易方达积极成长证券投资基金

【2010】第三季度报告

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：二〇一〇年十月二十八日

§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2010年10月26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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达积极成长混合
基金主代码	110005
交易代码	110005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月9日
报告期末基金份额总额	6,825,630,383.60份
投资目标	本基金主要投资超速成长公司，以实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采取主动投资管理模式，一方面主动地进行资产配置，以控制或规避市场的系统性风险；另一方面采取自下而上的选股策略，主要投资于利用“易方达成长公司评价体系”严格筛选的、具有良好成长性且价格合理的上市公司，其中投资的重点是“超速成长”公司的股票，以争取尽可能高的投资回报。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等偏高风险水平的基金品种。
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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-136,935,224.41
2.本期利润	1,293,051,283.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.1908
4.期末基金资产净值	7,613,461,028.10
5.期末基金份额净值	1.1154

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。

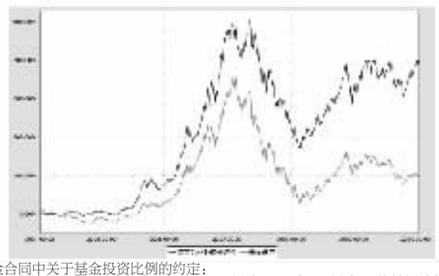
3.2 基金净值表现

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	19.91%	1.14%	10.65%	1.18%	9.26%	-0.04%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达积极成长证券投资基金
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
（2004年9月9日至2010年9月30日）



注：1. 基金合同中关于基金投资比例的约定：

一般情况下，本基金将60%以上的资产投资于股票市场。而当股票市场系统性风险加大时，本基金可加大投资债券市场的比例，但股票资产占基金总资产的比重最低不低于40%。

因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述比例限制时，基金管理人应在合理的期限内进行调整，以符合有关限制规定。法律法规另有规定时从其规定。

2. 本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3. 本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为398.27%，同期业绩比较基准收益率为102.56%。

§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		
陈志民	本基金的基金经理、基金首席投资官	2004-9-9	-	17年	硕士研究生，历任厦门国际信托投资公司信托部经理助理，南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资部副总经理，易方达基金管理有限公司基金投资部副总经理、机构理财部总经理、基金科翔基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理、机构理财部投资经理、基金投资部总经理。曾公派美国哥伦比亚大学国际关系学院学习，获公共管理硕士学位，并曾在美国Evergreen Investments基金管理公司国际股票投资部工作。
何云峰	本基金的基金经理、易方达中小盘股票型基金基金经理	2008-1-1	-	6年	博士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员兼易方达积极成长基金基金经理助理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，陈志民的“任职日期”为基金合同生效之日，何云峰的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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，对在同一个交易系统中交易的组合，启用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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

2010年3季度，A股市场扭转了上半年的下跌走势，呈现振荡反弹格局。季初市场在调控力度放松和宏观经济数据触底回升的预期下反弹较为强劲，但随后由于地产价格和CPI的持续攀升又使得市场对后续调控政策的实施有所担忧，上证综指围绕2600-2700点呈现振荡整理态势。海外市场则在预期发达国家进一步实施经济刺激政策和量化宽松货币政策的背景下表现较强，基本收复前期由于欧洲主权债务危机爆发引发的下跌。本季上证综合指数上涨267.86点，涨幅达10.65%，从板块及个股走势上看，市场结构性差别依然明显。受益于经济结构调整的消费、医药、新兴产业等板块走势强劲，股价不断创出反弹新高甚至历史新高，而受经济调控影响较大的煤炭、地产、银行、钢铁等周期类板块个股依然表现较差，对未来中国经济增长模式转变的预期在A股市场得到了淋漓尽致的表现。

基于对A股市场振荡向上格局的判断，易方达积极成长基金在三季度增加了股票仓位，同时对股票结构继续进行调整。在行业配置上，持续增加了食品饮料、家纺、医药、商业零售等板块个股配置，对估值合理的新材料、节能减排个股也适当增加了配置。而对于周期性行业股票的配置本基金仍较为审慎。同时，对于基本面优良、成长性较好的小盘股根据估值情况进行了动态优化，从实际效果来看，取得了较好的效果。

