

易方达稳健收益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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42

§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达稳健收益债券型证券投资基金	
基金简称	易方达稳健收益债券	
基金主代码	110007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 1 月 29 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	7,038,111,060.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
下属分级基金的交易代码	110007	110008
报告期末下属分级基金的份额总额	2,073,346,625.79 份	4,964,764,435.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于债券品种，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、股票主动投资以及新股（含增发）申购之间的配置：1、主要基于对利率走势、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、基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等，预测新股申购的收益率以及风险；3、股票市场走势的预测；4、可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。
业绩比较基准	中债总指数（全价）
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低于混合型基金、股票型基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街1 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	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码	510620	100818
法定代表人	刘晓艳	田国立

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1日至2016年6月30日）	
	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
本期已实现收益	45,219,878.81	119,295,790.09
本期利润	-23,649,890.40	-22,204,245.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0094	-0.0036
本期加权平均净值利润率	-0.73%	-0.28%
本期基金份额净值增长率	0.18%	0.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
期末可供分配利润	236,484,815.52	594,655,421.64
期末可供分配基金份额利润	0.1141	0.1198
期末基金资产净值	2,723,506,701.99	6,552,085,929.38

期末基金份额净值	1.3136	1.3197
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
基金份额累计净值增长率	110.81%	116.34%

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

易方达稳健收益债券 A

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	1.25%	0.24%	0.44%	0.05%	0.81%	0.19%
过去三个月	0.80%	0.26%	-0.70%	0.08%	1.50%	0.18%
过去六个月	0.18%	0.36%	-0.44%	0.09%	0.62%	0.27%
过去一年	7.99%	0.35%	3.25%	0.10%	4.74%	0.25%
过去三年	52.92%	0.34%	5.43%	0.13%	47.49%	0.21%
自基金合同生效起至今	110.81%	0.30%	12.26%	0.13%	98.55%	0.17%

易方达稳健收益债券 B

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	1.27%	0.24%	0.44%	0.05%	0.83%	0.19%
过去三个月	0.88%	0.26%	-0.70%	0.08%	1.58%	0.18%
过去六个月	0.33%	0.36%	-0.44%	0.09%	0.77%	0.27%
过去一年	8.19%	0.35%	3.25%	0.10%	4.94%	0.25%
过去三年	54.32%	0.34%	5.43%	0.13%	48.89%	0.21%
自基金合同生效起至今	116.34%	0.30%	12.26%	0.13%	104.08%	0.17%

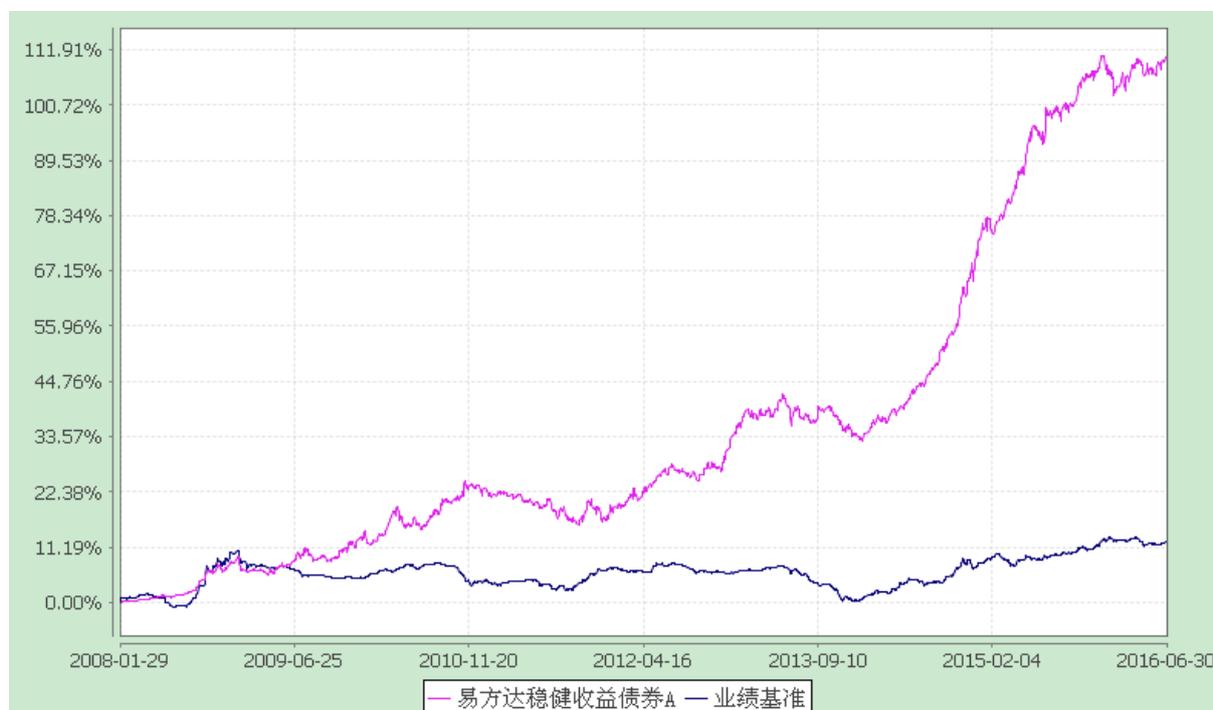
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达稳健收益债券型证券投资基金

