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

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2009年9月19日，有关财务数据截止日为2009年6月30日，净值表现截止日为2009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19、25、27、28楼
设立日期：2001年4月17日
法定代表人：梁棠
联系电话：4008818088
联系人：吴薇

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
广东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

梁棠先生，董事长，硕士，1958年生。历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，广东粤财投资控股有限公司总经理。现任广东粤财投资控股有限公司董事长、易方达基金管理有限公司董事长。2008年1月，当选为政协广东省第十届委员会常委。

叶俊英先生，副董事长、总裁，博士，1963年生。历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。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁。

李建勇先生，董事，博士，1957年生。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，现任广发证券股份有限公司总裁。

谢亮先生，董事，大学本科毕业，1963年生。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，董事，学士，1975年生。历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。现任广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。

张优造先生，董事、副总裁，硕士，1964年生。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、副总裁兼营运总监。

佟志广先生，独立董事，1933年生。历任中国驻印度、缅甸大使馆商务处秘书，中国常驻联合国代表团秘书，中国驻美国联络处商务秘书，中国粮油食品进出口总公司副总经理，香港华润集团有限公司常务董事、副董事长、总经理。1991年2月任对外经济贸易部副部长，在担任副部长期间曾任中国“复关”首席谈判代表，中美贸易谈判代表团团长。1994年4月任中国进出口银行董事长、党组书记。曾被选为中华人民共和国第八、第九届全国人民代表大会常务委员会委员、外事委员会委员，中国—欧洲议会友好小组副主席。

项兵先生，独立董事，博士，1962年生。历任加拿大CALGARY大学副教授，香港科技大学讲师，中欧国际工商学院核心教授，北京大学教授、博士生导师、EMBA及高级管理培训部主任，现任长江商学院院长。

谢石松先生，独立董事，法学博士，1963年生。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，中国国际法学会、中国国际经济法学会理事，广东省律师高级专业资格评审委员会委员，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委员，以及上海、广州、深圳、厦门等仲裁委员会仲裁员。

陈国祥先生，监事会主席，硕士，1963年生。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。

刘少波先生，监事，1960年生，曾任暨南大学金融系系主任，现任暨南大学经济学院教授、博士生导师。

廖智先生，监事，硕士，1971年生。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，副总裁兼市场总监，博士，1969年生。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。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼市场总监。

张南女士，督察长，博士，1970年生。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年出生，经济学硕士，9年证券从业经历。历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。现任易方达基金管理有限公司固定收益部副总经理、投资经理、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）。

3.固定收益投资决策委员会成员

本公司固定收益投资决策委员会成员包括：副董事长、总裁叶俊英先生，固定收益部总经理马骏先生以及固定收益部副总经理钟鸣远先生。

叶俊英先生，同上。

马骏先生，1966年出生，理学学士，15年证券从业经历。历任君安证券有限公司研究员，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，现任固定收益部总经理。

钟鸣远先生，同上。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1.依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、上市交易、申购、赎回、转换和登记事宜；
2.办理基金备案手续；
3.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6.编制季度、半年度和年度基金报告；
7.计算并公告基金资产净值；
8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9.召集基金份额持有人大会；
10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1.本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2.本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：
（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3.本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
（1）越权或违规经营；
（2）违反基金合同或托管协议；
（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
（6）玩忽职守、滥用职权；
（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（9）贬损同行，以抬高自己；
（10）以不正当手段谋求业务发展；
（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4.基金经理承诺
（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1.公司内部控制的总体目标
（1）保证公司经营管理活动的合法合规性；
（2）保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
（3）实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
（4）促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
（5）保护公司最重要的资本：公司声誉。

2.公司内部控制遵循的原则

（1）全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位职员；

（2）审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（3）相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

（4）独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

（5）有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（6）适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

（7）成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3.内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

4.关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

（1）授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

（4）交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

（5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

（7）监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察部开展监察稽核工作，并保证监察部的独立性和权威性。公司明确了监察部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

