

易方达平稳增长证券投资基金

2012 年半年度报告摘要

2012 年 6 月 30 日

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

送出日期：二〇一二年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达平稳增长混合
基金主代码	110001
交易代码	110001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年8月23日
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
报告期末基金份额总额	1,736,772,308.40份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求资本在低风险水平下的平稳增长
投资策略	本基金通过在股票和债券之间相对平衡的资产配置实现降低风险、稳定收益的目标。正常情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票资产30%—65%；债券资产30%—65%；现金资产不低于5%。其中，投资于具有持续发展能力的上市公司的资产比例不低于本基金股票投资总资产的80%。
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低风险品种。正常情况下，本基金将控制基金资产净值波动的标准差 σ_P 不超过上证A股指数波动的标准差 σ_M 的65%（置信度为90%）；在此前提下，通过合理配置股票和债券资产比重，并将股票投资集中于具有持续发展能力的上市公司，努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证A股指数涨幅的60%，股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的50%。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	易方达基金管理有限公司		中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	唐州徽
	联系电话	020-38797888	010-66594855
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话	400 881 8088		95566
传真	020-38799488		010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市体育西路 189 号城建大厦 28 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-39,086,391.31
本期利润	37,978,800.82
加权平均基金份额本期利润	0.0213
本期基金份额净值增长率	1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	0.1942
期末基金资产净值	2,074,102,643.02
期末基金份额净值	1.194

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个	-4.40%	0.67%	-6.21%	0.97%	1.81%	-0.30%

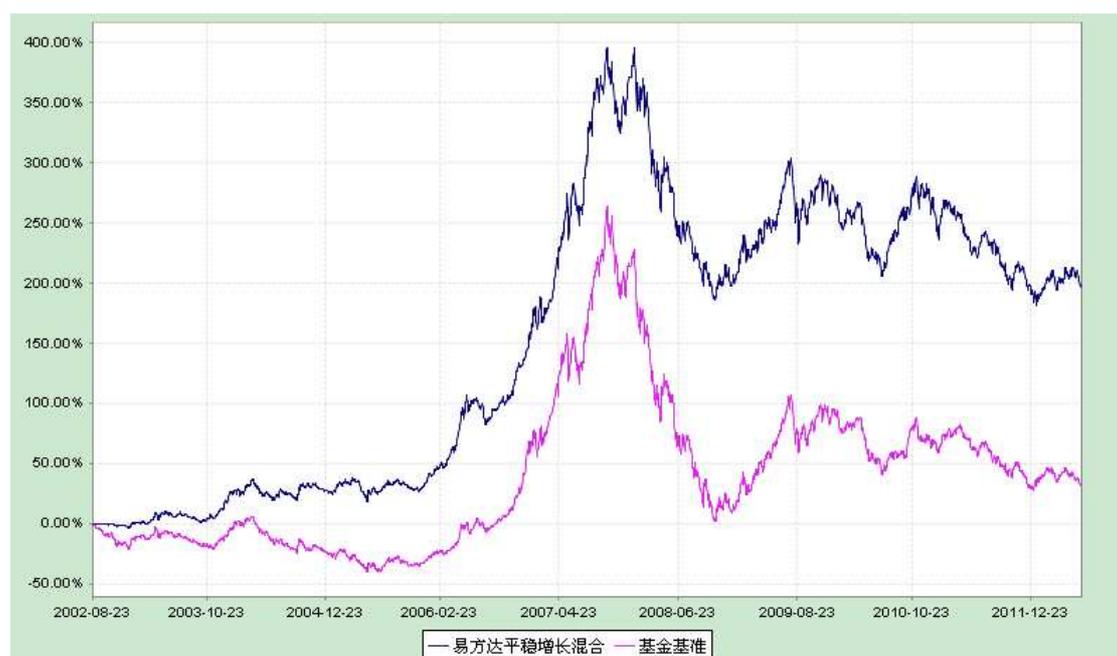
月						
过去三个月	1.53%	0.75%	-1.67%	0.96%	3.20%	-0.21%
过去六个月	1.62%	0.87%	1.14%	1.13%	0.48%	-0.26%
过去一年	-10.70%	0.81%	-19.46%	1.18%	8.76%	-0.37%
过去三年	-18.34%	0.99%	-24.98%	1.41%	6.64%	-0.42%
自基金合同生效起至今	198.53%	1.07%	32.42%	1.69%	166.11%	-0.62%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

