

# 易方达信用债债券型证券投资基金

## 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月三十一日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	易方达信用债债券	
基金主代码	000032	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 4 月 24 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,232,343,500.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C
下属分级基金的交易代码	000032	000033
报告期末下属分级基金的份额总额	1,034,636,603.15 份	197,706,897.04 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于信用债券，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取积极管理的投资策略，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，确定和动态调整信用债券、非信用债券和银行存款等资产类别的配置比例；自上而下地决定债券组合久期及类属配置；同时在严谨深入的信用分析的基础上，自下而上地精选个券，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债-信用债总指数
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	郭明

负责人	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年		2015 年		2014 年	
	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C
本期已实现收益	109,773,044.14	25,830,272.87	43,643,480.69	25,580,783.88	28,246,332.22	44,658,619.96
本期利润	56,770,527.07	10,081,126.39	78,802,633.10	46,081,466.75	39,627,323.28	67,027,512.23
加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.0250	0.1286	0.1161	0.1025	0.1117
本期基金份额净值增长率	3.04%	2.56%	12.75%	12.27%	9.71%	9.21%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.1759	0.1564	0.1050	0.0916	0.0292	0.0212

期末基金资产净值	1,263,281,035.98	237,519,077.45	1,696,835,557.39	617,443,909.03	495,029,414.68	273,862,998.05
期末基金份额净值	1.221	1.201	1.185	1.171	1.051	1.043

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 易方达信用债债券 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
过去三个月	-1.13%	0.10%	-2.74%	0.12%	1.61%	-0.02%
过去六个月	1.16%	0.09%	-1.92%	0.09%	3.08%	0.00%
过去一年	3.04%	0.08%	-2.45%	0.08%	5.49%	0.00%
过去三年	27.45%	0.12%	7.55%	0.08%	19.90%	0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.10%	0.12%	4.02%	0.08%	18.08%	0.04%

##### 易方达信用债债券 C

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
过去三个月	-1.31%	0.10%	-2.74%	0.12%	1.43%	-0.02%
过去六个月	0.92%	0.08%	-1.92%	0.09%	2.84%	-0.01%
过去一年	2.56%	0.08%	-2.45%	0.08%	5.01%	0.00%
过去三年	25.76%	0.12%	7.55%	0.08%	18.21%	0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.10%	0.12%	4.02%	0.08%	16.08%	0.04%