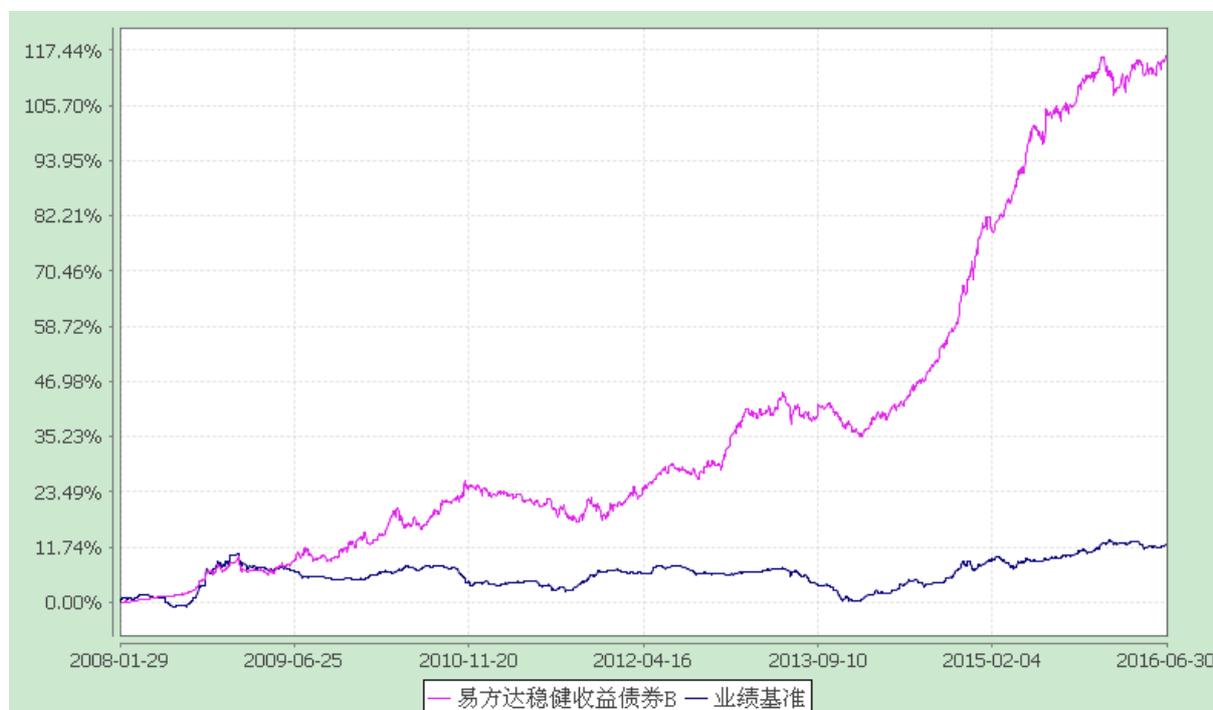
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008 年 1 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日)

易方达稳健收益债券 A



易方达稳健收益债券 B



注：1.本基金转型日期为 2008 年 1 月 29 日。

2.自基金转型至报告期末，A 级基金份额净值增长率为 110.81%，B 级基金份额净值增长率为

116.34%，同期业绩比较基准收益率为 12.26%。

§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		
胡剑	本基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、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	2012-02-29	-	10 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理。

	基金经理、固定收益研究部 总经理				
纪玲云	本基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理	2015-02-17	-	7 年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理兼固定收益研究员。
苏宁	本基金的基金经理助理、易方达信用债债券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	2015-02-17	-	5 年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司交易员、研究员。
轩璇	本基金的基金经理助理、易方达信用债债券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	2015-02-17	-	4 年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究员。
李一硕	本基金的基金经理助理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理	2015-02-17	-	8 年	硕士研究生,曾任瑞银证券有限公司任研究员,中国国际金融有限公司研究员,易方达基金管理有限公司研究员。

	助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理、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				
--	--	--	--	--	--

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 年上半年基本面呈现一季度回升后 4、5 月份小幅回落的走势。工业同比在 3 月份冲高至 6.8%后，4、5 月份回落至 6%附近，6 月份小幅超出市场预期，同比增长 6.2%。结构上，房地产和基建投资主导了本轮基本面的波动，民间投资数据持续大幅下滑，显示一季度来自房地产和基建的投资回升对实体经济的传导效果非常差。4 月份以来房地产投资数据的下滑使得市场对本轮经济回暖的可持续性偏于悲观。

市场方面，债券市场收益率在一季度以陡峭化上行为主，4 月份上行速度加快，5、6 月份基本回落至前期低点。信用债券则在一季度呈现利差持续缩窄的行情。4、5 月份受“铁物资”、“东特钢”等风险事件的影响，风险偏好情绪降至冰点，一级市场新券大量取消发行，信用利差快速回升。这种极度风险厌恶的情绪自 5 月下旬开始有所好转，高资质和城投品种的利差回落，截至 6 月底基本回落至前期低点。但市场的买盘仍集中在城投、高等级品种和行业龙头企业上，过剩产能行业的买盘依然非常有限。

