易方达消费行业股票型证券投资基金

2012 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期： 二〇一二年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国农业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。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
3 主要财务指标和基金净值表现.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
4 管理人报告.....9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....10
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.....11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....12
5 托管人报告.....13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....13
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.....13
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.....13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....13
6.1 资产负债表.....13
6.2 利润表.....15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....16
6.4 报表附注.....17
7 投资组合报告.....33
7.1 期末基金资产组合情况.....33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....37
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.....37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....38
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.....38
7.9 投资组合报告附注.....38
8 基金份额持有人信息.....38

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 39
9 开放式基金份额变动 39
10 重大事件揭示 39
10.1 基金份额持有人大会决议 39
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 39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 40
10.4 基金投资策略的改变 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 40
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 40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 40
10.8 其他重大事件 41
11 备查文件目录 43
11.1 备查文件目录 43
11.2 存放地点 43
11.3 查阅方式 43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达消费行业股票型证券投资基金
基金简称	易方达消费行业股票
基金主代码	110022
交易代码	110022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月20日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,970,552,227.88份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资消费行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据对消费行业各子行业的综合分析，从中选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资，在努力控制风险的前提下追求更高回报。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×85%+中债总指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种，理论上其风险收益水平高于混合基金和债券基金。同时，本基金作为行业基金，在享受消费行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	李芳菲

	联系电话	020－38797888	010-66060069
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020－38799488	010-63201816
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	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广州市体育西路 189 号城建大厦 25、26、27、28 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		510620	100031
法定代表人		叶俊英	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市体育西路 189 号城建大厦 25 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	-204,856,182.23
本期利润	175,297,530.91
加权平均基金份额本期利润	0.0405
本期加权平均净值利润率	4.76%
本期基金份额净值增长率	4.55%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2012 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	-504,441,753.40
期末可供分配基金份额利润	-0.1270
期末基金资产净值	3,466,110,474.48
期末基金份额净值	0.873

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.70%

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.期末可供分配利润,为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	0.46%	0.97%	-4.11%	0.81%	4.57%	0.16%
过去三个月	5.43%	0.98%	1.33%	0.96%	4.10%	0.02%
过去六个月	4.55%	1.22%	4.96%	1.17%	-0.41%	0.05%
过去一年	-7.03%	1.14%	-10.79%	1.12%	3.76%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-12.70%	1.06%	-7.75%	1.16%	-4.95%	-0.10%

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

易方达消费行业股票型证券投资基金

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

（2010 年 8 月 20 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)股票资产占基金资产的 80%—95%；

(2)本基金投资于中证指数公司界定的主要消费行业和可选消费行业股票的比例不低于股票资产的 95%；

(3)本基金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%；

(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5)进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(6)本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，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；

(7)保持不低于基金资产净值 5％的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(8)本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3％，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10％；

(9)本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10％；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20％；

(10)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

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-12.70%，同期业绩比较基准收益率为-7.75% 。

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		
刘芳洁	本基金的基金经理	2010-08-20	-	8年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、易方达科翔股票型基金（原科翔证券投资基金）的基金经理。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。
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 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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

2012 年上半年股票市场整体呈先扬后抑走势，结构分化明显。一季度基于经济放松的憧憬以及通胀回落的预期，市场表现较为活跃。但随着一季度经济数据的出炉和上市公司季报的披露，各项数据均显著低于预期，加之欧债危机不断恶化，内忧外困之下，市场在 5、6 月份出现了大幅下跌，其中煤炭、水泥、工程机械等周期性行业成为重灾区。从行业表现看，上半年房地产和食品饮料行业显著超越市场，特别是部分二、三线白酒企业，其超预期的业绩增速在上市公司业绩整体低迷的上半年显得极为突出，受到了资本市场的热烈追捧。

消费行业在上半年股价表现出现了较大分化，不少子行业如商业零售、纺织服装等逐步体现出“后经济周期”特点，收入和利润增速在一季度开始明显放缓，股价也随之出现一定程度调整。而食品饮料行业特别是白酒板块由于靓丽的业绩表现，股价表现非常抢眼。在当前的宏观环境下，投资者非常看重业绩增长的确定性，对于短期高增长的企业极为追捧，而不少曾经被贴上“优秀”标签的企业由于受经济周期影响业绩出现波动则被市场无情抛弃，估值迅速回落。这固然可以理解为市场的进步或者是经济下行环境中投资者“抱团取暖”的无奈选择，但某些公司股价短期的极端表现（无论涨跌）已经反映出投资者情绪的宣泄，其中是否存在“错误定价”的机会或陷阱在接下来的一、两个季度值得关注。