#### 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

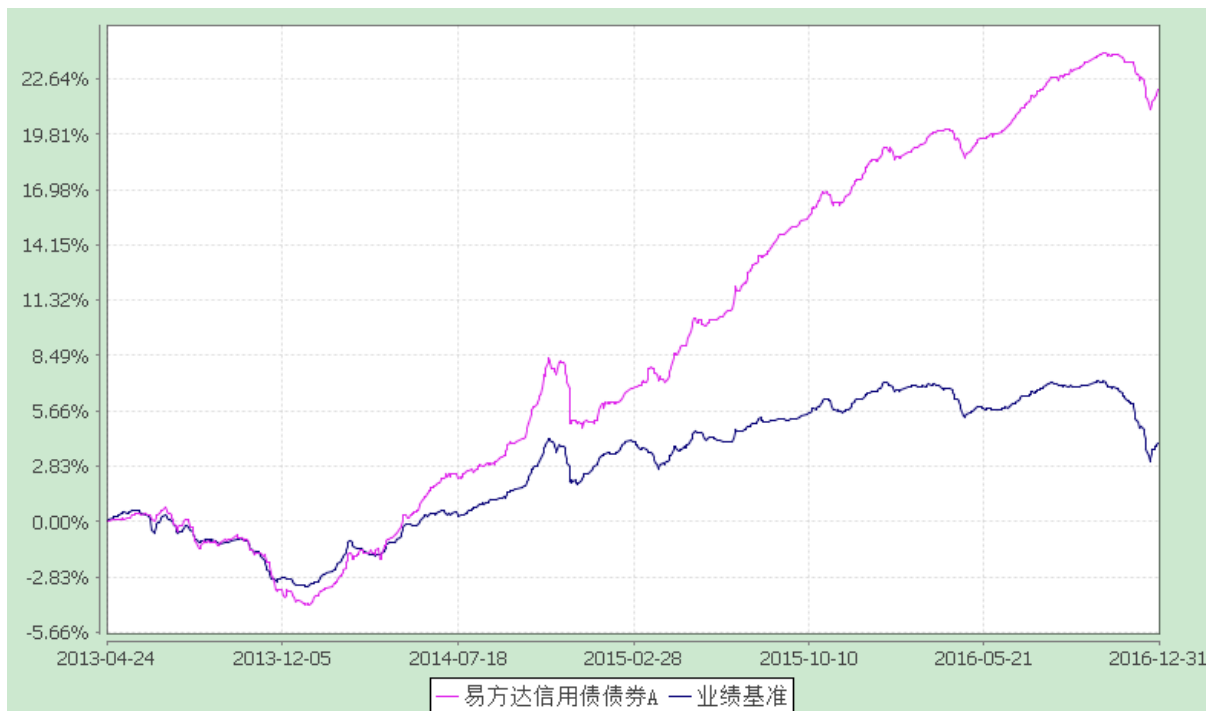
易方达信用债债券型证券投资基金

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

(2013 年 4 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日)

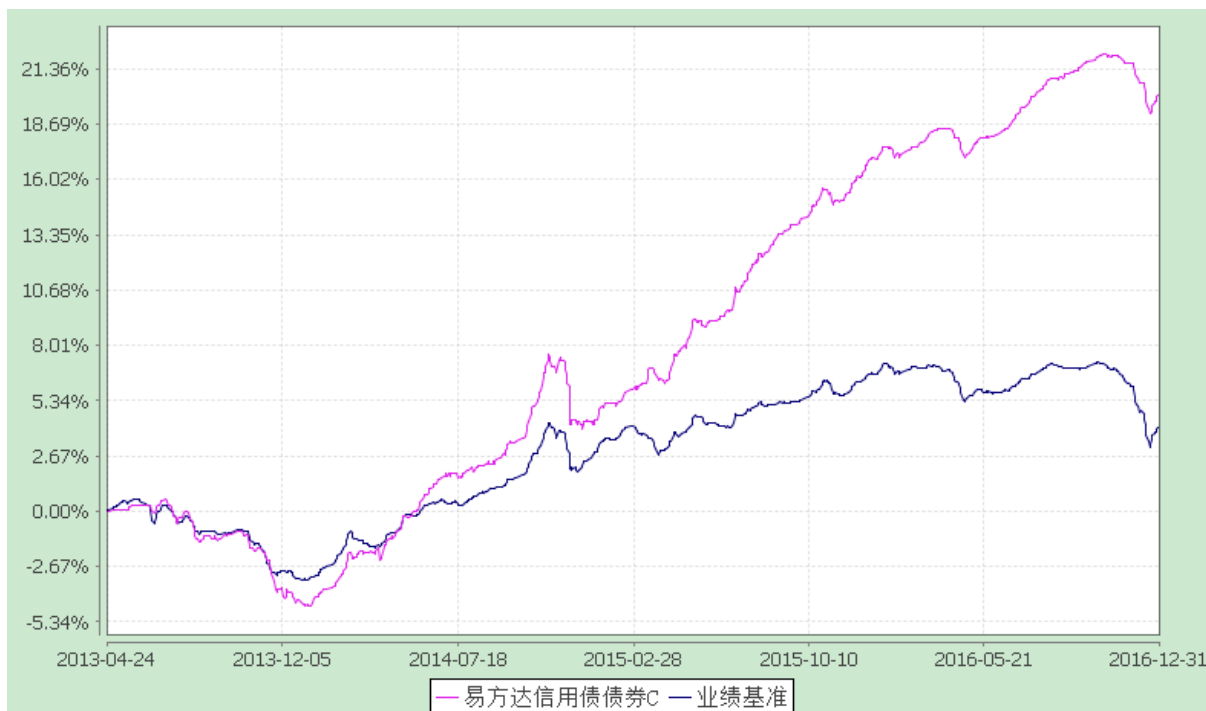
易方达信用债债券 A

(2013 年 4 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日)