易方达平稳增长证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2002年8月23日至2012年6月30日)



注：1. 基金合同中关于基金投资比例的约定：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，不超过本基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与由本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、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；
- (4) 投资于股票和债券资产的比例均不低于基金资产净值的 30%；
- (5) 法律法规规定的其它比例限制。

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. 本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为 198.53%，同期业绩比较基准收益率为 32.42%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 1.2 亿元。截至 2012 年 6 月 30 日，公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务资格。

自成立以来，易方达基金管理有限公司秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健的增长”的经营理念，努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务，为投资者创造最佳的回报。

截至 2012 年 6 月 30 日，易方达基金管理有限公司共管理 1 只封闭式基金、33 只开放式基金。封闭式基金有科瑞证券投资基金；开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达 50 指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深 300 指数证券投资基金、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定

期开放债券型证券投资基金。同时，公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯清濯	本基金的基金经理	2007-07-12	-	11年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、易方达科讯股票型基金（原科讯证券投资基金）的基金经理、基金投资部总经理助理。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则完善了相关分配机制。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，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成

交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 6 次，均为 ETF 基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国际上欧债危机牵动着所有海外市场投资者的心。一季度，欧美各主要市场指数在希腊债务问题出现转机后一度反弹。二季度继希腊之后，西班牙债务问题恶化，而欧盟迟迟未提出有效解决欧洲债务问题的方案，令投资者对债务问题的担忧进一步加剧。海外市场从五月开始调整，期间美国等主要经济体公布的利好数据也未能扭转市场整体下跌的趋势。在六月最后一个交易日，欧盟推出了救市计划，提振了投资者信心，海外市场开始反弹。

国内经济下行压力影响投资者信心。新年伊始，A 股投资者在通胀放缓和信贷放松的预期下，心态逐步转向积极，市场氛围也趋于活跃。上证指数连续两月上漲，一度创出年内新高 2478 点。在指数上涨阶段，周期类板块受到追捧，消费板块承受较大抛压。三月中旬开始，受到上市公司年报和季报业绩增长放缓的影响，投资者逐步趋于谨慎，指数回调，各板块都出现不同程度的调整。从三月开始，CPI 数据呈逐月环比下降趋势，令 A 股投资者在降低了对通胀担忧的同时，进一步增强了对国家放松宏观调控的预期。在乐观预期的推动下，上证综指四月份反弹了 5.9%。但之后陆续公布的 PMI 等经济数据普遍低于预期，且一直令投资者翘首企盼的信贷数据大幅增长情况也未出现，投资者的失落感终于在六月份转化为抛售股票的冲动。二季度末资金面骤紧，对六月下旬的市场快速下跌起到了推波助澜的作用。

报告期内，本基金维持了较高的白酒、乳业、植物蛋白饮料等品牌消费股票的配置比例，通过对优秀制造业和稀土等资源类股票的配置提高组合整体弹性，力争构建持续成长和阶段性高弹性相结合的股票组合。在上涨过程中基金业绩表现较好，但由于对市场的快速回调没有做好事先准备，基金净值在六月损失较大。

在债券配置方面，报告期内本基金采取相对稳健的投资策略，以配置利率产品和高等级的信用债为主，保持组合较高的流动性。

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 1.194 元，本报告期份额净值增长率为 1.62%，同期

业绩比较基准收益率为 1.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在六月最后一个交易日，欧洲推出的救市计划令海外投资者兴奋不已，但就此断言欧洲从此走出危机还为时尚早。单靠欧盟内部的救助只能延迟危机发生的时间，只有等欧洲各国找到发展经济的道路，走出衰退的泥潭，债务问题才可能从根本上得到解决。美、日等主要经济体也需要在全球大格局变化后寻找新的经济增长路径。

在出口和投资拉动的经济发展模式下，我国经济未来发展空间已经非常有限，经济发展模式转换势在必行。庞大人口基数下的消费升级为我国经济增长还预留了巨大的空间。如何通过货币政策和财政政策及时、正确、有效地引导我国经济尽快找到新的发展模式，是我国新一届政府面临的巨大挑战。

在转型过程中，投资者往往难以清晰的把握经济发展的方向。出口和投资相关板块已经难以持续吸引 A 股投资者，A 股市场中资金有可能向消费等收益确定性强的板块进一步集中，强者恒强的局面仍有可能延续。相比超跌反弹的时点，当前本基金更关注经济发展的方向。本基金未来股票结构调整的重点在于股票收益的确定性和整个组合的流动性，继续持有品牌消费品和传统中药等未来趋势明确的品种，同时，密切关注环保、消费电子等有可能在国家政策引导下快速增长的板块。