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 1.1154元，本报告期份额净值增长率为 19.91%，同期业绩比较基准收益率为 10.65%。

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2010年4季度，海外经济和国内经济仍处于较为复杂的态势中。海外经济在复苏企稳的状态下未来增长动力如何？国内经济在稳增长和经济结构转型的矛盾中如何平衡？这些都值得我们去思索。在这种背景下，A股市场短期可能较难出现走势确定的单边行情，持续振荡的可能性较大。

从未来国内经济增长的模式看，从后重工业时代进入消费时代是较为确定的方向。过去投资加外需的主要经济驱动力将转化为消费加投资。在未来的“十二五”规划中，无论是应对国际社会的压力或是自身经济结构的需要，中国将进入经济结构转型的阶段，与之对应受益的消费、医药等板块将是中长期投资重点。此外，目前国内经济发展的区域不平衡问题非常突出，中西部未来仍有较大的投资需求，机械产业也面临较大的产业升级和进口替代空间。长期看，中国经济的增长空间仍然较大。

目前国内的经济面临保持平稳较快增长和地产价格高企、CPI压力较大的复杂局面，政府将运用较多行政手段调控，容易引起经济波动加剧，从而使得股票市场的波动加大，因此需对调控政策的实施力度紧密跟踪。

基于上述判断，预计2010年4季度市场将处于振荡格局。市场结构性分化仍将较为明显。由于政策预期的转变，前期跌幅较深的周期类行业个股可能存在一定的反弹空间，但较难存在持续的超额收益，而受益于经济增长方式转变的大消费、新材料、新能源、信息技术等新经济模式板块依然可能受到市场的追捧。另外，自下而上发掘基本面超预期的个股也将获得较大超额回报。本基金将坚持价值投资的理念及自下而上的选股策略，继续做好基本面研究，优选成长性高、有持续成长能力、定价相对合理的“超速成长”公司，同时努力提高操作效率，争取为投资者带来满意的回报。

§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	权益投资	6,593,630,235.86	86.30
	其中：股票	6,593,630,235.86	86.30
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	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	956,398,743.89	12.52
6	其他各项资产	90,716,330.88	1.19
7	合计	7,640,745,310.63	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	37,564,370.15	0.49
B	采掘业	82,348,000.00	1.08
C	制造业	4,048,993,337.76	53.18
C0	食品、饮料	1,224,176,975.93	16.08
C1	纺织、服装、皮毛	452,639,361.48	5.95
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	39,431,763.84	0.52
C4	石油、化学、塑胶、塑料	281,769,141.18	3.70
C5	电子	189,296,457.32	2.49
C6	金属、非金属	125,177,457.05	1.64
C7	机械、设备、仪表	812,033,488.59	10.67
C8	医药、生物制品	855,898,051.67	11.24
C99	其他制造业	68,570,640.70	0.90
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,416,000.00	0.26
E	建筑业	313,022,891.84	4.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	284,472,948.80	3.74
H	批发和零售贸易	868,344,924.37	11.41
I	金融、保险业	487,386,290.63	6.40
J	房地产业	234,589,991.48	3.08
K	社会服务业	167,144,437.95	2.20
L	传播与文化产业	5,174,005.98	0.07
M	综合类	45,173,036.90	0.59
	合计	6,593,630,235.86	86.60

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	601318	中国平安	6,509,731	344,299,672.59	4.52
2	002024	苏宁电器	13,501,567	215,620,024.99	2.83
3	002029	七匹狼	5,801,815	194,592,875.10	2.56
4	600887	伊利股份	4,200,000	176,106,000.00	2.31
5	600729	重庆百货	3,100,000	168,888,000.00	2.22
6	000858	五粮液	4,591,122	157,613,218.26	2.07
7	600754	锦江股份	6,000,295	150,067,377.95	1.97
8	002106	莱宝高科	4,000,507	147,618,708.30	1.94
9	000581	威孚高科	6,000,613	147,315,049.15	1.93
10	002310	东方园林	1,295,899	140,423,615.64	1.84