易方达信用债债券 C

(2013 年 4 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日)



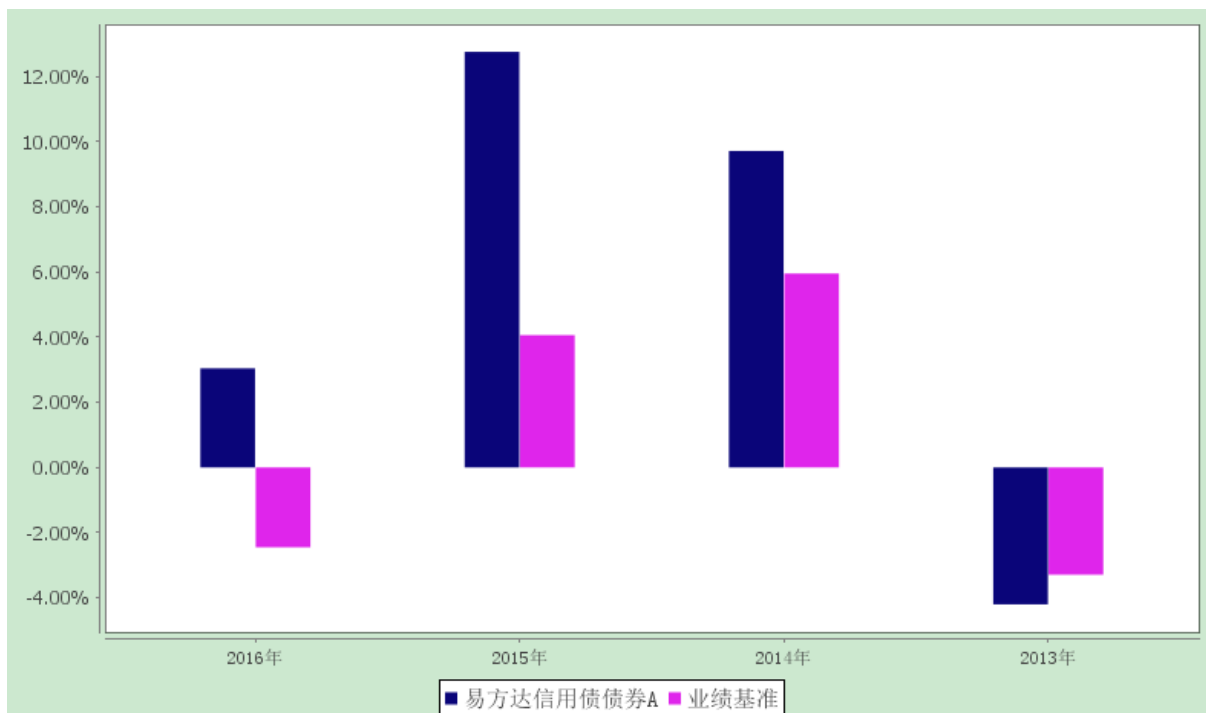
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 22.10%，C 类基金份额净值增长率为 20.10%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

