易方达安心回报债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二〇一二年二月

重要提示

本基金根据2011年5月9日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2011〕665号）和2011年5月12日《关于易方达安心回报债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函〔2011〕295号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2011年6月21日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

本基金主要投资于固定收益品种并辅以权益类品种，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：利率风险，本基金持有的信用品种违约带来的信用风险，新股发行数量减少及新股申购收益率降低带来的风险，股票市场的系统性风险及个别证券特有的非系统性风险，等等；基金运作风险，包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理运作过程中产生的基金管理风险，等等。此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破1元初始面值的风险。

本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率，但本基金的收益水平有可能不能达到或超过同期的目标收益率水平，投资者面临获得低于目标收益率甚至亏损的风险。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2011年12月21日，有关财务数据截止日为2011年9月30日，净值表现截止日为2011年12月31日。（本报告中财务数据未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1.基金管理人：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
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监基金字〔2001〕4号
法定代表人：叶俊英
设立日期：2001年4月17日
组织形式：有限责任公司
注册资本：12,000万元人民币
存续期限：持续经营
联系人：陈晓梅
联系电话：400 881 8088

2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总　计	100%

（二）主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

叶俊英先生，1963年生，经济学博士，董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长，广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁，易方达基金管理有限公司董事兼总裁、副董事长兼总裁。现任易方达基金管理有限公司董事长。

梁棠先生，1958年生，EMBA，董事。曾任广东省财政学校副校长，广东粤财实业发展公司总经理，广东粤财信托投资有限公司副总经理、总经理，广东粤财投资控股有限公司总经理，易方达基金管理有限公司副董事长。现任广东粤财投资控股有限公司董事长。2008年1月，当选为政协广东省第十届委员会常委。

李建勇先生，1957年生，经济学博士，董事。曾任广发证券股份有限公司成都营业部总经理、投资银行部总经理、公司总裁助理、公司副总裁、总裁。现任广发证券股份有限公司副董事长。

谢亮先生，1963年生，EMBA，董事。曾任53011、53061部队财务部门助理员，广州军区生产管理部财务部门助理员、处长。现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、计划财务部部长。

杨力先生，1975年生，EMBA，董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监，美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监，广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事、首席战略官。

张优造先生，1964年生，MBA，董事、副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理，广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理。现任易方达基金管理有限公司董事、副总裁，兼任易方达资产管理（香港）有限公司董事。

谢石松先生，1963年生，法学博士，独立董事。现任中山大学法学院教授、国际法研究所所长。兼任中国国际私法学会副会长，武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会成员，上海、广州、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员。

王化成先生，1963年生，经济学博士，独立董事。曾任中国人民大学商学院助教、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。

何小锋先生，1955年生，经济学硕士，独立董事。曾任广东省韶关市教育局干部、中共广东省韶关市委宣传部干部、北京大学经济学院讲师、副教授。现任北京大学经济学院金融系主任、教授、博士生导师。

陈国祥先生，1963年生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理，广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司总裁助理兼市场拓展部总经理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李舫金先生，1962年生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记、中国证监会广州证券监管办公室处长。现任广州国际控股集团有限公司副总经理、广州市广永国有资产经营有限公司党支部书记、董事长兼总经理，万联证券有限责任公司董事长（兼）、广州银行副董事长（兼）。

廖智先生，1971年生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管、易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、易方达基金管理有限公司人力资源部副总经理。现任易方达基金管理有限公司市场部总经理。

刘晓艳女士，1969年生，经济学博士，总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理，基金资产管理部总经理，易方达基金管理有限公司督察员兼监察部总经理、总经理助理兼市场部总经理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司总裁，兼任易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

张南女士，1970年生，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长，2001年10月加入易方达基金管理有限公司，曾任市场拓展部副总经理、督察长兼监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

2.基金经理

钟鸣远先生，1975年生，经济学硕士。曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部高级经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益部副经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理（自2008年3月19日起）、易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金经理（自2010年11月9日起）、易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理（自2011年6月21日起）。

3.投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：刘晓艳女士、肖坚先生、陈志民先生、马骏先生、刘震先生。

刘晓艳女士，同上。

肖坚先生，1969年生，经济学硕士。曾任广东粤财信托投资公司职员，香港安财投资有限公司财务部经理，粤信（香港）投资有限公司业务部副经理，广东粤财信托投资公司基金部经理，易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、基金投资部兼专户投资总监、基金科翔基金经理、易方达策略成长基金基金经理、易方达策略成长二号混合型基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司专户首席投资官。