权益方面，受美联储加息、外汇流出等因素影响，市场在年初出现一波较为明显的下跌，2 月份以后逐步稳定并在低位徘徊，不过较多行业基本面得到修复的公司股价创出新高，走出了一轮较为清晰的结构行情。

操作上，考虑到今年以来风险因素的叠加，组合保持了相对灵活的仓位。利率债方面，本组合在一季度主动降低久期并于 5 月初开始加仓利率品种，获得较好的利率波段收益。信用债券方面坚持以 2014 年以前的城投为配置品种，避免信用风险的同时，获得相对较高的静态收益。权益方面组合逐步在市场底部加仓，选择了一些具备安全边际且行业基本面有望修复的行业进行布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 级基金份额净值为 1.3136 元，本报告期份额净值增长率为 0.18%；B 级基金份额净值为 1.3197 元，本报告期份额净值增长率为 0.33%；同期业绩比较基准收益率为-0.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中期我们维持经济处于结构转型带来的下滑通道中的观点，期间可能出现阶段性托底延缓下滑速度，但这种托底也同时延长了下滑出清的时间。收益率在此过程中易下难上。

短期来看，考虑到政策面托底更加依赖于积极财政，货币方面通过基建放贷款的方式也更加简单直接，货币政策只有在基本面再次大幅下行的情况下才可能出现降准、降低回购利率等积极信号。而从短期的经济走势来看，基建投资有望维持，房地产投资虽有回落但仍然在相对较好的水平，对基本面的支撑仍有望维持。因此从大概率的情况来看，货币中性和经济企稳后略有回落的趋势仍将延续。

从收益率的情况来看，由于市场预期在未来某个时点地产投资的回落终将拖累经济，而基建也受制于财政空间和地方政府的预算约束，基本面可能在某一时点出现意外回落。从政策面的表态来看，基本面依靠稳增长持续上行的概率也不大，收益率向上风险有限。因此在目前的时点，综合风险收益的情况，即使经济基本面没有立即出现下滑，市场可能也会在一定程度上反映未来下滑的预期，推动收益率的下行。英国“脱欧公投”后收益率的大幅下行可能反映了这种需求。在基本面没有明显变化的情况下，收益率下行之后估值调整压力增加。

信用债券方面，三季度仍面临较多的不确定性，信用分化仍将继续。信用市场仍面临大量的短期融资券到期，另外 7、8 月份适逢评级跟踪的密集发布期，过剩产能行业的个券可能面临较多向下调整的压力。在此环境下，信用风险溢价难以出现明显恢复。不过高资质品种和城投等流动性溢价主导的利差有望跟随利率债出现下行，且风险偏好下降带来的结构性需求也将流动性利差压制在较低水平，甚至进一步收窄。

权益市场结构性行情仍将延续，整体具备安全边际的低估值蓝筹的风险较小，着力寻找基本面有所修复的行业配置依然是后期投资需要关注的重点。

实际操作中，本组合会继续关注微观实体经济的情况，等待货币政策和基本面出现拐点的时点，在此之前进行一些波段操作。信用债券方面，仍然以城投为主要配置品种，及时调整组合仓位，保持较好的灵活性。权益方面坚持价值理念，关注安全边际的变化，把握基本面走势，力争获取结构性行情的超额收益机会。

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

易方达稳健收益债券 A：本报告期内实施的利润分配金额为 600,314,037.40 元。

易方达稳健收益债券 B：本报告期内实施的利润分配金额为 1,232,889,545.93 元。

§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”）在易方达稳健收益债券型证券投资基金（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：易方达稳健收益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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	32,286,828.27	107,442,808.45
结算备付金		45,573,764.56	148,283,593.60
存出保证金		964,240.64	1,674,980.54
交易性金融资产	6.4.7.2	10,743,295,257.83	17,075,559,595.99
其中：股票投资		1,788,621,936.20	1,561,301,528.52
基金投资		-	-
债券投资		8,954,673,321.63	15,514,258,067.47
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		-	5,712,509.29
应收利息	6.4.7.5	155,423,467.10	259,976,617.73
应收股利		-	-
应收申购款		4,872,382.31	51,773,185.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	2,984.20	2,984.20
资产总计		10,982,418,924.91	17,650,426,274.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		1,657,428,425.83	3,751,998,255.50
应付证券清算款		1,108,189.33	-
应付赎回款		39,082,968.84	150,466,503.23
应付管理人报酬		4,535,163.57	5,840,711.31
应付托管费		1,511,721.17	1,946,903.77

应付销售服务费		679,751.66	1,074,209.57
应付交易费用	6.4.7.7	909,694.88	1,439,378.78
应交税费		976,646.00	976,646.00
应付利息		140,794.80	283,716.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	452,937.46	640,818.72
负债合计		1,706,826,293.54	3,914,667,143.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,038,111,060.86	9,072,802,436.01
未分配利润	6.4.7.10	2,237,481,570.51	4,662,956,695.28
所有者权益合计		9,275,592,631.37	13,735,759,131.29
负债和所有者权益总计		10,982,418,924.91	17,650,426,274.81