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

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

本基金本报告期未未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,323,894.62
2	应收证券清算款	80,930,763.19
3	应收股利	-
4	应收利息	163,112.36
5	应收申购款	5,298,560.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,716,330.88

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本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	6,661,402,499.91
本报告期基金总申购份额	450,781,883.94
减：本报告期基金总赎回份额	286,554,000.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,825,630,383.60

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准易方达积极成长证券投资基金设立的文件；

2.《易方达积极成长证券投资基金基金合同》；

3.《易方达积极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。

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
二〇一〇年十月二十八日

易方达沪深300指数证券投资基金

【2010】第三季度报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一〇年十月二十八日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达沪深300指数
基金主代码	110020
交易代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
报告期末基金份额总额	12,797,345,894.50份
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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照沪深300指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X95%+活期存款利率（税后）X5%。
风险收益特征	本基金是指数型股票基金，属于证券投资基金中的高风险、高收益品种，理论上其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-62,992,768.92
2.本期利润	1,350,715,488.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.1116
4.期末基金资产净值	11,418,302,775.23
5.期末基金份额净值	0.892

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；

2. 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。

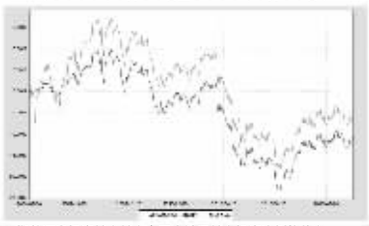
3.2 基金净值表现

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	14.21%	1.28%	13.79%	1.25%	0.42%	0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达沪深300指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009年8月26日至2010年9月30日）



注：1.易方达沪深300指数证券投资基金基金合同中关于基金投资比例的约定：

①本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

②本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

③本基金进入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%；

④本基金股票资产占基金资产的比例为90%-95%，其中投资沪深300指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的90%；

⑤本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

⑥本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

⑦本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

⑧本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

⑨本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券，基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

⑩本基金不参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

⑪本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

⑫保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

2.本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为-10.80%，同期基金业绩比较基准收益率为-5.14%。

§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		
林飞	本基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金的基金经理、易方达50指数基金的基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金的基金经理、指数与量化投资部总经理助理	2009-8-26	-	7年	博士研究生，历任融通基金管理有限公司基金经理助理，易方达基金管理有限公司易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理助理。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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，对在同一个交易系统中交易的组合，启用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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

三季度宏观经济运行相对平稳，工业增加值等宏观同比数据在连续多月回落之后于三季度开始出现回升，虽然通胀同比数据仍在高位，但随着季节性因素的减弱，环比增长压力已有所减轻，三季度汽车、工程机械、地产等重点行业数据好于预期。随着宏观数据逐渐企稳，投资者对经济二次回落预期有所减缓，市场开始逐步修复由二季度过于悲观的经济和政策预期所导致的过度反应。与此同时，市场估值转向远离平衡似乎已成为一种不可逆转的惯性趋势，围绕经济结构调整及政策扭出主线的市场结构分化仍在三季度进一步延续。上证指数最终季度涨幅10.73%，沪深300指数同期涨幅14.53%。作为标准型指数基金，沪深300指数基金三季度基金净值跟随基准指数出现一定幅度的上涨。

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 0.892元，本报告期份额净值增长率为14.21%，同期基准指数收益率为13.79%，年化跟踪误差0.97%，在合同规定的控制范围之内。

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

整体来看，决定经济运行方向的仍是经济基本面的中长期趋势，而这一趋势不会因为经济数据短期反复产生方向性的变化。结构上看，消费的平稳增长以及外需的逐渐恢复将成为带动经济进一步复苏的重要推动因素，经济正逐渐步入一个增长更为平稳以及结构更为均衡的区间。基于微观经济实体良好的基本面、前瞻性的调控政策以及后续可以进一步释放的内需空间，我们对国内经济中长期的增长前景依然维持相对乐观的判断，企业盈利稳步增长的趋势将进一步延续，市场的趋势和结构特征将逐步反映经济及企业基本面逐渐转好的过程。股指期货及融资融券等金融创新对市场产生的影响正在逐渐显现，在多层次金融工具逐渐深化的过程中，相信结构性因素将逐渐取代系统性因素成为影响市场走势的主要因素。