债券方面，本基金预期央行总体上仍将保持资金面的适度宽松，未来随着资金面的缓解，短期债市可能会继续走强。基于目前国内政策已经出现放松的迹象和实际的动作，未来随着货币信贷环比的恢复，经济环比也将有所改善，同时欧债危机出现积极的信号，本基金将择机降低组合久期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，

熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对易方达平稳增长证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达平稳增长证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	862,165.24	142,840,327.45
结算备付金	4,996,260.80	2,252,170.67
存出保证金	1,206,033.20	2,194,002.59
交易性金融资产	2,058,471,797.77	2,103,806,597.30
其中：股票投资	1,167,495,643.27	1,122,573,381.23
基金投资	-	-
债券投资	890,976,154.50	981,233,216.07
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	194,500,611.75	-
应收证券清算款	246,546,334.55	1,557,236.31
应收利息	18,368,612.65	9,361,747.40
应收股利	-	-
应收申购款	303,652.69	1,222,010.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,525,255,468.65	2,263,234,092.23
负债和所有者权益	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	440,298,857.05	-
应付证券清算款	1,250,820.92	93,722,816.75
应付赎回款	2,045,686.71	709,941.08
应付管理人报酬	2,615,444.16	2,819,289.74
应付托管费	435,907.33	469,881.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,434,597.80	1,355,601.14

应交税费	620,382.99	620,382.99
应付利息	251,736.37	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,199,392.30	1,430,615.38
负债合计	451,152,825.63	101,128,528.72
所有者权益：		
实收基金	1,736,772,308.40	1,840,436,237.77
未分配利润	337,330,334.62	321,669,325.74
所有者权益合计	2,074,102,643.02	2,162,105,563.51
负债和所有者权益总计	2,525,255,468.65	2,263,234,092.23

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.194 元，基金份额总额 1,736,772,308.40 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达平稳增长证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入	65,233,397.77	-226,254,259.62
1.利息收入	12,082,839.93	15,433,030.68
其中：存款利息收入	365,659.00	561,658.38
债券利息收入	11,342,321.77	14,729,620.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	374,859.16	141,751.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-23,971,990.77	-57,369,101.78
其中：股票投资收益	-32,776,043.98	-48,389,111.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,168,918.75	-19,918,422.73
资产支持证券投资收 益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,972,971.96	10,938,432.70
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	77,065,192.13	-184,373,276.13
4.汇兑收益（损失以“-”号	-	-

填列)		
5.其他收入(损失以“-”号填列)	57,356.48	55,087.61
减: 二、费用	27,254,596.95	37,955,686.56
1. 管理人报酬	16,005,879.20	20,333,313.96
2. 托管费	2,667,646.53	3,388,885.60
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,707,179.92	12,668,066.66
5. 利息支出	641,323.13	1,318,785.45
其中: 卖出回购金融资产支出	641,323.13	1,318,785.45
6. 其他费用	232,568.17	246,634.89
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	37,978,800.82	-264,209,946.18
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	37,978,800.82	-264,209,946.18

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 易方达平稳增长证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,840,436,237.77	321,669,325.74	2,162,105,563.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,978,800.82	37,978,800.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-103,663,929.37	-22,317,791.94	-125,981,721.31
其中: 1. 基金申购款	29,332,204.00	5,925,359.72	35,257,563.72
2. 基金赎回款	-132,996,133.37	-28,243,151.66	-161,239,285.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,736,772,308.40	337,330,334.62	2,074,102,643.02

项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,027,767,808.58	958,646,375.12	2,986,414,183.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-264,209,946.18	-264,209,946.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-132,905,533.29	-56,410,172.33	-189,315,705.62
其中：1. 基金申购款	35,717,112.31	14,212,174.39	49,929,286.70
2. 基金赎回款	-168,622,645.60	-70,622,346.72	-239,244,992.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,894,862,275.29	638,026,256.61	2,532,888,531.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：叶俊英，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达平稳增长证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]40 号文《关于同意易方达平稳增长证券投资基金募集的批复》的核准,由易方达基金管理有限公司作为基金发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2002 年 8 月 23 日正式生效,首次设立募集规模为 4,678,106,974.62 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,注册登记机构为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释(统称“企业会计准则”)以及其他相关规定,中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一

