

易方达裕祥回报债券型证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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 2016 年 1 月 22 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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
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.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	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.....	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12	投资组合报告附注	38
8	基金份额持有人信息	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
9	开放式基金份额变动	39
10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
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	40
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	41
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	42
11.1	备查文件目录	42
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	易方达裕祥回报债券型证券投资基金
基金简称	易方达裕祥回报债券
基金主代码	002351
交易代码	002351
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 22 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	571,407,356.31 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票、债券和银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。本基金将适度参与股票资产投资。股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	廖原
	联系电话	020-85102688	021-61618888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95528
传真		020-85104666	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	上海市中山东一路12号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	上海市中山东一路12号
邮政编码		510620	200120
法定代表人		刘晓艳	吉晓辉

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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 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（2016 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	7,291,975.85
本期利润	4,496,755.71
加权平均基金份额本期利润	0.0067
本期加权平均净值利润率	0.67%
本期基金份额净值增长率	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,695,875.94

期末可供分配基金份额利润	0.0082
期末基金资产净值	576,103,232.25
期末基金份额净值	1.008
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.80%

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。

4.本基金合同于 2016 年 1 月 22 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

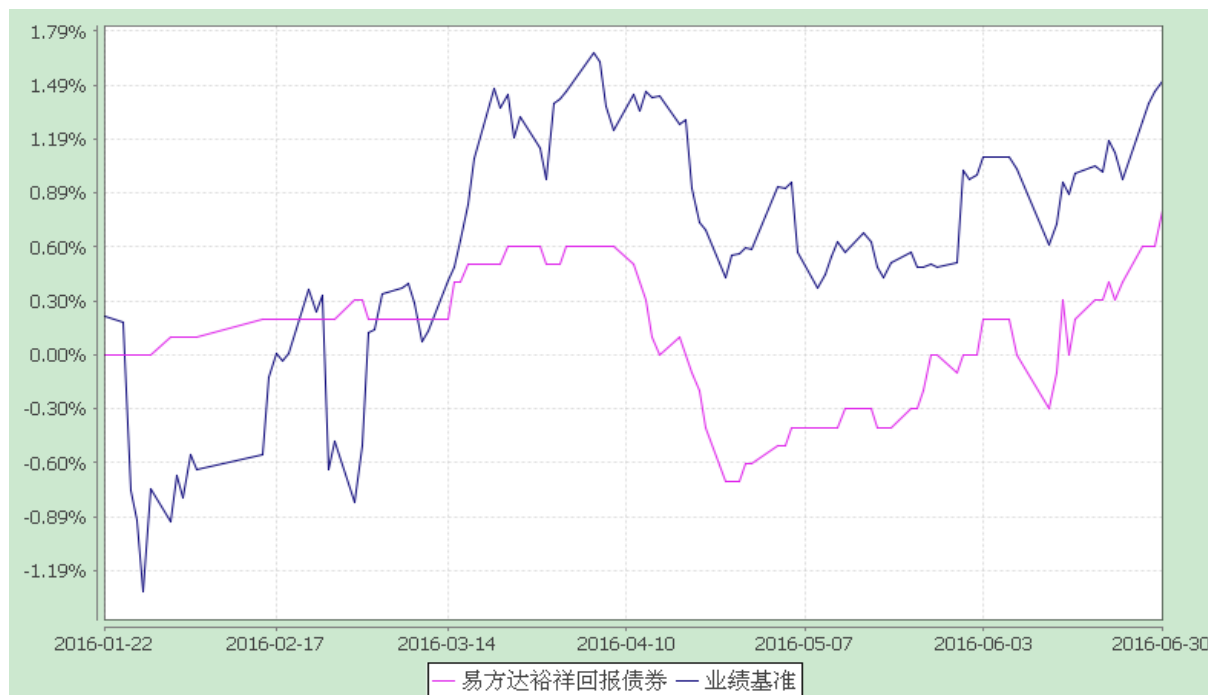
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.80%	0.18%	0.49%	0.15%	0.31%	0.03%
过去三个月	0.30%	0.13%	0.09%	0.16%	0.21%	-0.03%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.80%	0.10%	1.51%	0.23%	-0.71%	-0.13%

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

易方达裕祥回报债券型证券投资基金

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

(2016年1月22日至2016年6月30日)



注：1.本基金合同于 2016 年 1 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期末本基金处于建仓期内。

