

易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十四日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定,于2012年10月19日发布了本基金的财务报告,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在作出投资决策前请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。

本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

基金简称:易方达永旭添利定期开放债券;场内:易基永旭
基金代码:161117
基金运作方式:契约型开放式,本基金合同生效后,每封闭运作两年,集中开放一次申购和赎回
基金合同生效日:2012年6月19日
报告期末基金份额总额:1,685,312,169.47份
投资目标:本基金力争为基金份额持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。

投资策略:本基金在封闭期和开放期采取不同的投资策略,力争为基金份额持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准:本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上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。

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

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 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: 33,002,044.94
2.本期利润: 6,614,037.08
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0039
4.期末基金资产净值: 1,700,392,668.48
5.期末基金份额净值: 1.009

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准率③, 业绩比较基准率标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: 0.40%, 0.13%, 1.16%, 0.01%, -0.76%, 0.12%

3.2.2 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



注:1.本基金合同于2012年6月19日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.基金合同中关于业绩比较基准的约定: (1)债券类资产不低于基金资产的80%。开放期开始前两个月至开放期结束后三个月内不受此比例限制;开放期内,本基金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的55%;

(2)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(3)本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%;

(4)本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%;

(5)本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%;

(6)本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%;

(7)本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%;

(8)本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%;

如法律法规或监管部门取消上述限制条件,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不符合上述约定的比例限制,但基金管理人应在下一个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的,从其规定。

3.3 基金的投资组合报告

3.3.1 基金资产配置情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1.权益投资: 1,368,210
2.固定收益投资: 2,777,093,628.15
3.债券: 2,777,093,628.15
4.资产支持证券: -
5.金融衍生品投资: -
6.买入返售金融资产: 548,421,342.63

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 序号, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1.国家债券: 1,605,680
2.央行票据: 142,129,654.80
3.中期票据: 1,392,000
4.短期融资券: 1,414,406,800.00
5.企业债: 2,666,465,628.15
6.可转债: 10,995,000.00

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五名债券投资明细

Table with 4 columns: 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. 122033 09国债(1): 1,605,680
2. 122030 09国债(2): 1,368,210
3. 122036 09国债(3): 1,392,000
4. 121015 09国债(5): 1,315,007
5. 122815 11国债(1): 1,120,000

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资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1. 存出保证金: 85,345.57
2. 应收证券清算款: -
3. 应收利息: 65,548,333.81
4. 其他应收款: 32,092.80
5. 其他: -
6. 合计: 65,703,272.18

5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1. 存出保证金: 85,345.57
2. 应收证券清算款: -
3. 应收利息: 65,548,333.81
4. 其他应收款: 32,092.80
5. 其他: -
6. 合计: 65,703,272.18

5.6 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资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1. 存出保证金: 85,345.57
2. 应收证券清算款: -
3. 应收利息: 65,548,333.81
4. 其他应收款: 32,092.80
5. 其他: -
6. 合计: 65,703,272.18

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1. 存出保证金: 85,345.57
2. 应收证券清算款: -
3. 应收利息: 65,548,333.81
4. 其他应收款: 32,092.80
5. 其他: -
6. 合计: 65,703,272.18

5.8 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.9 本基金报告期内未持有股指期货。

5.10 本基金报告期内未持有国债期货。

5.11 本基金报告期内未持有期权。

5.12 本基金报告期内未持有权证。

5.13 本基金报告期内未持有其他衍生品。

5.14 本基金报告期内未持有其他资产。

5.15 本基金报告期内未持有其他资产。

5.16 本基金报告期内未持有其他资产。

5.17 本基金报告期内未持有其他资产。

5.18 本基金报告期内未持有其他资产。

5.19 本基金报告期内未持有其他资产。

5.20 本基金报告期内未持有其他资产。

5.21 本基金报告期内未持有其他资产。

5.22 本基金报告期内未持有其他资产。

5.23 本基金报告期内未持有其他资产。

5.24 本基金报告期内未持有其他资产。

5.25 本基金报告期内未持有其他资产。

5.26 本基金报告期内未持有其他资产。

5.27 本基金报告期内未持有其他资产。

5.28 本基金报告期内未持有其他资产。

5.29 本基金报告期内未持有其他资产。

5.30 本基金报告期内未持有其他资产。

5.31 本基金报告期内未持有其他资产。

5.32 本基金报告期内未持有其他资产。

5.33 本基金报告期内未持有其他资产。

5.34 本基金报告期内未持有其他资产。

易方达中小盘股票型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十四日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定,于2012年10月19日发布了本基金的财务报告,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在作出投资决策前请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。

本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

基金简称:易方达中小盘股票
基金代码:110111
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年6月19日
报告期末基金份额总额:1,744,917,519.78份
投资目标:通过投资具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,力求在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。

投资策略:本基金为主动股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,理论上其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金和债券型基金。

业绩比较基准:45%×中证指数收益率+35%×天相中小盘指数收益率+20%×中债国债总指数收益率

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

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 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: -269,672,425.00
2.本期利润: -135,767,104.81
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0775
4.期末基金资产净值: 2,400,206,242.95
5.期末基金份额净值: 1.3755

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准率③, 业绩比较基准率标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -5.29%, 1.05%, -6.01%, 1.06%, 0.72%, -0.01%