5.基金管理人关于内部控制制度声明书
（1）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
（2）本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

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：
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
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人民币
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

（1）易方达基金管理有限公司
办公地址：广州市体育西路189号城建大厦19、25、27、28楼
法定代表人：梁棠
电话：020–38797023
传真：400 881 8099
联系人：熊桃红
网址：www.efunds.com.cn

（2）易方达基金管理有限公司北京分公司
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分公司
办公地址：上海市世纪大道88号金贸大厦2307室
电话：021–50472350
传真：400 881 8099
联系人：王璟

2.代销机构

(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
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

(2)中国工商银行
地址：北京西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

(3)中国农业银行
住所：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
客户服务电话：95599
网址：www.95599.cn 或 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
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
客户服务电话：95559
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
法定代表人：秦晓
联系人：丰靖
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
法定代表人：孔丹
客户服务电话：95558
联系人：金蕾
电话：010–65557013
传真：010–65550827
网址：http://bank.ecitic.com

(7)深圳发展银行
办公地址：深圳市深南东路5047号
法定代表人：法兰克纽曼（Frank N.Newman）
联系人：周勤
联系电话：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 吴海鹏
电话：010–58351666
传真：010–83914283
客户服务电话：95568
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：上海市北京东路689号东银大厦
法定代表人：吉晓辉
联系人：倪苏云
电话：（021）61618888
传真：（021）63604199
客户服务电话：95528
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
地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
联系电话：010–66223584
客户服务电话：010–96169（北京） 022–96269（天津） 021–53599688（上海）029–85766888（西安） 0755–23957088（深圳）
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：霍兆龙
联系电话：0755–25859591
开放式基金业务传真：0755–25879453
客户服务电话：40066–99999（免长途费）或0755–961202
网址：www.pingan.com

(13)中国光大银行
公司名称：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
法定代表人：唐双宁
联系人：李伟
电话：010–68098778
传真：010–68560661
客户服务电话：95595（全国）
网址：www.cebbank.com

(14)广发银行
注册地址：广东省广州市农林下路83号
办公地址：广东省广州市农林下路83号
法定代表人：董建岳
客户服务电话：0571–96000888，020–38322222
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
客户服务电话：0769–96228
网址：www.dongguanbank.cn

(16)广发证券
注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：王志伟
联系人：黄岚
开放式基金业务传真：（020）87555305
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn

(17)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：胡长生
联系人：李洋
客户服务电话：400–888–8888
网址：www.chinastock.com.cn

(18)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：上海市银城中路168号上海银行大厦15楼
法定代表人：祝幼一
联系人：芮敏祺
开放式基金咨询电话：021–38676161
传真：021–38670666
客户服务电话：4008888666
网址：www.gtja.com

(19)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
开放式基金咨询电话：0755–82130833
开放式基金业务传真：0755–82133302
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

(20)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
电话：021–54033888
传真：021–54038844
客户服务电话：021–962505
网址：www.sywg.com

(21)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
法定代表人：宫少林
联系人：黄健
电话：0755–82943666
传真：0755–82943636
客户服务电话：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

(22)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：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
开放式基金咨询电话：4008888108
开放式基金业务传真：（010）65182261
网址：www.csc108.com

(23)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
法定代表人：吴万善
联系人：张小波
开放式基金咨询电话：95597
开放式基金业务传真：025–84579763
网址：www.htsc.com.cn

(24)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
电话：021–23219000
传真：021–23219100
客户服务电话：400–8888–001、021–95553
网址：www.htsec.com

(25)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：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010–84588888
传真：010–84865560
网址：www.ecitic.com

(26)华泰联合证券
注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
电话：0755–82492000
开放式基金咨询电话：95513，400–8888–555
开放式基金业务传真：0755–82492962
网址：www.lhzq.com

(27)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3楼
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021–22169999
传真：021–22169134
客户服务电话：4008888788、10108998
网址：www.ebscn.com

(28)长江证券
注册地址：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
电话：021–63219781
传真：021–51062920
客户服务电话：4008–888–999或027–85808318
网址：www.95579.com