3. 自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%。

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，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“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增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至 2016 年 6 月 30 日，易方达旗下共管理 92 只开放式基金、1 只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，管理公募基金总规模 4056.91 亿元。

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		
张清华	本基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理	2016-01-22	-	9 年	硕士研究生，曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员、易方达基金管理有限公司投资经理。
张雅君	本基金的基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理（自 2016 年 1 月 29 日至 2016 年 6 月 1 日）、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理	2016-06-02	-	7 年	硕士研究生，曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员。

林虎	本基金的基金经理助理、易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理助理	2016-01-29	-	4 年	博士研究生，曾任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师。
----	------------------------------------	------------	---	-----	--------------------------------------

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，张清华的“任职日期”为基金合同生效之日，张雅君、林虎的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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，以及强化事后监控分析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。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，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 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

2016 年上半年债券市场收益率并未出现明显的趋势，总体呈现震荡态势。一月份，市场对于供给侧改革带来经济短期阵痛形成一致预期，叠加全球股票市场波动带来的风险偏好下移，共同推动长债收益率出现显著下行。但是二月份以后，随着股票市场企稳，风险偏好逐步修复，同时经济中的积极信号逐步增多，市场开始出现分歧。首先是一线城市地产价格的快速上升开始向二线城市扩散。在货币宽松和政策支持下，一线城市地产销售的好转反应为价格的快速上升，并开始向部分二线城市传导。一二月份地产的新开工和投资数据均出现较为明显的回升，引发市场对于地产投资回升力度和持续性的关注。其次是大宗商品价格快速上升。一季度主要大宗商品价格包括原油、铁矿石、螺纹钢价格出现明显的上涨，考虑到大宗商品同时连接终端需求和通胀预期，市场对于未来增长和通胀的判断开始出现分歧。最后是农产品价格的居高不下导致通胀预期回升。一季度由于天气原因蔬菜价格出现了大幅上涨，而同时猪肉价格也屡创新高，这也触发了对于未来通胀回升的担忧。逐步增大的市场分歧导致长端无风险利率继续下行受阻，甚至出现了一定程度的回调。而在配置压力推动下，信用债收益率持续下行，信用利差被压缩至历史低位。处于对违约风险的担心，市场仍然偏好高等级信用债和城投债。

三月底开始信用风险事件频发，市场风险偏好迅速下降，信用债收益率快速走高。机构迫于赎回压力，流动性较好的利率债和城投类品种受到冲击，同时叠加营改增以及宏观审慎评估体系(MPA)考核导致的季末流动性紧张影响，利率出现了一波明显的上调。随后在央行公开市场续作加量以及中期借贷便利(MLF)投放等因素影响下，市场情绪有所回暖，推动信用债和利率债收益率转而下行。但是由于基本面仍处于边际改善态势以及对于六月底资金面的担心，利率以震荡整理为主。进入六月后，非农数据孱弱导致美联储加息预期骤降，随后公布的中国 5 月经济数据不及预期，尤其是地产的销售投资出现回落，市场对于经济前景转向悲观。接着是英国脱欧推动全球避险情绪升温，市场对全球央行再宽松的预期加强，推动市场收益率出现了显著下行。信用债自四月份冲击以后，结构分化明显。高等级、城投债收益率出现回落，但是过剩产能行业以及出现信用事件的发行主体收益率仍然维持高位，利差甚至有所扩大。

权益方面，股票年初受外汇市场动荡、外围风险偏好回落及熔断机制影响下跌幅度较大，之后市场悲观情绪有所修复，较长时间维持窄幅震荡格局。但由于年初下跌幅度较大，上半年上证综指、中小板指、创业板指分别下跌 17.22%、17.88%、17.92%。