3.2.2 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



注:1.基金合同中关于基金投资范围的约定: (1)股票类资产不低于基金资产的80%。

(2)基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(3)本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%;

(4)本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%;

(5)本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%;

(6)本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%;

(7)本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%;

(8)本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%;

如法律法规或监管部门取消上述限制条件,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不符合上述约定的比例限制,但基金管理人应在下一个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的,从其规定。

3.3 基金的投资组合报告

3.3.1 基金资产配置情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1.权益投资: 2,162,100,000.00
2.固定收益投资: 248,106,242.95
3.债券: 248,106,242.95
4.资产支持证券: -
5.金融衍生品投资: -
6.买入返售金融资产: -

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 序号, 行业名称, 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.中期票据: -
4.短期融资券: -
5.企业债: 2,666,465,628.15
6.可转债: -

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五名债券投资明细

Table with 4 columns: 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. 001235 洪博股份: 9,000,000
2. 600340 华夏幸福: 7,925,767
3. 603118 中国平安: 3,312,873
4. 021013 东方国润: 1,687,438
5. 600098 广州发展: 15,000,000

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资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1. 存出保证金: -
2. 应收证券清算款: -
3. 应收利息: 50,040,000.00
4. 其他应收款: 50,040,000.00
5. 其他: -
6. 合计: 100,080,000.00

5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1. 存出保证金: -
2. 应收证券清算款: -
3. 应收利息: 50,040,000.00
4. 其他应收款: 50,040,000.00
5. 其他: -
6. 合计: 100,080,000.00

5.6 报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末未持有股指期货。

5.8 报告期末未持有国债期货。

5.9 报告期末未持有期权。

5.10 报告期末未持有权证。

5.11 报告期末未持有其他衍生品。

5.12 报告期末未持有其他资产。

5.13 报告期末未持有其他资产。

5.14 报告期末未持有其他资产。

5.15 报告期末未持有其他资产。

5.16 报告期末未持有其他资产。

5.17 报告期末未持有其他资产。

5.18 报告期末未持有其他资产。

5.19 报告期末未持有其他资产。

5.20 报告期末未持有其他资产。

5.21 报告期末未持有其他资产。

5.22 报告期末未持有其他资产。

5.23 报告期末未持有其他资产。

5.24 报告期末未持有其他资产。

5.25 报告期末未持有其他资产。

5.26 报告期末未持有其他资产。

5.27 报告期末未持有其他资产。

5.28 报告期末未持有其他资产。

5.29 报告期末未持有其他资产。

5.30 报告期末未持有其他资产。

5.31 报告期末未持有其他资产。

5.32 报告期末未持有其他资产。

5.33 报告期末未持有其他资产。

5.34 报告期末未持有其他资产。

5.35 报告期末未持有其他资产。

5.36 报告期末未持有其他资产。

5.37 报告期末未持有其他资产。

5.38 报告期末未持有其他资产。

5.39 报告期末未持有其他资产。

5.40 报告期末未持有其他资产。

5.41 报告期末未持有其他资产。

5.42 报告期末未持有其他资产。

5.43 报告期末未持有其他资产。

5.44 报告期末未持有其他资产。

5.45 报告期末未持有其他资产。

5.46 报告期末未持有其他资产。

5.47 报告期末未持有其他资产。

5.48 报告期末未持有其他资产。

5.49 报告期末未持有其他资产。

5.50 报告期末未持有其他资产。

5.51 报告期末未持有其他资产。

5.52 报告期末未持有其他资产。

5.53 报告期末未持有其他资产。

5.54 报告期末未持有其他资产。

5.55 报告期末未持有其他资产。

5.56 报告期末未持有其他资产。

5.57 报告期末未持有其他资产。

5.58 报告期末未持有其他资产。

5.59 报告期末未持有其他资产。

5.60 报告期末未持有其他资产。

5.61 报告期末未持有其他资产。

5.62 报告期末未持有其他资产。

5.63 报告期末未持有其他资产。

5.64 报告期末未持有其他资产。

5.65 报告期末未持有其他资产。

5.66 报告期末未持有其他资产。

5.67 报告期末未持有其他资产。

5.68 报告期末未持有其他资产。

5.69 报告期末未持有其他资产。

5.70 报告期末未持有其他资产。

5.71 报告期末未持有其他资产。

5.72 报告期末未持有其他资产。

5.73 报告期末未持有其他资产。

5.74 报告期末未持有其他资产。

5.75 报告期末未持有其他资产。

5.76 报告期末未持有其他资产。

5.77 报告期末未持有其他资产。

5.78 报告期末未持有其他资产。

5.79 报告期末未持有其他资产。

5.80 报告期末未持有其他资产。

5.81 报告期末未持有其他资产。

5.82 报告期末未持有其他资产。

5.83 报告期末未持有其他资产。

5.84 报告期末未持有其他资产。

5.85 报告期末未持有其他资产。

5.86 报告期末未持有其他资产。

5.87 报告期末未持有其他资产。

5.88 报告期末未持有其他资产。

5.89 报告期末未持有其他资产。

5.90 报告期末未持有其他资产。

5.91 报告期末未持有其他资产。

5.92 报告期末未持有其他资产。

5.93 报告期末未持有其他资产。

5.94 报告期末未持有其他资产。

5.95 报告期末未持有其他资产。

5.96 报告期末未持有其他资产。

5.97 报告期末未持有其他资产。