易方达策略成长二号混合型证券投资基金

【2012】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：二〇一二年十月二十四日

§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2012年10月19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2012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	3,049,317,206.61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。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-60,729,628.00
2.本期利润	-116,573,171.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0380
4.期末基金资产净值	3,710,115,056.79
5.期末基金份额净值	1.217

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。

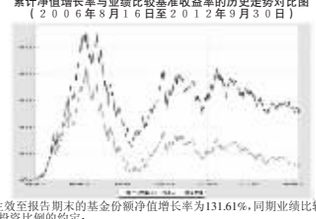
3.2 基金净值表现

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	-3.03%	0.83%	-4.49%	0.76%	1.46%	0.07%

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

易方达策略成长二号混合型证券投资基金
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
（2006年8月16日至2012年9月30日）



注：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131.61%，同期业绩比较基准收益率为28.34% 。

1、基金合同中关于基金投资比例的约定：
(1)持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
(2)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，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)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；
(5)基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；
(6)基金的股票投资比例最高可达基金资产净值的95%；
(7)法律法规和基金合同规定的其他限制。

如法律法规或监管部门取消上述禁止或限制性规定的，本基金可不受上述规定的约束或限制。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，本基金合同将从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十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。

§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、研究部总经理助理	2011-9-30	-	9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，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

2012年三季度上证综指下跌6.26%，指数走势呈现震荡下行的特征。三季度国内各项经济指标显示经济依然低迷，行业利润增速放缓从周期性行业逐渐向非周期性行业扩散，经济活动当中的亮点是先导性行业房地产和汽车的销售出现好转。外围经济当中美国经济平稳复苏、失业率逐步下降，欧洲经济形势改观不明显、失业率再次创新高。

本基金在三季度小幅降低仓位，继续增加大消费行业的配置，降低银行和房地产行业的配置。

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1.217元，本报告期份额净值增长率为-3.03%，同期业绩比较基准收益率为-4.49%。

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2012年四季度，总体的判断是经济在底部缓慢复苏。首先，先导性行业房地产和汽车的销售出现好转，带动相关投资品行业趋势向好。外围经济中美国经济稳健复苏、欧债危机趋缓，有可能带动出口企业订单企稳。其次，房地产价格维持在高位，限制了宏观政策放松的空间。重资产的周期性行业由于面临产能过剩压力，资本开支意愿不强。随着经济增速放缓，消费者的消费意愿也开始下降，在高端白酒的消费中已经有所体现。因此综合判断经济复苏将比较缓慢。

对于二级市场而言，维持估值体系国际化的判断。对于多数中小市值股票，尽管前期跌幅较大，但由于这些股票在发行时就处于盈利和估值的高位，在经济增速回落和股票供给不断加大的背景下，预计这些股票价格的调整将继续，我们将更重视对中大市值当中优秀企业的配置。总体我们将保持较为谨慎的仓位，配置方向依然以大消费行业为主。

§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	2,726,344,269.27	72.92
	其中：股票	2,726,344,269.27	72.92
2	固定收益投资	437,095,918.40	11.69
	其中：债券	437,095,918.40	11.69
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,401,440.60	10.71
	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	155,158,270.99	4.15
6	其他各项资产	19,672,905.71	0.53
7	合计	3,738,672,804.97	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	采掘业	12,385,939.91	0.33
C	制造业	1,917,751,356.24	51.69
C0	食品、饮料	721,736,238.33	19.45
C1	纺织、服装、皮毛	93,657,367.28	2.52
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,121,649.87	2.91
C5	电子	2,623,717.44	0.07
C6	金属、非金属	1,909,800.00	0.05
C7	机械、设备、仪表	538,437,212.77	14.51
C8	医药、生物制品	451,265,370.55	12.16
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,119,310.72	1.32
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	269,606,225.46	7.27
I	金融、保险业	90,170,253.50	2.43
J	房地产业	337,007,600.34	9.08
K	社会服务业	49,156,983.10	1.32
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,146,600.00	0.03
	合计	2,726,344,269.27	73.48