作为被动投资的基金产品，沪深300指数基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。期望本基金为投资者分享中国证券市场监券股未来长期稳定的增长提供良好的投资机会。

§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	10,613,144,248.43	88.74
	其中：股票	10,613,144,248.43	88.74
2	固定收益投资	392,200,000.00	3.28
	其中：债券	392,200,000.00	3.28
	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	941,486,861.73	7.87
6	其他各项资产	13,219,002.09	0.11
7	合计	11,960,050,112.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	9,115,250.40	0.08
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	9,115,250.40	0.08

5.2.2 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	44,292,631.05	0.39
B	采掘业	1,212,357,556.00	10.62
C	制造业	3,523,668,683.45	30.86
C0	食品、饮料	566,178,163.35	4.96
C1	纺织、服装、皮毛	44,208,867.79	0.39
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	14,721,242.70	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	259,051,937.15	2.27
C5	电子	51,429,035.84	0.45
C6	金属、非金属	869,050,806.23	7.61
C7	机械、设备、仪表	1,240,416,195.66	10.86
C8	医药、生物制品	438,018,051.86	3.84
C99	其他制造业	40,594,382.87	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	345,227,869.54	3.02
E	建筑业	345,141,058.93	3.02
F	交通运输、仓储业	461,428,492.51	4.04
G	信息技术业	344,797,663.32	3.02
H	批发和零售贸易	377,199,244.74	3.30
I	金融、保险业	3,003,729,797.69	26.31
J	房地产业	578,199,353.03	5.06
K	社会服务业	99,386,937.43	0.87
L	传播与文化产业	20,926,454.28	0.18
M	综合类	247,673,256.06	2.17
	合计	10,604,028,998.03	92.87

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1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	601318	中国平安	7,447,290	393,887,168.10	3.45
2	600036	招商银行	26,746,057	346,361,438.15	3.03
3	601328	交通银行	45,018,523	261,107,433.40	2.29
4	600016	民生银行	48,856,688	249,169,108.80	2.18
5	601398	工商银行	53,900,793	217,759,203.72	1.91
6	601166	兴业银行	9,074,314	209,798,139.68	1.84
7	600000	浦发银行	14,900,090	193,105,166.40	1.69
8	000002	万科A	20,938,614	175,884,357.60	1.54
9	601088	中国神华	7,131,626	168,377,689.86	1.47
10	600030	中信证券	15,060,060	160,239,038.40	1.40

5.3.2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

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	600816	安信信托	670,239	9,115,250.40	0.08

注：本报告期末本基金积极投资部分仅持有以上股票。

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	392,200,000.00	3.43
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	392,200,000.00	3.43

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	1001015	10央行票据15	4,000,000	392,200,000.00	3.43

注：本报告期末本基金仅持有以上债券。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	526,761.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,992,302.14
4	应收利息	4,425,156.51
5	应收申购款	3,274,782.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,219,002.09

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5.1期末指数投资前一名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	9,115,250.40	0.08	重大事项停牌

§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	11,937,221,900.98
本报告期基金总申购份额	1,591,983,700.25
减：本报告期基金总赎回份额	731,859,706.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,797,345,894.50

§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沪深300指数证券投资基金募集的文件；

2.《易方达沪深300指数证券投资基金基金合同》；

3.《易方达沪深300指数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。

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
二〇一〇年十月二十八日

易方达货币市场基金

【2010】第三季度报告

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：二〇一〇年十月二十八日

§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2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达货币
基金主代码	110006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年2月2日
报告期末基金份额总额	2,936,573,771.70份
投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的回报。
投资策略	在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。
业绩比较基准	税后活期存款利率（即活期存款利率×(1-利息税率)）。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其