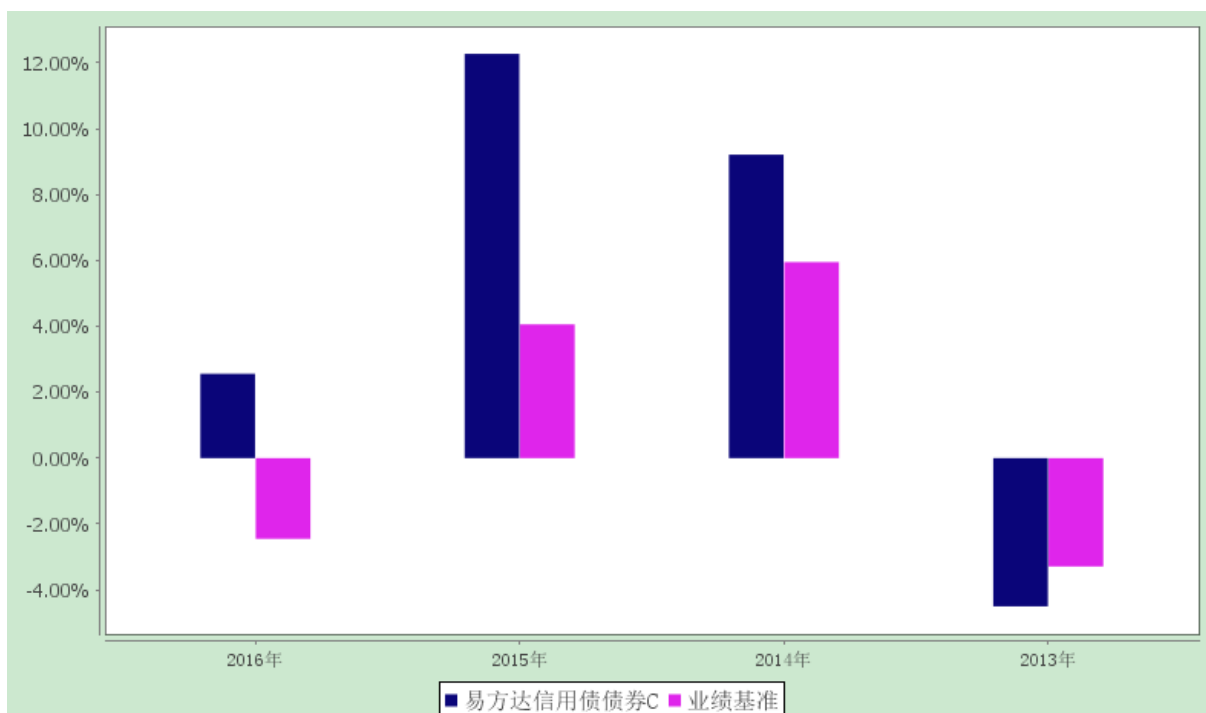
易方达信用债债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达信用债债券 A



易方达信用债债券 C



注：本基金合同生效日为 2013 年 4 月 24 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连、南京等六个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。2012 年 10 月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016 年 12 月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理的各类资产总规模 10491 亿元，其中公募基金规模 4283 亿元，公募基金规模排名连续 12 年保持在行业前五名，服务客户超过 5000 万户，公司净资产 66 亿元，在国内资产管理行业具有领先的市场地位和综合实力。

#### 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基金经理、易方达稳健收益	2013-04-24	-	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



	债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理				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。
纪玲云	本基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理	2013-09-14	-	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、易方达稳健收益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。
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、易方达瑞景灵活配置混合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基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)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	2015-02-17	-	8年	硕士研究生，曾任瑞银证券有限公司研究员，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。
轩辕璇	本基金的基金经理助理、易方达稳健收益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。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，胡剑的“任职日期”为基金合同生效之日，纪玲云、李一硕、苏宁、轩辕璇的“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。

#### 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对

我司旗下所有投资组合 2016 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 29 次，其中 26 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间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。

#### 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 年经济基本面与债券市场收益率均呈现震荡走势。

经济增长在一季度出现较多积极因素，并在 3 月份出现明显的回暖，但二季度受房地产投资、制造业投资下滑影响，再度走弱。三季度之后，随着企业盈利能力逐步改善，制造业投资出现显著回升，在此带动下，整体经济基本面再次步入企稳回升的通道，这一趋势在四季度的经济、金融数据中逐步得到验证。物价方面，全年通胀都比较温和。中上游价格呈现大幅上涨的态势，但是对下游传导依然较弱。

市场方面，债券市场全年呈现剧烈的震荡。1-10 月 10 年金融债收益率水平在 3.0-3.4% 之间窄幅震荡，1-4 月份收益率持续上行至 3.4% 以上，5 月份以后缓慢下行，至 10 月下旬下行至 3.0% 附近；11-12 月份随着经济回升确认和央行货币政策转紧，债券市场出现一波急跌，10 年金融债最高上行 100BP 至 4% 左右。