陈志民先生，1971年生，法学硕士、公共管理硕士。曾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（主管研究），易方达基金管理有限公司基金投资部副总经理、机构理财部副总经理、机构理财部投资经理、基金投资部总经理、总裁助理、基金投资总监、基金科翔基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理、易方达积极成长基金基金经理，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。现任易方达基金管理有限公司基金首席投资官。

马骏先生，1966年生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA）。曾任君安证券有限公司营业部职员，深圳众大投资有限公司投资部副总经理，广发证券有限责任公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、基金科讯基金经理、易方达50指数基金基金经理、易方达深证100ETF基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益首席投资官，兼任易方达资产管理（香港）有限公司人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人。

刘震先生，1969年生，理学硕士。曾任D.E.Shaw &Co机构部副总裁，加拿大皇家银行多美年证券公司（RBC Dominion Securities）股权衍生产品部副总裁，HorizonLive.com高级副总裁，美国银行证券公司（Banc of America Securities）机构部总监，Sagamore Hill Capital Management高级量化策略师，瑞银投资银行（UBS Investment Bank）自营部执行董事兼任交易员，布莱文霍华德美国资产管理公司（Brevan Howard Asset Management）量化投资总监兼任交易员，北京红色天时金融科技有限公司（The Red Capital，LLC）执行合伙人，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部投资经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349，018，545，827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构：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：020-85102506
传真：400 881 8099
联系人：熊桃红
网址：www.efunds.com.cn

直销机构网点信息：

（1）易方达基金管理有限公司广州直销中心
办公地址：广州市体育西路189号城建大厦26楼
电话：020-85102506
传真：400 881 8099
联系人：熊桃红

（2）易方达基金管理有限公司北京直销中心
办公地址：北京市西城区金融街20号B座8层
电话：010-63213377
传真：400 881 8099
联系人：魏巍

（3）易方达基金管理有限公司上海直销中心
办公地址：上海市世纪大道88号金贸大厦2706-2708室
电话：021-50476668
传真：400 881 8099
联系人：王璟

（4）易方达基金管理有限公司网上交易系统
网址：www.efunds.com.cn

2.代销机构（以下排序不分先后）

（1）中国工商银行
注册地址：北京西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：刘业伟
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（2）中国银行
住所：北京市复兴门内大街1号
办公地址：北京市复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
联系人：侯燕鹏
客户服务电话：95566
传真：010-66594465
网址：www.boc.cn

（3）中国建设银行
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：张建国（代行）
联系人：王嘉朔
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

（4）中国农业银行
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
联系人：滕涛
客户服务电话：95599
开放式基金业务传真：010-85109219
网址：www.abchina.com

（5）交通银行
住所：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
联系电话：021-58781234
客户服务电话：95559
传真：021-58408483
网址：www.bankcomm.com

（6）招商银行
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
联系人：邓炯鹏
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（7）中信银行
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：田国立
联系人：丰靖
联系电话：010-65557083
客户服务电话：95558
传真：010-65550827
网址：bank.ecitic.com

（8）深圳发展银行
注册地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遂宁
联系人：张青
联系电话：0755-82088888
客户服务电话：95501
网址：www.sdb.com.cn

（9）民生银行
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：董云巍
联系电话：010-57092615
客户服务电话：95568
传真：010-57092611
网址：www.cmbc.com.cn

（10）浦发银行
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：倪苏云
联系电话：021-61618888
客户服务电话：95528
传真：021-63604199
网址：www.spdb.com.cn

（11）上海银行
注册地址：上海市浦东新区银城中路168号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：宁黎明
联系人：张萍
联系电话：021-68475888
开放式基金咨询电话：021-962888
开放式基金业务传真：021-68476111
网址：www.bankofshanghai.com

（12）北京银行
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
客户服务电话：95526
传真：010-66226045
网址：www.bankofbeijing.com.cn

（13）平安银行
注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人：孙建一
联系人：芮蕊
联系电话：0755-25879756
客户服务电话：95511-3
开放式基金业务传真：0755-25879453
网址：bank.pingan.com

（14）中国光大银行
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号金融街F3大厦（中国光大中心）
法定代表人：唐双宁
联系人：薛军丽
联系电话：010-63636150
客户服务电话：95595
传真：010-68560661
网址：www.cebbank.com?