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	13,909,873	297,393,084.74	8.02
2	600887	伊利股份	11,655,924	248,271,181.20	6.69
3	600519	贵州茅台	836,827	205,692,076.60	5.54
4	000002	万 科A	20,388,364	171,873,908.52	4.63
5	600066	宇通客车	5,587,243	121,634,280.11	3.28
6	600340	华夏幸福	6,039,762	107,628,558.84	2.90
7	000538	云南白药	1,579,714	98,258,210.80	2.65
8	000963	华东医药	2,730,882	94,215,429.00	2.54
9	600315	上海家化	1,740,130	81,177,064.50	2.19
10	000028	国药一致	2,259,977	76,613,220.30	2.06

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	136,628,000.00	3.68
3	金融债券	49,840,000.00	1.34
	其中：政策性金融债	49,840,000.00	1.34
4	企业债券	7,605,918.40	0.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	243,022,000.00	6.55
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	437,095,918.40	11.78

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	1182226	11首钢MTN1	1,000,000	103,050,000.00	2.78
2	1101094	11央行票据94	1,000,000	96,700,000.00	2.61
3	120228	12国开28	500,000	49,840,000.00	1.34
4	1282193	12鲁能源MTN1	500,000	49,595,000.00	1.34
5	1282219	12科伦MTN1	500,000	48,705,000.00	1.31

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 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	1,500,000.00
2	应收证券清算款	10,983,914.05
3	应收股利	205,612.43
4	应收利息	6,931,290.85
5	应收申购款	52,088.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,672,905.71

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	3,096,948,402.23
本报告期基金总申购份额	14,409,896.49
减：本报告期基金总赎回份额	62,041,092.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,049,317,206.61

§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策略成长二号混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达策略成长二号混合型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
二〇一二年十月二十四日

易方达策略成长证券投资基金

【2012】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：二〇一二年十月二十四日

§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2012年10月19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2012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	1,264,250,016.91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。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-82,998,298.93
2.本期利润	-121,997,441.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0958
4.期末基金资产净值	3,981,759,739.22
5.期末基金份额净值	3.150

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	-2.95%	0.81%	-4.49%	0.76%	1.54%	0.05%

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2012年9月30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、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379.57%，同期基金业绩比较基准收益率为43.33%。

§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、研究部总经理助理	2011-9-30	-	9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，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

2012年三季度上证综指下跌6.26%，指数走势呈现震荡下行的特征。三季度国内各项经济指标显示经济依然低迷，行业利润增速放缓从周期性行业逐渐向非周期性行业扩散，经济活动当中的亮点是先导性行业房地产和汽车的销售出现好转。外围经济当中美国经济平稳复苏、失业率逐步下降，欧洲经济形势改观不明显、失业率再次创新高。

本基金在三季度小幅降低仓位，继续增加大消费行业的配置，降低银行和房地产行业的配置。

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3.15元，本报告期份额净值增长率为-2.95%，同期业绩比较基准收益率为-4.49%。

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2012年四季度，总体的判断是经济在底部缓慢复苏。首先，先导性行业房地产和汽车的销售出现好转，带动相关投资品行业趋势向好。外围经济中美国经济稳健复苏、欧债危机趋缓，有可能带动出口企业订单企稳。其次，房地产价格维持在高位，限制了宏观政策放松的空间。重资产的周期性行业由于面临产能过剩压力，资本开支意愿不强。随着经济增速放缓，消费者的消费意愿也开始下降，在高端白酒的消费中已经有所体现。因此综合判断经济复苏将比较缓慢。

对于二级市场而言，维持估值体系国际化的判断。对于多数中小市值股票，尽管前期跌幅较大，但由于这些股票在发行时就处于盈利和估值的高位，在经济增速回落和股票供给不断加大的背景下，预计这些股票价格的调整将继续，我们将更重视对中大市值当中优秀企业的配置。总体我们将保持较为谨慎的仓位，配置方向依然以大消费行业为主。