本基金一季度成立，银行间账户开立期间主要进行存款投资。银行间账户开立后，缓慢建仓中

短期限资质优良的城投债、公用事业类债券和高等级信用债。二季度开始择机介入权益投资，权益对基金净值有较大提升。

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 1.008 元，本报告期份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年下半年等待经济下行拐点的信号。上半年支撑经济回暖的主要动力是基建和地产投资，对于基建投资的可持续性分歧不大。三季度市场关注的焦点将集中于地产投资能否持续，以及何时出现拐点。当前房地产销售数据已经开始出现回落，如果这是趋势性的拐点，那么未来一段时间内将再次引发地产库存堆积以及房地产投资的下降，为经济带来较大的下行压力。三季度随着蔬菜和猪肉价格对于通胀推动渐趋消散，通胀水平将会逐步下行，如果叠加上地产投资的下滑，经济可能将会再次面对较大的通缩压力。政策方面，今年以来经济改善和通胀上升约束了货币政策的进一步宽松可能，但是在经济下行风险仍然较大的背景下货币政策也很难转向紧缩，预计短期内仍将保持中性。货币政策仍然紧跟经济变化，货币政策空间的进一步打开需要观察到经济下行的拐点信号。期间汇率和资产价格可能会对货币政策形成阶段性的扰动。信用风险仍然较大，三季度到期量增加和债券市场风险偏好下行会导致风险较高的行业融资更加困难，这会进一步加剧信用风险的暴露和传染。同时供给侧改革和去产能的推进也带来了一定政策上的不确定性。

权益市场方面，考虑到国内基建和地产投资对于经济的支撑仍然存在，短期内经济快速下滑的概率较低。同时海外英国脱欧导致美联储加息推迟以及全球货币政策宽松预期再起，均有利于国内市场风险偏好修复，不过仍然需要关注外部市场风险发酵。

下半年组合仍将继续优化信用债资质结构，维持适度杠杆，利率债把握波段操作的机会。权益部分将密切关注市场风险偏好的变化，做好波段操作，力争以优异的业绩回报基金持有人。

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、固定收益总部、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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对易方达裕祥回报债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对易方达裕祥回报债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：易方达裕祥回报债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	3,607,583.83
结算备付金		522,744.95
存出保证金		23,483.03
交易性金融资产	6.4.7.2	661,731,360.73
其中：股票投资		78,065,071.67
基金投资		-
债券投资		583,666,289.06
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	10,740,657.58
应收股利		-
应收申购款		7,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		676,632,830.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 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		99,999,650.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		499.50
应付管理人报酬		204,105.43
应付托管费		51,026.35
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	83,941.60

应交税费		-
应付利息		31,307.88
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	159,067.11
负债合计		100,529,597.87
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	571,407,356.31
未分配利润	6.4.7.10	4,695,875.94
所有者权益合计		576,103,232.25
负债和所有者权益总计		676,632,830.12

注：1.本基金合同生效日为 2016 年 1 月 22 日，2016 年半年度实际报告期间为 2016 年 1 月 22 日至 2016 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.008 元，基金份额总额 571,407,356.31 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达裕祥回报债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		6,517,938.79
1.利息收入		10,747,262.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,693,218.60
债券利息收入		7,781,590.48
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		272,453.26
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,567,845.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,317,328.87
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	749,483.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,795,220.14
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	133,741.86
减：二、费用		2,021,183.08
1. 管理人报酬		1,171,176.29
2. 托管费		292,794.03
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	86,380.52
5. 利息支出		300,381.08
其中：卖出回购金融资产支出		300,381.08
6. 其他费用	6.4.7.19	170,451.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,496,755.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,496,755.71

注：本基金合同生效日为 2016 年 1 月 22 日，2016 年半年度实际报告期间为 2016 年 1 月 22 日至 2016 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达裕祥回报债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 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）	681,094,039.00	-	681,094,039.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,496,755.71	4,496,755.71
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）	-109,686,682.69	199,120.23	-109,487,562.46
其中：1.基金申购款	19,744,804.39	21,936.04	19,766,740.43
2.基金赎回款	-129,431,487.08	177,184.19	-129,254,302.89
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）	571,407,356.31	4,695,875.94	576,103,232.25

注：本基金合同生效日为 2016 年 1 月 22 日，2016 年半年度实际报告期间为 2016 年 1 月 22 日至 2016 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均

无同期对比数据。

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：

基金管理人负责人：刘晓艳，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

易方达裕祥回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]13 号《关于准予易方达裕祥回报债券型证券投资基金注册的批复》进行募集，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《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 681,094,039.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,942.02 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2016 年 1 月 19 日至 2016 年 1 月 20 日，募集金额总额为人民币 681,094,039.00 元，其中：有效净认购金额为人民币 681,081,096.98 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 12,942.02 元，经安永华明（2016）验字第 60468000_G02 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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》、《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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本报告期末的财务状况以及

本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2016 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余

成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基

金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购金融资产支出，按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (3) 每一基金份额享有同等分配权；
- (4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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。

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

个人所得税税率为 20%。

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个人所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	3,607,583.83
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	3,607,583.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	75,898,795.00	78,065,071.67	2,166,276.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	41,020,942.57	41,076,289.06
	银行间市场	547,606,843.30	542,590,000.00
	合计	588,627,785.87	583,666,289.06
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	664,526,580.87	661,731,360.73	-2,795,220.14

