货币B
本报告期期初基金份额总额	350,837,615.00	727,154,316.00
本报告期基金总申购份额	4,203,870,802.00	8,752,638,789.00
减:本报告期基金总赎回份额	4,234,943,585.00	8,998,174,879.00
本报告期期末基金份额总额	319,764,832.00	481,618,226.00

注:总申购份额含因份额升降级等导致的强制调增份额,总赎回份额含因份额升降级等导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达保证金收益货币市场基金募集的文件;

2.《易方达保证金收益货币市场基金合同》;

3.《易方达保证金收益货币市场基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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
二〇一四年一月二十一日

易方达策略成长证券投资基金

【2013】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达策略成长混合
基金主代码	110002
交易代码	110002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月9日
报告期末基金份额总额	1,430,964,737.74份
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。
投资策略	本基金为主动型股票基金,投资的总体原则是在价值区域内把握波动,在波动中实现研究的"溢价"。基金采取相对稳定的资产配置策略,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时,以雄厚的研究力量为依托,通过以价值成长比率(PEG)为核心的系统方法筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握行业/板块、个股的市场波动所带来的获利机会,为基金份额持有人追求较高的当期收益及长期资本增值。
业绩比较基准	上证A指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	18,438,583.26
2.本期利润	-29,273,232.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0202
4.期末基金资产净值	5,418,172,931.04
5.期末基金份额净值	3.786

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

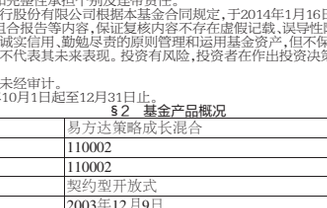
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.39%	1.06%	-1.88%	0.74%	1.49%	0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达策略成长证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年12月9日至2013年12月31日)



注:1. 基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)基金持有一家上市公司的股票,不超过基金资产净值的10%;

(2)基金与由基金管理人管理的其它基金持有任何一家公司发行的证券的总和,不超过该证券的10%;

(3)基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;

(4)基金股票投资比例最高可达95%;

(5)法律法规规定的其他限制。

因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。

2.本基金的建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为512.82%,同期业绩比较基准收益率为46.01%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡海洪	本基金的基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理、易方达消费行业股票型证券投资基金的基金经理、研究部总经理助理	2011-9-30	-	10年	硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司研究员,易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、机构理财部投资经理。

注:1.此处的"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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。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,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,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。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

本报告期内,公司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量超过该证券当日成交量的5%的交易共有12次,其中11次为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易,1次为不同基金经理管理的非指数基金间因投资策略不同而发生的反向交易,该次交易基金经理已提供决策依据,并履行了审批程序。

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季度上证指数下跌2.7%,创业板指数下跌4.6%。四季度制造业信心指数和发电量等经济指标显示经济景气度有所回落,同时资金市场偏紧、市场利率上行。在此宏观经济和资金市场背景下,四季度房地产、银行和资源等强周期行业出现较大幅度的下跌,防御类行业中大众消费品和医药也出现小幅回调,家电涨幅较大。

本基金在四季度仓位和行业配置保持稳定,组合构造以"大健康、大消费"为核心配置,主要集中在医药、大众消费品和家电等行业,主要的调整是将一些周期股换成成长股,同时根据医药行业政策变化对医药类个股重新梳理,整体组合的集中度继续提高,股票集中在管理优秀的个股上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为3.786元,本报告期份额净值增长率为-0.39%,同期业绩比较基准收益率为-1.88%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年一季度,政府推行的市场化改革和经济转型继续释放经济的内生增长动力,互联网技术的迅速发展催生更多新的商业模式,同时欧美经济持续复苏也营造更好的外部经济环境。 在经济保持稳健的增长背景下,也要看到国内产能过剩的局面还没有得到根本改观,经济依然处于去杠杆的进程。经济运行的这些特征决定了股票市场的结构分化将继续存在。从市场资金看,加强影子银行监管等措施将进一步使得实体经济资金市场偏紧,同时大量新股发行也将分流部分二级市场资金。