（15）广发银行
注册地址：广东省广州市东风东路713号
办公地址：广东省广州市东风东路713号
法定代表人：董建岳
客户服务电话：400-830-8003
网址：www.gdb.com.cn

（16）东莞银行
注册地址：东莞市运河东一路193号
办公地址：东莞市运河东一路193号
法定代表人：廖玉林
联系人：巫渝峰
联系电话：0769-22100193
客户服务电话：0769-96228
网址：www.dongguanbank.cn

（17）上海农村商业银行
注册地址：中国上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址：上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦16层
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平
联系电话：021-38576977
开放式基金咨询电话：021-962999
开放式基金业务传真：021-50105124
网址：www.srcb.com

（18）杭州银行
注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人：吴太普
联系人：严峻
联系电话：0571-85108195
客户服务电话：400-888-8508、0571-96523
传真：0571-85106576
网址：www.hzbank.com.cn

（19）华夏银行
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
联系人：马旭
开放式基金咨询电话：95577
开放式基金业务传真：010-85238680
网址：www.hxb.com.cn

（20）东莞农村商业银行
注册地址：东莞市城区南城路2号
办公地址：东莞市城区旗峰路2号
法定代表人：何沛良
联系人：黄飞燕
客户服务电话：0769-961122?
网站：www.drcbank.com

（21）广州银行
注册地址：广州市广州大道北195号
办公地址：广州市广州大道北195号
法定代表人：姚建军
客户服务电话：广州：96699；全国：4008996699?
网址：www.gzcb.com.cn

（22）广发证券
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：林治海
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
开放式基金业务传真：020-87555305
网址：www.gf.com.cn

（23）银河证券
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
联系人：田薇
客户服务电话：4008-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

（24）国泰君安证券
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
开放式基金咨询电话：021-38676161
客户服务电话：400-8888-666
传真：021-38670666
网址：www.gtja.com

（25）国信证券
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
联系电话：0755-82130833
客户服务电话：95536
传真：0755-82133952
网址：www.guosen.com.cn

（26）申银万国证券
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：曹晔
联系电话：021-54033888
客户服务电话：95523、4008895523
传真：021-54038844
网址：www.sywg.com

（27）招商证券
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
联系电话：0755-82943666
客户服务电话：95565、400-8888-111
传真：0755-82943636
网址：www.newone.com.cn

（28）中信建投证券
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
开放式基金咨询电话：400-8888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
网址：www.csc108.com

（29）华泰证券
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：程高峰
开放式基金咨询电话：95597
开放式基金业务传真：025-51863323
网址：www.htsc.com.cn

（30）海通证券
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
联系电话：021-23219000
客户服务电话：95553、400-8888-001
传真：021-23219100
网址：www.htsec.com

（31）中信证券
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
联系电话：010-60833722
传真：010-60833739
网址：www.cs.ecitic.com

（32）光大证券
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
联系电话：021-22169999
客户服务电话：400-8888-788、10108998
传真：021-22169134
网址：www.ebscn.com

（33）长江证券
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
联系电话：027-65799999
客户服务电话：95579、4008-888-999
传真：027-85481900
网址：www.95579.com

（34）东方证券
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
联系电话：021-63325888
客户服务电话：95503
传真：021-63326173
网址：www.dfzq.com.cn

（35）中银国际证券
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
开放式基金咨询电话：400-620-8888
开放式基金业务传真：021-50372474
网址：www.bocichina.com.cn

（36）长城证券
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：匡婷
联系电话：0755-83516289
客户服务电话：0755-33680000、400-6666-888
传真：0755-83515567
网址：www.cgws.com

（37）兴业证券
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
联系电话：021-38565785
客户服务电话：400-8888-123
网址：www.xyzq.com.cn

（38）国联证券
注册地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人：雷建辉
联系人：沈刚
客户服务电话：95570
开放式基金业务传真：0510-82830162
网址：www.glsc.com.cn

（39）平安证券
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
客户服务电话：400-881-6168
开放式基金业务传真：0755-82400862
网址：www.pingan.com

（40）湘财证券
注册地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莺
联系电话：021-68634518
开放式基金咨询电话：400-888-1551
开放式基金业务传真：021-68865680
网址：www.xcsc.com