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	757.92
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	211.68
应收债券利息	10,739,678.44
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.54
合计	10,740,657.58

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	69,716.89
银行间市场应付交易费用	14,224.71
合计	83,941.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	158,667.11
其他应付款	400.00
合计	159,067.11

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	681,094,039.00	681,094,039.00
本期申购	19,744,804.39	19,744,804.39
本期赎回（以“-”号填列）	-129,431,487.08	-129,431,487.08
本期末	571,407,356.31	571,407,356.31

注：1. 本基金合同于2016年1月22日生效，基金合同生效日的基金份额总额为681,094,039.00份基金份额，其中认购资金利息折合12,942.02份基金份额。

2. 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,291,975.85	-2,795,220.14	4,496,755.71
本期基金份额交易产生的	-1,047,902.15	1,247,022.38	199,120.23

变动数			
其中：基金申购款	85,763.50	-63,827.46	21,936.04
基金赎回款	-1,133,665.65	1,310,849.84	177,184.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,244,073.70	-1,548,197.76	4,695,875.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
活期存款利息收入	238,632.56
定期存款利息收入	2,450,972.23
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,569.53
其他	44.28
合计	2,693,218.60

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	414,394,463.72
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	410,806,212.79
减：应收利息总额	5,905,579.80
买卖债券差价收入	-2,317,328.87

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	749,483.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	749,483.60

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-2,795,220.14
——股票投资	2,166,276.67
——债券投资	-4,961,496.81
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-2,795,220.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
基金赎回费收入	133,741.86
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	133,741.86

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
交易所市场交易费用	77,755.52
银行间市场交易费用	8,625.00
合计	86,380.52

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
审计费用	32,666.90
信息披露费	126,000.21
银行汇划费	11,384.05
其他	400.00
合计	170,451.16

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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)	基金托管人

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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,171,176.29
其中：支付销售机构的客户维护费	2,400.07

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	292,794.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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	
	2016年1月22日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	3,607,583.83	238,632.56

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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（2016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：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016-06-15	2016-07-01	新发流通	99.99	99.99	6,680	667,948.76	667,948.76	-

				受限						
13646 9	16 联 通 01	2016-0 6-07	2016-0 7-04	新发 流通 受限	100.00	100.00	300,00 0	30,000 ,000.0 0	30,000 ,000.0 0	-

6.4.12.2 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
30034 5	红宇新材	2016-06 -21	重大事项停牌	10.46	2016-0 7-19	11.46	658,500	6,701,144.43	6,887,910.00	-
00093 6	华西股份	2016-05 -24	重大事项停牌	8.22	2016-0 7-13	9.04	865,460	7,551,038.40	7,114,081.20	-

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 2016 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 99,999,650.00 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
1480037	14 普湾债	2016-07-12	108.59	500,000	54,295,000.00
160208	16 国开 08	2016-07-12	99.68	500,000	49,840,000.00
合计				1,000,000	104,135,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

本基金为债券型基金，理论上其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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 2016 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 87.42%。

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 2016年6月30日
A-1	30,140,432.88
A-1 以下	0.00
未评级	40,469,803.28
合计	70,610,236.16

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、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

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 2016年6月30日
AAA	207,235,041.73
AAA 以下	266,273,566.32
未评级	50,287,123.29
合计	523,795,731.34

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，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等债券资产，股票（含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、权证等权益类品种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，但须符合中国证监会相关规定。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 2016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	3,607,583.83	-	-	-	3,607,583.83
结算备付金	522,744.95	-	-	-	522,744.95
存出保证金	23,483.03	-	-	-	23,483.03
交易性金融资产	69,926,000.00	503,134,340.30	10,605,948.76	78,065,071.67	661,731,360.73
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	-	-	-	10,740,657.58	10,740,657.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,000.00	7,000.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	74,079,811.81	503,134,340.30	10,605,948.76	88,812,729.25	676,632,830.12
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	99,999,650.00	-	-	-	99,999,650.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	499.50	499.50
应付管理人报酬	-	-	-	204,105.43	204,105.43
应付托管费	-	-	-	51,026.35	51,026.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	83,941.60	83,941.60
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	31,307.88	31,307.88
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	159,067.11	159,067.11
负债总计	99,999,650.00	-	-	529,947.87	100,529,597.87
利率敏感度缺口	-25,919,838.19	503,134,340.30	10,605,948.76	88,282,781.38	576,103,232.25