在组合构建上,我们将保持"大健康、大消费"的核心配置,对新能源、自动化和互联网等领域的成长股研究已经逐步积累,选择合适的标的和时机逐渐加大配置。

§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	4,675,802,136.13	85.98
	其中:股票	4,675,802,136.13	85.98
2	固定收益投资	369,723,100.00	6.80
	其中:债券	369,723,100.00	6.80
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	229,890,564.93	4.23
	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	116,179,140.97	2.14
6	其他资产	46,379,397.27	0.85
7	合计	5,437,974,339.30	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	6,262,751.44	0.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,801,625,468.77	70.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	72,534,000.00	1.34
F	批发和零售业	402,004,237.50	7.42
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	-	-
K	房地产业	153,748,000.00	2.84
L	租赁和商务服务业	195,750,000.00	3.61
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	43,877,678.42	0.81
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,675,802,136.13	86.30

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	000651	格力电器	15,800,000	516,028,000.00	9.52
2	600887	伊利股份	12,690,000	495,925,200.00	9.15
3	000538	云南白药	3,000,000	305,970,000.00	5.65
4	600066	宇通客车	13,190,000	231,616,400.00	4.27
5	000963	华东医药	5,000,000	230,000,000.00	4.24
6	600315	上海家化	5,400,000	228,042,000.00	4.21
7	600276	恒瑞医药	5,400,482	205,110,306.36	3.79
8	002400	省广股份	5,400,000	195,750,000.00	3.61
9	600535	天士力	4,200,000	180,138,000.00	3.32
10	000895	双汇发展	3,800,000	178,904,000.00	3.30

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	267,792,000.00	4.94
	其中:政策性金融债	267,792,000.00	4.94
4	企业债券	1,517,100.00	0.03
5	企业短期融资券	100,414,000.00	1.85
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	369,723,100.00	6.82

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	130243	13国开43	1,000,000	99,300,000.00	1.83
2	041352001	13南方水泥CP001	700,000	70,525,000.00	1.30
3	130236	13国开36	600,000	59,586,000.00	1.10
4	110418	11农发18	500,000	49,225,000.00	0.91
5	041364016	13鄂联投CP001	300,000	29,889,000.00	0.55

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 根据上海家化联合股份有限公司2013年11月20日发布的《关于收到中国证监局<检查通知书>的公告》,公司因涉嫌未按照规定披露信息被中国证券监督管理委员会立案稽查。

该公司所处化妆品行业市场空间大,公司产品核心竞争力强,管理层平稳交接。本基金自买入到当前获取不错的收益率,将根据公司的基本面变化决定持仓变化。

除上海家化外,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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	554,538.53
2	应收证券清算款	37,713,484.48
3	应收股利	-
4	应收利息	6,723,101.62
5	应收申购款	1,388,272.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,379,397.27

5.10.4 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。

5.10.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,341,626,773.41
本报告期基金总申购份额	181,542,672.50
减:本报告期基金总赎回份额	92,204,708.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,430,964,737.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准易方达策略成长证券投资基金设立的文件;

2.《易方达策略成长证券投资基金基金合同》;

3.《易方达策略成长证券投资基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

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。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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
二〇一四年一月二十一日

易方达策略成长二号混合型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达策略成长二号混合
基金主代码	112002
交易代码	112002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月16日
报告期末基金份额总额	3,097,631,487.87份
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。
投资策略	本基金投资的总体原则是在价值区域内把握波动,在波动中实现研究的"溢价"。基金采取相对稳定的资产配置策略,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时,以雄厚的研究力量为依托,通过以价值成长比率(PEG)为核心的系统方法筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票,并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握行业/板块、个股的市场波动所带来的获利机会,为基金持有人追求较高的当期收益及长期资本增值。
业绩比较基准	上证A指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	2,506,117.19
2.本期利润	-19,529,024.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0065
4.期末基金资产净值	4,799,904,714.34
5.期末基金份额净值	1.550

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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