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，A 级基金份额净值 1.3136 元，B 级基金份额净值 1.3197 元；基金份额总额 7,038,111,060.86 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 级基金份额总额 2,073,346,625.79 份，B 级基金份额总额 4,964,764,435.07 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 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 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		58,064,194.05	333,671,051.22
1.利息收入		291,956,726.69	94,050,698.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,632,260.01	458,308.42
债券利息收入		290,315,797.50	93,476,668.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,669.18	115,721.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,807,632.87	277,604,473.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-105,446,945.43	185,311,421.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	66,415,286.43	90,925,247.13
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	11,224,026.13	1,367,805.12

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-210,369,805.16	-41,103,914.80
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	4,284,905.39	3,119,793.88
减：二、费用		103,918,330.31	28,231,075.71
1. 管理人报酬		33,653,310.01	8,100,640.01
2. 托管费		11,217,769.92	2,700,213.39
3. 销售服务费		4,861,410.60	1,664,709.81
4. 交易费用	6.4.7.18	3,392,211.84	2,102,216.96
5. 利息支出		50,528,171.45	13,417,018.58
其中：卖出回购金融资产支出		50,528,171.45	13,417,018.58
6. 其他费用	6.4.7.19	265,456.49	246,276.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,854,136.26	305,439,975.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,854,136.26	305,439,975.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	9,072,802,436.01	4,662,956,695.28	13,735,759,131.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-45,854,136.26	-45,854,136.26
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）	-2,034,691,375.15	-546,417,405.18	-2,581,108,780.33
其中：1.基金申购款	5,612,555,016.76	1,685,455,075.77	7,298,010,092.53
2.基金赎回款	-7,647,246,391.91	-2,231,872,480.95	-9,879,118,872.86
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）	-	-1,833,203,583.33	-1,833,203,583.33
五、期末所有者权益（基金净值）	7,038,111,060.86	2,237,481,570.51	9,275,592,631.37
项目	上年度可比期间		

	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,464,032,307.06	513,543,206.43	1,977,575,513.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	305,439,975.51	305,439,975.51
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）	844,701,235.74	272,057,127.61	1,116,758,363.35
其中：1.基金申购款	3,023,429,149.26	1,014,531,878.86	4,037,961,028.12
2.基金赎回款	-2,178,727,913.52	-742,474,751.25	-2,921,202,664.77
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）	-	-158,462,454.06	-158,462,454.06
五、期末所有者权益（基金净值）	2,308,733,542.80	932,577,855.49	3,241,311,398.29

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

易方达稳健收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据原易方达月月收益中短期债券投资基金(以下简称“原易方达月月收益基金”)基金份额持有人大会 2007 年 12 月 21 日审议通过的《关于易方达月月收益中短期债券投资基金转型的议案》及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[2008]101 号《关于核准易方达月月收益中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》核准，由原易方达月月收益基金转型而来。

根据《易方达月月收益中短期债券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致并经中国证监会核准，基金管理人易方达基金管理有限公司将《易方达月月收益中短期债券投资基金基金合同》修订为《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》。《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》自 2008 年 1 月 29 日起生效，原《易方达月月收益中短期债券投资基金基金合同》同日失效。

本基金自 2008 年 1 月 29 日起，根据申购费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为

不同的级别。不收取申购费用、收取销售服务费的基金份额等级称为 A 级；收取申购费用、不收取销售服务费的基金份额等级称为 B 级。本基金 A 级、B 级两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 级基金份额和 B 级基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该级别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一级别的基金份额，但各等级别基金份额之间不能相互转换。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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,股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司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,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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	32,286,828.27
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	32,286,828.27

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	1,787,241,332.11	1,788,621,936.20	1,380,604.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,370,677,429.37	1,370,235,021.63	-442,407.74
	银行间市场	7,472,524,693.31	7,584,438,300.00	111,913,606.69
	合计	8,843,202,122.68	8,954,673,321.63	111,471,198.95
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	10,630,443,454.79	10,743,295,257.83	112,851,803.04
----	-------------------	-------------------	----------------

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	3,622.20
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	18,457.38
应收债券利息	155,400,997.01
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	390.51
合计	155,423,467.10

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	2,984.20
待摊费用	-
合计	2,984.20

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	746,128.39
银行间市场应付交易费用	163,566.49
合计	909,694.88

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	250,000.00
应付赎回费	9,003.72
预提费用	193,933.74
合计	452,937.46

6.4.7.9 实收基金**易方达稳健收益债券 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,986,039,052.22	2,986,039,052.22
本期申购	964,903,440.48	964,903,440.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,877,595,866.91	-1,877,595,866.91
本期末	2,073,346,625.79	2,073,346,625.79

易方达稳健收益债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,086,763,383.79	6,086,763,383.79
本期申购	4,647,651,576.28	4,647,651,576.28
本期赎回（以“-”号填列）	-5,769,650,525.00	-5,769,650,525.00
本期末	4,964,764,435.07	4,964,764,435.07

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**易方达稳健收益债券 A**

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	886,403,192.89	640,067,981.65	1,526,471,174.54
本期利润	45,219,878.81	-68,869,769.21	-23,649,890.40