步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股

份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	691,348,963.13	13.67%	1,823,790,363.41	22.36%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	55,317,680.10	8.55%	167,801,796.30	22.37%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	587,645.44	13.79%	130,788.30	5.39%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,550,219.19	22.75%	191,961.55	8.52%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,005,879.20	20,333,313.96
其中：支付销售机构的客户	409,626.65	507,244.86

维护费		
-----	--	--

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,667,646.53	3,388,885.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	50,664,244.57	-	-	450,000,000.00	309,581.30
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	153,237,808.99	-	-	180,860,000.00	89,612.97

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	862,165.24	327,738.60	115,557,231.68	503,866.18

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600780	通宝能源	2012-01-18	重大事项	7.13	-	-	1,500,000	12,441,632.40	10,695,000.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 415,298,857.05 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值 总额
090217	09国开17	2012-07-03	100.05	400,000	40,020,000.00
110020	11付息国债20	2012-07-04	100.37	300,000	30,111,000.00
110414	11农发14	2012-07-04	100.18	1,500,000	150,270,000.00

1001060	10央行票据60	2012-07-05	100.00	1,100,000	110,000,000.00
1101088	11央行票据88	2012-07-05	96.91	900,000	87,219,000.00
合计		-	-	4,200,000	417,620,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 25,000,000.00 元,于 2012 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,295,002,797.77 元,第二层级的余额为 763,469,000.00 元,无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级的余额为 1,397,476,597.30 元,第二层级的余额为 706,330,000.00 元,无属于第三层级的余额)。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,167,495,643.27	46.23
	其中：股票	1,167,495,643.27	46.23
2	固定收益投资	890,976,154.50	35.28
	其中：债券	890,976,154.50	35.28
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	194,500,611.75	7.70
	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	5,858,426.04	0.23
6	其他各项资产	266,424,633.09	10.55
7	合计	2,525,255,468.65	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	868,024,388.19	41.85
C0	食品、饮料	496,223,319.76	23.92
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	38,200,000.00	1.84
C6	金属、非金属	6,586,500.00	0.32
C7	机械、设备、仪表	212,118,637.73	10.23
C8	医药、生物制品	114,895,930.70	5.54
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,355,000.00	0.55
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	11,510,728.74	0.55
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	238,512,530.02	11.50
K	社会服务业	13,740,000.00	0.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	24,352,996.32	1.17
	合计	1,167,495,643.27	56.29

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	700,018	167,409,304.70	8.07
2	600597	光明乳业	9,000,004	83,880,037.28	4.04
3	000729	燕京啤酒	9,000,000	65,700,000.00	3.17
4	601100	恒立油缸	5,699,602	62,695,622.00	3.02
5	600048	保利地产	4,999,795	56,697,675.30	2.73
6	000848	承德露露	3,200,000	56,160,000.00	2.71
7	600887	伊利股份	2,699,908	55,564,106.64	2.68
8	600085	同仁堂	3,000,379	52,356,613.55	2.52
9	600383	金地集团	7,999,947	51,839,656.56	2.50
10	000157	中联重科	4,999,827	50,148,264.81	2.42

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	172,248,109.28	7.97
2	000895	双汇发展	121,363,510.01	5.61
3	000157	中联重科	98,858,366.74	4.57
4	601318	中国平安	96,666,585.02	4.47
5	600030	中信证券	85,665,582.60	3.96