(29)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：王益民
联系人：吴宇
电话：021–63325888
传真：021–63326173
客户服务电话：95503
网站：www.dfzq.com.cn

(30)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
法定代表人：唐新宇
联系人：张静
开放式基金咨询电话：4006208888
开放式基金业务传真：021–50372474
网址：www.bocichina.com.cn

(31)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
电话：0755–83516289
传真：0755–83516199
客户服务电话：0755–82288968
网址：www.cc168.com.cn

(32)兴业证券
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦
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
业务联系人：谢高得
业务联系电话：021–38565785
客户服务电话：4008888123
网址：www.xyzq.com.cn

(33)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：袁丽萍
开放式基金咨询电话：0510–82588168
开放式基金业务传真：0510–82830162
网址：www.glsc.com.cn

(34)平安证券
注册地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦
办公地址：深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼（518029）
法定代表人：陈敬达
联系人：袁月、毛娟梅
电话：0755–82450826
客户服务电话：95511
开放式基金业务传真：0755–82433794
网址：www.pa18.com

(35)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：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莺
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

(36)国元证券
注册地址：合肥市寿春路179号
办公地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系人：程维
开放式基金咨询电话：95578和400–8888–777
开放式基金业务传真：0551—2207965
网址：www.gyzq.com.cn

(37)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：王少华
联系人：黄静
联系电话：010–84183389
客户服务电话：400–818–8118
开放式基金业务传真：010–64482090
网址：www.guodu.com

(38)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40–42楼
法定代表人：段强
联系人：刘军辉、王飞
联系电话：0755–83199511
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.csco.com.cn

(39)西部证券
注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16–17层
办公地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16–17层
法定代表人：刘建武
联系人：冯萍
电话：029–87406488
传真：029–87406387
客户服务电话：029–96708
网址：www.westsecu.com.cn

(40)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
法定代表人：李工
联系人：唐泳
联系电话：0551–5161671
客户服务电话：0551–96518、4008096518
开放式基金业务传真：0551–5161672
网址：www.hazq.com

(41)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：张治国
联系电话：0351–8686703
传真：0351–8686619
客户服务电话：400–666–1618
网址：www.i618.com.cn

(42)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
电话：0512–65581136
传真：0512–65588021
客户服务电话：0512–96288
网址：www.dwzq.com.cn

(43)中原证券
注册地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址：郑州市经三路15号广汇国贸11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或4008139666
开放式基金业务传真：0371–65585665
网址：www.ccnew.com

(44)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
电话：0431–85096709
客户服务电话：4006000686 0431–85096733
网址：www.nesc.cn

(45)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
电话：0571–87925129
客户服务电话：0571–96336（上海地区：962336）
网址：www.ctsec.com

(46)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
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
联系电话：0755–82558305
开放式基金咨询电话：4008001001
开放式基金业务传真：0755–82558355
网址：www.essence.com.cn

(47)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：李舫金
联系人：刘广
联系电话：020–37865031
开放式基金业务传真：020–37865008
客户服务电话：400–8888–133
网址：www.wlzq.com.cn

(48)中信金通证券
注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：刘军
联系人：王勤
联系电话：0571–85783715
开放式基金咨询电话：0571–96598
开放式基金业务传真：0571–85783771
网址：www.96598.com.cn

(49)南京证券
注册地址：江苏省南京市大钟亭8号
法人代表：张华东
联系人：徐翔
联系电话：025–83367888–4201
传真：025–83320066
网址：www.njzq.com.cn

(50)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：青岛市东海西路28号
法定代表人：史洁民
联系人：丁韶燕
联系电话：0532–85022026
传真：0532–85022026
客户服务电话：0532–96577
网址：www.zxwt.com.cn

(51)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（410005）
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（410005）
法定代表人：周晖
联系人：郭磊
联系电话：0731–4403319
开放式基金业务传真：0731–4403439
网址：www.cfzq.com