本期基金份额交易产生的变动数	-94,824,218.78	-157,522,951.76	-252,347,170.54
其中：基金申购款	103,373,121.13	183,709,845.89	287,082,967.02
基金赎回款	-198,197,339.91	-341,232,797.65	-539,430,137.56
本期已分配利润	-600,314,037.40	-	-600,314,037.40
本期末	236,484,815.52	413,675,260.68	650,160,076.20

易方达稳健收益债券 B

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	1,829,070,951.81	1,307,414,568.93	3,136,485,520.74
本期利润	119,295,790.09	-141,500,035.95	-22,204,245.86
本期基金份额交易产生的变动数	-120,821,774.33	-173,248,460.31	-294,070,234.64
其中：基金申购款	516,629,085.27	881,743,023.48	1,398,372,108.75
基金赎回款	-637,450,859.60	-1,054,991,483.79	-1,692,442,343.39
本期已分配利润	-1,232,889,545.93	-	-1,232,889,545.93
本期末	594,655,421.64	992,666,072.67	1,587,321,494.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	400,515.41
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,212,869.05
其他	18,875.55
合计	1,632,260.01

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	927,597,212.16
减：卖出股票成本总额	1,033,044,157.59
买卖股票差价收入	-105,446,945.43

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1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	19,919,302,457.35

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,569,666,476.62
减：应收利息总额	283,220,694.30
买卖债券差价收入	66,415,286.43

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1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,224,026.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,224,026.13

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1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-210,369,805.16
——股票投资	-61,467,275.88
——债券投资	-148,902,529.28
——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	-210,369,805.16

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	4,284,905.39
其他	-
合计	4,284,905.39

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	3,219,681.84
银行间市场交易费用	172,530.00

合计	3,392,211.84
----	--------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	52,722.75
银行间账户维护费	18,000.00
其他	800.00
合计	265,456.49

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。

6.4.10 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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,653,310.01	8,100,640.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,875,831.63	802,502.60

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以 0.6% 的管理费率来计算，具体计算方法如下：

每日应付的基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次日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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,217,769.92	2,700,213.39

注：本基金的托管费按该基金前一日资产净值乘以 0.2% 的托管费率来计算。计算方法如下：

每日应支付的基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次日从基金资产中一次性支付给基金托管人。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B	合计
易方达基金管理有限公司	2,333,321.70	-	2,333,321.70
中国银行	320,497.69	-	320,497.69
广发证券	20,098.78	-	20,098.78
合计	2,673,918.17	-	2,673,918.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达稳健收益债券A	易方达稳健收益债券B	合计
易方达基金管理有限公司	894,552.65	-	894,552.65
中国银行	156,746.88	-	156,746.88
广发证券	8,109.45	-	8,109.45
合计	1,059,408.98	-	1,059,408.98

注：本基金 A 级基金份额的销售服务年费率为 0.30%，B 级基金份额不计提销售服务费。A 级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

每日应支付的 A 级基金销售服务费 = 前一日 A 级基金份额的基金资产净值 × R ÷ 当年天数

R 为 A 级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付给基金销售机构，于次月前两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 2016年1月1日至2016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	-	-	-	-	1,199,350,000.00	68,889.30
上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	51,135,050.55	71,506,350.68	-	-	1,859,300,000.00	270,592.33

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 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

易方达稳健收益债券 A

无。

易方达稳健收益债券 B

份额单位：份

关联方名称	易方达稳健收益债券B本期末 2016年6月30日		易方达稳健收益债券B上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
广发证券	-	-	131,942,868.45	2.17%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	32,286,828.27	400,515.41	180,870,960.67	127,687.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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

金额单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券	1680038	16 普兰店债	分销	300,000	30,000,000.00
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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

易方达稳健收益债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2016-01-04	-	2016-01-04	2.000	393,318,766. 48	206,995,270. 92	600,314,037. 40	-
合计				2.000	393,318,766. 48	206,995,270. 92	600,314,037. 40	-

易方达稳健收益债券 B

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2016-01-04	-	2016-01-04	2.000	929,843,849. 40	303,045,696. 53	1,232,889,54 5.93	-
合计				2.000	929,843,849. 40	303,045,696. 53	1,232,889,54 5.93	-

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：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

00231 2	三泰 控股	2015-1 1-16	2016-1 1-17	非公 开发 行流 通受 限	20.18	18.95	2,480, 000	50,046 ,400.0 0	46,996 ,000.0 0	-
6.4.12.1.2 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
12700 3	海印 转债	2016-0 6-15	2016-0 7-01	新发 流 通 受 限	99.99	99.99	8,860	885,93 2.03	885,93 2.03	-
13646 9	16 联 通 01	2016-0 6-07	2016-0 7-04	新发 流 通 受 限	100.00	100.00	400,00 0	40,000 ,000.0 0	40,000 ,000.0 0	-
13647 0	16 联 通 02	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	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期。

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
00065 1	格力电 器	2016-02 -22	重大事 项停牌	22.07	-	-	2,580,363	45,562,522.74	56,948,611.4 1	-
60000 5	武钢股 份	2016-06 -27	重大事 项停牌	2.76	-	-	20,754,012	75,515,146.12	57,281,073.1 2	-
60001 9	宝钢股 份	2016-06 -27	重大事 项停牌	4.90	-	-	24,979,857	145,017,244.2 6	122,401,299. 30	-