信用债券方面，利差在全年大部分时间呈现流动性溢价压缩的状态，仅在 4 月份信用风险事件导致流动性风险上升时，出现扩大，尤其过剩产能行业利差大幅上行 100BP。5-6 月份以后，随着企业经营环境的改善，利差随之压缩。11-12 月份利率的快速调整也伴随着流动性溢价的回升，但回升幅度有限，且在年底再度回落至历史低点。

操作上，本组合在一、三季度分别降低了组合久期和仓位，并在 7-8 月份参与了超长债的波段操作。信用债券方面以城投品种为主，避免了 4 月份信用利差的大幅波动。组合整体波段操作较为有效，且在积极的流动性管理前提下，较为成功地应对了年度市场波动和规模变动，组合表现积极

稳健。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.221 元，本报告期份额净值增长率为 3.04%；C 类基金份额净值为 1.201 元，本报告期份额净值增长率为 2.56%；同期业绩比较基准收益率为-2.45%。

#### 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，我们认为目前经济企稳回升的趋势能够持续一段时间，央行将延续中性偏紧的货币政策，债券市场整体易跌难涨，需要等待更好的参与机会。

经济方面，我们认为近期制造业投资的回升、融资数据的改善均显示出经济本身的活力有所恢复。今年供给侧改革以来，大宗商品价格持续快速上涨，这反映出实际经济的“供需缺口”大幅低于市场预期，或者说“化解过剩产能”经过最近几年的调整，已经有了一定成效。这种观点无论是否准确，都将极大地改善微观经济对投资的预期，而从政策层面来看，“一刀切”式的去产能政策也会较 2016 年有所减少。

另一方面，制造业投资自 2011 年来持续下行，从 30%左右的高位下降至 2-3%的水平，持续将近 5 年左右的时间。期间我国的工业增加值仍有 10-6%的增长，GDP 仍有 10-6.7%的增长，消费还稳定在 10%以上的水平。供给和需求此消彼长，这使得投资长期稳定在 2-3%超低水平的可能性不大。因此，制造业投资的回升本身具备一定的合理性。

综合来看，我们认为此轮来自制造业投资的回升体现了经济自身活力的恢复，具备一定的延续性，经济基本面在未来一段时间大概率仍将保持一定的企稳回升态势。

负面影响可能来自于房地产投资。不过考虑到本轮房地产小周期行情中销售大幅回升而投资增长不多，房地产库存并未增长，因此，我们预期对实际的投资负面影响也相对有限。

政策方面，央行中性偏紧的货币政策倾向非常确定，除非出现经济的预期外下行，货币政策端难有明显转向。这一点也是对债券市场最为不利的。当然如果由于资金面的阶段性紧张带来短端的超调，也是较好的投资机会。