（41）国元证券
注册地址：无锡市县前东街168号国联大厦6层
办公地址：无锡市县前东街168号国联大厦6层
法定代表人：凤良志
联系人：陈琳琳
开放式基金咨询电话：95578
开放式基金业务传真：0551-2272100
网址：www.gyzq.com.cn

（42）国都证券
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
联系电话：010-84183333
客户服务电话：400-818-8118
开放式基金业务传真：010-84183311-3389
网址：www.guodu.com

（43）西部证券
注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：冯萍
联系电话：029-87406488
客户服务电话：029-95582
传真：029-87406387
网址：www.westsecu.com.cn

（44）华安证券
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座
法定代表人：李工
联系人：甘霖
联系电话：0551-5161666
客户服务电话：96518、400-80-96518
开放式基金业务传真：0551-5161672
网址：www.hazq.com

（45）山西证券
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
联系电话：0351-8686659
客户服务电话：95573或400-666-1618
传真：0351-8686619
网址：www.i618.com.cn

（46）东吴证券
注册地址：苏州市工业园区翠园路181号
办公地址：苏州市工业园区翠园路181号
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
联系电话：0512-65581136
客户服务电话：0512-33396288
传真：0512-65588021
网址：www.dwzq.com.cn

（47）中原证券
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号17楼
法定代表人：石保上
联系人：程月艳、耿铭
联系电话：0371-65585670
开放式基金咨询电话：0371-967218、4008139666
开放式基金业务传真：0371-65585665
网址：www.ccnew.com

（48）东北证券
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
联系电话：0431-85096709
客户服务电话：4006-000-686、0431-85096733
网址：www.nesc.cn

（49）财通证券
注册地址：杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人：沈继宁
联系人：乔骏
联系电话：0571-87925129
客户服务电话：0571-96336（上海地区：962336）
网址：www.ctsec.com

（50）安信证券
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
联系电话：0755-82825551
客户服务电话：4008001001
传真：0755-82558355
网址：www.essence.com.cn

（51）万联证券
注册地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人：张建军
联系人：罗创斌
联系电话：020-37865070
客户服务电话：400-8888-133
开放式基金业务传真：020-22373718-1013
网址：www.wlzq.com.cn

（52）南京证券
注册地址：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
联系电话：025-83367888-4201
客户服务电话：400-828-5888
传真：025-83320066
网址：www.njzq.com.cn

（53）中信万通证券
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326
客户服务电话：0532-96577
传真：0532-85022605
网址：www.zxwt.com.cn

（54）财富证券
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
联系人：郭磊
联系电话：0731-84403360、0731-84403319
业务投诉电话：0731-84403350
开放式基金业务传真：0731-84403439
网址：www.cfzq.com

（55）东莞证券
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：张巧玲
联系电话：0769-2211655
开放式基金咨询电话：0769-961130
开放式基金业务传真：0769-22119423
网址：www.dgzq.com.cn

（56）金元证券
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心？17？层
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
联系电话：0755-83025022
客户服务电话：400-8888-228
传真：0755-83025625
网址：www.jyzq.cn

（57）国海证券
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人：张雅锋
联系人：牛孟宇
联系电话：0755-83709350
客户服务电话：95563
传真：0755-83700205
网址：www.ghzq.com.cn

（58）广州证券
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人：刘东
联系人：林洁茹
联系电话：020-87322668
客户服务电话：020-961303
传真：020-87325036
网址：www.gzs.com.cn

（59）第一创业证券
注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
联系人：崔国良
联系电话：0755-25832852
客户服务电话：0755-25832583
网址：www.firstcapital.com.cn

（60）渤海证券
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
联系人：王兆权
联系电话：022-28451861
客户服务电话：400-6515-988
传真：022-28451892
网址：www.bhzq.com

（61）东海证券
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
法定代表人：朱科敏
联系人：李涛
联系电话：0519-88157761
客户服务电话：0519-88166222、021-52574550、0379-64902266
免费服务热线：400-888-8588
传真：0519-88157761
网址：www.longone.com.cn

（62）齐鲁证券
注册地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
联系电话：0531-68889155
客户服务电话：95538
传真：0531-68889752
网址：www.qlzq.com.cn

（63）宏源证券
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
联系电话：010-88085858
客户服务电话：4008-000-562
传真：010-88085195
网址：www.hysec.com

