

易方达增强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：中国建设银行股份有限公司

二〇一一年十一月

重要提示

本基金根据 2008 年 2 月 3 日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达增强回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2008]226 号）和 2008 年 2 月 21 日《关于易方达增强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[2008]44 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2008 年 3 月 19 日正式生效。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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本基金合同的当事人，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。

本基金主要投资于固定收益品种并参与新股申购（含增发）和套利性机会投资，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，投资风险，包括利率风险，本基金持有的信用类固定收益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，债券投资和新股申购出现亏损的风险，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实施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。

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》。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书涉及与托管业务相关的更新信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 9 月 19 日，有关财务数据截止日为 2011 年 6 月 30 日，净值表现截

止日为 2011 年 6 月 30 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、26、27、28 楼

成立日期：2001 年 4 月 17 日

法定代表人：叶俊英

联系电话：4008818088

联系人：陈晓梅

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、总裁，易方达基金管理有限公司副董事长、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，高级工商管理硕士，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

股份有限公司总经理，易方达基金管理有限公司董事长。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，高级工商管理硕士，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，高级工商管理硕士，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，工商管理硕士，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。

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、中国证监会广州证管办处长。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、董事长兼总裁，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，公司常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司总裁。

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. 基金经理介绍

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投资经理，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（自 2011 年 6 月 21 日起）。

王晓晨女士，1980 年生，经济学学士。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。现任易方达基金管理有限公司易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理（自 2011 年 8 月 15 日起）。

3. 投资决策委员会成员

投资决策委员会成员包括：总裁刘晓艳女士、专户首席投资官肖坚先生、基金首席投资官陈志民先生、总裁助理兼任固定收益投资总监马骏先生以及指数与量化投资部总经理刘震先生。

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、总裁助理兼专户投资总监、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、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总裁助理、固定收益投资总监。

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

本基金之基金托管人为中国建设银行股份有限公司，基本情况如下：

住所：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：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

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：北京市金融大街 19 号富凯大厦 B1007 室

电话：010-66574378

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：郭树清

联系人：王嘉朔

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(2) 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

(3) 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

(4) 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

(5) 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

(6) 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：孔丹

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

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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：蔡宇洲

联系电话：0755-22197874

客户服务电话：40066-99999

开放式基金业务传真：0755-25879453

网址：bank.pingan.com

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 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

(17) 江苏银行

注册地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

联系人：田春慧、法晓宁

联系电话：025-58587018、025-58587036

客户服务电话：96098、40086-96098

传真：025-58587038

网址：www.jsbchina.cn

(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

联系电话：010-85238425

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

（22） 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

（23） 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

（24） 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

(25) 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

(26) 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

(27) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 华泰联合证券

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、
18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、
25 层、26 层

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

联系电话：0755-82492000

开放式基金咨询电话：95513

开放式基金业务传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.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：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

开放式基金咨询电话：400-888-5288、0510-82588168

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) 世纪证券

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 楼

法定代表人：卢长才

联系人：王佳佳

联系电话：0755-83199599 转 8172

开放式基金咨询电话：0755-83199511

开放式基金业务传真：0755-83199545

网址：www.cscoc.com.cn

(44) 西部证券

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 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

(45) 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

(46) 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

(47) 东吴证券

注册地址: 苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址: 苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

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

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 中信金通证券

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

联系电话：0571-87112510

客户服务电话：96598

传真：0571-85106383

网址：www.bigsun.com.cn

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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

(59) 国海证券

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 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：武斌

联系电话：0755-83707413

客户服务电话：95563

传真：0755-83700205

网址：www.ghzq.com.cn

(60) 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：吴志明

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

(61) 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

(62) 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：天津市南开区滨水西道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

(63) 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

(64) 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

(65) 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

(66) 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

(67) 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 层至 21 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层