实际操作中，本组合将维持偏短的久期和杠杆水平，保持良好的流动性，根据市场情况适度参与中短端品种，对中长端品种保持谨慎，等待更加确定的经济下行信号。

#### 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

易方达信用债债券 A：本报告期内未实施利润分配。

易方达信用债债券 C：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，本基金托管人在对易方达信用债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，易方达信用债债券型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达信用债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达信用债债券型证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达信用债债券型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达信用债债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	3,249,517.19	2,783,231.66
结算备付金	6,789,590.63	83,441,538.41
存出保证金	35,180.38	71,488.85
交易性金融资产	1,819,425,659.18	3,293,604,044.96
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,819,425,659.18	3,293,604,044.96
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	83,200,364.80	99,000,169.50
应收证券清算款	-	-
应收利息	41,961,497.05	63,274,224.19
应收股利	-	-
应收申购款	6,042,300.42	10,483,993.11
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,960,704,109.65</b>	<b>3,552,658,690.68</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>		
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	455,120,566.50	1,228,508,535.23
应付证券清算款	5,518.33	1,125,157.85
应付赎回款	2,635,522.50	6,230,837.88
应付管理人报酬	1,031,440.64	1,320,031.16
应付托管费	294,697.34	377,151.77
应付销售服务费	97,167.94	232,060.65
应付交易费用	31,268.15	48,764.93
应交税费	-	-
应付利息	286,622.82	153,633.98
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	401,192.00	383,050.81
<b>负债合计</b>	<b>459,903,996.22</b>	<b>1,238,379,224.26</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,232,343,500.19	1,959,217,769.48
未分配利润	268,456,613.24	355,061,696.94
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,500,800,113.43</b>	<b>2,314,279,466.42</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,960,704,109.65</b>	<b>3,552,658,690.68</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.221 元，C 类基金份额净值 1.201 元；基金份额总额 1,232,343,500.19 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,034,636,603.15 份，C 类基金份额总额 197,706,897.04 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达信用债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>104,459,524.64</b>	<b>150,902,390.29</b>
1.利息收入	143,561,237.12	94,054,673.91
其中：存款利息收入	671,150.36	1,022,947.07
债券利息收入	142,389,514.24	92,924,957.04
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	500,572.52	106,769.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	28,400,102.03	-643,699.85
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	28,400,102.03	-643,699.85
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-68,751,663.55	55,659,835.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,249,849.04	1,831,580.95
<b>减：二、费用</b>	<b>37,607,871.18</b>	<b>26,018,290.44</b>
1. 管理人报酬	16,813,829.69	7,944,898.39
2. 托管费	4,803,951.39	2,269,970.98
3. 销售服务费	1,932,665.97	1,774,789.96
4. 交易费用	75,692.75	125,574.54
5. 利息支出	13,494,686.73	13,442,625.22



其中：卖出回购金融资产支出	13,494,686.73	13,442,625.22
6. 其他费用	487,044.65	460,431.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>66,851,653.46</b>	<b>124,884,099.85</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>66,851,653.46</b>	<b>124,884,099.85</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达信用债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	1,959,217,769.48	355,061,696.94	2,314,279,466.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,851,653.46	66,851,653.46
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）	-726,874,269.29	-153,456,737.16	-880,331,006.45
其中：1.基金申购款	2,128,702,079.43	436,102,608.57	2,564,804,688.00
2.基金赎回款	-2,855,576,348.72	-589,559,345.73	-3,445,135,694.45
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	1,232,343,500.19	268,456,613.24	1,500,800,113.43

项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
（基金净值）			
一、期初所有者权益 （基金净值）	733,869,216.29	35,023,196.44	768,892,412.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	124,884,099.85	124,884,099.85
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）	1,225,348,553.19	195,154,400.65	1,420,502,953.84
其中：1.基金申购款	3,281,829,711.53	451,655,682.51	3,733,485,394.04
2.基金赎回款	-2,056,481,158.34	-256,501,281.86	-2,312,982,440.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益 （基金净值）	1,959,217,769.48	355,061,696.94	2,314,279,466.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达信用债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]66 号《关于核准易方达信用债债券型证券投资基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达信用债债券型证券

投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达信用债债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,465,617,374.90 份基金份额,其中认购资金利息折合 866,313.76 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 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。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 7.4.6 税项

##### (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。

##### (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；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有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。

### (3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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。

#### 7.4.7 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

**7.4.8.1.1 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。

**7.4.8.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.8.1.3 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。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,813,829.69	7,944,898.39
其中：支付销售机构的客户维护费	1,645,773.20	919,711.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,803,951.39	2,269,970.98

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

## 7.4.8.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C	合计
易方达基金管理有限 公司	-	360,169.89	360,169.89
中国工商银行	-	209,601.75	209,601.75
广发证券	-	22,886.75	22,886.75
合计	-	592,658.39	592,658.39
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达信用债债券A	易方达信用债债券C	合计
易方达基金管理有限 公司	-	642,466.25	642,466.25
中国工商银行	-	198,282.83	198,282.83
广发证券	-	13,919.50	13,919.50
合计	-	854,668.58	854,668.58