本基金在上半年表现不够理想。春节前后当高档白酒“一批”价格出现下滑时我们便开始担心白酒终端销售放缓对企业的冲击，过早降低了白酒行业的配置比例，特别是错过了业绩驱动带来的二三线白酒企业的大涨，对基金净值影响较大。另外，我们在上半年买入了一些看上去便宜但存在显著瑕疵的企业，这些股票在所谓的“低位”买入以后跌幅惊人，虽然比例不高但给基金净值依然带来了不小损失。整体而言，本基金在上半年除了大比例减持商业零售，核心资产变动不大。

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 0.873 元，本报告期份额净值增长率为 4.55%，同期业绩比较基准收益率为 4.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 3 季度，我们认为影响市场短期因素可能集中在流动性是否能从货币放松实质性走向信贷放松以及经济增速是否明确在 2 季度见底两个方面，如果这两个问题均能给出肯定的答案，对投资者信心的恢复将有显著帮助。但长期而言，经济增速的下行以及结构转型的压力将始终抑制周期性行业估值的提升，如何扭转投资者对于经济中长期的悲观预期成为股票市场能否反转的关键因素。而对于消费行业而言，仍将显著受益于中国经济的结构转型，我们努力以中长期的视角审视企业，继续将主要精力放在对企业的深入研究和精挑细选上，着眼于找出那些能持续成长或者成长超出预期的优质企业，力争为投资者带来良好的回报。

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

在托管易方达消费行业股票型证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《易方达消费行业股票型证券投资基金基金合同》、《易方达消费行业股票型证券投资基金托管协议》的约定，对易方达消费行业股票型证券投资基金的基金管理人——易方达基金管理有限公司自 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日的基金投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司在易方达消费行业股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的易方达消费行业股票型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

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：易方达消费行业股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末

		2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	80,267,925.11	439,586,563.38
结算备付金		2,361,980.00	4,320,891.65
存出保证金		1,094,069.71	1,657,156.31
交易性金融资产	6.4.7.2	3,258,043,805.16	3,507,324,687.27
其中：股票投资		3,008,205,805.16	3,215,277,674.17
基金投资		-	-
债券投资		249,838,000.00	292,047,013.10
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	180,000,390.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,212,302.85	3,764,094.78
应收股利		472,500.00	-
应收申购款		441,243.92	9,693,187.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,526,894,216.75	3,966,346,581.10
负债和所有者权益	**附注号**	**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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		49,999,805.00	-
应付证券清算款		559,617.00	99,117,564.04
应付赎回款		3,089,589.16	1,880,442.64
应付管理人报酬		4,309,233.24	4,998,399.14
应付托管费		718,205.53	833,066.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,111,294.40	1,973,826.12
应交税费		-	-
应付利息		39,075.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	956,922.04	1,184,659.05
负债合计		60,783,742.27	109,987,957.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,970,552,227.88	4,617,488,577.77
未分配利润	6.4.7.10	-504,441,753.40	-761,129,954.19
所有者权益合计		3,466,110,474.48	3,856,358,623.58

负债和所有者权益总计		3,526,894,216.75	3,966,346,581.10

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.873 元，基金份额总额 3,970,552,227.88 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达消费行业股票型证券投资基金

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	附注号	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		**211,922,641.12**	**-139,230,826.65**
1.利息收入		8,227,103.99	5,658,994.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	914,540.00	1,091,223.32
债券利息收入		5,904,578.83	3,991,699.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,407,985.16	576,071.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-177,228,630.59	-117,790,158.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-192,475,205.70	-130,204,020.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	792,440.55	136,202.78
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	14,454,134.56	12,277,659.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	380,153,713.14	-28,138,993.13
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	770,454.58	1,039,330.24
减：二、费用		**36,625,110.21**	**41,579,746.19**
1．管理人报酬		27,494,627.40	29,148,166.37
2．托管费		4,582,437.85	4,858,027.63
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.18	4,268,047.81	7,312,953.76
5．利息支出		39,075.90	-
其中：卖出回购金融资产支出		39,075.90	-