法定代表人：杨明辉

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

(68) 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

(69) 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

(70) 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

(71) 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

(72) 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

(73) 西南证券

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：王珠林

联系人：陈诚

联系电话：023-63786464

客户服务电话：4008096096

传真：023-63786311

网址：www.swsc.com.cn

(74) 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

(75) 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

(76) 红塔证券

注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

网址：www.hongtastock.com

(77) 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：张志刚

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

(78) 东兴证券

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

客户服务电话：400-8888-993

传真：010-66555246

网址：www.dxzq.net.cn

(79) 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

(80) 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

(81) 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

(82) 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

(83) 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

（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、26、27、28 楼

法定代表人：叶俊英

电话：400 881 8088

传真：020-38799249

联系人：余贤高

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所：北京市天元律师事务所

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 11 层

负责人：王立华

电话：010-88092188

传真：010-88092150

经办律师：朱小辉、陈华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：金毅

经办会计师：薛竞、金毅

四、 基金的名称

本基金名称：易方达增强回报债券型证券投资基金

五、 基金的类型

本基金类型：契约型开放式债券型基金

六、 基金的投资目标

通过主要投资于债券品种，力争为基金持有人创造较高的当期收益和总回报，实现基金资产的长期稳健增值。

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，包括债券回购、央行票据、国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、股票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。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。

本基金各类资产的投资比例范围为：债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中，公司债、企业债、短期融资券、金融债等信用类固定收益品种不低于固定收益资产总值的50%，可转换债券不高于基金资产净值的30%，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%；股票等权益类品种不高于基金资产的20%；基金保留的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%。

此处信用类固定收益品种是指除了国债和央行票据等并非由国家信用担保的固定收益证券品种。

八、 基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种（含可转换债券）、新股（含增发）申购之间的配置：1）基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2）对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；3）基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析，预测新股申购的收益率以及风险；4）套利性投资机会的投资期间及预期收益率；5）股票市场走势的预测；6）可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。

2. 固定收益品种投资策略

（1）固定收益品种的配置策略

a. 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、价格指数和汇率等）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，提高债券组合的总投资收益。

b. 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。

c. 类属配置

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

(2) 固定收益品种的选择

在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上，本基金对影响个别债券定价的主要因素，包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

1) 非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）的选择

本基金对国债、央行票据等非信用类固定收益品种的投资，主要根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种。

2) 信用类固定收益品种（除可转换债券）的选择

本基金投资信用状况良好的信用类债券。通过对宏观经济和企业财务状况进行分析，对固定收益品种的信用风险进行度量及定价，利用市场对信用利差定价的相对失衡，对溢价率较高的品种进行投资。

本基金对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用类债券采取自上而下的投资策略。

- a) 根据宏观经济环境及各行业的发展状况，决定各行业的配置比例；
- b) 充分分析债券发行人的产业趋势、监管环境、公司背景、盈利情况、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；
- c) 运用财务评分模型对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流

平等方面进行综合评分，度量发行人财务风险；

- d) 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；
- e) 综合发行人各方面分析结果，采用数量化模型，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。

3) 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、债券价值和转换期权价值，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。

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、派息频率及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，估算可转换债券的转换期权价值。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。为控制基金的波动性和流动性风险，本基金投资可转换债券的资产不超过基金资产净值的 30%。

4) 资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。本基金投资资产支持证券的比例不高于基金资产净值的 20%。

(3) 信用类固定收益品种的风险管理

针对发行主体的信用风险，我们通过以下三个方面来进行信用风险的管理：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。

3. 股票及权证等权益类品种的投资策略

本基金股票部分除新股申购（含增发）和套利性机会外，不直接从二级市场买入股票。本基金通过对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力、利润成长性等

因素的分析，参考同类公司的估值水平，进行股票的价值评估，从而判断一、二级市场价差的大小，并根据资金成本、新股的中签率及上市后股价涨幅的统计、股票锁定期间投资风险判断，制定新股申购策略。