§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	2,876,652,398.62	71.67
	其中：股票	2,876,652,398.62	71.67
2	固定收益投资	542,118,000.00	13.51
	其中：债券	542,118,000.00	13.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	368,261,232.39	9.18
	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	204,016,021.88	5.08
6	其他各项资产	22,605,111.96	0.56
7	合计	4,013,652,764.85	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	采掘业	12,223,073.07	0.31
C	制造业	2,031,757,091.00	51.03
C0	食品、饮料	768,679,011.29	19.31
C1	纺织、服装、皮毛	99,716,126.19	2.50
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	116,921,238.57	2.94
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	565,189,800.54	14.19
C8	医药、生物制品	481,250,914.41	12.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,436,508.58	0.86
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	287,300,871.56	7.22
I	金融、保险业	95,035,546.77	2.39
J	房地产业	363,298,582.34	9.12
K	社会服务业	52,600,725.30	1.32
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,876,652,398.62	72.25

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	14,974,275	320,149,999.50	8.04
2	600887	伊利股份	12,601,196	268,405,474.80	6.74
3	600519	贵州茅台	912,588	224,314,130.40	5.63
4	000002	万 科A	22,310,636	188,078,661.48	4.72
5	600066	宇通客车	5,890,041	128,226,192.57	3.22
6	600340	华夏幸福	6,591,222	117,455,576.04	2.95
7	000538	云南白药	1,727,268	107,436,069.60	2.70
8	000963	华东医药	3,009,970	103,843,965.00	2.61
9	600315	上海家化	1,905,395	88,886,676.75	2.23
10	000028	国药一致	2,452,016	83,123,342.40	2.09

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	107,286,000.00	2.69
3	金融债券	151,230,000.00	3.80
	其中：政策性金融债	151,230,000.00	3.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	283,602,000.00	7.12
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	542,118,000.00	13.62

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	1101094	11央行票据94	800,000	77,360,000.00	1.94
2	1182226	11首钢MTN1	500,000	51,525,000.00	1.29
3	110415	11农发15	500,000	51,350,000.00	1.29
4	1182365	11潍柴集MTN2	500,000	51,075,000.00	1.28
5	120305	12进出05	500,000	50,040,000.00	1.26

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 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	1,632,350.74
2	应收证券清算款	11,800,154.33
3	应收股利	221,805.81
4	应收利息	8,660,196.41
5	应收申购款	290,604.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,605,111.96

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	1,267,331,351.38
本报告期基金总申购份额	33,016,990.39
减：本报告期基金总赎回份额	36,098,324.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,264,250,016.91

§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。
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
二〇一二年十月二十四日

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金

【2012】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：二〇一二年十月二十四日

§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2012年10月19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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达标普消费品指数增强(QDII)
基金主代码	118002
交易代码	118002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月4日
报告期末基金份额总额	61,810,136.71份
投资目标	在严格控制跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以指数化投资为主，并辅以有限度的增强操作。本基金将以标普全球高端消费品指数的成份股构成及权重为基础，并基于量化模型和基本面研究进行投资组合的构建。在投资组合建立后，基金管理人将适时对投资组合进行调整，力争将投资组合对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在8%以内，从而分享高端消费品行业品牌优势，高盈利所具有的长期投资价值，并力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	标普全球高端消费品指数(净收益指数，使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金为指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金，主要风险有汇率风险、国家风险和高端消费品企业特有的风险。
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
境外投资顾问	英文名称：无 中文名称：无
境外资产托管人	英文名称：Bank of China（HongKong）Limited 中文名称：中国银行（香港）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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	849,017.10
2.本期利润	816,522.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0048
4.期末基金资产净值	62,949,412.05
5.期末基金份额净值	1.018

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。

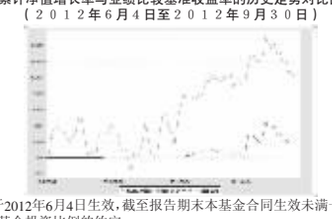
3.2 基金净值表现

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	1.80%	0.45%	7.00%	1.18%	-5.20%	-0.73%

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

易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金
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
（2012年6月4日至2012年9月30日）



注：1.本基金合同于2012年6月4日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.基金合同中关于基金投资比例的约定：
(1)本基金投资于股票及股票存托凭证的资产不低于基金资产净值的90%，其中投资标普全球高端消费品指数成份股及备选成份股的资产不低于股票及股票存托凭证资产的80%；现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%；
(2)基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。本款所称银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行；
(3)基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的10%，但标的指数成份股不受此限；
(4)基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%；
(5)基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量，但标的指数成份股不受此限