6．其他费用	6.4.7.19	240,921.25	260,598.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**175,297,530.91**	**-180,810,572.84**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		175,297,530.91	-180,810,572.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达消费行业股票型证券投资基金

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）	4,617,488,577.77	-761,129,954.19	3,856,358,623.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	175,297,530.91	175,297,530.91
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）	-646,936,349.89	81,390,669.88	-565,545,680.01
其中：1.基金申购款	190,271,964.91	-27,882,050.76	162,389,914.15
2.基金赎回款	-837,208,314.80	109,272,720.64	-727,935,594.16
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）	3,970,552,227.88	-504,441,753.40	3,466,110,474.48
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）	4,467,215,678.44	-76,574,855.87	4,390,640,822.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-180,810,572.84	-180,810,572.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-524,778,198.52	16,666,895.68	-508,111,302.84

值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	344,943,752.26	-21,609,690.61	323,334,061.65
2.基金赎回款	-869,721,950.78	38,276,586.29	-831,445,364.49
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）	3,942,437,479.92	-240,718,533.03	3,701,718,946.89

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

易方达消费行业股票型证券投资基金(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”)证监许可[2010]875 号《关于核准易方达消费行业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达消费行业股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达消费行业股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 8 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,372,732,356.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,109,089.55 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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”），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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	80,267,925.11
定期存款	-
其他存款	-
合计	80,267,925.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,973,347,816.79	3,008,205,805.16	34,857,988.37
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	250,747,811.64	249,838,000.00	-909,811.64
	合计	250,747,811.64	249,838,000.00	-909,811.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,224,095,628.43	3,258,043,805.16	33,948,176.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	180,000,390.00	-
合计	180,000,390.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,466.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	956.61
应收债券利息	4,051,086.17
应收买入返售证券利息	141,793.38
应收申购款利息	-
其他	-
合计	4,212,302.85

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,108,785.39
银行间市场应付交易费用	2,509.01
合计	1,111,294.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	8,016.06
预提费用	198,905.98
合计	956,922.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,617,488,577.77	4,617,488,577.77
本期申购	190,271,964.91	190,271,964.91
本期赎回（以“-”号填列）	-837,208,314.80	-837,208,314.80
本期末	3,970,552,227.88	3,970,552,227.88

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-356,930,912.29	-404,199,041.90	-761,129,954.19
本期利润	-204,856,182.23	380,153,713.14	175,297,530.91
本期基金份额交易产生的变动数	62,381,489.25	19,009,180.63	81,390,669.88
其中：基金申购款	-16,857,536.53	-11,024,514.23	-27,882,050.76
基金赎回款	79,239,025.78	30,033,694.86	109,272,720.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-499,405,605.27	-5,036,148.13	-504,441,753.40

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	892,712.24
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	20,389.20
其他	1,438.56
合计	914,540.00

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,558,887,520.03
减：卖出股票成本总额	1,751,362,725.73
买卖股票差价收入	-192,475,205.70

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	103,248,585.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,043,572.60
减：应收利息总额	2,412,572.59
债券投资收益	792,440.55

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,454,134.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,454,134.56

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	380,153,713.14
——股票投资	381,426,655.28
——债券投资	-1,272,942.14
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	380,153,713.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	770,454.58

合计	770,454.58

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	4,267,122.81
银行间市场交易费用	925.00
合计	4,268,047.81

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	26,615.27
银行间账户维护费	15,000.00
其他费用	400.00
合计	240,921.25

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	32,891,175.14	1.24%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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	27,957.38	1.26%	27,957.38	2.52%
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	-	-	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	27,494,627.40	29,148,166.37
其中：支付销售机构的客户维护费	5,917,857.66	7,670,515.19

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×1.5%/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三个工

作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	4,582,437.85	4,858,027.63

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×0.25%/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三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 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
中国农业银行	-	-	-	-	50,000,000.00	65,126.51
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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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