在新发股票获准上市后以及可转换债券转股后，本基金管理人将根据对股票内在投资价值的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

本基金所指套利性机会指的是，在确定的期限内，预期股票投资可获得固定的收益率，例如要约收购类过程中存在的投资机会。本基金将在严格测算交易成本、投资收益率的基础上，参与股票的套利。

本基金不主动进行权证的投资。对分离交易的可转换公司债券，在认股权证上市后，本基金将根据权证估值模型的分析结果，在权证价值被高估时，选择适当的时机卖出。

九、 基金的业绩比较基准

中债总指数（全价）

中债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、权威性，并得到投资者的广泛认同，适合作为本基金的业绩比较基准。

将来如有更合适的指数推出，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，属证券投资基金中的低风险品种，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、 基金的投资组合报告(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建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2011 年 10 月 17 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 4 月 1 日至 2011 年 6 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	350,644,974.59	7.26
	其中：股票	350,644,974.59	7.26
2	固定收益投资	4,188,726,946.96	86.70
	其中：债券	4,188,726,946.96	86.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	99,000,268.50	2.05
	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	75,022,723.95	1.55
6	其他各项资产	118,117,875.97	2.44
7	合计	4,831,512,789.97	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	24,640,000.00	0.61
B	采掘业	-	-
C	制造业	198,999,254.00	4.95
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	23,136,000.00	0.58
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,242,055.96	0.63
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	52,061,301.45	1.29
C7	机械、设备、仪表	61,219,896.59	1.52
C8	医药、生物制品	37,340,000.00	0.93
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	89,685,968.01	2.23
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	30,370,590.94	0.75
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	6,949,161.64	0.17
M	综合类	-	-
	合计	350,644,974.59	8.72

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	601880	大连港	22,820,857	89,685,968.01	2.23
2	002233	塔牌集团	3,078,500	40,728,555.00	1.01
3	600267	海正药业	1,000,000	37,340,000.00	0.93
4	002564	张化机	1,536,000	30,812,160.00	0.77
5	002563	森马服饰	630,226	30,370,590.94	0.75
6	601118	海南橡胶	2,000,000	24,640,000.00	0.61
7	002572	宁基股份	300,000	23,136,000.00	0.58
8	300198	纳川股份	750,000	20,707,500.00	0.51
9	300185	通裕重工	900,000	15,759,000.00	0.39
10	300217	东方电热	460,000	13,330,800.00	0.33

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	155,418,577.50	3.86
2	央行票据	691,880,000.00	17.20
3	金融债券	803,368,000.00	19.97
	其中：政策性金融债	803,368,000.00	19.97
4	企业债券	1,344,677,279.15	33.42
5	企业短期融资券	529,328,000.00	13.16
6	中期票据	-	-

7	可转债	664,055,090.31	16.51
8	其他	-	-
9	合计	4,188,726,946.96	104.11

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	1101032	11央行票据32	5,000,000	497,450,000.00	12.36
2	113001	中行转债	1,860,030	196,381,967.40	4.88
3	110225	11国开25	1,900,000	188,461,000.00	4.68
4	110013	国投转债	1,410,000	168,255,300.00	4.18
5	110016	川投转债	1,221,150	140,078,116.50	3.48

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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	47,877,490.98
3	应收股利	-
4	应收利息	38,836,451.24
5	应收申购款	30,653,933.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,117,875.97

(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	113001	中行转债	196,381,967.40	4.88
2	113002	工行转债	28,717,128.00	0.71
3	110011	歌华转债	22,800,238.20	0.57
4	125731	美丰转债	7,464,770.21	0.19

(5) 报告期末前十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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002572	宁基股份	23,136,000.00	0.58	新股流通受限
2	300198	纳川股份	20,707,500.00	0.51	新股流通受限
3	300217	东方电热	13,330,800.00	0.33	新股流通受限