（64）方正证券
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：邵艳霞
联系电话：0731-85832507
客户服务电话：95571
传真：0731-85832214
网址：www.foundersc.com

（65）中投证券
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
联系电话：0755-82023442
客户服务电话：400-600-8008
传真：0755-82026539
网址：www.cjis.cn

（66）中航证券
注册地址：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
联系人：戴蕾
联系电话：0791-6768681
客户服务电话：400-8866-567
传真：0791-6770178
网址：www.avicsec.com

（67）日信证券
注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
联系人：陈韦杉
联系电话：010-88086830-730
客户服务电话：010-88086830
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn

（68）天源证券
注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦6楼
法定代表人：林小明
联系人：王斌
联系电话：0755-33331188-8801
客户服务电话：4006543218
传真：0755-33329815
网址：www.tyzq.com.cn

（69）华宝证券
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
联系人：宋歌
联系电话：021-50122086
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com

（70）民族证券
注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人：赵大建
联系人：李微
客户服务电话：400-889-5618
网址：www.e5618.com

（71）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

（72）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

（73）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

（74）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

（75）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

（76）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

（77）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

（78）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

（79）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

（80）中金公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼27层及28层
法定代表人：李剑阁
联系人：王雪筠
联系电话：010-85679265
网址：www.cicc.com

（二）基金注册登记机构
名称：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：4008818088
传真：020-38799249
联系人：余贤高

（三）律师事务所和经办律师
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人：廖海
联系电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：梁丽金
经办律师：梁丽金、刘佳

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：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：易方达安心回报债券型证券投资基金

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

本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率，主要面向以储蓄存款为主要投资工具的中小投资者，追求基金资产的长期、持续、稳定增值，努力为投资者实现有吸引力的回报，为投资者提供养老投资的工具。

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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、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、股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种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，但须符合中国证监会相关规定。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金各类资产的投资比例范围为：固定收益类品种的比例不低于基金资产的80%；权益类品种的比例不高于基金资产的20%；现金以及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

本基金采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种的战略及战术资产配置，在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上，提高基金的收益水平。

（1）战略资产配置策略

本基金根据大类资产在不同市场环境下表现出的相关关系，对各类资产进行相对稳定的战略配置，以此降低基金的组合风险，控制基金资产净值的波动，追求收益稳定。具体来看，本基金主要通过研究各类资产在较长时期的收益与风险水平特征，及各类资产收益与风险间的相关关系，对国内外宏观经济形势、宏观经济政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，在本基金合同约定范围内设定战略资产配置比例，使本基金具有明确、稳定的风险收益特征。

（2）战术资产配置策略

在战略资产配置策略的框架下，本基金在对各类资产在未来3至6个月的预期收益率与风险进行分析的基础上，定期对各类资产的配置比例进行优化，在严格控制基金下行风险的前提下，提高基金的收益水平。

2、固定收益类品种投资策略

（1）固定收益品种的配置策略

1）类属配置策略

根据类属资产的风险来源不同以及是否含有转股权等特征，本基金将固定收益类品种细分为利率品种、信用品种以及可转换债券三类类属资产。

理论与实践证明，经济增长与通货膨胀均具有周期波动的固有规律，且两者之间具有相关关系。由于价格的“粘性”，通胀周期通常滞后于经济周期。按照经济周期理论，本基金将经济分为衰退、萧条、复苏、繁荣四个阶段，并在各个阶段通过主要投资不同的固定收益类属资产，以获得超越长期平均通胀水平的回报。具体如下：

在经济衰退与萧条阶段，经济下滑，企业盈利能力降低，导致信用利差趋于扩大。本基金将主要投资于中长期的利率品种，在有效规避信用风险的基础上获取较好的回报。

在经济复苏阶段，由于通胀周期滞后的原因，基准利率仍处于较低水平。但此阶段经济增速已开始回升，信用利差较大。本基金将逐步增大组合中信用品种的比重，以获取良好回报。

在经济繁荣阶段，经济已回升了一段时期，通胀压力抬升，经济进入加息周期。本基金通过投资与基准利率挂钩的浮息债来获取较好的回报。此外，本基金还将适当投资受益于经济增长的可转债品种。

同时，本基金通过对信贷水平、证券市场走势以及不同类属资产之间的相关关系等其他因素进行分析，调整各类属资产的投资比例，在收益与风险间寻求配置的最佳平衡点。

2）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、通胀率和汇率等）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，预测未来的利率与通胀水平变化趋势，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，在消除或减轻由通胀因素的负面影响、减少其对债券组合带来的负面冲击的前提上，提高债券组合的总投资收益。