中国农业银行	80,267,925.11	892,712.24	79,256,308.85	1,045,840.57

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002029	七匹狼	2012-06-26	2013-06-27	非公开发行流通受限	23.00	23.08	800,000	18,400,000.00	18,464,000.00	-
600467	好当家	2011-11-30	2012-11-28	非公开发行流通受限	11.45	7.10	1,120,000	12,824,000.00	7,952,000.00	-

注：1.以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

2.山东好当家海洋发展股份有限公司于 2012 年 5 月 30 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 0.50 元人民币现金（含税）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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 49,999,805.00 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
110414	11农发14	2012-07-05	100.18	500,000	50,090,000.00
合计		-	-	500,000	50,090,000.00

6.4.12.3.2 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为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.87%(2011 年 12 月 31 日：2.63%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
A-1	29,990,580.82	71,093,350.82
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	223,898,505.35	194,344,955.69
合计	253,889,086.17	265,438,306.51

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级 。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	30,329,276.66
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	30,329,276.66

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价 格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	80,267,925.11	-	-	-	80,267,925.11
结算备付金	2,361,980.00	-	-	-	2,361,980.00
存出保证金	-	-	-	1,094,069.71	1,094,069.71
交易性金融资产	249,838,000.00	-	-	3,008,205,805.16	3,258,043,805.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	180,000,390.00	-	-	-	180,000,390.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,212,302.85	4,212,302.85
应收股利	-	-	-	472,500.00	472,500.00
应收申购款	7,644.96	-	-	433,598.96	441,243.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	512,475,940.07	-	-	3,014,418,276.68	3,526,894,216.75
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	49,999,805.00	-	-	-	49,999,805.00
应付证券清算款	-	-	-	559,617.00	559,617.00
应付赎回款	-	-	-	3,089,589.16	3,089,589.16
应付管理人报酬	-	-	-	4,309,233.24	4,309,233.24
应付托管费	-	-	-	718,205.53	718,205.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,111,294.40	1,111,294.40
应交税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	39,075.90	39,075.90
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	956,922.04	956,922.04
负债总计	49,999,805.00	-	-	10,783,937.27	60,783,742.27
利率敏感度缺口	462,476,135.07	-	-	3,003,634,339.41	3,466,110,474.48
上年度末2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	439,586,563.38	-	-	-	439,586,563.38
结算备付金	4,320,891.65	-	-	-	4,320,891.65
存出保证金	-	-	-	1,657,156.31	1,657,156.31
交易性金融资产	262,441,000.00	29,606,013.10	-	3,215,277,674.17	3,507,324,687.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,764,094.78	3,764,094.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	35,755.73	-	-	9,657,431.98	9,693,187.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	706,384,210.76	29,606,013.10	-	3,230,356,357.24	3,966,346,581.10
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	99,117,564.04	99,117,564.04
应付赎回款	-	-	-	1,880,442.64	1,880,442.64
应付管理人报酬	-	-	-	4,998,399.14	4,998,399.14
应付托管费	-	-	-	833,066.53	833,066.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,973,826.12	1,973,826.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,184,659.05	1,184,659.05
负债总计	-	-	-	109,987,957.52	109,987,957.52
利率敏感度缺口	706,384,210.76	29,606,013.10	-	3,120,368,399.72	3,856,358,623.58

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降25个基点	228,293.49	759,647.93
	2. 市场利率上升25个基点	-227,736.67	-754,736.57

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情

况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	3,008,205,805.16	86.79	3,215,277,674.17	83.38
交易性金融资产-债券投资	249,838,000.00	7.21	292,047,013.10	7.57
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,258,043,805.16	94.00	3,507,324,687.27	90.95

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升5%	170,993,909.68	181,333,362.49
	2. 业绩比较基准下降5%	-170,993,909.68	-181,333,362.49