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，投资者在做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2008年3月19日，基金合同生效以来截至2011年6月30日的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1. 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)
自基金合同生效日至2008年12月31日	10.40%	0.18%	8.85%	0.23%	1.55%	-0.05%
2009年1月1日至2009年12月31日	7.36%	0.36%	-4.44%	0.11%	11.80%	0.25%
2010年1月1日至2010年12月31日	12.35%	0.30%	-0.87%	0.10%	13.22%	0.20%

2011年1月1日至2011年6月30日	0.62%	0.19%	-0.43%	0.08%	1.05%	0.11%
自基金合同生效日至2011年6月30日	33.99%	0.28%	2.66%	0.15%	31.33%	0.13%

2. 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)
自基金合同生效日至2008年12月31日	9.90%	0.18%	8.85%	0.23%	1.05%	-0.05%
2009年1月1日至2009年12月31日	7.02%	0.36%	-4.44%	0.11%	11.46%	0.25%
2010年1月1日至2010年12月31日	11.87%	0.31%	-0.87%	0.10%	12.74%	0.21%
2011年1月1日至2011年6月30日	0.44%	0.18%	-0.43%	0.08%	0.87%	0.10%
自基金合同生效日至2011年6月30日	32.15%	0.28%	2.66%	0.15%	29.49%	0.13%

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) 销售服务费；
- 4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5) 基金份额持有人大会费用；
- 6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7) 基金的证券交易费用；

- 8) 基金财产划拨支付的银行费用;
- 9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

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

在通常情况下, 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.65% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.65\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 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支付给基金管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下, 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 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支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

(3) 基金的销售服务费

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 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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

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销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出,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。

(4) 除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

3. 不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

4. 基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(二) 与基金销售有关的费用

1. 基金申购费率

本基金 A 类基金份额的申购费率为:

申购金额 M (元) (含申购费)	申购费率
M < 100 万	0.8%
100 万 ≤ M < 500 万	0.4%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.1%
1000 万 ≤ M	每笔 1000 元

本基金 B 类基金份额不收取申购费。

本基金的申购费由申购人承担,不计入基金财产。

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。

2. 基金赎回费率

本基金 A 类基金份额的最高赎回费率不超过 5%,赎回费率为:

持有年限 Y	赎回费率
Y<1 年	0.1%
1 年≤Y<2 年	0.05%
2 年≤Y	0%

注：就赎回费的计算而言，1 年指 365 天，2 年为 730 天，以此类推。

本基金 B 类基金份额不收取赎回费。

本基金的赎回费由赎回人承担，赎回费的 25% 归入基金财产，余额为注册登记费和其他手续费。

3. 基金转换费率

本基金目前已开通与易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达 50 指数基金、易方达积极成长基金、易方达策略成长二号混合型基金、易方达价值精选股票型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达科讯股票型基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深 300 指数基金、易方达深证 100ETF 联接基金、易方达上证中盘 ETF 联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达医疗保健行业股票型基金、易方达安心回报债券型基金和易方达资源行业股票型基金之间的转换业务，具体实施办法和转换费率参见相关公告。基金转换费由基金份额持有人承担，由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归入基金财产（对于持有期限少于 30 日的易方达安心回报债券型基金 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，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 2 日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（如网上交易、电话交易等）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，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购、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《易方达增强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 6 日刊登的本基金更新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、主要人员情况部分的内容。
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，根据相关公告的内容，增加了 4 个代销机构：上海农村商业银行、华夏银行、东莞农村商业银行和江海证券；根据最新资料更新了基金份额发售机构信息、基金注册登记机构信息。
4. 在“九、基金转换”部分，更新了部分表述，并相应更新了“十七、基金的费用与税收”的部分表述。
5. 在“十二、基金的投资”部分，补充了本基金 2011 年第 2 季度投资组合报告的内容。
6. 在“十三、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。
7. 在“二十四、对基金份额持有人的服务”部分，更新了部分内容。
8. 在“二十五、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司

2011 年 11 月 9 日