3）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。

（2）利率品种的投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

（3）信用品种的投资策略与信用风险管理

本基金对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用产品的信用风险溢价、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。具体而言：

1）根据宏观经济环境及各行业的发展状况，确定各行业的优先配置顺序；

2）研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、公司背景、盈利状况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息，分析企业的长期运作风险；

3）运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评价，度量发行人财务风险；

4）利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算债券发行人的违约率及违约损失率；

5）综合发行人各方面分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择溢价偏高的品种进行投资。

本基金从以下三个方面来进行信用风险管理：1）进行独立的发行主体信用分析，不断在实践中完善分析方法和积累分析经验数据；2）严格遵守信用类债券的备选库制度，根据不同的信用风险等级，按照不同的投资管理流程和权限管理制度，对入库债券进行定期信用跟踪分析；3）采取分散化投资策略和集中度限制，严格控制组合整体的违约风险水平。

（4）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、债券价值和内嵌期权价值，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，估算可转换债券的内嵌期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

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。

3、权益类品种的投资策略

在权益类品种投资过程中，本基金将控制基金资产净值的波动幅度，特别是下跌风险作为首要因素进行考虑，并严格管理权益类品种的投资比例。

（1）新股申购策略

本基金通过对新股的分析，参考同类公司的估值水平，判断一、二级市场价差的大小，并根据过往新股的中签率及上市后股价涨幅的统计、综合考虑锁定期间的投资风险以及资金成本，制定新股申购策略。

（2）股票二级市场的投资策略

在股票二级市场投资方面，本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。在行业配置方面，除通过对包括产业政策、行业成长性、市场竞争、行业估值等方面进行深入研究以外，本管理人将着重分析未来一段时间的通胀水平的变化特征及其成因，选择受益于该运行特征或者受其负面影响最小的行业进行重点投资。在个股选择方面，本管理人将精选满足以下特征的公司进行谨慎的投资：

1）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；

2）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；

3）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；

4）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，价值被市场低估的企业。

（3）权证的投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于本基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

九、基金的业绩比较基准

三年期银行定期存款收益率（税后）+1.0%

上述“三年期银行定期存款收益率”是指当年1月1日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。《基金合同》生效日所在年度以《基金合同》生效日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”为准。

上述业绩比较基准能反映本基金“力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率”的投资目标和产品定位，符合本基金“在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上，提高基金的收益水平”的追求绝对回报的投资策略，也符合本基金的风险收益特征，并且该基准中“三年银行定期存款收益率”容易被广大投资人理解和接受，因而较为适当。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前2日在至少一种指定媒体上进行公告并报中国证监会备案。

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工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2012年1月16日复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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	75,605,438.30	5.59
	其中：股票	75,605,438.30	5.59
2	固定收益投资	1,135,983,523.78	83.98
	其中：债券	1,135,983,523.78	83.98
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	67,900,221.85	5.02
	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	37,354,650.91	2.76
6	其他各项资产	35,759,742.65	2.64
7	合计	1,352,603,577.49	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	采掘业	-	-
C	制造业	71,790,130.30	6.28
C0	食品、饮料	24,363,137.70	2.13
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	11,254,344.00	0.98
C5	电子	4,147,700.00	0.36
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	32,024,948.60	2.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,760.00	0.00
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,801,548.00	0.33
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
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	75,605,438.30	6.61

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	600887	伊利股份	1,331,319	24,363,137.70	2.13
2	002603	以岭药业	499,762	19,140,884.60	1.67
3	600267	海正药业	390,900	12,884,064.00	1.13
4	002326	永太科技	385,931	9,262,344.00	0.81
5	002528	英飞拓	190,000	4,147,700.00	0.36
6	002410	广联达	110,800	3,801,548.00	0.33
7	000731	四川美丰	300,000	1,992,000.00	0.17
8	002620	瑞和股份	500	13,760.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有以上股票。

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	100,801,079.88	8.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	520,249,000.00	45.50
	其中：政策性金融债	520,249,000.00	45.50
4	企业债券	313,702,433.40	27.44
5	企业短期融资券	189,321,000.00	16.56
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,910,010.50	1.04
8	其他	-	-
9	合计	1,135,983,523.78	99.35