6.4.14 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 2,981,789,805.16 元，第二层级的余额为 276,254,000.00 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 3,227,964,887.27 元，第二层级的余额为 279,359,800.00 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	3,008,205,805.16	85.29
	其中：股票	3,008,205,805.16	85.29
2	固定收益投资	249,838,000.00	7.08
	其中：债券	249,838,000.00	7.08
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	180,000,390.00	5.10
	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	82,629,905.11	2.34
6	其他各项资产	6,220,116.48	0.18
7	合计	3,526,894,216.75	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	7,952,000.00	0.23
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,353,149,794.16	67.89
C0	食品、饮料	1,476,607,316.91	42.60
C1	纺织、服装、皮毛	378,638,042.40	10.92
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	25,215,000.00	0.73
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	467,641,017.65	13.49
C8	医药、生物制品	4,283,147.20	0.12
C99	其他制造业	765,270.00	0.02
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	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	590,166,093.10	17.03
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	12,277,917.90	0.35
K	社会服务业	44,660,000.00	1.29
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,008,205,805.16	86.79

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000568	泸州老窖	7,450,000	315,209,500.00	9.09
2	600887	伊利股份	11,179,936	230,083,082.88	6.64
3	600694	大商股份	6,523,300	218,204,385.00	6.30
4	600600	青岛啤酒	5,601,827	213,933,773.13	6.17
5	002157	正邦科技	19,442,437	204,923,285.98	5.91
6	000651	格力电器	8,900,000	185,565,000.00	5.35
7	000963	华东医药	6,015,139	181,657,197.80	5.24
8	600519	贵州茅台	709,874	169,766,367.10	4.90
9	600280	南京中商	5,342,410	168,232,490.90	4.85

10	002397	梦洁家纺	6,880,000	143,792,000.00	4.15
11	002327	富安娜	3,120,000	141,928,800.00	4.09
12	000858	五 粮 液	3,000,000	98,280,000.00	2.84
13	000848	承德露露	5,279,928	92,662,736.40	2.67
14	600104	上汽集团	6,099,838	87,166,685.02	2.51
15	000527	美的电器	6,299,911	69,614,016.55	2.01
16	600251	XD 冠农股	3,520,000	65,929,600.00	1.90
17	000895	双汇发展	1,022,749	63,287,708.12	1.83
18	000800	一汽轿车	5,400,000	58,644,000.00	1.69
19	002293	罗莱家纺	662,644	49,433,242.40	1.43
20	000069	华侨城 A	7,000,000	44,660,000.00	1.29
21	002029	七 匹 狼	1,700,000	43,484,000.00	1.25
22	600060	海信电器	1,500,000	25,215,000.00	0.73
23	000625	长安汽车	5,000,000	24,400,000.00	0.70
24	002304	洋河股份	160,570	21,604,693.50	0.62
25	000581	威孚高科	750,000	20,550,000.00	0.59
26	601258	庞大集团	2,499,834	15,248,987.40	0.44
27	600166	福田汽车	2,000,000	14,300,000.00	0.41
28	600467	好当家	1,120,000	7,952,000.00	0.23
29	000927	一汽夏利	999,976	7,329,824.08	0.21
30	002285	世联地产	419,985	6,215,778.00	0.18
31	600340	华夏幸福	335,110	6,062,139.90	0.17
32	600511	国药股份	200,000	2,800,000.00	0.08
33	600998	九州通	200,000	2,676,000.00	0.08
34	000788	西南合成	351,664	2,567,147.20	0.07
35	000650	仁和药业	200,000	1,716,000.00	0.05
36	002557	洽洽食品	46,098	926,569.80	0.03
37	002345	潮宏基	33,000	765,270.00	0.02
38	002024	苏宁电器	88,800	745,032.00	0.02
39	600327	大东方	100,000	602,000.00	0.02
40	600690	青岛海尔	6,100	71,492.00	0.00

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	122,326,185.74	3.17
2	600251	冠农股份	96,219,812.82	2.50

3	600104	上汽集团	85,986,278.59	2.23
4	000527	美的电器	75,959,556.82	1.97
5	000895	双汇发展	67,790,190.58	1.76
6	600166	福田汽车	62,305,768.21	1.62
7	000800	一汽轿车	56,136,403.34	1.46
8	600060	海信电器	49,888,043.44	1.29
9	002293	罗莱家纺	38,998,702.82	1.01
10	002024	苏宁电器	36,416,884.61	0.94
11	000858	五 粮 液	35,154,899.09	0.91
12	002304	洋河股份	33,811,557.57	0.88
13	000625	长安汽车	31,464,489.31	0.82
14	000063	中兴通讯	29,572,772.68	0.77
15	002157	正邦科技	22,505,051.09	0.58
16	000651	格力电器	22,173,149.79	0.57
17	601258	庞大集团	19,210,334.49	0.50
18	000069	华侨城 A	19,111,435.66	0.50
19	002029	七 匹 狼	18,400,000.00	0.48
20	600887	伊利股份	18,101,623.80	0.47