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

## 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31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
中国工商银行	-	151,264,525.38	-	-	1,607,360,000.00	306,270.84
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
中国工商银行	204,412,484.62	10,388,624.43	-	-	544,600,000.00	65,438.49

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达信用债债券 A

无。

易方达信用债债券 C

无。

##### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,249,517.19	132,646.42	2,783,231.66	87,578.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

##### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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 429,320,566.50 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
1080083	10 攀国投债	2017-01-09	81.41	200,000	16,282,000.00
1280111	12 营口债	2017-01-09	74.99	200,000	14,998,000.00
1380359	13 普兰店债 01	2017-01-09	84.23	200,000	16,846,000.00
1480328	14 合力债 02	2017-01-09	106.29	300,000	31,887,000.00
1580139	15 通辽天诚 债 02	2017-01-09	104.88	140,000	14,683,200.00
160206	16 国开 06	2017-01-10	97.44	2,300,000	224,112,000.00
150207	15 国开 07	2017-01-10	100.91	380,000	38,345,800.00
160304	16 进出 04	2017-01-10	99.85	700,000	69,895,000.00
合计				4,420,000	427,049,000.00

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 25,800,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 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。

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

(1)公允价值

(a)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 12 月 31 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,819,425,659.18 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：无属于第一层次的余额，第二层次 3,293,604,044.96 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 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,819,425,659.18	92.79
	其中：债券	1,819,425,659.18	92.79
	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	83,200,364.80	4.24
	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	10,039,107.82	0.51
7	其他各项资产	48,038,977.85	2.45
8	合计	1,960,704,109.65	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

### 8.4.2 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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

## 8.5 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	344,462,000.00	22.95
	其中：政策性金融债	344,462,000.00	22.95
4	企业债券	974,466,659.18	64.93
5	企业短期融资券	360,011,000.00	23.99
6	中期票据	140,486,000.00	9.36
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,819,425,659.18	121.23

## 8.6 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	160206	16 国开 06	2,300,000	224,112,000.00	14.93
2	041654030	16 河钢 CP003	1,000,000	100,220,000.00	6.68
3	1480557	14 鹤城投债	800,000	79,640,000.00	5.31
4	160304	16 进出 04	700,000	69,895,000.00	4.66
5	1480289	14 贺州城投债	600,000	64,632,000.00	4.31

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 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。

8.12.2 本基金本报告期没有投资股票。

**8.12.3 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	35,180.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,961,497.05
5	应收申购款	6,042,300.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,038,977.85

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达信用债债券 A	18,467	56,026.24	858,910,369.20	83.02%	175,726,233.95	16.98%
易方达信用债债券 C	8,597	22,997.20	19,469,030.11	9.85%	178,237,866.93	90.15%
合计	27,064	45,534.42	878,379,399.31	71.28%	353,964,100.88	28.72%

## 9.2 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	易方达信用债债券 A	18,130.49	0.0018%
	易方达信用债债券 C	758.16	0.0004%
	合计	18,888.65	0.0015%

## 9.3 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	易方达信用债债券 A	0
	易方达信用债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达信用债债券 A	0
	易方达信用债债券 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达信用债债券 A	易方达信用债债券 C
基金合同生效日（2013 年 4 月 24 日）基金份额总额	1,182,610,710.10	3,283,006,664.80
本报告期期初基金份额总额	1,431,894,758.71	527,323,010.77
本报告期基金总申购份额	1,409,187,644.84	719,514,434.59
减：本报告期基金总赎回份额	1,806,445,800.40	1,049,130,548.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,034,636,603.15	197,706,897.04

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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；于 2016 年 8 月 27 日发布公告，自 2016 年 8 月 27 日起聘任吴欣荣先生担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 100,000.00 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增东北证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中信证券股份有限公司各一个交易单元。

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。

#### 11.7.2 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,920,375.79	1.77%	62,119,20 0,000.00	100.00%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	496,362,283. 01	98.23%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一七年三月三十一日