6	000729	燕京啤酒	84,902,839.68	3.93
7	601166	兴业银行	84,618,372.69	3.91
8	600111	包钢稀土	67,983,313.15	3.14
9	601100	恒立油缸	65,782,798.05	3.04
10	600887	伊利股份	63,248,679.30	2.93
11	600549	厦门钨业	59,546,963.64	2.75
12	600048	保利地产	58,355,777.06	2.70
13	000983	西山煤电	54,299,810.82	2.51
14	600104	上汽集团	52,074,737.67	2.41
15	600837	海通证券	50,687,276.33	2.34
16	600383	金地集团	49,348,132.28	2.28
17	600000	浦发银行	49,132,625.90	2.27
18	600366	宁波韵升	49,038,979.42	2.27
19	601939	建设银行	44,951,714.40	2.08
20	600085	同仁堂	44,836,849.05	2.07
21	000002	万科A	43,369,459.12	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600887	伊利股份	133,899,276.08	6.19
2	000568	泸州老窖	131,989,540.16	6.10
3	600600	青岛啤酒	121,862,497.42	5.64
4	601318	中国平安	103,450,650.13	4.78
5	600111	包钢稀土	93,608,790.46	4.33
6	600030	中信证券	85,744,123.82	3.97
7	601166	兴业银行	84,264,285.97	3.90
8	601699	潞安环能	73,048,735.39	3.38
9	000895	双汇发展	72,897,351.77	3.37
10	600549	厦门钨业	57,406,103.21	2.66
11	600406	国电南瑞	54,305,547.51	2.51
12	002293	罗莱家纺	54,104,532.01	2.50
13	600104	上汽集团	53,203,263.67	2.46
14	000983	西山煤电	50,052,981.72	2.32
15	600000	浦发银行	49,878,377.20	2.31
16	600837	海通证券	49,132,587.06	2.27
17	000869	张裕A	47,445,229.69	2.19
18	000157	中联重科	45,497,230.05	2.10
19	601336	新华保险	45,145,792.15	2.09

20	601939	建设银行	44,204,974.80	2.04
----	--------	------	---------------	------

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,534,350,923.65
卖出股票收入（成交）总额	2,526,554,466.95

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	60,222,000.00	2.90
2	央行票据	371,713,000.00	17.92
3	金融债券	220,305,000.00	10.62
	其中：政策性金融债	220,305,000.00	10.62
4	企业债券	62,627,061.20	3.02
5	企业短期融资券	100,534,000.00	4.85
6	中期票据	-	-
7	可转债	75,575,093.30	3.64
8	其他	-	-
9	合计	890,976,154.50	42.96

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101088	11 央行票据 88	1,900,000	184,129,000.00	8.88
2	110414	11 农发 14	1,500,000	150,270,000.00	7.25
3	1001060	10 央行票据 60	1,100,000	110,000,000.00	5.30
4	1101096	11 央行票据 96	800,000	77,584,000.00	3.74
5	090217	09 国开 17	700,000	70,035,000.00	3.38

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,206,033.20
2	应收证券清算款	246,546,334.55
3	应收股利	-
4	应收利息	18,368,612.65
5	应收申购款	303,652.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	266,424,633.09

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	59,428,977.30	2.87
2	126729	燕京转债	8,954,000.00	0.43

7.9.5 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的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比	持有份额	占总份额

			例		比例
98,114	17,701.57	41,665,357.07	2.40%	1,695,106,951.33	97.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	5,373.03	0.0003%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002 年 8 月 23 日）基金份额总额	4,678,106,974.62
本报告期期初基金份额总额	1,840,436,237.77
本报告期基金总申购份额	29,332,204.00
减：本报告期基金总赎回份额	132,996,133.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,736,772,308.40

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2012 年 3 月 3 日发布了《易方达基金管理有限公司高管人员变更公告》，经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]266 号文核准批复，自 2012 年 3 月 1 日起基金管理人聘任肖坚先生、陈志民先生担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	96,079,154.56	1.90%	83,877.31	1.97%	-
广发证券	1	691,348,963.13	13.67%	587,645.44	13.79%	-
平安证券	1	165,043,933.78	3.26%	140,286.49	3.29%	-
银河证券	2	862,903,822.54	17.06%	715,021.07	16.78%	-
招商证券	1	543,202,923.42	10.74%	465,868.14	10.93%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	615,111,108.57	12.16%	522,843.48	12.27%	-
华泰证券	2	967,619,820.34	19.13%	797,882.08	18.72%	-
中信建投	1	202,742,846.54	4.01%	164,729.82	3.86%	-
国金证券	1	913,749,167.72	18.07%	784,249.16	18.40%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元，华泰联合证券有限责任公司更名为

华泰证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需
要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	236,196,410.84	36.51%	-	-	-	-
广发证券	55,317,680.10	8.55%	-	-	-	-
平安证券	56,657,575.50	8.76%	44,300,000.00	38.45%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	11,674,184.65	1.80%	35,900,000.00	31.16%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	23,103,864.00	3.57%	-	-	-	-
华泰证券	194,188,728.07	30.02%	-	-	-	-
中信建投	4,966,359.19	0.77%	-	-	-	-
国金证券	64,750,337.62	10.01%	35,000,000.00	30.38%	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一二年八月二十四日