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	000987	广州友谊	125,012,906.00	3.24
2	600327	大东方	122,808,061.25	3.18
3	600694	大商股份	106,871,891.81	2.77
4	000568	泸州老窖	102,782,419.58	2.67
5	600887	伊利股份	90,323,395.29	2.34
6	000417	合肥百货	71,441,218.01	1.85
7	000063	中兴通讯	71,352,009.76	1.85
8	600519	贵州茅台	66,865,065.36	1.73
9	000069	华侨城 A	62,227,683.62	1.61
10	002029	七 匹 狼	53,548,286.55	1.39
11	600260	凯乐科技	51,792,542.35	1.34
12	600166	福田汽车	47,113,295.49	1.22
13	002251	步 步 高	43,629,497.34	1.13
14	600280	南京中商	41,846,366.54	1.09
15	000581	威孚高科	41,316,001.49	1.07
16	000858	五 粮 液	39,533,965.90	1.03
17	002325	洪涛股份	36,546,955.51	0.95

18	002157	正邦科技	29,384,156.32	0.76
19	002024	苏宁电器	29,080,073.00	0.75
20	002293	罗莱家纺	28,685,529.10	0.74

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	1,162,864,201.44
卖出股票收入（成交）总额	1,558,887,520.03

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	-	-
2	央行票据	29,094,000.00	0.84
3	金融债券	190,798,000.00	5.50
	其中：政策性金融债	190,798,000.00	5.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	29,946,000.00	0.86
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	249,838,000.00	7.21

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	070419	07 农发 19	1,200,000	120,672,000.00	3.48
2	110414	11 农发 14	700,000	70,126,000.00	2.02
3	041253027	12 澜沧江 CP001	300,000	29,946,000.00	0.86
4	1101096	11 央行票据 96	300,000	29,094,000.00	0.84

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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未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	1,094,069.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	472,500.00
4	应收利息	4,212,302.85
5	应收申购款	441,243.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,220,116.48

7.9.4 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。

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
91,220	43,527.21	1,054,955,331.23	26.57%	2,915,596,896.65	73.43%

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	68,975.55	0.0017%

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（2010 年 8 月 20 日）基金份额总额	6,372,732,356.41
本报告期期初基金份额总额	4,617,488,577.77
本报告期基金总申购份额	190,271,964.91
减：本报告期基金总赎回份额	837,208,314.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,970,552,227.88

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	
申银万国	2	265,991,300.21	10.00%	223,705.57	10.09%	-
渤海证券	2	287,920,516.49	10.83%	233,937.69	10.56%	-
万联证券	1	522,085,514.69	19.64%	444,166.59	20.04%	-
兴业证券	1	433,727,721.14	16.31%	372,266.94	16.80%	-
瑞银证券	1	1,115,980,122.80	41.98%	914,251.36	41.25%	-
广发证券	1	32,891,175.14	1.24%	27,957.38	1.26%	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

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服务；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
申银万国	30,313,619.65	100.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-05
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加财富里昂证券为代销机构及在财富里昂证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-19
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浦发银行定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-06

4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信证券（浙江）为代销机构及在中信证券（浙江）推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-16
5	易方达基金管理有限公司关于延长中国工商银行借记卡基金网上直销申购费率优惠期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-29
6	易方达基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-03
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-31
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国泰君安证券自助式交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-09
9	易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-16
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-27
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东吴证券网上交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-05-04
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在渤海证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-05-21
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华融证券网上交易定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-05-29
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信万通证券为代销机构及在中信万通证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-11
15	易方达基金管理有限公司关于开通机构投资者网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-11
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配七匹狼（002029）非公开发行A股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-28
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-29
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-29

	申购费率优惠活动的公告		

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达消费行业股票型证券投资基金募集的文件；
2.《易方达消费行业股票型证券投资基金基金合同》；
3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4.《易方达消费行业股票型证券投资基金托管协议》；
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。

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 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
二〇一二年八月二十四日