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 1,268,428,425.83 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
150011	15 付息国债 11	2016-07-01	101.68	2,000,000	203,360,000.00

150212	15 国开 12	2016-07-01	101.25	3,200,000	324,000,000.00
160206	16 国开 06	2016-07-01	99.88	2,720,000	271,673,600.00
160210	16 国开 10	2016-07-01	99.95	5,050,000	504,747,500.00
合计				12,970,000	1,303,781,100.00

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 389,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日（先后）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。

6.4.13 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。

本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金在日常经营活动中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 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 62.92%(2015 年 12 月 31 日：76.78%)。

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	上年度末 2015年12月31日
A-1	30,783,531.15	2,290,395,736.61
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	539,846,338.80	3,898,680,504.43
合计	570,629,869.95	6,189,076,241.04

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 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	上年度末 2015年12月31日
AAA	687,129,106.19	577,227,679.90
AAA 以下	5,047,025,520.90	4,316,009,939.67
未评级	2,805,289,821.60	4,691,843,148.34
合计	8,539,444,448.69	9,585,080,767.91

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、金融债、央行票据、企业债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购等固定收益品种，银行存款、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。本基金所持大部分证券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 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	32,286,828.27	-	-	-	32,286,828.27
结算备付金	45,573,764.56	-	-	-	45,573,764.56

存出保证金	964,240.64	-	-	-	964,240.64
交易性金融资产	620,298,200.00	5,195,492,061.90	3,138,883,059.73	1,788,621,936.20	10,743,295,257.83
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	-	-	-	155,423,467.10	155,423,467.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,872,382.31	4,872,382.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,984.20	2,984.20
资产总计	699,123,033.47	5,195,492,061.90	3,138,883,059.73	1,948,920,769.81	10,982,418,924.91
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	1,657,428,425.83	-	-	-	1,657,428,425.83
应付证券清算款	-	-	-	1,108,189.33	1,108,189.33
应付赎回款	-	-	-	39,082,968.84	39,082,968.84
应付管理人报酬	-	-	-	4,535,163.57	4,535,163.57
应付托管费	-	-	-	1,511,721.17	1,511,721.17
应付销售服务费	-	-	-	679,751.66	679,751.66
应付交易费用	-	-	-	909,694.88	909,694.88
应交税费	-	-	-	976,646.00	976,646.00
应付利息	-	-	-	140,794.80	140,794.80
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	452,937.46	452,937.46
负债总计	1,657,428,425.83	-	-	49,397,867.71	1,706,826,293.54
利率敏感度缺口	-958,305,392.36	5,195,492,061.90	3,138,883,059.73	1,899,522,902.10	9,275,592,631.37
上年度末 2015 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	107,442,808.45	-	-	-	107,442,808.45
结算备付金	148,283,593.60	-	-	-	148,283,593.60
存出保证金	1,674,980.54	-	-	-	1,674,980.54
交易性金融资产	6,203,316,550.00	5,118,820,356.20	4,192,121,161.27	1,561,301,528.52	17,075,559,595.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,712,509.29	5,712,509.29
应收利息	-	-	-	259,976,617.73	259,976,617.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	51,773,185.01	51,773,185.01
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,984.20	2,984.20
资产总计	6,460,717,932.59	5,118,820,356.20	4,192,121,161.27	1,878,766,824.75	17,650,426,274.81
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	3,751,998,255.50	-	-	-	3,751,998,255.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	150,466,503.23	150,466,503.23
应付管理人报酬	-	-	-	5,840,711.31	5,840,711.31
应付托管费	-	-	-	1,946,903.77	1,946,903.77
应付销售服务费	-	-	-	1,074,209.57	1,074,209.57
应付交易费用	-	-	-	1,439,378.78	1,439,378.78
应交税费	-	-	-	976,646.00	976,646.00
应付利息	-	-	-	283,716.64	283,716.64
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	640,818.72	640,818.72
负债总计	3,751,998,255.50	-	-	162,668,888.02	3,914,667,143.52

利率敏感度缺口	2,708,719,677.09	5,118,820,356.20	4,192,121,161.27	1,716,097,936.73	13,735,759,131.29
---------	------------------	------------------	------------------	------------------	-------------------

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	上年度末 2015年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	77,633,742.91	104,207,743.06
	2.市场利率上升25个基点	-76,338,541.07	-102,573,635.74

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		上年度末 2015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	1,788,621,936.20	19.28	1,561,301,528.52	11.37
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	1,788,621,936.20	19.28	1,561,301,528.52	11.37

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	上年度末 2015年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	97,990,699.52	85,667,124.49
	2.业绩比较基准下降 5%	-97,990,699.52	-85,667,124.49

注：股票投资业绩基准取上证 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 1,520,543,028.80 元，属于第二层次的余额为 9,222,752,229.03 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,509,303,092.79 元，第二层次 15,566,256,503.20 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(2015 年 12 月 31 日:同)。