(52)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：游锦辉
联系人：张建平 0769–22119423
开放式基金咨询电话：0769–961130
开放式基金业务传真：0769–22119423
网站：www.dgzq.com.cn

(53)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：金春
电话：0755–83025695
传真：0755–83025625
客户服务电话：400–8888–228
网址：www.jyzq.com.cn

(54)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30楼
法定代表人：张雅锋
联系人：武斌
联系电话：0755–83707413
传真：0755–83700205
客户服务电话：4008888100（全国）、96100（广西）
网址：www.ghzq.com.cn

(55)广州证券
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人：吴志明
联系人：樊刚正
电话：020–87322668
传真：020–87325036
客户服务电话：020–961303
网址：www.gzs.com.cn

(56)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：徐菁
电话：0755–25832848
客户服务电话：0755–25832583
网址：www.firstcapital.com.cn

(57)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：天津市河西区宾水道3号
法定代表人：张志军
联系人：王兆权
电话：022–28451861
传真：022–28451892
客户服务电话：4006515988
网址：www.bhzq.com

(58)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
电话：0519–88157761
传真：0519–88157761
客户服务电话：021–52574550　0519–88166222　0379–64902266
免费服务热线：400–888–8588
网址：www.longone.com.cn

(59)齐鲁证券
通讯地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
联系人：傅咏梅
联系电话：0531–81283938
传真电话：0531–81283900
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

(60)信泰证券
注册地址：南京市长江路88号
办公地址：南京市中山东路90号24楼
法定代表人：吴建党
联系人：舒萌菲
电话：(025)84784782
传真：(025)84784741
客户服务电话：400–8888–918
网址：www.thope.com

(61)宏源证券
注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2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：010–88085338
客户服务电话：4008–000–562
传真：010–88085344
网址：www.hysec.com

(62)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：彭博
电话：0731–85832343
传真：0731–85832214
客户服务电话：95571
网址：www.foundersc.com

(63)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20层
办公地址：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20层
法定代表人：杨小阳
联系人：刘权
电话：（0755）82026521
传真：（0755）82026539
客户服务电话：400–600–8008
网址：www.cjis.cn

(64)江南证券
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号五楼
法定代表人：姚江涛
联系人：余雅娜
电话：0791–6768763
传真：0791–6789414
客户服务电话：0791–6781119
网址：www.scstock.com

(65)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：洪明
联系人：张利军
联系电话：0471–6292465，010–88086830–652
传真：010–88086637
网址：www.rxzq.com.cn

(66)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：裴东平
联系人：张斌
电话：0755–33331188–8803
传真：0755–33329815
客户服务电话：4006543218
网址：www.tyzq.com.cn

(67)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23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23层
客户服务电话：400–820–9898
网址：www.cnhbstock.com

(68)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
客户服务电话：400–889–5618
网址：www.e5618.com

(69)西南证券
注册地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22–25楼
办公地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22–25楼
法定代表人：王珠林
联系人：秦治国
电话：023–63721712
传真：023–63786215
客户服务电话：4008096096
网址：www.swsc.com.cn

(70)新时代证券
注册地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦1501
办公地址：北京市西城区金融大街1号A座8楼
法定代表人：马金声
联系人：高滋生
联系电话：010–83561149
客户服务电话：400–698–9898
开放式基金业务传真：010–83561001
网址：www.xsdzq.cn

(71)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

（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19、25、27、28楼
法定代表人：梁棠
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1233号汇亚大厦1604–1608室
法定代表人：杨绍信
联系电话：021–61238888
传真电话：021–61238800
经办注册会计师：汪棣、金毅
联系人：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、现金流水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的判断，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2009年11月2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2009年4月1日至2009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	128,058,592.62	10.47
	其中：股票	128,058,592.62	10.47
2	固定收益投资	931,879,425.16	76.21
	其中：债券	931,879,425.16	76.21
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	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	140,746,401.21	11.51
6	其他资产	22,061,029.41	1.80
7	合计	1,222,745,448.40	100.00

（下转B28版）