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	110411	11农发11	1,200,000	120,600,000.00	10.55
2	110240	11国开40	1,000,000	99,690,000.00	8.72
3	110308	11进出08	1,000,000	99,590,000.00	8.71
4	110311	11进出11	700,000	70,105,000.00	6.13
5	110314	11进出14	600,000	60,504,000.00	5.29

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）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	375,000.00
2	应收证券清算款	23,938,955.74
3	应收股利	-
4	应收利息	11,285,402.01
5	应收申购款	160,384.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,759,742.65

（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	110078	澄星转债	2,560,310.50	0.22

（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2011年6月21日，基金合同生效以来（截至2011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. 易方达安心回报债券A 类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)
基金合同生效至2011年12月31日	0.70%	0.29%	3.06%	0.02%	-2.36%	0.27%

2. 易方达安心回报债券B 类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)
基金合同生效至2011年12月31日	0.60%	0.28%	3.06%	0.02%	-2.46%	0.26%

十三、费用概览

（一）与基金运作相关的费用

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）从B类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（6）基金份额持有人大会费用；
（7）基金的证券交易费用；
（8）基金的银行汇划费用；
（9）按照国家有关规定和《基金合同》可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.70%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.20%÷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款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（3）销售服务费

本基金A 类基金份额不收取销售服务费，B类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费按前一日B类基金资产净值的0.40%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.40%÷当年天数
H 为B类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为B类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

上述（一）基金费用的种类中其他各项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3.不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）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财产的损失；
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
（3）《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4.基金费用的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

（二）与基金销售相关的费用

1.申购费

（1）申购费率：

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人的直销中心申购本基金A类份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额M(元)	A类基金份额申购费率
M<100万	0.32%
100万≤M<500万	0.16%
500万≤M<1000万	0.04%
M≥1000万	1000元/笔

其他投资者申购本基金A类基金份额的申购费率见下表：

申购金额M(元)	A类基金份额申购费率
M<100万	0.8%
100万≤M<500万	0.4%
500万≤M<1000万	0.1%
M≥1000万	1000元/笔

本基金B类基金份额不收取申购费用。

（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。

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（3）申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
对于1000万元（含）以上的申购，净申购金额=申购金额-绝对数额的申购费金额

申购费用以人民币元为单位，四舍五入，保留至小数点后二位；申购份数采取四舍五入的方法保留小数点后二位，由此产生的误差计入基金财产。

2.赎回费

（1）赎回费率：

本基金A类基金份额赎回费率见下表：

持有期限N(天)	A类基金份额赎回费率
0-29	0.75%
30-364	0.1%
365-729	0.05%
730及以上	0%

本基金B类基金份额赎回费率见下表：

持有期限N(天)	B类基金份额赎回费率
0-29	0.75%
30及以上	0%

（2）赎回费的收取方式和用途

本基金的赎回费由赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期不少于30日的A类份额所收取的赎回费，在扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例为赎回费总额的25%。对于持有期限少于30日的A类/B类基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产。

（3）赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用，其中：

赎回总金额=赎回数量×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回费用、赎回金额的单位为人民币元，计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

3.转换费率

基金转换费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日的本基金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。具体实施办法和转换费率详见相关公告。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（如通过互联网、电话、移动通信等方式）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，基金管理人可以适当调低基金申购、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《易方达安心回报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2011年5月13日刊登的本基金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，根据相关公告和最新资料补充了基金份额发售机构信息，并更新了经办注册会计师信息。
4. 将“六、基金的募集安排”改为“六、基金的募集”，更新了部分内容，概述了基金的募集情况。
5. 更新了“七、基金合同的生效”部分的内容，概述了基金合同生效的情况。
6. 在“八、基金份额的申购、赎回”部分，更新了部分内容。
7. 将“九、基金的转换和定期定额投资计划”改为“九、基金转换”，并根据相关公告的内容进行了更新。
8. 在“十一、基金的投资”部分，更新了“（七）投资决策”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。
9. 增加了“十二、基金的业绩”部分，补充了基金合同生效以来的投资业绩数据，并相应调整其他部分的序号。
10. 在“十六、基金的费用与税收”部分，更新了部分内容。
11. 在“二十三、对基金份额持有人的服务”部分，更新了部分内容。
12. 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补充。

易方达基金管理有限公司
2012年2月3日