(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	1,788,621,936.20	16.29
	其中:股票	1,788,621,936.20	16.29
2	固定收益投资	8,954,673,321.63	81.54
	其中:债券	8,954,673,321.63	81.54
	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	77,860,592.83	0.71
7	其他各项资产	161,263,074.25	1.47
8	合计	10,982,418,924.91	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	39,789,600.00	0.43
C	制造业	1,150,791,398.29	12.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	200,267,870.64	2.16
F	批发和零售业	69,906,713.94	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	299,831,450.01	3.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	28,034,903.32	0.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,788,621,936.20	19.28

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	600519	贵州茅台	650,093	189,775,148.56	2.05
2	002375	亚厦股份	16,613,388	187,731,284.40	2.02
3	600115	东方航空	22,911,482	151,444,896.02	1.63
4	000858	五粮液	3,831,361	124,634,173.33	1.34

5	600019	宝钢股份	24,979,857	122,401,299.30	1.32
6	601111	中国国航	16,509,658	111,605,288.08	1.20
7	000333	美的集团	4,462,970	105,861,648.40	1.14
8	600887	伊利股份	4,313,114	71,899,610.38	0.78
9	600005	武钢股份	20,754,012	57,281,073.12	0.62
10	000651	格力电器	2,580,363	56,948,611.41	0.61
11	300068	南都电源	2,490,594	54,444,384.84	0.59
12	002312	三泰控股	2,869,904	54,384,680.80	0.59
13	601012	隆基股份	3,479,863	45,412,212.15	0.49
14	000786	北新建材	4,991,509	45,322,901.72	0.49
15	300195	长荣股份	2,386,360	44,266,978.00	0.48
16	600489	中金黄金	3,540,000	39,789,600.00	0.43
17	600221	海南航空	11,602,923	36,781,265.91	0.40
18	600694	大商股份	799,863	30,810,722.76	0.33
19	600340	华夏幸福	1,149,914	28,034,903.32	0.30
20	002092	中泰化学	2,799,950	23,687,577.00	0.26
21	600703	三安光电	1,131,350	22,593,059.50	0.24
22	000418	小天鹅 A	461,504	15,054,260.48	0.16
23	002271	东方雨虹	868,098	14,957,328.54	0.16
24	600686	金龙汽车	999,915	14,728,747.95	0.16
25	600585	海螺水泥	999,936	14,539,069.44	0.16
26	600660	福耀玻璃	999,998	13,999,972.00	0.15
27	002035	华帝股份	541,991	13,267,939.68	0.14
28	000501	鄂武商 A	824,444	12,935,526.36	0.14
29	000759	中百集团	1,696,300	11,721,433.00	0.13
30	002572	索菲亚	199,970	11,202,319.40	0.12
31	000059	华锦股份	1,200,000	11,160,000.00	0.12
32	600496	精工钢构	2,065,093	8,797,296.18	0.09
33	601933	永辉超市	2,059,814	8,507,031.82	0.09
34	600535	天士力	199,950	7,150,212.00	0.08
35	000568	泸州老窖	200,000	5,940,000.00	0.06
36	600697	欧亚集团	200,000	5,932,000.00	0.06
37	600812	华北制药	948,779	5,891,917.59	0.06
38	000959	首钢股份	1,077,371	3,986,272.70	0.04
39	600477	杭萧钢构	548,283	3,739,290.06	0.04

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	600115	东方航空	176,739,043.19	1.29
2	601111	中国国航	129,464,383.90	0.94
3	002375	亚厦股份	123,883,083.40	0.90
4	600519	贵州茅台	115,294,700.70	0.84
5	000333	美的集团	102,994,163.78	0.75
6	000858	五 粮 液	92,947,384.51	0.68
7	000959	首钢股份	69,215,139.42	0.50
8	600019	宝钢股份	68,100,107.59	0.50
9	600887	伊利股份	56,822,440.49	0.41
10	600496	精工钢构	44,224,095.47	0.32
11	300068	南都电源	41,226,458.40	0.30
12	000786	北新建材	41,023,482.93	0.30
13	600221	海南航空	39,431,007.84	0.29
14	600489	中金黄金	38,570,276.71	0.28
15	601012	隆基股份	32,415,687.32	0.24
16	600010	包钢股份	30,335,090.69	0.22
17	300195	长荣股份	25,721,072.11	0.19
18	002092	中泰化学	22,054,572.00	0.16
19	000418	小天鹅 A	19,991,909.94	0.15
20	600005	武钢股份	19,915,611.29	0.14

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	601012	隆基股份	90,539,431.12	0.66
2	601111	中国国航	88,905,004.04	0.65
3	600496	精工钢构	79,201,852.83	0.58
4	600115	东方航空	68,531,977.09	0.50
5	000959	首钢股份	65,318,526.50	0.48
6	600019	宝钢股份	62,356,639.70	0.45
7	601398	工商银行	42,251,165.98	0.31
8	300127	银河磁体	38,099,933.28	0.28
9	601009	南京银行	38,086,301.93	0.28
10	000786	北新建材	35,201,135.44	0.26
11	000792	盐湖股份	31,321,872.36	0.23
12	600010	包钢股份	29,597,095.46	0.22
13	000722	湖南发展	27,157,768.54	0.20
14	002035	华帝股份	26,859,625.98	0.20
15	000858	五 粮 液	26,632,938.50	0.19