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 2016年6月30日
	1.市场利率下降25个基点	3,496,116.99
	2.市场利率上升25个基点	-3,462,096.97

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 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	78,065,071.67	13.55
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	78,065,071.67	13.55

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 2016年6月30日
	1.业绩比较基准上升5%	4,461,394.39
	2.业绩比较基准下降5%	-4,461,394.39

注：股票投资部分业绩基准取上证 A 指。

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 65,149,369.53 元，属于第二层次的余额为 596,581,991.20 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)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。

(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	78,065,071.67	11.54
	其中：股票	78,065,071.67	11.54
2	固定收益投资	583,666,289.06	86.26
	其中：债券	583,666,289.06	86.26
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,130,328.78	0.61
7	其他各项资产	10,771,140.61	1.59
8	合计	676,632,830.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	56,600,697.67	9.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,828,568.00	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,378,785.00	0.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,257,021.00	1.95
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,065,071.67	13.55

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	002032	苏泊尔	395,147	13,612,814.15	2.36
2	600660	福耀玻璃	943,400	13,207,600.00	2.29
3	300407	凯发电气	628,672	12,453,992.32	2.16
4	600629	华建集团	590,300	11,257,021.00	1.95
5	000936	华西股份	865,460	7,114,081.20	1.23
6	300345	红宇新材	658,500	6,887,910.00	1.20
7	600029	南方航空	487,800	3,443,868.00	0.60
8	000089	深圳机场	398,200	3,384,700.00	0.59
9	300383	光环新网	89,150	3,378,785.00	0.59

10	300425	环能科技	105,000	3,324,300.00	0.58
----	--------	------	---------	--------------	------

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002032	苏泊尔	13,413,262.74	2.33
2	600660	福耀玻璃	13,386,455.30	2.32
3	600629	华建集团	10,811,379.93	1.88
4	300407	凯发电气	10,673,855.70	1.85
5	000936	华西股份	7,551,038.40	1.31
6	300345	红宇新材	6,701,144.43	1.16
7	000089	深圳机场	3,352,409.00	0.58
8	300383	光环新网	3,351,520.50	0.58
9	600029	南方航空	3,350,229.00	0.58
10	300425	环能科技	3,307,500.00	0.57

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票卖出交易。

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	75,898,795.00
卖出股票收入（成交）总额	-

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	-	-
3	金融债券	89,832,000.00	15.59
	其中：政策性金融债	89,832,000.00	15.59

4	企业债券	181,835,000.00	31.56
5	企业短期融资券	29,934,000.00	5.20
6	中期票据	280,979,000.00	48.77
7	可转债（可交换债）	1,086,289.06	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	583,666,289.06	101.31

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	1480073	14 唐山城投债	500,000	54,530,000.00	9.47
2	101454045	14 湘投 MTN001	500,000	54,460,000.00	9.45
3	1480037	14 普湾债	500,000	54,295,000.00	9.42
4	101456077	14 德泰 MTN001	500,000	53,310,000.00	9.25
5	101553003	15 五矿股 MTN001	500,000	50,370,000.00	8.74

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	23,483.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,740,657.58
5	应收申购款	7,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,771,140.61

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情 况说明
1	000936	华西股份	7,114,081.20	1.23	重大事项停 牌

2	300345	红宇新材	6,887,910.00	1.20	重大事项停牌
---	--------	------	--------------	------	--------

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 比例	持有份额	占总份额 比例
432	1,322,702.21	548,013,769.80	95.91%	23,393,586.51	4.09%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	14,375.81	0.0025%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 1 月 22 日）基金份额总额	681,094,039.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,744,804.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	129,431,487.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	571,407,356.31

注：本基金合同生效日为 2016 年 01 月 22 日。

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

本基金管理人于 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理。

自 2016 年 1 月起，上海浦东发展银行股份有限公司进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

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	
申万宏源	2	75,898,795.00	100.00%	69,716.89	100.00%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增申万宏源证券有限公司两个交易单元。

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
申万宏源	28,123,089.37	100.00%	351,000.00	100.00%	-	-

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	易方达裕祥回报债券型证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-23
2	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新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、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
3	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-29
4	易方达基金管理有限公司关于易方达裕祥回报债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-24
5	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
8	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
9	易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-02

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达裕祥回报债券型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达裕祥回报债券型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

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

二〇一六年八月二十四日