16	600477	杭萧钢构	20,643,532.96	0.15
17	000550	江铃汽车	19,716,455.94	0.14
18	600377	宁沪高速	18,792,461.01	0.14
19	002375	亚厦股份	16,124,323.05	0.12
20	600812	华北制药	16,073,248.36	0.12

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	1,321,831,841.15
卖出股票收入（成交）总额	927,597,212.16

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	506,839,000.00	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,738,992,000.00	29.53
	其中：政策性金融债	2,738,992,000.00	29.53
4	企业债券	5,161,983,543.60	55.65
5	企业短期融资券	100,233,000.00	1.08
6	中期票据	421,671,000.00	4.55
7	可转债（可交换债）	24,954,778.03	0.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,954,673,321.63	96.54

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	160210	16 国开 10	11,400,000	1,139,430,000.00	12.28
2	160206	16 国开 06	5,000,000	499,400,000.00	5.38
3	150212	15 国开 12	3,200,000	324,000,000.00	3.49
4	150011	15 付息国债 11	2,700,000	274,536,000.00	2.96
5	160418	16 农发 18	2,200,000	225,170,000.00	2.43

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	964,240.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	155,423,467.10
5	应收申购款	4,872,382.31
6	其他应收款	2,984.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,263,074.25

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	600019	宝钢股份	122,401,299.30	1.32	重大事项停 牌
2	600005	武钢股份	57,281,073.12	0.62	重大事项停 牌
3	000651	格力电器	56,948,611.41	0.61	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

份额级别	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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
易方达稳健收益 债券 A	37,946	54,639.40	792,338,589.15	38.22%	1,281,008,036. 64	61.78%
易方达稳健收益 债券 B	27,680	179,362.88	4,310,522,246. 64	86.82%	654,242,188.43	13.18%
合计	65,626	107,245.77	5,102,860,835. 79	72.50%	1,935,250,225. 07	27.50%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达稳健收益债券 A	406,794.38	0.0196%
	易方达稳健收益债券 B	31,608.89	0.0006%
	合计	438,403.27	0.0062%

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	份额级别	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	易方达稳健收益债券 A	0
	易方达稳健收益债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	易方达稳健收益债券 A	0
	易方达稳健收益债券 B	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
基金合同生效日（2008 年 1 月 29 日）基金份额总额	297,851,306.81	384,810,820.32
本报告期期初基金份额总额	2,986,039,052.22	6,086,763,383.79
本报告期基金总申购份额	964,903,440.48	4,647,651,576.28
减：本报告期基金总赎回份额	1,877,595,866.91	5,769,650,525.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,073,346,625.79	4,964,764,435.07

§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。

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	1,355,798,441.70	60.36%	1,262,660.18	60.36%	-
平安证券	1	890,271,811.61	39.64%	829,109.80	39.64%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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；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	1,031,152,718.05	99.93%	140,132,000,000.00	99.96%	-	-
平安证券	747,844.00	0.07%	50,000,000.00	0.04%	-	-

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因指数熔断调	基金管理人网站	2016-01-04

	整旗下部分基金开放时间的公告		
2	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东海期货为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-11
4	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-14
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-20
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加昆仑银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-26
7	易方达基金管理有限公司关于旗下基金认购 2016 年普兰店市建设投资有限公司公司债券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-27
8	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经北证为销售机构、参加中经北证申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	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
9	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证金牛为销售机构、参加中证金牛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	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
10	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
11	易方达稳健收益债券型证券投资基金春节前两个工作日在直销中心暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-03
12	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-26
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广东南粤银行为销售机构、参加广东南粤银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-04
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富济财富为销售机构、参加富济财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-08
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加青岛农商银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-09
16	易方达基金管理有限公司关于在大同证券推	中国证券报、上海证券	2016-03-10

	出旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加厦门银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-21
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德州银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-23
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加同花顺费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
20	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、证券时报及基金管理人网站	2016-03-30
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加微众银行为销售机构、参加微众银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-07
22	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、证券时报及基金管理人网站	2016-04-07
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-07
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江泰隆商业银行为销售机构、参加浙江泰隆商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
26	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正达广为销售机构、参加中正达广申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加锦州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-28
29	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
30	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

		人网站	
31	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
32	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-04
33	易方达基金管理有限公司关于官方淘宝店关闭服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
34	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
35	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加云南红塔银行为销售机构、参加云南红塔银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-09
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加民生银行直销银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-13
37	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加徽商期货为销售机构、参加徽商期货申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-18
38	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-19
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大智慧为销售机构、参加大智慧申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
41	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
42	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加川财证券为销售机构、参加川财证券申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-27
43	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大连银行为销售机构、参加大连银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-31
44	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金为销售机构、参加鼎信汇金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01
45	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2016-06-20

	式基金参加鑫鼎盛费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
46	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加余杭农村商业银行销售机构、参加余杭农村商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-23
47	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、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与深圳新兰德申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30
49	易方达基金管理有限公司关于在官方京东店开展基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30

§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月月收益中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议的批复；
2. 《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达稳健收益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. 中国证监会批准易方达月月收益中短期债券投资基金募集的文件；
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

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。

二〇一六年八月二十四日